

## 【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9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 9月11日から2022年 3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】

###### <ファンドの目的>

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。

###### <信託金限度額>

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。

###### <基本的性格>

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。

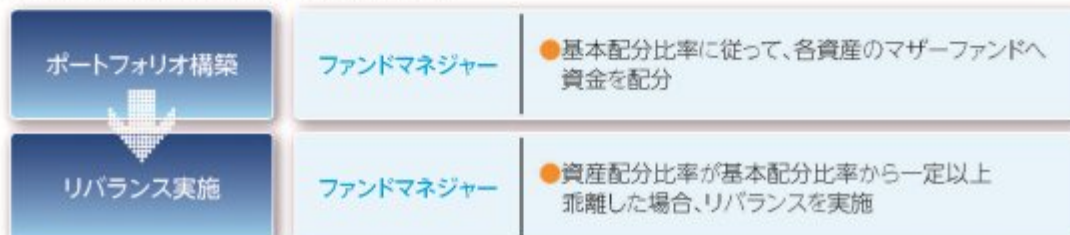
### 基本配分比率



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

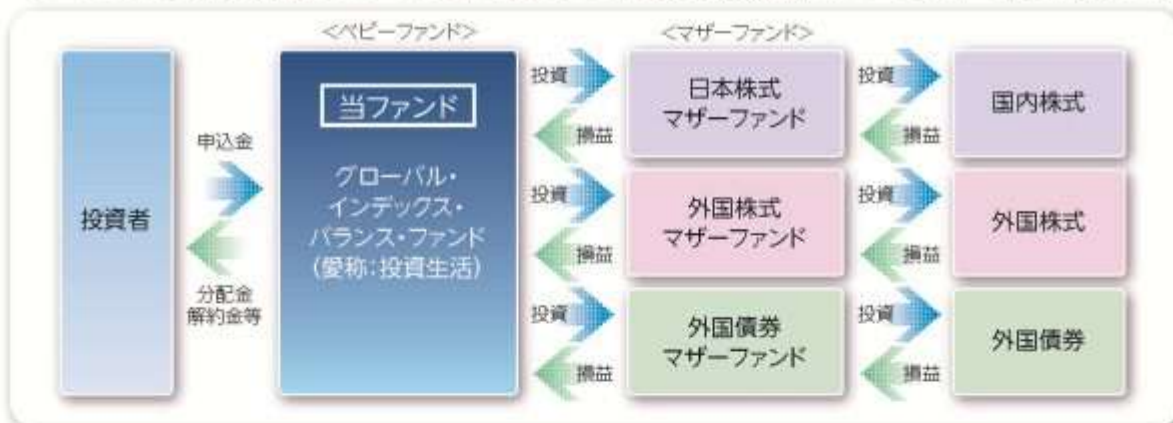
ファンドマネジャーは基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※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。

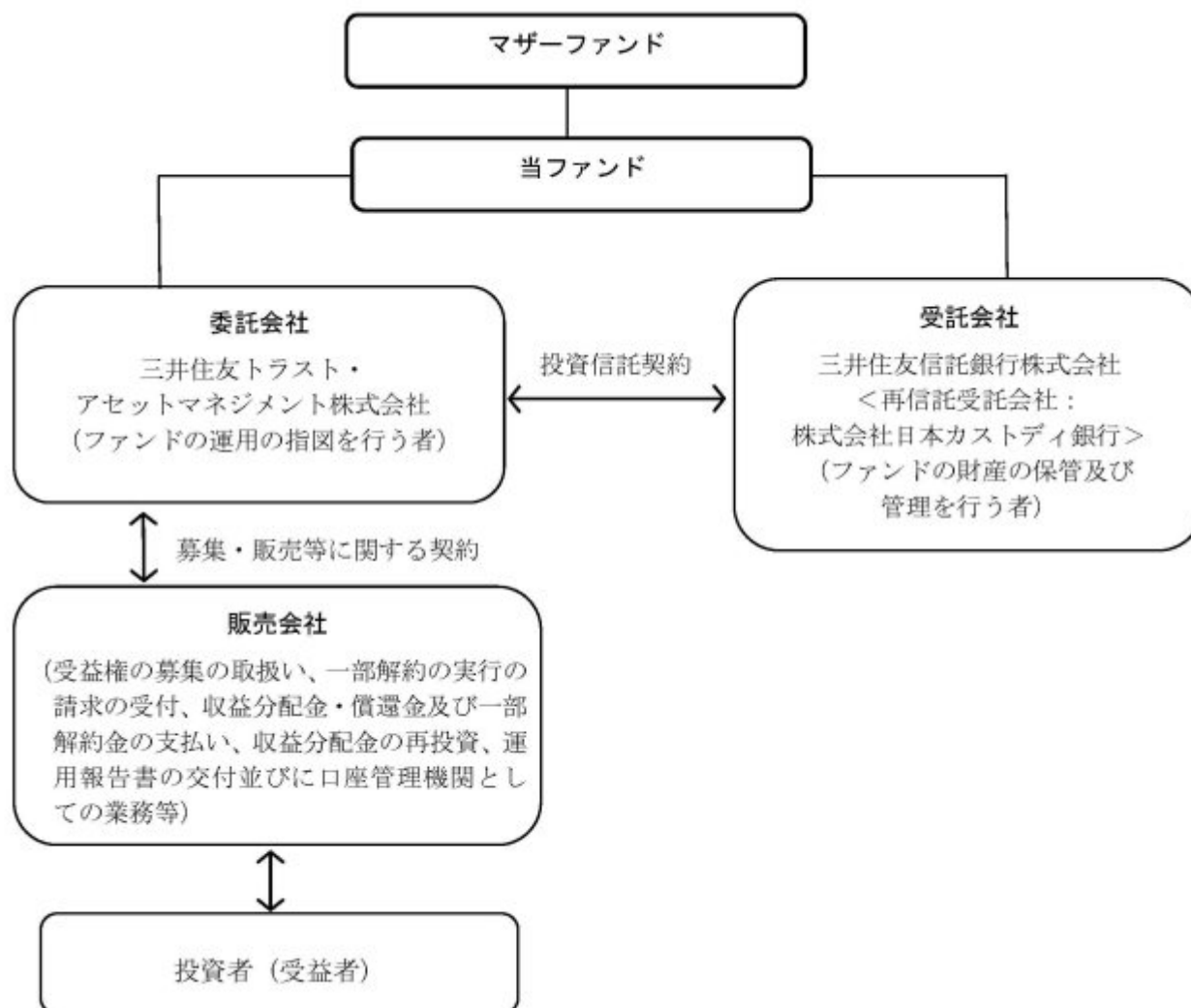
## (2) 【ファンドの沿革】

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（2021年6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券で、上記1．から11．までの証券又は証券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券（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。

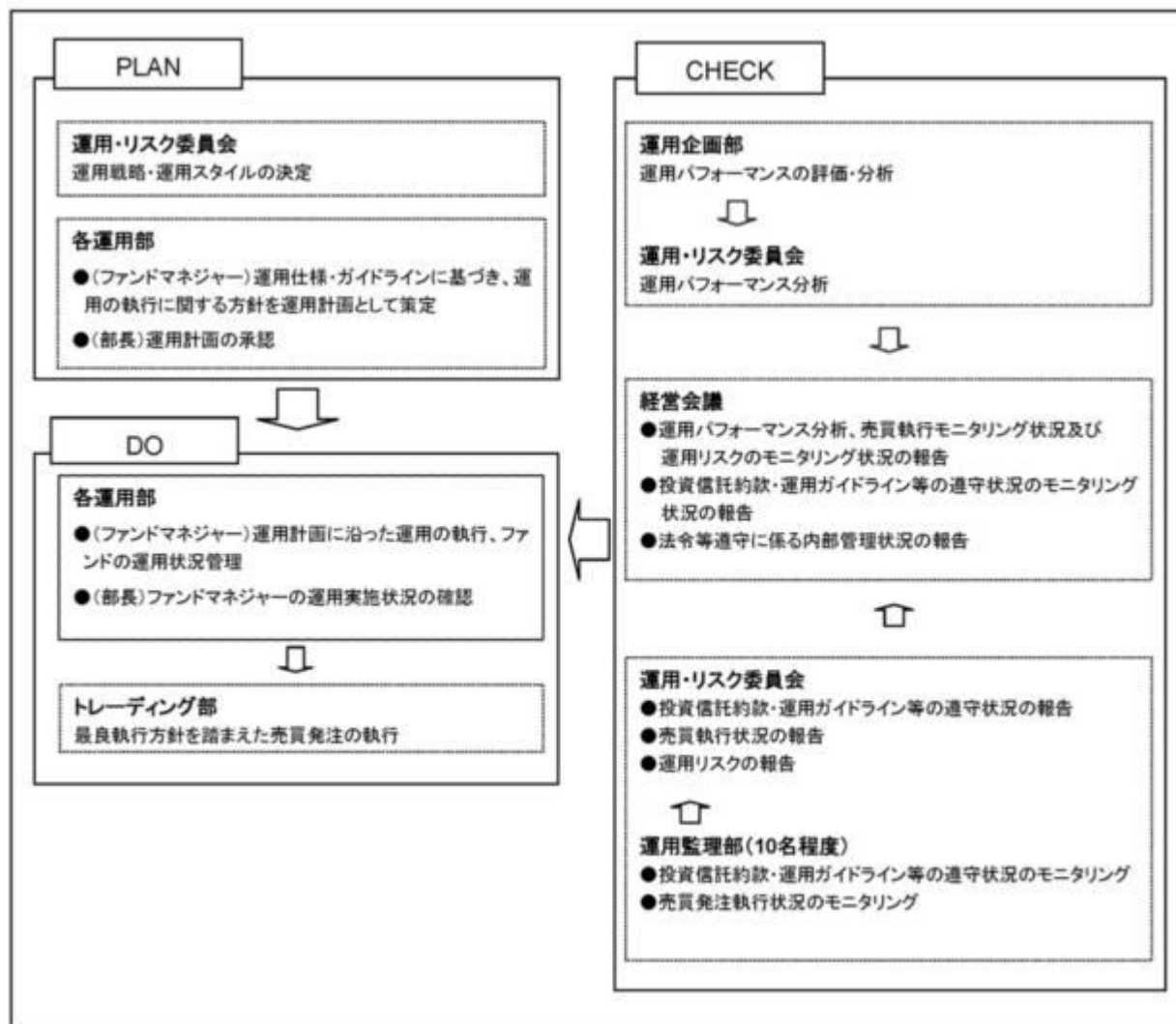
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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。）に掲げる資産への投資等並びに上記イ．からロ．まで及びク．からト．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．まで及びク．からト．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。
- ウ．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。
- エ．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7月～2021年6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、算出、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、ファンドの収益又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国株 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。
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。同指数の作成・公表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及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、誤差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グローバル・エマージング・マーケット・グローバル・ハイ・ティーン・ファイブ (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諾なしに本指数を複製・使用・譲渡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、2021年6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、2021年6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	3,667,190,257	99.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		13,402,577	0.36
合計(純資産総額)		3,680,592,834	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	301,603,491	4.0278	1,214,798,542	4.1084	1,239,107,782	33.67
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	561,554,501	2.1886	1,229,018,181	2.1765	1,222,223,371	33.21
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	455,333,272	2.6625	1,212,324,837	2.6483	1,205,859,104	32.76

(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	99.64
合計	99.64

(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
第14期計算期間末	(2021年 6月10日)	3,676,026,407	3,676,026,407	20,530	20,530
	2020年 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	
	2021年 1月末日	3,404,691,685		18,703	
	2月末日	3,429,815,345		19,049	
	3月末日	3,586,595,854		19,979	
	4月末日	3,596,719,079		20,097	
	5月末日	3,632,130,842		20,358	
	6月末日	3,680,592,834		20,584	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
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
第14期計算期間	2020年 6月11日～2021年 6月10日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
--	-----	--------

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期計算期間	2020年 6月11日～2021年 6月10日	20.8

(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期計算期間	2020年 6月11日～2021年 6月10日	106,278,424	221,795,479	1,790,587,673

(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	287,218,375,230	98.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,231,751,453	1.45
合計(純資産総額)		291,450,126,683	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	4,196,880,000	1.44

(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	1,091,000	7,675.30	8,373,755,660	9,710.00	10,593,610,000	3.63
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	674,600	10,478.14	7,068,559,888	10,815.00	7,295,799,000	2.50
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	838,500	8,789.80	7,370,252,292	7,775.00	6,519,337,500	2.24
日本	株式	キーエンス	電気機器	105,700	57,570.58	6,085,211,088	56,070.00	5,926,599,000	2.03
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,265,700	484.22	3,518,254,596	600.10	4,360,146,570	1.50
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	737,200	4,676.97	3,447,868,752	5,470.00	4,032,484,000	1.38
日本	株式	任天堂	その他製品	61,600	63,945.47	3,939,041,500	64,620.00	3,980,592,000	1.37
日本	株式	信越化学工業	化学	195,000	19,269.27	3,757,508,354	18,580.00	3,623,100,000	1.24
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,236,100	2,701.52	3,339,359,032	2,894.50	3,577,891,450	1.23
日本	株式	日本電産	電気機器	259,200	14,187.52	3,677,406,310	12,875.00	3,337,200,000	1.15
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	896,000	3,589.84	3,216,496,866	3,719.00	3,332,224,000	1.14
日本	株式	日立製作所	電気機器	517,800	4,373.84	2,264,777,205	6,361.00	3,293,725,800	1.13
日本	株式	HOYA	精密機器	210,100	13,623.21	2,862,236,421	14,730.00	3,094,773,000	1.06
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	63,100	43,565.02	2,748,952,975	48,080.00	3,033,848,000	1.04
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	847,900	2,856.41	2,421,952,704	3,550.00	3,010,045,000	1.03
日本	株式	KDDI	情報・通信業	847,500	3,242.94	2,748,396,222	3,465.00	2,936,587,500	1.01
日本	株式	ダイキン工業	機械	137,200	23,113.03	3,171,108,480	20,690.00	2,838,668,000	0.97
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	735,000	3,344.23	2,458,016,252	3,830.00	2,815,050,000	0.97
日本	株式	村田製作所	電気機器	316,400	10,472.69	3,313,562,024	8,482.00	2,683,704,800	0.92
日本	株式	ファナック	電気機器	94,500	27,062.54	2,557,410,126	26,795.00	2,532,127,500	0.87
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	741,900	3,143.48	2,332,153,970	3,200.00	2,374,080,000	0.81
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,443,300	1,409.73	2,034,673,964	1,587.50	2,291,238,750	0.79
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	414,900	3,960.57	1,643,241,612	5,297.00	2,197,725,300	0.75

日本	株式	三井物産	卸売業	846,100	2,063.25	1,745,719,592	2,500.50	2,115,673,050	0.73
日本	株式	S M C	機械	31,500	68,223.34	2,149,035,500	65,650.00	2,067,975,000	0.71
日本	株式	第一三共	医薬品	846,300	3,568.37	3,019,919,400	2,394.50	2,026,465,350	0.70
日本	株式	富士通	電気機器	96,900	16,965.58	1,643,964,967	20,800.00	2,015,520,000	0.69
日本	株式	三菱商事	卸売業	645,800	2,686.88	1,735,187,794	3,028.00	1,955,482,400	0.67
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	933,700	1,686.73	1,574,900,064	1,934.50	1,806,242,650	0.62
日本	株式	デンソー	輸送用機器	237,100	6,042.96	1,432,787,335	7,579.00	1,796,980,900	0.62

(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	0.18
		建設業	2.27
		食料品	3.34
		繊維製品	0.49
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.27
		医薬品	5.21
		石油・石炭製品	0.42
		ゴム製品	0.69
		ガラス・土石製品	0.75
		鉄鋼	0.77
		非鉄金属	0.71
		金属製品	0.62
		機械	5.30
		電気機器	17.91
		輸送用機器	7.78
		精密機器	2.69
		その他製品	2.41
		電気・ガス業	1.19
		陸運業	3.33
		海運業	0.34
		空運業	0.45
倉庫・運輸関連業	0.17		
情報・通信業	8.65		
卸売業	4.68		
小売業	4.56		
銀行業	4.87		
証券、商品先物取引業	0.76		

	保険業	1.79
	その他金融業	1.08
	不動産業	1.99
	サービス業	5.59
	小計	98.55
合計		98.55

(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	216	円	4,225,950,400	4,196,880,000	1.44

(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	189,190,779,133	64.51
	イギリス	12,171,421,657	4.15
	カナダ	10,093,562,893	3.44
	スイス	9,425,300,026	3.21
	フランス	9,357,536,779	3.19
	ドイツ	8,285,884,343	2.83
	オーストラリア	5,643,669,958	1.92
	オランダ	5,388,931,711	1.84
	アイルランド	5,077,982,818	1.73
	スウェーデン	3,100,759,579	1.06
	デンマーク	2,273,768,493	0.78
	スペイン	2,201,590,309	0.75

	香港	2,040,310,965	0.70
	イタリア	1,669,555,158	0.57
	フィンランド	1,121,739,995	0.38
	ジャージー	941,088,874	0.32
	シンガポール	783,126,576	0.27
	ベルギー	765,918,880	0.26
	バミューダ	684,648,340	0.23
	ケイマン	578,320,060	0.20
	ノルウェー	568,220,019	0.19
	イスラエル	533,715,333	0.18
	ルクセンブルク	292,065,533	0.10
	ニュージーランド	276,629,978	0.09
	キュラソー	229,140,351	0.08
	オーストリア	175,035,813	0.06
	ポルトガル	139,577,887	0.05
	パナマ	103,066,102	0.04
	リベリア	97,481,025	0.03
	マン島	73,456,026	0.03
	パプアニューギニア	34,619,108	0.01
	小計	273,318,903,722	93.20
投資信託受益証券	オーストラリア	113,353,535	0.04
	香港	42,227,296	0.01
	小計	155,580,831	0.05
投資証券	アメリカ	5,284,816,350	1.80
	オーストラリア	378,701,609	0.13
	イギリス	156,006,325	0.05
	フランス	145,872,676	0.05
	シンガポール	118,010,608	0.04
	香港	99,392,423	0.03
	カナダ	43,902,170	0.01
	小計	6,226,702,161	2.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		13,566,297,395	4.63
合計(純資産総額)		293,267,484,109	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	9,967,249,938	3.40
	買建	カナダ	815,758,160	0.28
	買建	ドイツ	1,640,996,820	0.56
	買建	イギリス	537,591,600	0.18
	買建	オーストラリア	450,094,800	0.15

(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		1,830,907,802	0.62
	売建		104,197,562	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。

## 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	785,112	15,122.92	11,873,186,596	15,075.37	11,835,854,991	4.04
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	335,078	26,782.47	8,974,218,493	30,011.41	10,056,163,910	3.43
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	20,037	370,680.74	7,427,330,128	381,295.32	7,640,014,351	2.61
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	112,478	29,646.49	3,334,578,802	38,911.99	4,376,743,509	1.49

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	13,785	231,996.84	3,198,076,440	278,702.51	3,841,914,164	1.31
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	14,062	230,982.82	3,248,080,434	270,417.86	3,802,615,961	1.30
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	35,900	94,045.30	3,376,226,534	75,278.44	2,702,496,025	0.92
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	28,938	60,115.71	1,739,628,451	88,582.32	2,563,395,194	0.87
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	142,670	15,257.82	2,176,834,378	17,044.80	2,431,781,787	0.83
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	122,897	18,184.88	2,234,867,320	18,138.43	2,229,159,541	0.76
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	79,470	23,085.78	1,834,627,461	26,091.35	2,073,479,664	0.71
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	64,092	26,003.99	1,666,647,907	30,543.30	1,957,581,299	0.67
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	44,358	35,884.31	1,591,756,480	44,021.89	1,952,723,351	0.67
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	135,176	12,033.81	1,626,682,570	13,961.81	1,887,302,304	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	50,551	30,836.33	1,558,807,763	35,190.97	1,778,939,190	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	115,113	14,327.85	1,649,321,867	14,861.95	1,710,803,881	0.58
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	52,256	29,794.67	1,556,950,547	32,373.40	1,691,704,432	0.58
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	41,447	37,458.97	1,552,562,137	40,693.44	1,686,621,008	0.58
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	363,211	3,579.47	1,300,104,549	4,521.61	1,642,300,742	0.56
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	85,011	20,032.67	1,702,997,547	19,233.17	1,635,031,814	0.56
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	19,578	60,526.79	1,184,993,690	77,619.04	1,519,625,604	0.52
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	22,518	54,418.62	1,225,398,701	65,325.13	1,470,991,390	0.50
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	32,944	37,053.43	1,220,688,280	41,873.43	1,379,478,607	0.47
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	198,480	5,523.47	1,096,298,524	6,924.51	1,374,378,650	0.47
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	214,339	5,651.74	1,211,389,114	6,252.19	1,340,088,838	0.46
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	20,738	60,906.35	1,263,076,056	58,994.42	1,223,426,489	0.42
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	194,251	6,117.28	1,188,288,845	6,174.78	1,199,458,588	0.41
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	189,887	6,433.54	1,221,646,445	6,275.41	1,191,619,728	0.41
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	42,706	26,416.45	1,128,141,178	27,181.66	1,160,820,390	0.40
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	198,333	5,316.68	1,054,474,364	5,850.78	1,160,404,297	0.40

(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	外国	エネルギー	3.16
		素材	4.14
		資本財	6.16
		商業・専門サービス	1.15
		運輸	1.98
		自動車・自動車部品	1.91
		耐久消費財・アパレル	1.97
		消費者サービス	1.74
		メディア・娯楽	7.08
		小売	5.38
		食品・生活必需品小売り	1.28
		食品・飲料・タバコ	3.74
		家庭用品・パーソナル用品	1.68
		ヘルスケア機器・サービス	4.91
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.23
		銀行	5.80
		各種金融	4.49
		保険	2.88
		不動産	0.46
		ソフトウェア・サービス	11.70
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.51		
電気通信サービス	1.64		
公益事業	2.74		
半導体・半導体製造装置	4.48		
	小計	93.20	
投資信託受益証券			0.05
投資証券			2.12
合計			95.37

(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	421	アメリカドル	89,383,887	9,884,070,224	90,136,100	9,967,249,938	3.40
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	38	カナダドル	9,107,905	811,969,731	9,150,400	815,758,160	0.28
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	36	スイスフラン	4,292,382	515,300,459	4,327,920	519,566,796	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	208	ユーロ	8,578,426	1,128,749,293	8,522,800	1,121,430,024	0.38
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	30	オーストラリアドル	5,455,110	453,428,743	5,415,000	450,094,800	0.15
	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	50	イギリスポンド	3,542,867.5	542,625,586	3,510,000	537,591,600	0.18

(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	12,739,000.00	1,400,012,050	1,408,526,690	0.48
	ユーロ	買建	2,000,000.00	265,401,800	263,178,800	0.09
	イギリスポンド	買建	820,000.00	126,196,210	125,587,836	0.04
	スイスフラン	買建	280,000.00	33,628,644	33,614,476	0.01
	ユーロ	売建	300,000.00	39,475,050	39,474,600	0.01
	ニュージーランドドル	売建	340,000.00	26,274,112	26,274,962	0.01
	香港ドル	売建	2,700,000.00	38,444,760	38,448,000	0.01

(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	64,729,626,574	43.61
	フランス	14,660,359,057	9.88
	イタリア	13,699,656,216	9.23
	ドイツ	10,995,664,043	7.41
	イギリス	9,487,869,680	6.39



	スペイン	8,576,868,362	5.78
	ベルギー	3,441,901,339	2.32
	オーストラリア	3,085,637,917	2.08
	カナダ	2,952,038,392	1.99
	オランダ	2,809,496,330	1.89
	オーストリア	2,158,447,125	1.45
	アイルランド	1,204,063,541	0.81
	メキシコ	1,169,785,323	0.79
	ポーランド	908,737,549	0.61
	フィンランド	906,292,552	0.61
	デンマーク	728,535,911	0.49
	マレーシア	697,082,503	0.47
	イスラエル	673,312,173	0.45
	シンガポール	625,267,113	0.42
	スウェーデン	526,197,233	0.35
	ノルウェー	365,119,454	0.25
	小計	144,401,958,387	97.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,011,628,467	2.70
合計(純資産総額)		148,413,586,854	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	1,193,753,453	0.80
	買建	ドイツ	1,474,574,954	0.99

(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		2,660,934,850	1.79

(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	10,531.01	961,481,868	10,285.66	939,081,471	0.625	2030/8/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/30/24	8,000,000	11,549.99	923,999,571	11,410.04	912,803,346	1.500	2024/9/30	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	7,250,000	11,888.64	861,926,826	11,678.28	846,675,639	2.125	2025/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	6,700,000	11,886.48	796,394,571	11,709.38	784,528,815	2.375	2024/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	7,400,000	10,568.16	782,044,226	10,321.08	763,760,514	0.625	2030/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/25	7,000,000	10,972.47	768,073,134	10,824.74	757,732,172	0.250	2025/9/30	0.51
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	6,500,000	11,478.29	746,088,873	11,383.04	739,897,906	2.000	2023/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	6,500,000	11,082.43	720,358,481	11,064.91	719,219,231	0.250	2023/4/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/30/23	6,000,000	11,896.42	713,785,259	11,736.59	704,195,903	2.875	2023/11/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	11,801.82	714,010,312	11,611.76	702,511,719	2.000	2025/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.625% 06/30/23	6,000,000	11,625.60	697,536,429	11,582.17	694,930,505	2.625	2023/6/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	5,750,000	11,688.21	672,072,629	11,461.44	659,033,045	1.625	2026/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.625% 04/30/23	5,800,000	11,426.02	662,709,396	11,341.14	657,786,426	1.625	2023/4/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	5,390,000	12,473.07	672,298,927	12,112.82	652,881,514	2.625	2029/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	5,800,000	11,294.71	655,093,198	11,231.86	651,447,947	1.500	2022/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	5,500,000	12,008.72	660,480,084	11,765.53	647,104,660	2.250	2025/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	6,160,000	10,601.14	653,030,802	10,497.32	646,635,214	0.875	2030/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.5% 06/30/27	6,000,000	10,903.79	654,227,566	10,688.68	641,320,803	0.500	2027/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 2% 11/30/22	5,500,000	11,436.60	629,013,380	11,347.19	624,095,592	2.000	2022/11/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	5,260,000	12,130.97	638,089,104	11,821.26	621,798,339	2.250	2027/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	5,400,000	11,691.67	631,350,463	11,460.14	618,848,012	1.625	2026/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	5,300,000	11,618.24	615,766,887	11,384.12	603,358,605	1.500	2026/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 07/31/25	5,000,000	12,279.56	613,978,172	12,024.27	601,213,956	2.875	2025/7/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/31/25	5,000,000	12,229.88	611,494,440	11,978.92	598,946,203	2.750	2025/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.25% 01/31/24	5,090,000	11,737.03	597,414,843	11,594.91	590,181,314	2.250	2024/1/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/28	5,300,000	11,074.09	586,927,143	11,091.69	587,859,697	1.250	2028/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	5,000,000	11,873.95	593,697,971	11,692.10	584,605,359	2.250	2024/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.125% 10/15/23	5,200,000	11,047.20	574,454,461	11,011.78	572,612,611	0.125	2023/10/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.375% 01/31/23	5,000,000	11,552.37	577,618,517	11,441.79	572,089,517	2.375	2023/1/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/28	4,670,000	12,518.00	584,590,673	12,175.89	568,614,282	2.750	2028/2/15	0.38

(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	97.30
合計	97.30

(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	33	アメリカ ドル	4,083,545.46	451,558,457	4,071,117.27	450,184,148	0.30
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	23	アメリカ ドル	3,040,220.72	336,187,607	3,042,109.49	336,396,467	0.23
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	23	アメリカ ドル	3,638,064.4	402,297,161	3,682,156.25	407,172,838	0.27
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	15	ユーロ	1,682,371.5	221,366,442	1,681,950	221,310,981	0.15
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	21	ユーロ	2,815,854.1	370,510,082	2,814,000	370,266,120	0.25
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	39	ユーロ	6,701,641.9	881,802,041	6,710,730	882,997,853	0.59

(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	11,010,000.00	1,209,894,027	1,217,265,600	0.82
	カナダドル	買建	1,480,000.00	133,558,934	131,927,200	0.09
	ユーロ	買建	8,490,000.00	1,127,680,091	1,117,241,550	0.75
	イギリスポンド	買建	1,270,000.00	196,266,446	194,500,500	0.13

(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：2021年6月30日

## 基準価額・純資産の推移



基準価額 20,584円

純資産総額 36.81億円

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2017年6月	0円
2018年6月	0円
2019年6月	0円
2020年6月	0円
2021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	33.7%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/半導体	-	-	1.4%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	1.2%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.9%
		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	33.2%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.2%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.8%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.7%
		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	32.8%	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。  
※2021年は年初から作成基準日までの収益率です。  
※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。

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等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、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にあっても、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14期計算期間(2020年6月11日から2021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13期 ( 2020年 6月10日現在 )	第14期 ( 2021年 6月10日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	15,873,903	22,773,320
親投資信託受益証券	3,155,500,956	3,661,255,721
未収入金	82,460,627	4,616,617
流動資産合計	3,253,835,486	3,688,645,658
資産合計	3,253,835,486	3,688,645,658
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,058,593	920,020
未払受託者報酬	860,365	966,883
未払委託者報酬	9,463,919	10,635,696
未払利息	23	25
その他未払費用	86,002	96,627
流動負債合計	13,468,902	12,619,251
負債合計	13,468,902	12,619,251
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,906,104,728	1,790,587,673
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	1,334,261,856	1,885,438,734
( 分配準備積立金 )	998,005,737	1,504,059,804
元本等合計	3,240,366,584	3,676,026,407
純資産合計	3,240,366,584	3,676,026,407
負債純資産合計	3,253,835,486	3,688,645,658

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自 2019年 6月11日	至 2020年 6月10日	自 2020年 6月11日	至 2021年 6月10日
営業収益				
受取利息		29		48
有価証券売買等損益		248,264,578		672,338,989
営業収益合計		248,264,607		672,339,037
営業費用				
支払利息		10,129		4,739
受託者報酬		1,732,861		1,867,274
委託者報酬		19,061,376		20,539,994
その他費用		173,196		186,603
営業費用合計		20,977,562		22,598,610
営業利益又は営業損失（ ）		227,287,045		649,740,427
経常利益又は経常損失（ ）		227,287,045		649,740,427
当期純利益又は当期純損失（ ）		227,287,045		649,740,427
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（ ）		7,980,363		31,503,596
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		85,242,076		87,904,089
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		85,242,076		87,904,089
剰余金減少額又は欠損金増加額		134,412,107		154,964,042
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		134,412,107		154,964,042
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,334,261,856		1,885,438,734

## (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13期 (2020年 6月10日現在)	第14期 (2021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	1,906,104,728口	1,790,587,673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) 2.0530円 (20,530円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第13期 自 2019年 6月11日 至 2020年 6月10日	第14期 自 2020年 6月11日 至 2021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>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	<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>60,649,756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>557,587,075円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>806,940,838円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>885,822,973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>2,311,000,642円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,790,587,673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>12,906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	60,649,756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	557,587,075円	収益調整金額	C	806,940,838円	分配準備積立金額	D	885,822,973円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,311,000,642円	当ファンドの期末残存口数	F	1,790,587,673口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	12,906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																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	60,649,756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	557,587,075円																																																											
収益調整金額	C	806,940,838円																																																											
分配準備積立金額	D	885,822,973円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,311,000,642円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,790,587,673口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	12,906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14期 自 2020年 6月11日 至 2021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14期 (2021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13期	第14期
	自 2019年 6月11日 至 2020年 6月10日	自 2020年 6月11日 至 2021年 6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	106,278,424円
期中一部解約元本額	231,301,778円	221,795,479円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第13期 (2020年 6月10日現在)	第14期 (2021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	230,411,420	610,010,810
合計	230,411,420	610,010,810

## （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	562,333,524	1,230,723,150	
	外国株式マザーファンド	302,024,720	1,216,495,167	
	外国債券マザーファンド	455,976,490	1,214,037,404	
合計		1,320,334,734	3,661,255,721	

(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	2021年 6月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,374,018,882
株式	288,439,459,900
未収配当金	1,894,265,134
前払金	9,737,500
差入委託証拠金	172,052,500
流動資産合計	292,889,533,916
資産合計	292,889,533,916
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,737,500
未払金	14,871,350
未払解約金	277,152,408
未払利息	2,618
流動負債合計	301,763,876
負債合計	301,763,876
純資産の部	
元本等	
元本	133,684,734,050
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	158,903,035,990
元本等合計	292,587,770,040
純資産合計	292,587,770,040
負債純資産合計	292,889,533,916

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 6月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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。  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。
3.収益及び費用の計上基準	(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。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2021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	133,684,734,050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 2.1886円 (1万口当たり純資産額) (21,886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

	2021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。

	2021年 6月10日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021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	<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>

## （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	2021年 6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	8,173,263,248円
期中一部解約元本額	15,809,029,409円
期末元本額	133,684,734,050円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	608,429,504円
D C 日本株式インデックスファンド	312,441,480円
D C 日本株式インデックスファンド L	53,768,948,318円
D C 日本株式インデックスファンド A	694,461,606円
D C バランスファンド 3 0	2,218,924,812円
D C バランスファンド 5 0	3,452,906,248円
D C バランスファンド 7 0	1,999,319,022円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	562,333,524円
日本株式インデックス e	1,504,018,368円
インデックスコレクション（国内株式）	18,948,476,015円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	11,868,207,672円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	2,413,610,118円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	2,023,052,346円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,496,206,043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）	2,802,750,385円
日本株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	1,104,518,513円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	57,191,726円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	659,095,114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）	78,783,715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）	144,541,542円

区分	2021年 6月10日現在
V Aバランス株式30（適格機関投資家専用）	719,719円
V Aバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	260,067,263円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	849,269,072円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	483,038,371円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	8,388,516,463円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	765,441,435円
V Aバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	88,884,195円
V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,343,021,741円
V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	31,881,890円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	166,501,205円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,158,709,913円
V Aバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	62,428,669円
V Aバランス50-50（適格機関投資家専用）	64,810,602円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	27,056,172円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	685,485,910円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	296,249,190円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	5,009,347,951円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	93,592,481円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	39,553,021円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	9,552,581円
V Aバランス20-80（適格機関投資家専用）	137,793,096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）	4,597,039円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021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		14,837,454,420
合計		14,837,454,420

(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

（2021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	4,010,312,500	-	4,000,575,000	9,737,500

合計	4,010,312,500	-	4,000,575,000	9,737,500
----	---------------	---	---------------	-----------

## (注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、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	4,700	2,947.00	13,850,900	
日本水産	135,400	547.00	74,063,800	
マルハニチロ	22,800	2,477.00	56,475,600	
雪国まいたけ	12,000	1,736.00	20,832,000	
カネコ種苗	4,400	1,501.00	6,604,400	
サカタのタネ	17,400	3,865.00	67,251,000	
ホクト	12,200	1,936.00	23,619,200	
ホクリヨウ	2,300	768.00	1,766,400	
住石ホールディングス	25,500	128.00	3,264,000	
日鉄鉱業	3,300	6,440.00	21,252,000	
三井松島ホールディングス	6,100	979.00	5,971,900	
I N P E X	536,300	815.00	437,084,500	
石油資源開発	19,100	2,037.00	38,906,700	
K & O エナジーグループ	7,100	1,363.00	9,677,300	
ヒノキヤグループ	3,600	2,554.00	9,194,400	
ショーボンドホールディングス	20,800	4,675.00	97,240,000	
ミライト・ホールディングス	50,600	1,939.00	98,113,400	
タマホーム	8,800	2,095.00	18,436,000	
サンヨーホームズ	1,700	730.00	1,241,000	
日本アクア	5,800	570.00	3,306,000	
ファーストコーポレーション	4,500	761.00	3,424,500	
ベステラ	2,800	1,595.00	4,466,000	
Robot Home	27,300	276.00	7,534,800	
キャンディル	2,500	558.00	1,395,000	
スペースバリューホールディングス	17,800	700.00	12,460,000	
ダイセキ環境ソリューション	2,800	969.00	2,713,200	
第一カッター興業	3,600	1,416.00	5,097,600	
安藤・間	93,500	820.00	76,670,000	

東急建設	42,700	751.00	32,067,700
コムシスホールディングス	51,700	3,220.00	166,474,000
ビーアールホールディングス	19,500	514.00	10,023,000
高松コンストラクショングループ	9,100	2,054.00	18,691,400
東建コーポレーション	4,500	9,760.00	43,920,000
ソネック	1,500	965.00	1,447,500
ヤマウラ	6,300	907.00	5,714,100
オリエンタル白石	49,000	294.00	14,406,000
大成建設	104,800	3,740.00	391,952,000
大林組	336,800	930.00	313,224,000
清水建設	315,500	939.00	296,254,500
飛島建設	9,700	1,085.00	10,524,500
長谷工コーポレーション	110,300	1,533.00	169,089,900
松井建設	13,300	727.00	9,669,100
銭高組	1,500	4,360.00	6,540,000
鹿島建設	246,800	1,491.00	367,978,800
不動テトラ	8,200	1,853.00	15,194,600
大末建設	4,200	1,028.00	4,317,600
鉄建建設	6,800	1,898.00	12,906,400
西松建設	24,100	3,395.00	81,819,500
三井住友建設	81,400	495.00	40,293,000
大豊建設	7,400	4,070.00	30,118,000
前田建設工業	84,400	985.00	83,134,000
佐田建設	7,800	483.00	3,767,400
ナカノフドー建設	8,100	408.00	3,304,800
奥村組	18,500	2,988.00	55,278,000
東鉄工業	14,400	2,357.00	33,940,800
イチケン	2,400	1,838.00	4,411,200
富士ピー・エス	4,300	569.00	2,446,700
浅沼組	4,000	4,610.00	18,440,000
戸田建設	139,900	795.00	111,220,500
熊谷組	15,600	2,912.00	45,427,200
北野建設	2,100	2,405.00	5,050,500
植木組	3,000	1,530.00	4,590,000
矢作建設工業	14,900	723.00	10,772,700
ピーエス三菱	11,100	654.00	7,259,400
日本ハウスホールディングス	23,000	352.00	8,096,000
大東建託	36,800	12,060.00	443,808,000
新日本建設	14,300	888.00	12,698,400
N I P P O	27,900	3,010.00	83,979,000
東亜道路工業	2,100	4,590.00	9,639,000
前田道路	20,800	2,221.00	46,196,800



日本道路	3,300	7,890.00	26,037,000
東亜建設工業	9,000	2,510.00	22,590,000
日本国土開発	32,800	584.00	19,155,200
若築建設	6,100	1,444.00	8,808,400
東洋建設	37,800	569.00	21,508,200
五洋建設	143,000	801.00	114,543,000
世紀東急工業	16,200	876.00	14,191,200
福田組	3,900	4,955.00	19,324,500
住友林業	79,200	2,185.00	173,052,000
日本基礎技術	10,300	507.00	5,222,100
巴コーポレーション	15,000	390.00	5,850,000
大和ハウス工業	311,000	3,348.00	1,041,228,000
ライト工業	19,300	1,827.00	35,261,100
積水ハウス	365,300	2,213.00	808,408,900
日特建設	8,800	778.00	6,846,400
北陸電気工事	5,800	1,222.00	7,087,600
ユアテック	19,300	740.00	14,282,000
日本リーテック	7,000	1,743.00	12,201,000
四電工	1,800	3,335.00	6,003,000
中電工	15,500	2,334.00	36,177,000
関電工	54,800	910.00	49,868,000
きんでん	68,400	1,872.00	128,044,800
東京エネシス	11,200	989.00	11,076,800
トーエネック	3,400	3,690.00	12,546,000
住友電設	9,500	2,368.00	22,496,000
日本電設工業	18,500	1,834.00	33,929,000
協和エクシオ	51,100	2,723.00	139,145,300
新日本空調	8,900	2,095.00	18,645,500
九電工	23,600	3,480.00	82,128,000
三機工業	23,900	1,430.00	34,177,000
日揮ホールディングス	112,400	1,081.00	121,504,400
中外炉工業	3,600	2,037.00	7,333,200
ヤマト	10,800	804.00	8,683,200
太平電業	7,500	2,666.00	19,995,000
高砂熱学工業	30,400	1,844.00	56,057,600
三晃金属工業	1,300	2,480.00	3,224,000
朝日工業社	2,500	2,982.00	7,455,000
明星工業	21,800	750.00	16,350,000
大気社	16,400	3,400.00	55,760,000
ダイダン	7,500	2,677.00	20,077,500
日比谷総合設備	10,800	1,857.00	20,055,600
フィル・カンパニー	1,900	2,957.00	5,618,300

テスホールディングス	6,100	1,761.00	10,742,100
東洋エンジニアリング	14,100	721.00	10,166,100
レイズネクスト	18,100	1,164.00	21,068,400
ニッポン	31,500	1,579.00	49,738,500
日清製粉グループ本社	121,800	1,655.00	201,579,000
日東富士製粉	800	7,020.00	5,616,000
昭和産業	9,100	3,005.00	27,345,500
鳥越製粉	9,500	795.00	7,552,500
中部飼料	13,200	1,193.00	15,747,600
フィード・ワン	14,500	771.00	11,179,500
東洋精糖	1,800	1,194.00	2,149,200
日本甜菜製糖	5,600	1,649.00	9,234,400
D M三井製糖ホールディングス	8,500	1,864.00	15,844,000
塩水港精糖	12,800	226.00	2,892,800
日新製糖	5,100	1,741.00	8,879,100
森永製菓	25,300	3,470.00	87,791,000
中村屋	2,600	3,780.00	9,828,000
江崎グリコ	29,700	4,300.00	127,710,000
名糖産業	4,700	1,554.00	7,303,800
井村屋グループ	6,100	2,329.00	14,206,900
不二家	6,900	2,191.00	15,117,900
山崎製パン	80,800	1,607.00	129,845,600
第一屋製パン	2,100	960.00	2,016,000
モロゾフ	1,700	5,390.00	9,163,000
亀田製菓	6,100	4,465.00	27,236,500
寿スピリッツ	10,400	7,880.00	81,952,000
カルビー	49,100	2,510.00	123,241,000
森永乳業	19,900	5,710.00	113,629,000
六甲バター	7,200	1,623.00	11,685,600
ヤクルト本社	74,100	6,230.00	461,643,000
明治ホールディングス	71,300	6,760.00	481,988,000
雪印メグミルク	25,900	2,183.00	56,539,700
プリマハム	15,200	2,962.00	45,022,400
日本ハム	41,200	4,365.00	179,838,000
林兼産業	3,600	618.00	2,224,800
丸大食品	10,600	1,707.00	18,094,200
S Foods	9,700	3,385.00	32,834,500
柿安本店	3,700	2,568.00	9,501,600
伊藤ハム米久ホールディングス	69,400	698.00	48,441,200
サッポロホールディングス	36,800	2,357.00	86,737,600
アサヒグループホールディングス	235,500	5,443.00	1,281,826,500
キリンホールディングス	457,100	2,300.00	1,051,330,000

宝ホールディングス	79,900	1,504.00	120,169,600
オエノンホールディングス	30,600	381.00	11,658,600
養命酒製造	3,300	1,855.00	6,121,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	82,500	1,845.00	152,212,500
サントリー食品インターナショナル	72,100	4,235.00	305,343,500
ダイドグループホールディングス	6,100	5,090.00	31,049,000
伊藤園	32,700	6,640.00	217,128,000
キーコーヒー	10,600	2,111.00	22,376,600
ユニカフェ	3,200	999.00	3,196,800
ジャパンフーズ	1,500	1,214.00	1,821,000
日清オイリオグループ	13,800	3,070.00	42,366,000
不二製油グループ本社	26,300	2,775.00	72,982,500
かどや製油	1,200	4,035.00	4,842,000
J - オイルミルズ	10,100	1,931.00	19,503,100
キッコーマン	77,600	7,180.00	557,168,000
味の素	256,300	2,641.50	677,016,450
ブルドックソース	4,900	2,265.00	11,098,500
キューピー	60,000	2,577.00	154,620,000
ハウス食品グループ本社	40,300	3,265.00	131,579,500
カゴメ	44,100	3,005.00	132,520,500
焼津水産化学工業	5,200	984.00	5,116,800
アリアケジャパン	9,800	6,800.00	66,640,000
ピエトロ	1,400	1,684.00	2,357,600
エバラ食品工業	2,400	2,556.00	6,134,400
やまみ	1,200	1,943.00	2,331,600
ニチレイ	51,300	2,878.00	147,641,400
東洋水産	55,500	4,290.00	238,095,000
イトアンドホールディングス	3,700	1,890.00	6,993,000
大冷	1,200	1,963.00	2,355,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,000	778.00	4,668,000
日清食品ホールディングス	42,300	7,830.00	331,209,000
永谷園ホールディングス	5,300	2,190.00	11,607,000
一正蒲鉾	4,200	969.00	4,069,800
フジッコ	11,700	1,931.00	22,592,700
ロック・フィールド	11,600	1,519.00	17,620,400
日本たばこ産業	577,900	2,188.00	1,264,445,200
ケンコーマヨネーズ	6,600	1,675.00	11,055,000
わらべや日洋ホールディングス	7,100	2,070.00	14,697,000
なとり	6,000	1,893.00	11,358,000
イフジ産業	1,700	942.00	1,601,400
ピクルスコーポレーション	2,600	3,270.00	8,502,000
ファーマフーズ	10,200	2,892.00	29,498,400

北の達人コーポレーション	37,600	485.00	18,236,000
ユーグレナ	54,900	878.00	48,202,200
紀文食品	6,300	1,487.00	9,368,100
ミヨシ油脂	3,800	1,241.00	4,715,800
理研ビタミン	10,200	1,558.00	15,891,600
片倉工業	14,300	1,545.00	22,093,500
グンゼ	7,800	4,750.00	37,050,000
東洋紡	41,800	1,355.00	56,639,000
ユニチカ	31,600	376.00	11,881,600
富士紡ホールディングス	5,200	4,090.00	21,268,000
倉敷紡績	9,900	2,027.00	20,067,300
シキボウ	5,900	952.00	5,616,800
日本毛織	34,900	1,002.00	34,969,800
トーア紡コーポレーション	4,200	464.00	1,948,800
帝国繊維	12,000	2,124.00	25,488,000
帝人	99,200	1,785.00	177,072,000
東レ	762,000	752.00	573,024,000
サカイオーベックス	2,900	3,040.00	8,816,000
住江織物	2,300	1,888.00	4,342,400
日本フェルト	6,600	452.00	2,983,200
イチカワ	1,600	1,367.00	2,187,200
日東製網	1,100	1,534.00	1,687,400
アツギ	8,300	617.00	5,121,100
ダイニック	4,000	775.00	3,100,000
セーレン	26,000	2,119.00	55,094,000
ソトー	4,300	806.00	3,465,800
東海染工	1,400	1,136.00	1,590,400
小松マテーレ	17,400	959.00	16,686,600
ワコールホールディングス	26,300	2,581.00	67,880,300
ホギメディカル	14,200	3,485.00	49,487,000
T S Iホールディングス	32,400	354.00	11,469,600
マツオカコーポレーション	3,400	1,786.00	6,072,400
ワールド	13,900	1,602.00	22,267,800
三陽商会	5,500	1,017.00	5,593,500
ナイガイ	4,200	330.00	1,386,000
オンワードホールディングス	63,600	383.00	24,358,800
ルックホールディングス	3,700	1,577.00	5,834,900
ゴールドウイン	17,400	6,640.00	115,536,000
デサント	18,000	2,412.00	43,416,000
キング	5,800	528.00	3,062,400
ヤマトインターナショナル	9,600	342.00	3,283,200
特種東海製紙	6,500	4,355.00	28,307,500

王子ホールディングス	473,500	652.00	308,722,000
日本製紙	46,500	1,283.00	59,659,500
三菱製紙	14,900	369.00	5,498,100
北越コーポレーション	75,200	587.00	44,142,400
中越パルプ工業	4,000	1,247.00	4,988,000
巴川製紙所	3,500	808.00	2,828,000
大王製紙	50,700	1,736.00	88,015,200
阿波製紙	2,700	424.00	1,144,800
レンゴー	108,500	950.00	103,075,000
トモク	6,400	1,943.00	12,435,200
ザ・パック	8,000	2,790.00	22,320,000
クラレ	165,600	1,117.00	184,975,200
旭化成	697,200	1,266.00	882,655,200
共和レザー	5,700	719.00	4,098,300
昭和電工	79,900	3,600.00	287,640,000
住友化学	828,000	610.00	505,080,000
住友精化	5,100	3,610.00	18,411,000
日産化学	58,000	5,540.00	321,320,000
ラサ工業	3,400	1,884.00	6,405,600
クレハ	9,000	6,370.00	57,330,000
多木化学	4,100	5,460.00	22,386,000
テイカ	7,700	1,362.00	10,487,400
石原産業	18,900	1,048.00	19,807,200
片倉コープアグリ	2,700	1,214.00	3,277,800
日本曹達	14,700	3,375.00	49,612,500
東ソー	162,600	1,998.00	324,874,800
トクヤマ	31,200	2,324.00	72,508,800
セントラル硝子	20,100	2,088.00	41,968,800
東亜合成	64,200	1,168.00	74,985,600
大阪ソーダ	10,700	2,492.00	26,664,400
関東電化工業	24,900	1,007.00	25,074,300
デンカ	38,400	3,735.00	143,424,000
信越化学工業	194,500	18,535.00	3,605,057,500
日本カーバイド工業	3,800	1,306.00	4,962,800
堺化学工業	7,400	1,900.00	14,060,000
第一稀元素化学工業	10,600	1,743.00	18,475,800
エア・ウォーター	107,200	1,769.00	189,636,800
日本酸素ホールディングス	86,600	2,099.00	181,773,400
日本化学工業	3,000	2,892.00	8,676,000
東邦アセチレン	1,600	1,213.00	1,940,800
日本パーカライズिंग	53,100	1,091.00	57,932,100
高压ガス工業	16,700	647.00	10,804,900

チタン工業	1,300	1,933.00	2,512,900
四国化成工業	14,000	1,235.00	17,290,000
戸田工業	2,200	2,407.00	5,295,400
ステラ ケミファ	5,700	3,070.00	17,499,000
保土谷化学工業	3,100	3,960.00	12,276,000
日本触媒	19,000	5,580.00	106,020,000
大日精化工業	8,700	2,407.00	20,940,900
カネカ	27,200	4,390.00	119,408,000
三菱瓦斯化学	105,400	2,488.00	262,235,200
三井化学	90,800	3,810.00	345,948,000
J S R	105,600	3,195.00	337,392,000
東京応化工業	18,000	6,930.00	124,740,000
大阪有機化学工業	9,700	4,265.00	41,370,500
三菱ケミカルホールディングス	703,100	894.40	628,852,640
K Hネオケム	17,300	2,714.00	46,952,200
ダイセル	141,400	910.00	128,674,000
住友ベークライト	16,500	4,985.00	82,252,500
積水化学工業	222,400	1,853.00	412,107,200
日本ゼオン	94,900	1,541.00	146,240,900
アイカ工業	29,300	4,000.00	117,200,000
宇部興産	53,100	2,325.00	123,457,500
積水樹脂	17,400	2,079.00	36,174,600
タキロンシーアイ	22,800	586.00	13,360,800
旭有機材	5,900	1,357.00	8,006,300
ニチバン	5,500	1,766.00	9,713,000
リケンテクノス	25,700	582.00	14,957,400
大倉工業	5,000	2,425.00	12,125,000
積水化成品工業	14,100	591.00	8,333,100
群栄化学工業	2,400	2,449.00	5,877,600
タイガースポリマー	5,500	451.00	2,480,500
ミライアル	3,400	1,410.00	4,794,000
ダイキアクシス	4,000	878.00	3,512,000
ダイキョーニシカワ	22,200	738.00	16,383,600
竹本容器	3,800	991.00	3,765,800
森六ホールディングス	5,700	2,330.00	13,281,000
恵和	2,100	3,040.00	6,384,000
日本化薬	65,100	1,045.00	68,029,500
カーリットホールディングス	10,400	675.00	7,020,000
日本精化	7,600	1,474.00	11,202,400
扶桑化学工業	8,300	4,030.00	33,449,000
トリケミカル研究所	9,800	3,485.00	34,153,000
A D E K A	48,400	1,903.00	92,105,200

日油	39,600	5,750.00	227,700,000
新日本理化	17,400	274.00	4,767,600
ハリマ化成グループ	7,800	905.00	7,059,000
花王	257,100	6,797.00	1,747,508,700
第一工業製薬	3,600	3,420.00	12,312,000
石原ケミカル	2,700	2,192.00	5,918,400
日華化学	3,500	1,261.00	4,413,500
ニイタカ	2,200	2,508.00	5,517,600
三洋化成工業	6,300	5,580.00	35,154,000
有機合成薬品工業	8,100	326.00	2,640,600
大日本塗料	11,900	850.00	10,115,000
日本ペイントホールディングス	433,900	1,642.00	712,463,800
関西ペイント	118,200	2,918.00	344,907,600
神東塗料	8,300	199.00	1,651,700
中国塗料	25,300	900.00	22,770,000
日本特殊塗料	7,900	1,152.00	9,100,800
藤倉化成	14,200	531.00	7,540,200
太陽ホールディングス	7,700	5,250.00	40,425,000
D I C	44,400	2,905.00	128,982,000
サカタインクス	23,000	1,058.00	24,334,000
東洋インキS Cホールディングス	22,200	2,096.00	46,531,200
T & K T O K A	7,300	822.00	6,000,600
富士フイルムホールディングス	188,700	7,670.00	1,447,329,000
資生堂	213,400	8,108.00	1,730,247,200
ライオン	139,600	1,965.00	274,314,000
高砂香料工業	6,700	2,697.00	18,069,900
マンダム	22,500	2,131.00	47,947,500
ミルボン	14,400	6,450.00	92,880,000
ファンケル	39,100	3,605.00	140,955,500
コーセー	20,200	18,040.00	364,408,000
コタ	6,800	1,437.00	9,771,600
シーボン	1,400	1,960.00	2,744,000
ポーラ・オルビスホールディングス	45,800	2,982.00	136,575,600
ノエビアホールディングス	9,100	5,250.00	47,775,000
アジュバンコスメジャパン	2,400	1,026.00	2,462,400
新日本製薬	2,900	2,137.00	6,197,300
エステー	6,900	1,798.00	12,406,200
アグロ カネショウ	4,000	1,419.00	5,676,000
コニシ	17,600	1,507.00	26,523,200
長谷川香料	18,500	2,300.00	42,550,000
星光P M C	6,200	831.00	5,152,200
小林製薬	30,100	9,320.00	280,532,000

荒川化学工業	9,000	1,220.00	10,980,000
メック	7,400	2,785.00	20,609,000
日本高純度化学	2,900	2,824.00	8,189,600
タカラバイオ	28,100	2,880.00	80,928,000
J C U	12,100	3,520.00	42,592,000
新田ゼラチン	6,700	644.00	4,314,800
O A Tアグリオ	2,000	1,428.00	2,856,000
デクセリアルズ	30,000	2,200.00	66,000,000
アース製薬	8,100	6,660.00	53,946,000
北興化学工業	10,000	959.00	9,590,000
大成ラミック	3,300	2,740.00	9,042,000
クミアイ化学工業	44,400	923.00	40,981,200
日本農薬	19,100	518.00	9,893,800
アキレス	7,400	1,397.00	10,337,800
有沢製作所	14,900	914.00	13,618,600
日東電工	64,900	8,450.00	548,405,000
レック	12,700	1,182.00	15,011,400
三光合成	11,300	446.00	5,039,800
きもと	16,400	255.00	4,182,000
藤森工業	9,600	4,085.00	39,216,000
前澤化成工業	6,800	1,247.00	8,479,600
未来工業	3,800	1,726.00	6,558,800
ウェーブロックホールディングス	3,700	712.00	2,634,400
J S P	6,300	1,656.00	10,432,800
エフピコ	19,700	4,055.00	79,883,500
天馬	8,000	2,521.00	20,168,000
信越ポリマー	16,500	1,062.00	17,523,000
東リ	26,700	247.00	6,594,900
ニフコ	39,400	4,020.00	158,388,000
バルカー	8,700	2,100.00	18,270,000
ユニ・チャーム	227,700	4,388.00	999,147,600
ショーエイコーポレーション	2,400	970.00	2,328,000
協和キリン	108,000	3,670.00	396,360,000
武田薬品工業	893,500	3,767.00	3,365,814,500
アステラス製薬	931,200	1,909.50	1,778,126,400
大日本住友製薬	79,600	2,340.00	186,264,000
塩野義製薬	135,100	5,839.00	788,848,900
わかもと製薬	12,800	328.00	4,198,400
日本新薬	30,500	8,480.00	258,640,000
バイオフェルミン製薬	1,800	3,130.00	5,634,000
中外製薬	335,900	4,267.00	1,433,285,300
科研製薬	18,400	4,765.00	87,676,000



エーザイ	118,700	10,000.00	1,187,000,000	
ロート製薬	51,200	2,899.00	148,428,800	
小野薬品工業	246,600	2,463.50	607,499,100	
久光製薬	31,200	5,820.00	181,584,000	
持田製薬	14,900	3,745.00	55,800,500	
参天製薬	186,900	1,511.00	282,405,900	
扶桑薬品工業	3,500	2,322.00	8,127,000	
日本ケミファ	1,300	2,600.00	3,380,000	
ツムラ	35,800	3,700.00	132,460,000	
日医工	30,400	961.00	29,214,400	
キッセイ薬品工業	19,000	2,170.00	41,230,000	
生化学工業	18,900	1,084.00	20,487,600	
栄研化学	18,900	2,169.00	40,994,100	
日水製薬	3,900	982.00	3,829,800	
鳥居薬品	6,700	2,525.00	16,917,500	
JCRファーマ	30,300	3,400.00	103,020,000	
東和薬品	15,500	2,562.00	39,711,000	
富士製薬工業	6,600	1,191.00	7,860,600	
ゼリア新薬工業	19,500	2,103.00	41,008,500	
第一三共	843,900	2,497.00	2,107,218,300	
キョーリン製薬ホールディングス	23,700	1,745.00	41,356,500	
大幸薬品	13,200	1,066.00	14,071,200	
ダイト	6,900	3,405.00	23,494,500	
大塚ホールディングス	223,200	4,695.00	1,047,924,000	
大正製薬ホールディングス	25,500	6,280.00	160,140,000	
ペプチドリーム	55,400	4,925.00	272,845,000	
あすか製薬ホールディングス	12,200	1,043.00	12,724,600	
サワイグループホールディングス	23,500	5,050.00	118,675,000	
日本コークス工業	90,700	104.00	9,432,800	
ニチレキ	12,700	1,346.00	17,094,200	
ユシロ化学工業	6,000	1,215.00	7,290,000	
ビーピー・カストロール	3,800	1,397.00	5,308,600	
富士石油	26,100	290.00	7,569,000	
MORESCO	3,900	1,116.00	4,352,400	
出光興産	119,200	2,695.00	321,244,000	
ENEOSホールディングス	1,615,600	464.80	750,930,880	
コスモエネルギーホールディングス	33,900	2,448.00	82,987,200	
横浜ゴム	62,200	2,291.00	142,500,200	
TOYO TIRE	56,500	2,281.00	128,876,500	
ブリヂストン	285,600	4,934.00	1,409,150,400	
住友ゴム工業	96,500	1,506.00	145,329,000	
藤倉コンポジット	9,400	501.00	4,709,400	

オカモト	6,500	4,300.00	27,950,000
フコク	4,700	1,038.00	4,878,600
ニッタ	11,100	2,730.00	30,303,000
住友理工	20,800	740.00	15,392,000
三ツ星ベルト	13,000	1,776.00	23,088,000
バンドー化学	18,900	865.00	16,348,500
日東紡績	16,000	3,455.00	55,280,000
A G C	98,600	4,845.00	477,717,000
日本板硝子	54,500	619.00	33,735,500
石塚硝子	1,800	1,936.00	3,484,800
日本山村硝子	4,500	941.00	4,234,500
日本電気硝子	39,900	2,681.00	106,971,900
オハラ	4,300	1,527.00	6,566,100
住友大阪セメント	19,400	3,045.00	59,073,000
太平洋セメント	63,600	2,489.00	158,300,400
日本ヒューム	9,900	733.00	7,256,700
日本コンクリート工業	23,400	343.00	8,026,200
三谷セキサン	5,000	4,135.00	20,675,000
アジアパイルホールディングス	16,700	506.00	8,450,200
東海カーボン	105,100	1,623.00	170,577,300
日本カーボン	5,900	4,410.00	26,019,000
東洋炭素	6,300	2,665.00	16,789,500
ノリタケカンパニーリミテド	6,000	4,215.00	25,290,000
T O T O	76,700	6,010.00	460,967,000
日本碍子	118,200	2,023.00	239,118,600
日本特殊陶業	81,700	1,719.00	140,442,300
M A R U W A	3,700	10,630.00	39,331,000
品川リフラクトリーズ	2,500	3,640.00	9,100,000
黒崎播磨	1,800	4,575.00	8,235,000
ヨータイ	7,800	1,153.00	8,993,400
イソライト工業	4,900	630.00	3,087,000
東京窯業	13,900	327.00	4,545,300
ニッカトー	5,000	708.00	3,540,000
フジミインコーポレーテッド	8,600	5,020.00	43,172,000
クニミネ工業	3,400	1,168.00	3,971,200
エーアンドエーマテリアル	2,100	1,031.00	2,165,100
ニチアス	27,200	2,805.00	76,296,000
ニチハ	15,000	2,945.00	44,175,000
日本製鉄	507,000	1,951.50	989,410,500
神戸製鋼所	194,500	733.00	142,568,500
中山製鋼所	14,900	430.00	6,407,000
合同製鐵	5,800	1,695.00	9,831,000

ジェイ エフ イー ホールディングス	307,300	1,354.00	416,084,200
東京製鐵	41,400	1,136.00	47,030,400
共英製鋼	12,000	1,486.00	17,832,000
大和工業	22,600	3,800.00	85,880,000
東京鐵鋼	4,100	1,597.00	6,547,700
大阪製鐵	5,700	1,136.00	6,475,200
淀川製鋼所	14,000	2,260.00	31,640,000
丸一鋼管	34,500	2,775.00	95,737,500
モリ工業	3,200	2,443.00	7,817,600
大同特殊鋼	17,400	5,530.00	96,222,000
日本高周波鋼業	4,100	425.00	1,742,500
日本冶金工業	8,300	2,345.00	19,463,500
山陽特殊製鋼	12,800	1,603.00	20,518,400
愛知製鋼	6,000	3,200.00	19,200,000
日立金属	100,100	2,122.00	212,412,200
日本金属	2,700	993.00	2,681,100
大平洋金属	7,200	1,873.00	13,485,600
新日本電工	68,700	310.00	21,297,000
栗本鐵工所	4,800	1,694.00	8,131,200
虹技	1,500	1,179.00	1,768,500
三菱製鋼	7,900	886.00	6,999,400
日亜鋼業	15,700	300.00	4,710,000
日本精線	1,500	4,465.00	6,697,500
エンビプロ・ホールディングス	4,600	1,255.00	5,773,000
シンニッタン	13,100	260.00	3,406,000
新家工業	2,700	1,656.00	4,471,200
大紀アルミニウム工業所	16,100	1,186.00	19,094,600
日本軽金属ホールディングス	29,000	1,881.00	54,549,000
三井金属鉱業	28,700	3,180.00	91,266,000
東邦亜鉛	5,900	1,975.00	11,652,500
三菱マテリアル	70,200	2,293.00	160,968,600
住友金属鉱山	135,800	4,740.00	643,692,000
D O W Aホールディングス	26,900	4,355.00	117,149,500
古河機械金属	17,600	1,302.00	22,915,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,100	826.00	9,168,600
東邦チタニウム	19,100	973.00	18,584,300
U A C J	16,200	2,672.00	43,286,400
C Kサンエツ	2,200	3,400.00	7,480,000
古河電気工業	33,000	2,903.00	95,799,000
住友電気工業	370,700	1,728.00	640,569,600
フジクラ	128,200	472.00	60,510,400
昭和電線ホールディングス	10,300	1,639.00	16,881,700

東京特殊電線	1,400	2,561.00	3,585,400
タツタ電線	18,900	574.00	10,848,600
カナレ電気	1,800	1,811.00	3,259,800
平河ヒューテック	5,900	1,209.00	7,133,100
リョービ	13,100	1,668.00	21,850,800
アーレスティ	13,200	520.00	6,864,000
アサヒホールディングス	39,900	2,338.00	93,286,200
稲葉製作所	6,000	1,522.00	9,132,000
宮地エンジニアリンググループ	3,500	2,317.00	8,109,500
トーカロ	27,400	1,413.00	38,716,200
アルファC o	3,700	1,144.00	4,232,800
SUMCO	135,500	2,523.00	341,866,500
川田テクノロジーズ	2,200	3,705.00	8,151,000
RS Technologies	3,400	5,780.00	19,652,000
ジェイテックコーポレーション	1,200	3,020.00	3,624,000
信和	5,600	729.00	4,082,400
東洋製罐グループホールディングス	67,600	1,598.00	108,024,800
ホッカンホールディングス	5,400	1,434.00	7,743,600
コロナ	5,900	939.00	5,540,100
横河ブリッジホールディングス	18,200	2,094.00	38,110,800
駒井ハルテック	2,200	1,795.00	3,949,000
高田機工	1,000	2,718.00	2,718,000
三和ホールディングス	100,100	1,361.00	136,236,100
文化シャッター	31,300	1,081.00	33,835,300
三協立山	13,700	798.00	10,932,600
アルインコ	7,000	994.00	6,958,000
東洋シャッター	2,300	702.00	1,614,600
LIXIL	146,300	2,889.00	422,660,700
日本フィルコン	7,400	498.00	3,685,200
ノーリツ	22,000	1,841.00	40,502,000
長府製作所	10,800	2,021.00	21,826,800
リンナイ	20,700	10,560.00	218,592,000
ダイニチ工業	5,100	799.00	4,074,900
日東精工	13,300	562.00	7,474,600
三洋工業	1,300	1,854.00	2,410,200
岡部	21,500	669.00	14,383,500
ジーテクト	13,200	1,535.00	20,262,000
東ブレ	19,800	1,665.00	32,967,000
高周波熱錬	20,400	591.00	12,056,400
東京製綱	7,600	1,220.00	9,272,000
サンコール	9,100	462.00	4,204,200
モリテック スチール	8,300	501.00	4,158,300

パイオラックス	15,700	1,519.00	23,848,300
エイチワン	10,400	814.00	8,465,600
日本発條	105,800	898.00	95,008,400
中央発條	5,100	1,223.00	6,237,300
アドバネクス	1,500	1,359.00	2,038,500
立川ブラインド工業	4,700	1,323.00	6,218,100
三益半導体工業	8,300	2,637.00	21,887,100
日本ドライケミカル	2,700	1,807.00	4,878,900
日本製鋼所	32,300	2,894.00	93,476,200
三浦工業	46,000	5,000.00	230,000,000
タクマ	36,100	1,807.00	65,232,700
ツガミ	22,100	1,714.00	37,879,400
オークマ	12,400	5,580.00	69,192,000
芝浦機械	11,100	2,555.00	28,360,500
アマダ	155,800	1,178.00	183,532,400
アイダエンジニアリング	28,000	875.00	24,500,000
滝澤鉄工所	3,100	1,136.00	3,521,600
F U J I	42,400	2,577.00	109,264,800
牧野フライス製作所	12,500	4,400.00	55,000,000
オーエスジー	52,500	1,898.00	99,645,000
ダイジェット工業	1,300	1,323.00	1,719,900
旭ダイヤモンド工業	28,100	537.00	15,089,700
D M G 森精機	67,300	1,933.00	130,090,900
ソディック	25,500	1,112.00	28,356,000
ディスコ	14,400	33,750.00	486,000,000
日東工器	5,100	1,947.00	9,929,700
日進工具	8,400	1,545.00	12,978,000
パンチ工業	9,000	635.00	5,715,000
富士ダイス	5,400	653.00	3,526,200
豊和工業	6,000	806.00	4,836,000
O K K	4,100	400.00	1,640,000
東洋機械金属	7,700	543.00	4,181,100
津田駒工業	2,000	896.00	1,792,000
エンシュウ	2,700	899.00	2,427,300
島精機製作所	15,600	2,067.00	32,245,200
オプトラン	13,300	2,560.00	34,048,000
N C ホールディングス	3,300	1,226.00	4,045,800
イワキポンプ	6,800	999.00	6,793,200
フリーー	10,400	1,221.00	12,698,400
ヤマシンフィルタ	21,500	769.00	16,533,500
日阪製作所	13,200	827.00	10,916,400
やまびこ	20,600	1,222.00	25,173,200

平田機工	5,000	6,430.00	32,150,000
ペガサスミシン製造	10,900	498.00	5,428,200
マルマエ	4,400	2,119.00	9,323,600
タツモ	4,500	1,684.00	7,578,000
ナブテスコ	62,600	4,900.00	306,740,000
三井海洋開発	11,300	2,213.00	25,006,900
レオン自動機	10,500	1,522.00	15,981,000
S M C	31,400	62,840.00	1,973,176,000
ホソカワミクロン	3,700	6,090.00	22,533,000
ユニオンツール	4,000	4,025.00	16,100,000
オイレス工業	14,900	1,561.00	23,258,900
日精エー・エス・ビー機械	3,600	5,300.00	19,080,000
サトーホールディングス	14,000	2,618.00	36,652,000
技研製作所	9,400	4,620.00	43,428,000
日本エアーテック	3,500	1,290.00	4,515,000
カワタ	3,000	903.00	2,709,000
日精樹脂工業	8,300	1,327.00	11,014,100
オカダアイヨン	3,400	1,309.00	4,450,600
ワイエイシイホールディングス	4,200	1,068.00	4,485,600
小松製作所	486,600	3,145.00	1,530,357,000
住友重機械工業	61,500	3,380.00	207,870,000
日立建機	50,200	3,560.00	178,712,000
日工	16,200	707.00	11,453,400
巴工業	4,200	2,340.00	9,828,000
井関農機	10,800	1,433.00	15,476,400
T O W A	10,000	2,150.00	21,500,000
丸山製作所	2,300	1,850.00	4,255,000
北川鉄工所	4,900	1,772.00	8,682,800
ローツェ	4,700	9,810.00	46,107,000
タカキタ	3,800	668.00	2,538,400
クボタ	564,200	2,385.00	1,345,617,000
荏原実業	2,700	6,170.00	16,659,000
三菱化工機	3,500	2,754.00	9,639,000
月島機械	19,900	1,184.00	23,561,600
帝国電機製作所	7,500	1,305.00	9,787,500
新東工業	25,700	793.00	20,380,100
澁谷工業	9,400	3,305.00	31,067,000
アイチ コーポレーション	18,400	882.00	16,228,800
小森コーポレーション	27,400	798.00	21,865,200
鶴見製作所	8,300	1,770.00	14,691,000
住友精密工業	1,600	2,617.00	4,187,200
日本ギア工業	4,500	325.00	1,462,500

酒井重工業	2,000	2,475.00	4,950,000
荏原製作所	44,600	5,380.00	239,948,000
石井鐵工所	1,600	3,005.00	4,808,000
西島製作所	11,000	886.00	9,746,000
北越工業	11,100	1,166.00	12,942,600
ダイキン工業	136,800	20,245.00	2,769,516,000
オルガノ	3,500	6,210.00	21,735,000
トーヨーカネツ	4,100	2,465.00	10,106,500
栗田工業	58,100	5,170.00	300,377,000
椿本チエイン	15,400	3,285.00	50,589,000
大同工業	5,200	1,049.00	5,454,800
木村化工機	9,100	899.00	8,180,900
アネスト岩田	18,200	1,083.00	19,710,600
ダイフク	59,100	9,320.00	550,812,000
サムコ	2,700	3,220.00	8,694,000
加藤製作所	6,000	1,019.00	6,114,000
油研工業	1,900	1,752.00	3,328,800
タダノ	51,900	1,156.00	59,996,400
フジテック	37,000	2,533.00	93,721,000
C K D	24,900	2,462.00	61,303,800
キトー	9,100	1,705.00	15,515,500
平和	30,000	1,955.00	58,650,000
理想科学工業	7,900	1,758.00	13,888,200
S A N K Y O	25,600	2,822.00	72,243,200
日本金銭機械	12,000	578.00	6,936,000
マースグループホールディングス	6,900	1,641.00	11,322,900
フクシマガリレイ	7,400	4,535.00	33,559,000
オーイズミ	4,700	383.00	1,800,100
ダイコク電機	5,000	915.00	4,575,000
竹内製作所	18,000	2,853.00	51,354,000
アマノ	28,100	2,966.00	83,344,600
J U K I	14,900	819.00	12,203,100
蛇の目ミシン工業	9,800	786.00	7,702,800
マックス	14,400	1,662.00	23,932,800
グローリー	27,600	2,310.00	63,756,000
新晃工業	10,000	1,893.00	18,930,000
大和冷機工業	17,300	1,082.00	18,718,600
セガサミーホールディングス	97,700	1,446.00	141,274,200
日本ピストンリング	4,000	1,318.00	5,272,000
リケン	5,000	2,667.00	13,335,000
T P R	14,500	1,533.00	22,228,500
ツバキ・ナカシマ	20,700	1,856.00	38,419,200

ホシザキ	33,800	10,340.00	349,492,000
大豊工業	8,800	1,042.00	9,169,600
日本精工	220,600	1,049.00	231,409,400
NTN	248,600	318.00	79,054,800
ジェイテクト	103,100	1,219.00	125,678,900
不二越	10,000	4,160.00	41,600,000
日本トムソン	29,500	626.00	18,467,000
THK	67,000	3,385.00	226,795,000
ユーシン精機	7,200	830.00	5,976,000
前澤給装工業	7,500	1,092.00	8,190,000
イーグル工業	13,300	1,134.00	15,082,200
前澤工業	6,500	609.00	3,958,500
日本ピラー工業	10,900	2,251.00	24,535,900
キッツ	33,200	795.00	26,394,000
マキタ	140,100	5,030.00	704,703,000
日立造船	85,300	730.00	62,269,000
三菱重工業	168,800	3,438.00	580,334,400
IHI	72,300	2,845.00	205,693,500
スター精密	16,600	1,818.00	30,178,800
日清紡ホールディングス	65,700	928.00	60,969,600
イビデン	51,800	5,410.00	280,238,000
コニカミノルタ	219,000	642.00	140,598,000
ブラザー工業	131,400	2,298.00	301,957,200
ミネベアミツミ	185,300	2,893.00	536,072,900
日立製作所	516,400	6,073.00	3,136,097,200
東芝	212,500	4,720.00	1,003,000,000
三菱電機	1,073,900	1,747.50	1,876,640,250
富士電機	64,700	5,130.00	331,911,000
東洋電機製造	4,300	1,201.00	5,164,300
安川電機	115,600	5,160.00	596,496,000
シンフォニアテクノロジー	14,000	1,295.00	18,130,000
明電舎	18,200	2,298.00	41,823,600
オリジン	3,000	1,326.00	3,978,000
山洋電気	5,300	7,750.00	41,075,000
デンヨー	9,200	2,043.00	18,795,600
東芝テック	11,500	4,480.00	51,520,000
芝浦メカトロニクス	2,000	7,610.00	15,220,000
マブチモーター	29,900	4,445.00	132,905,500
日本電産	258,500	12,260.00	3,169,210,000
トレックス・セミコンダクター	6,100	2,182.00	13,310,200
東光高岳	5,900	1,419.00	8,372,100
ダイヘン	11,800	4,880.00	57,584,000



ヤーマン	17,900	1,445.00	25,865,500
JVCケンウッド	95,800	236.00	22,608,800
ミマキエンジニアリング	10,600	706.00	7,483,600
I-PEX	5,300	2,542.00	13,472,600
日新電機	25,200	1,358.00	34,221,600
大崎電気工業	21,500	620.00	13,330,000
オムロン	89,400	8,330.00	744,702,000
日東工業	15,800	1,803.00	28,487,400
I D E C	14,400	2,039.00	29,361,600
正興電機製作所	3,800	1,645.00	6,251,000
不二電機工業	2,300	1,281.00	2,946,300
ジーエス・ユアサ コーポレーション	38,800	3,110.00	120,668,000
サクサホールディングス	2,600	1,395.00	3,627,000
メルコホールディングス	3,800	4,940.00	18,772,000
テクノメディカ	2,800	1,627.00	4,555,600
日本電気	136,500	5,150.00	702,975,000
富士通	96,600	18,765.00	1,812,699,000
沖電気工業	43,700	1,009.00	44,093,300
岩崎通信機	4,700	943.00	4,432,100
電気興業	5,200	2,270.00	11,804,000
サンケン電気	12,600	5,260.00	66,276,000
ナカヨ	2,200	1,477.00	3,249,400
アイホン	6,100	2,115.00	12,901,500
ルネサスエレクトロニクス	475,400	1,183.00	562,398,200
セイコーエプソン	133,300	1,974.00	263,134,200
ワコム	78,700	659.00	51,863,300
アルバック	19,800	5,370.00	106,326,000
アクセル	5,200	917.00	4,768,400
E I Z O	9,100	5,080.00	46,228,000
日本信号	25,100	936.00	23,493,600
京三製作所	23,400	449.00	10,506,600
能美防災	14,500	2,001.00	29,014,500
ホーチキ	8,300	1,226.00	10,175,800
星和電機	6,500	556.00	3,614,000
エレコム	24,900	2,002.00	49,849,800
パナソニック	1,145,400	1,254.50	1,436,904,300
シャープ	142,900	1,936.00	276,654,400
アンリツ	64,600	2,056.00	132,817,600
富士通ゼネラル	32,800	2,798.00	91,774,400
ソニーグループ	672,800	10,795.00	7,262,876,000
T D K	51,900	13,840.00	718,296,000
帝国通信工業	5,300	1,190.00	6,307,000

タムラ製作所	38,800	568.00	22,038,400
アルプスアルパイン	88,300	1,205.00	106,401,500
池上通信機	3,400	850.00	2,890,000
鈴木	5,400	1,031.00	5,567,400
日本トリム	2,500	3,705.00	9,262,500
ローランド ディー・ジー	6,700	2,489.00	16,676,300
フォスター電機	10,900	1,012.00	11,030,800
S M K	2,800	2,568.00	7,190,400
ヨコオ	8,600	2,346.00	20,175,600
ホシデン	30,000	1,001.00	30,030,000
ヒロセ電機	16,600	15,800.00	262,280,000
日本航空電子工業	24,700	1,840.00	45,448,000
T O A	12,800	899.00	11,507,200
マクセルホールディングス	21,900	1,280.00	28,032,000
古野電気	14,400	1,045.00	15,048,000
ユニデンホールディングス	2,800	2,530.00	7,084,000
スミダコーポレーション	9,800	1,104.00	10,819,200
アイコム	4,500	2,399.00	10,795,500
リオン	4,800	2,821.00	13,540,800
本多通信工業	9,700	491.00	4,762,700
横河電機	107,500	1,711.00	183,932,500
新電元工業	4,200	4,205.00	17,661,000
アズビル	72,600	4,370.00	317,262,000
東亜ディーケーケー	6,100	824.00	5,026,400
日本光電工業	44,600	3,185.00	142,051,000
チノー	3,500	1,500.00	5,250,000
共和電業	11,600	391.00	4,535,600
日本電子材料	4,500	1,997.00	8,986,500
堀場製作所	21,300	7,340.00	156,342,000
アドバンテスト	79,900	9,910.00	791,809,000
小野測器	5,700	560.00	3,192,000
エスペック	9,800	2,147.00	21,040,600
キーエンス	105,400	53,850.00	5,675,790,000
日置電機	5,300	5,620.00	29,786,000
シスメックス	83,900	11,270.00	945,553,000
日本マイクロニクス	19,100	1,556.00	29,719,600
メガチップス	11,000	3,300.00	36,300,000
O B A R A G R O U P	5,000	3,915.00	19,575,000
澤藤電機	1,400	2,237.00	3,131,800
原田工業	5,100	925.00	4,717,500
コーセル	13,700	1,090.00	14,933,000
イリソ電子工業	9,200	4,965.00	45,678,000

オブテックスグループ	18,000	1,883.00	33,894,000
千代田インテグレ	4,900	1,850.00	9,065,000
アイ・オー・データ機器	4,600	1,077.00	4,954,200
レーザーテック	47,200	20,560.00	970,432,000
スタンレー電気	75,400	3,395.00	255,983,000
岩崎電気	4,300	1,827.00	7,856,100
ウシオ電機	55,500	1,714.00	95,127,000
岡谷電機産業	9,500	353.00	3,353,500
ハリオス テクノ ホールディング	11,800	354.00	4,177,200
エノモト	3,300	1,731.00	5,712,300
日本セラミック	11,100	2,976.00	33,033,600
遠藤照明	6,300	794.00	5,002,200
古河電池	8,100	1,642.00	13,300,200
双信電機	6,500	574.00	3,731,000
山一電機	7,400	1,729.00	12,794,600
図研	7,200	3,050.00	21,960,000
日本電子	19,700	5,860.00	115,442,000
カシオ計算機	86,400	1,921.00	165,974,400
ファナック	94,300	26,390.00	2,488,577,000
日本シイエムケイ	24,500	448.00	10,976,000
エンプラス	5,000	4,100.00	20,500,000
大真空	3,900	4,110.00	16,029,000
ローム	44,700	9,920.00	443,424,000
浜松ホトニクス	77,100	6,860.00	528,906,000
三井ハイテック	10,700	4,355.00	46,598,500
新光電気工業	36,200	3,645.00	131,949,000
京セラ	163,800	6,891.00	1,128,745,800
太陽誘電	47,900	5,200.00	249,080,000
村田製作所	315,500	8,284.00	2,613,602,000
双葉電子工業	19,200	815.00	15,648,000
北陸電気工業	4,700	1,004.00	4,718,800
ニチコン	34,400	1,152.00	39,628,800
日本ケミコン	10,800	2,422.00	26,157,600
K O A	15,300	1,615.00	24,709,500
市光工業	16,900	742.00	12,539,800
小糸製作所	64,400	7,020.00	452,088,000
ミツバ	19,800	903.00	17,879,400
S C R E E Nホールディングス	18,600	10,680.00	198,648,000
キャノン電子	10,200	1,731.00	17,656,200
キャノン	533,700	2,643.50	1,410,835,950
リコー	273,300	1,394.00	380,980,200
象印マホービン	29,400	1,703.00	50,068,200

MUTOHホールディングス	1,800	1,587.00	2,856,600
東京エレクトロン	62,900	47,570.00	2,992,153,000
トヨタ紡織	31,300	2,243.00	70,205,900
芦森工業	2,100	1,056.00	2,217,600
ユニプレス	17,700	1,010.00	17,877,000
豊田自動織機	86,900	9,690.00	842,061,000
モリタホールディングス	17,200	1,598.00	27,485,600
三櫻工業	14,900	1,201.00	17,894,900
デンソー	236,500	7,789.00	1,842,098,500
東海理化電機製作所	28,300	1,811.00	51,251,300
三井E & Sホールディングス	41,600	522.00	21,715,200
川崎重工業	83,600	2,535.00	211,926,000
名村造船所	32,300	178.00	5,749,400
日本車輛製造	3,900	2,212.00	8,626,800
三菱ロジスネクスト	14,200	1,061.00	15,066,200
近畿車輛	1,800	1,282.00	2,307,600
日産自動車	1,266,600	556.70	705,116,220
いすゞ自動車	285,100	1,582.00	451,028,200
トヨタ自動車	1,088,000	9,866.00	10,734,208,000
日野自動車	134,100	1,015.00	136,111,500
三菱自動車工業	397,500	317.00	126,007,500
エフテック	7,600	888.00	6,748,800
レシップホールディングス	4,300	609.00	2,618,700
G M B	2,000	1,058.00	2,116,000
ファルテック	1,900	769.00	1,461,100
武蔵精密工業	24,000	2,442.00	58,608,000
日産車体	15,700	748.00	11,743,600
新明和工業	30,300	1,005.00	30,451,500
極東開発工業	18,500	1,737.00	32,134,500
トピー工業	8,900	1,375.00	12,237,500
ティラド	3,400	2,938.00	9,989,200
曙ブレーキ工業	58,900	181.00	10,660,900
タチエス	16,500	1,471.00	24,271,500
N O K	52,000	1,402.00	72,904,000
フタバ産業	27,000	538.00	14,526,000
K Y B	12,000	3,985.00	47,820,000
大同メタル工業	22,300	636.00	14,182,800
プレス工業	53,400	352.00	18,796,800
ミクニ	13,800	321.00	4,429,800
太平洋工業	22,500	1,188.00	26,730,000
河西工業	14,600	419.00	6,117,400
アイシン	78,600	4,870.00	382,782,000

マツダ	337,100	1,023.00	344,853,300
今仙電機製作所	9,500	746.00	7,087,000
本田技研工業	845,600	3,576.00	3,023,865,600
スズキ	212,900	4,786.00	1,018,939,400
S U B A R U	307,800	2,273.50	699,783,300
安永	5,200	1,250.00	6,500,000
ヤマハ発動機	151,800	3,260.00	494,868,000
T B K	12,900	419.00	5,405,100
エクセディ	14,600	1,773.00	25,885,800
豊田合成	34,700	2,793.00	96,917,100
愛三工業	16,900	895.00	15,125,500
盟和産業	1,700	986.00	1,676,200
日本プラスト	9,100	744.00	6,770,400
ヨロズ	9,200	1,272.00	11,702,400
エフ・シー・シー	17,600	1,747.00	30,747,200
シマノ	40,200	24,265.00	975,453,000
テイ・エス テック	49,900	1,631.00	81,386,900
ジャムコ	6,300	1,285.00	8,095,500
テルモ	329,200	4,473.00	1,472,511,600
クリエートメディック	3,600	1,007.00	3,625,200
日機装	34,700	1,183.00	41,050,100
日本エム・ディ・エム	6,200	2,243.00	13,906,600
島津製作所	138,200	3,995.00	552,109,000
J M S	9,100	865.00	7,871,500
長野計器	7,800	1,199.00	9,352,200
ブイ・テクノロジー	5,000	5,430.00	27,150,000
東京計器	6,900	1,084.00	7,479,600
愛知時計電機	1,400	4,295.00	6,013,000
インターアクション	5,400	2,439.00	13,170,600
オーバル	9,700	286.00	2,774,200
東京精密	18,100	5,280.00	95,568,000
マニー	42,800	2,478.00	106,058,400
ニコン	164,000	1,211.00	198,604,000
トプコン	54,100	1,814.00	98,137,400
オリンパス	594,200	2,411.50	1,432,913,300
理研計器	9,500	2,784.00	26,448,000
タムロン	8,700	2,487.00	21,636,900
H O Y A	211,300	13,740.00	2,903,262,000
シード	4,200	836.00	3,511,200
ノーリツ鋼機	9,700	2,302.00	22,329,400
エー・アンド・デイ	9,100	1,043.00	9,491,300
朝日インテック	113,100	2,661.00	300,959,100

シチズン時計	136,300	440.00	59,972,000	
リズム	3,400	799.00	2,716,600	
大研医器	8,500	563.00	4,785,500	
メニコン	16,500	7,190.00	118,635,000	
シンシア	1,200	641.00	769,200	
松風	4,900	2,004.00	9,819,600	
セイコーホールディングス	15,200	2,326.00	35,355,200	
ニプロ	80,100	1,371.00	109,817,100	
中本パックス	2,700	1,608.00	4,341,600	
スノーピーク	6,400	3,335.00	21,344,000	
パラマウントベッドホールディングス	20,600	1,984.00	40,870,400	
トランザクション	5,900	1,422.00	8,389,800	
粧美堂	3,100	427.00	1,323,700	
ニホンフラッシュ	9,200	1,256.00	11,555,200	
前田工織	11,800	3,410.00	40,238,000	
永大産業	14,000	319.00	4,466,000	
アートネイチャー	10,300	671.00	6,911,300	
バンダイナムコホールディングス	88,800	8,022.00	712,353,600	
アイフィスジャパン	2,700	716.00	1,933,200	
共立印刷	17,900	144.00	2,577,600	
S H O E I	10,100	3,880.00	39,188,000	
フランスベッドホールディングス	13,800	922.00	12,723,600	
パイロットコーポレーション	18,100	3,650.00	66,065,000	
萩原工業	6,000	1,431.00	8,586,000	
トッパン・フォームズ	19,200	1,085.00	20,832,000	
フジシールインターナショナル	22,100	2,386.00	52,730,600	
タカラトミー	48,200	968.00	46,657,600	
廣濟堂	7,500	985.00	7,387,500	
エステールホールディングス	2,900	649.00	1,882,100	
タカノ	3,700	643.00	2,379,100	
プロネクサス	8,600	1,043.00	8,969,800	
ホクシン	6,600	170.00	1,122,000	
ウッドワン	3,600	1,295.00	4,662,000	
大建工業	7,200	2,094.00	15,076,800	
凸版印刷	163,200	1,898.00	309,753,600	
大日本印刷	129,700	2,393.00	310,372,100	
共同印刷	3,300	2,734.00	9,022,200	
N I S S H A	22,000	1,579.00	34,738,000	
光村印刷	900	1,701.00	1,530,900	
T A K A R A & C O M P A N Y	5,300	1,738.00	9,211,400	
アシックス	95,000	2,601.00	247,095,000	
ツツミ	2,700	2,334.00	6,301,800	

ローランド	8,400	6,290.00	52,836,000	
小松ウオール工業	3,300	1,948.00	6,428,400	
ヤマハ	63,900	6,460.00	412,794,000	
河合楽器製作所	3,000	3,665.00	10,995,000	
クリナップ	10,000	517.00	5,170,000	
ピジョン	69,000	3,340.00	230,460,000	
オリバー	2,300	2,751.00	6,327,300	
兼松サステック	700	1,800.00	1,260,000	
キングジム	8,900	951.00	8,463,900	
リンテック	23,000	2,444.00	56,212,000	
イトーキ	21,300	379.00	8,072,700	
任天堂	61,500	67,090.00	4,126,035,000	
三菱鉛筆	17,700	1,433.00	25,364,100	
タカラスタANDARD	22,200	1,568.00	34,809,600	
コクヨ	51,500	1,819.00	93,678,500	
ナカバヤシ	10,600	605.00	6,413,000	
グローブライド	5,200	4,310.00	22,412,000	
オカムラ	36,900	1,462.00	53,947,800	
美津濃	10,600	2,357.00	24,984,200	
東京電力ホールディングス	910,900	345.00	314,260,500	
中部電力	328,600	1,358.50	446,403,100	
関西電力	406,900	1,088.50	442,910,650	
中国電力	154,900	1,027.00	159,082,300	
北陸電力	98,200	632.00	62,062,400	
東北電力	251,500	886.00	222,829,000	
四国電力	89,300	754.00	67,332,200	
九州電力	237,200	872.00	206,838,400	
北海道電力	100,500	521.00	52,360,500	
沖縄電力	20,900	1,442.00	30,137,800	
電源開発	85,400	1,638.00	139,885,200	
エフオン	6,500	975.00	6,337,500	
イーレックス	15,800	1,931.00	30,509,800	
レノバ	18,200	3,875.00	70,525,000	
東京瓦斯	206,500	2,167.00	447,485,500	
大阪瓦斯	194,500	2,096.00	407,672,000	
東邦瓦斯	52,800	5,610.00	296,208,000	
北海道瓦斯	5,800	1,564.00	9,071,200	
広島ガス	22,100	374.00	8,265,400	
西部ガスホールディングス	12,100	2,494.00	30,177,400	
静岡ガス	30,500	1,014.00	30,927,000	
メタウォーター	12,100	2,089.00	25,276,900	
SBSホールディングス	7,900	3,395.00	26,820,500	

東武鉄道	111,900	3,105.00	347,449,500
相鉄ホールディングス	36,800	2,292.00	84,345,600
東急	270,900	1,628.00	441,025,200
京浜急行電鉄	137,900	1,526.00	210,435,400
小田急電鉄	172,000	2,953.00	507,916,000
京王電鉄	60,000	7,160.00	429,600,000
京成電鉄	80,500	3,710.00	298,655,000
富士急行	14,600	5,460.00	79,716,000
新京成電鉄	2,800	2,158.00	6,042,400
東日本旅客鉄道	189,000	8,515.00	1,609,335,000
西日本旅客鉄道	95,700	6,947.00	664,827,900
東海旅客鉄道	89,300	18,255.00	1,630,171,500
西武ホールディングス	129,400	1,435.00	185,689,000
鴻池運輸	17,100	1,130.00	19,323,000
西日本鉄道	29,800	2,892.00	86,181,600
ハマキョウレックス	8,200	3,075.00	25,215,000
サカイ引越センター	4,900	5,730.00	28,077,000
近鉄グループホールディングス	101,700	4,215.00	428,665,500
阪急阪神ホールディングス	135,700	3,685.00	500,054,500
南海電気鉄道	48,200	2,502.00	120,596,400
京阪ホールディングス	45,300	3,645.00	165,118,500
神戸電鉄	2,400	3,510.00	8,424,000
名古屋鉄道	83,600	2,271.00	189,855,600
山陽電気鉄道	7,300	1,965.00	14,344,500
アルプス物流	7,100	1,008.00	7,156,800
日本通運	35,200	8,800.00	309,760,000
ヤマトホールディングス	142,500	2,987.00	425,647,500
山九	26,100	4,905.00	128,020,500
丸運	5,800	267.00	1,548,600
丸全昭和運輸	8,200	3,370.00	27,634,000
センコーグループホールディングス	56,100	1,038.00	58,231,800
トナミホールディングス	2,400	5,040.00	12,096,000
ニッコンホールディングス	34,100	2,388.00	81,430,800
日本石油輸送	1,100	2,593.00	2,852,300
福山通運	13,000	4,015.00	52,195,000
セイノーホールディングス	76,200	1,488.00	113,385,600
エスライン	2,800	897.00	2,511,600
神奈川中央交通	2,500	3,675.00	9,187,500
日立物流	22,400	3,740.00	83,776,000
丸和運輸機関	21,500	1,568.00	33,712,000
C & F ロジホールディングス	10,300	1,645.00	16,943,500
九州旅客鉄道	78,700	2,758.00	217,054,600



S Gホールディングス	192,200	2,626.00	504,717,200
日本郵船	85,300	5,110.00	435,883,000
商船三井	60,500	4,845.00	293,122,500
川崎汽船	31,300	3,350.00	104,855,000
N Sユナイテッド海運	5,200	2,262.00	11,762,400
飯野海運	49,300	452.00	22,283,600
共栄タンカー	2,900	865.00	2,508,500
乾汽船	7,000	1,217.00	8,519,000
日本航空	247,800	2,707.00	670,794,600
A N Aホールディングス	274,500	2,894.00	794,403,000
パスコ	2,000	1,553.00	3,106,000
ランコム	3,100	8,260.00	25,606,000
日新	8,100	1,527.00	12,368,700
三菱倉庫	35,200	3,445.00	121,264,000
三井倉庫ホールディングス	10,800	2,399.00	25,909,200
住友倉庫	35,900	1,516.00	54,424,400
澁澤倉庫	5,600	2,129.00	11,922,400
東陽倉庫	17,000	324.00	5,508,000
日本トランスシティ	22,400	532.00	11,916,800
ケイヒン	2,000	1,372.00	2,744,000
中央倉庫	6,200	1,066.00	6,609,200
川西倉庫	1,900	1,148.00	2,181,200
安田倉庫	8,400	950.00	7,980,000
ファイズホールディングス	1,800	830.00	1,494,000
東洋埠頭	3,100	1,537.00	4,764,700
宇徳	7,200	516.00	3,715,200
上組	55,900	2,207.00	123,371,300
サンリツ	2,600	738.00	1,918,800
キムラユニティー	2,700	1,317.00	3,555,900
キューソー流通システム	2,500	1,704.00	4,260,000
近鉄エクスプレス	19,200	2,361.00	45,331,200
東海運	5,800	311.00	1,803,800
エーアイティー	6,400	993.00	6,355,200
内外トランスライン	3,600	1,909.00	6,872,400
日本コンセプト	3,200	1,656.00	5,299,200
N E C ネットエスアイ	35,000	1,756.00	61,460,000
クロスキャット	3,000	1,011.00	3,033,000
システナ	37,700	1,901.00	71,667,700
デジタルアーツ	6,200	8,770.00	54,374,000
日鉄ソリューションズ	15,300	3,385.00	51,790,500
キューブシステム	5,800	1,034.00	5,997,200
エイジア	1,700	2,119.00	3,602,300

コア	4,600	1,445.00	6,647,000
ラクーンホールディングス	7,500	2,635.00	19,762,500
ソリトンシステムズ	5,400	1,660.00	8,964,000
ソフトクリエイティブホールディングス	4,200	2,266.00	9,517,200
T I S	105,500	2,774.00	292,657,000
J N Sホールディングス	5,200	575.00	2,990,000
電算システム	4,000	2,957.00	11,828,000
グリー	65,000	574.00	37,310,000
G M Oペパボ	1,000	4,945.00	4,945,000
コーエーテクモホールディングス	28,100	5,110.00	143,591,000
三菱総合研究所	4,600	3,835.00	17,641,000
電算	1,300	2,450.00	3,185,000
A G S	5,600	872.00	4,883,200
ファインデックス	9,100	1,027.00	9,345,700
ブレインパッド	2,800	4,935.00	13,818,000
K L a b	19,300	711.00	13,722,300
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	14,200	1,134.00	16,102,800
イーブックイニシアティブジャパン	1,800	3,135.00	5,643,000
ネクソン	266,800	2,535.00	676,338,000
アイスタイル	32,600	557.00	18,158,200
エムアップホールディングス	2,800	2,772.00	7,761,600
エイチーム	7,400	1,737.00	12,853,800
エニグモ	10,100	1,408.00	14,220,800
テクノスジャパン	8,600	609.00	5,237,400
コロプラ	34,900	846.00	29,525,400
ブロードリーフ	52,700	522.00	27,509,400
クロス・マーケティンググループ	5,100	701.00	3,575,100
デジタルハーツホールディングス	4,900	1,532.00	7,506,800
システム情報	8,100	975.00	7,897,500
メディアドゥ	4,100	4,955.00	20,315,500
じげん	26,700	415.00	11,080,500
ブイキューブ	5,800	2,683.00	15,561,400
エンカレッジ・テクノロジー	2,200	675.00	1,485,000
サイバーリンクス	3,600	1,659.00	5,972,400
フィックスターズ	11,500	895.00	10,292,500
C A R T A H O L D I N G S	4,400	1,722.00	7,576,800
オブティム	7,400	2,309.00	17,086,600
セレス	3,500	3,485.00	12,197,500
S H I F T	5,300	15,740.00	83,422,000
ティーガイア	11,300	1,957.00	22,114,100
セック	1,600	2,630.00	4,208,000
日本アジアグループ	10,200	912.00	9,302,400

テクマトリックス	16,500	1,634.00	26,961,000
プロシップ	3,300	1,347.00	4,445,100
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25,500	2,280.00	58,140,000
GMOペイメントゲートウェイ	20,200	13,760.00	277,952,000
ザッパラス	4,500	584.00	2,628,000
システムリサーチ	3,200	2,099.00	6,716,800
インターネットイニシアティブ	28,100	3,100.00	87,110,000
さくらインターネット	11,700	630.00	7,371,000
ヴィンクス	3,200	988.00	3,161,600
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,400	5,190.00	12,456,000
SRAホールディングス	5,700	2,778.00	15,834,600
システムインテグレータ	3,300	644.00	2,125,200
朝日ネット	8,900	711.00	6,327,900
eBASE	12,900	859.00	11,081,100
アバント	11,400	1,574.00	17,943,600
アドソル日進	3,800	2,409.00	9,154,200
ODKソリューションズ	2,500	846.00	2,115,000
フリービット	6,500	946.00	6,149,000
コムチュア	9,800	2,356.00	23,088,800
サイバーコム	2,000	1,537.00	3,074,000
アステリア	7,900	833.00	6,580,700
アイル	6,000	1,521.00	9,126,000
マークライنز	4,500	3,170.00	14,265,000
メディカル・データ・ビジョン	12,100	2,179.00	26,365,900
gumi	14,800	1,059.00	15,673,200
ショーケース	2,600	775.00	2,015,000
モバイルファクトリー	2,500	1,281.00	3,202,500
テラスカイ	3,500	2,676.00	9,366,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,800	2,079.00	9,979,200
PCIホールディングス	4,200	1,241.00	5,212,200
パイプドHD	2,300	1,696.00	3,900,800
アイビーシー	2,000	1,011.00	2,022,000
ネオジャパン	2,100	1,699.00	3,567,900
PR TIMES	2,300	3,525.00	8,107,500
ラクス	31,800	2,194.00	69,769,200
ランドコンピュータ	1,800	1,099.00	1,978,200
ダブルスタンダード	1,400	5,060.00	7,084,000
オープンドア	6,300	2,672.00	16,833,600
マイネット	3,400	782.00	2,658,800
アカツキ	4,300	3,700.00	15,910,000
ベネフィットジャパン	900	2,030.00	1,827,000
Ubicomホールディングス	2,800	3,295.00	9,226,000

カナミックネットワーク	11,600	659.00	7,644,400
ノムラシステムコーポレーション	5,400	295.00	1,593,000
チェンジ	19,400	2,848.00	55,251,200
シンクロ・フード	6,900	428.00	2,953,200
オークネット	5,700	1,394.00	7,945,800
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	1,090.00	2,507,000
セグエグループ	2,900	1,135.00	3,291,500
エイトレッド	2,100	2,243.00	4,710,300
AOI TYO Holdings	10,900	899.00	9,799,100
マクロミル	21,800	839.00	18,290,200
ビーグリー	2,200	1,406.00	3,093,200
オロ	3,400	3,505.00	11,917,000
ユーザーローカル	1,600	4,130.00	6,608,000
テモナ	2,500	1,140.00	2,850,000
ニーズウェル	2,500	613.00	1,532,500
サインポスト	2,500	877.00	2,192,500
ソルクシーズ	4,300	1,040.00	4,472,000
フェイス	3,500	839.00	2,936,500
プロトコーポレーション	12,800	1,182.00	15,129,600
ハイマックス	3,200	1,067.00	3,414,400
野村総合研究所	183,100	3,450.00	631,695,000
サイバネットシステム	7,800	823.00	6,419,400
CEホールディングス	6,000	532.00	3,192,000
日本システム技術	2,000	1,543.00	3,086,000
インテージホールディングス	13,300	1,536.00	20,428,800
東邦システムサイエンス	3,000	920.00	2,760,000
ソースネクスト	50,800	323.00	16,408,400
インフォコム	9,700	3,085.00	29,924,500
HEROZ	3,100	2,496.00	7,737,600
ラクスル	11,500	4,805.00	55,257,500
I P S	2,600	2,779.00	7,225,400
F I G	12,300	291.00	3,579,300
システムサポート	3,300	1,417.00	4,676,100
イーソル	5,900	1,109.00	6,543,100
アルテリア・ネットワークス	11,800	1,657.00	19,552,600
E d u L a b	1,000	5,490.00	5,490,000
東海ソフト	1,800	1,411.00	2,539,800
ウイングアーク1st	5,600	2,398.00	13,428,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,500	2,198.00	5,495,000
サーバーワークス	1,100	3,860.00	4,246,000
東名	1,200	1,064.00	1,276,800
ヴィッツ	1,100	2,083.00	2,291,300

トピラシステムズ	1,600	1,340.00	2,144,000	
Sansan	9,400	8,780.00	82,532,000	
Link-U	2,100	1,197.00	2,513,700	
ギフトィ	6,400	3,240.00	20,736,000	
ベース	1,200	5,270.00	6,324,000	
フォーカスシステムズ	7,300	902.00	6,584,600	
クレスコ	7,000	1,716.00	12,012,000	
フジ・メディア・ホールディングス	109,500	1,264.00	138,408,000	
オービック	33,200	20,110.00	667,652,000	
ジャストシステム	15,000	5,980.00	89,700,000	
TDCソフト	9,400	1,011.00	9,503,400	
Zホールディングス	1,448,200	499.80	723,810,360	
トレンドマイクロ	56,300	5,590.00	314,717,000	
IDホールディングス	4,200	1,358.00	5,703,600	
日本オラクル	21,400	9,800.00	209,720,000	
アルファシステムズ	2,900	3,655.00	10,599,500	
フューチャー	12,800	2,084.00	26,675,200	
CAC Holdings	7,000	1,462.00	10,234,000	
SBテクノロジー	3,900	3,005.00	11,719,500	
トーセ	3,100	812.00	2,517,200	
オービックビジネスコンサルタント	10,700	6,330.00	67,731,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	48,100	3,315.00	159,451,500	
アイティフォー	14,100	781.00	11,012,100	
東計電算	1,600	4,805.00	7,688,000	
エクスネット	1,900	1,021.00	1,939,900	
大塚商会	57,100	6,060.00	346,026,000	
サイボウズ	12,400	2,521.00	31,260,400	
電通国際情報サービス	13,100	3,860.00	50,566,000	
ACCESS	13,400	875.00	11,725,000	
デジタルガレージ	17,500	4,710.00	82,425,000	
EMシステムズ	17,700	908.00	16,071,600	
ウェザーニューズ	3,200	5,760.00	18,432,000	
CIJ	7,500	854.00	6,405,000	
ビジネスエンジニアリング	1,100	3,210.00	3,531,000	
日本エンタープライズ	11,800	218.00	2,572,400	
WOWOW	5,200	2,422.00	12,594,400	
スカラ	9,700	830.00	8,051,000	
インテリジェント ウェイブ	6,500	658.00	4,277,000	
IMAGICA GROUP	9,400	488.00	4,587,200	
ネットワンシステムズ	43,100	3,390.00	146,109,000	
システムソフト	23,300	156.00	3,634,800	
アルゴグラフィックス	8,300	3,165.00	26,269,500	

マーベラス	16,900	793.00	13,401,700
エイベックス	18,300	1,506.00	27,559,800
日本ユニシス	36,600	3,165.00	115,839,000
兼松エレクトロニクス	5,800	3,580.00	20,764,000
都築電気	4,800	1,825.00	8,760,000
TBSホールディングス	70,000	1,812.00	126,840,000
日本テレビホールディングス	88,100	1,332.00	117,349,200
朝日放送グループホールディングス	10,800	717.00	7,743,600
テレビ朝日ホールディングス	32,700	1,876.00	61,345,200
スカパーJSATホールディングス	69,900	425.00	29,707,500
テレビ東京ホールディングス	7,700	2,179.00	16,778,300
日本BS放送	3,800	1,114.00	4,233,200
ビジョン	13,300	1,284.00	17,077,200
スマートバリュー	3,000	796.00	2,388,000
ワイヤレスゲート	4,900	455.00	2,229,500
コネクシオ	6,100	1,494.00	9,113,400
クロップス	2,200	873.00	1,920,600
日本電信電話	1,232,700	2,874.50	3,543,396,150
KDDI	845,200	3,632.00	3,069,766,400
ソフトバンク	957,900	1,409.00	1,349,681,100
光通信	12,400	20,820.00	258,168,000
エムティーアイ	10,500	679.00	7,129,500
GMOインターネット	37,400	3,105.00	116,127,000
ファイバーゲート	3,600	1,504.00	5,414,400
アйдママーケティングコミュニケーション	3,300	434.00	1,432,200
KADOKAWA	27,300	4,675.00	127,627,500
学研ホールディングス	15,100	1,382.00	20,868,200
ゼンリン	19,300	1,164.00	22,465,200
昭文社ホールディングス	4,700	482.00	2,265,400
インプレスホールディングス	8,700	208.00	1,809,600
アイネット	5,600	1,430.00	8,008,000
松竹	7,000	13,240.00	92,680,000
東宝	62,200	4,660.00	289,852,000
東映	3,500	21,480.00	75,180,000
エヌ・ティ・ティ・データ	280,700	1,713.00	480,839,100
ピー・シー・エー	1,600	4,160.00	6,656,000
ビジネスブレイン太田昭和	3,700	1,763.00	6,523,100
DTS	22,000	2,637.00	58,014,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	45,000	5,870.00	264,150,000
シーイーシー	11,500	1,522.00	17,503,000
カブコン	90,400	3,325.00	300,580,000
アイ・エス・ビー	5,000	1,426.00	7,130,000

ジャステック	6,900	1,293.00	8,921,700
S C S K	24,400	6,250.00	152,500,000
日本システムウエア	3,600	2,297.00	8,269,200
アイネス	10,500	1,350.00	14,175,000
T K C	17,900	3,335.00	59,696,500
富士ソフト	11,300	5,580.00	63,054,000
N S D	34,000	1,799.00	61,166,000
コナミホールディングス	38,300	7,230.00	276,909,000
福井コンピュータホールディングス	4,900	4,225.00	20,702,500
J B C Cホールディングス	7,300	1,332.00	9,723,600
ミロク情報サービス	10,600	1,622.00	17,193,200
ソフトバンクグループ	836,200	8,022.00	6,707,996,400
ハウスイ	900	958.00	862,200
高千穂交易	4,100	1,132.00	4,641,200
オルパヘルスケアホールディングス	1,700	1,734.00	2,947,800
伊藤忠食品	2,600	5,230.00	13,598,000
エレマテック	8,500	1,233.00	10,480,500
J A L U X	3,000	1,907.00	5,721,000
あらた	8,400	4,130.00	34,692,000
トーメンデバイス	1,400	3,960.00	5,544,000
東京エレクトロン デバイス	3,500	5,660.00	19,810,000
フィールズ	9,300	483.00	4,491,900
双日	584,200	346.00	202,133,200
アルフレッサ ホールディングス	109,700	1,698.00	186,270,600
横浜冷凍	29,700	890.00	26,433,000
ラサ商事	5,600	914.00	5,118,400
アルコニックス	11,300	1,496.00	16,904,800
神戸物産	73,000	2,848.00	207,904,000
ハイパー	2,200	547.00	1,203,400
あい ホールディングス	15,100	2,167.00	32,721,700
ディーブイエックス	3,300	987.00	3,257,100
ダイワボウホールディングス	48,200	1,744.00	84,060,800
マクニカ・富士エレホールディングス	25,200	2,446.00	61,639,200
ラクト・ジャパン	4,600	2,837.00	13,050,200
グリムス	3,100	1,762.00	5,462,200
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,400	716.00	13,174,400
八洲電機	8,200	984.00	8,068,800
メディアスホールディングス	6,000	1,035.00	6,210,000
レスターホールディングス	11,000	1,881.00	20,691,000
ジュテックホールディングス	2,400	1,014.00	2,433,600
大光	4,100	686.00	2,812,600
O C H Iホールディングス	3,100	1,286.00	3,986,600

TO K A Iホールディングス	51,300	886.00	45,451,800
黒谷	2,900	951.00	2,757,900
C o m i n i x	1,900	754.00	1,432,600
三洋貿易	10,700	1,304.00	13,952,800
ビューティガレージ	1,700	3,685.00	6,264,500
ウイン・パートナーズ	7,700	979.00	7,538,300
ミタチ産業	2,900	659.00	1,911,100
シップヘルスケアホールディングス	37,300	2,582.00	96,308,600
明治電機工業	3,600	1,339.00	4,820,400
デリカフーズホールディングス	4,100	635.00	2,603,500
スターティアホールディングス	2,100	1,372.00	2,881,200
コメダホールディングス	23,100	2,063.00	47,655,300
ピーバンドットコム	1,500	805.00	1,207,500
アセンテック	2,700	1,408.00	3,801,600
富士興産	3,200	1,221.00	3,907,200
協栄産業	1,200	1,394.00	1,672,800
小野建	9,500	1,319.00	12,530,500
南陽	2,200	1,914.00	4,210,800
佐島電機	6,600	777.00	5,128,200
エコートレーディング	2,300	623.00	1,432,900
伯東	6,500	1,539.00	10,003,500
コンドーテック	8,200	1,005.00	8,241,000
中山福	6,100	487.00	2,970,700
ナガイレーベン	14,000	2,590.00	36,260,000
三菱食品	11,600	2,931.00	33,999,600
松田産業	7,700	2,194.00	16,893,800
第一興商	21,000	4,475.00	93,975,000
メディバルホールディングス	106,000	2,182.00	231,292,000
S P K	4,600	1,350.00	6,210,000
萩原電気ホールディングス	3,900	2,441.00	9,519,900
アズワン	7,600	12,870.00	97,812,000
スズデン	3,700	1,470.00	5,439,000
尾家産業	3,100	1,252.00	3,881,200
シモジマ	6,500	1,105.00	7,182,500
ドウシシャ	10,000	1,694.00	16,940,000
小津産業	2,300	1,932.00	4,443,600
高速	5,600	1,461.00	8,181,600
たけびし	3,700	1,559.00	5,768,300
リックス	2,400	1,548.00	3,715,200
丸文	9,400	634.00	5,959,600
ハピネット	8,800	1,460.00	12,848,000
橋本総業ホールディングス	2,100	2,754.00	5,783,400



日本ライフライン	34,200	1,408.00	48,153,600
タカショー	6,900	820.00	5,658,000
マルカ	3,400	2,412.00	8,200,800
I D O M	35,700	635.00	22,669,500
進和	6,300	2,140.00	13,482,000
エスケイジャパン	2,600	452.00	1,175,200
ダイترون	4,500	2,050.00	9,225,000
シークス	13,500	1,603.00	21,640,500
田中商事	3,300	710.00	2,343,000
オーハシテクニカ	5,400	1,498.00	8,089,200
白銅	3,800	1,888.00	7,174,400
ダイコー通産	1,300	1,488.00	1,934,400
伊藤忠商事	739,800	3,363.00	2,487,947,400
丸紅	1,043,100	1,004.00	1,047,272,400
高島	1,700	1,756.00	2,985,200
長瀬産業	58,100	1,632.00	94,819,200
蝶理	6,800	1,717.00	11,675,600
豊田通商	106,300	5,200.00	552,760,000
三共生興	16,100	538.00	8,661,800
兼松	42,300	1,505.00	63,661,500
ツカモトコーポレーション	1,800	1,400.00	2,520,000
三井物産	843,800	2,552.00	2,153,377,600
日本紙パルプ商事	5,500	3,605.00	19,827,500
カメイ	13,800	1,156.00	15,952,800
東都水産	1,200	4,590.00	5,508,000
O U Gホールディングス	1,700	2,853.00	4,850,100
スターゼン	7,800	2,135.00	16,653,000
山善	41,300	971.00	40,102,300
椿本興業	2,000	3,415.00	6,830,000
住友商事	667,500	1,527.50	1,019,606,250
内田洋行	4,500	4,840.00	21,780,000
三菱商事	644,000	3,072.00	1,978,368,000
第一実業	4,800	4,250.00	20,400,000
キャノンマーケティングジャパン	26,200	2,643.00	69,246,600
西華産業	5,600	1,802.00	10,091,200
佐藤商事	8,700	1,122.00	9,761,400
菱洋エレクトロ	8,100	2,626.00	21,270,600
東京産業	9,600	617.00	5,923,200
ユアサ商事	10,800	3,060.00	33,048,000
神鋼商事	2,400	2,472.00	5,932,800
トルク	6,400	244.00	1,561,600
阪和興業	21,200	3,295.00	69,854,000

正栄食品工業	6,800	4,135.00	28,118,000
カナデン	8,600	1,078.00	9,270,800
菱電商事	7,600	1,621.00	12,319,600
フルサト工業	5,400	1,869.00	10,092,600
岩谷産業	25,400	6,180.00	156,972,000
ナイス	4,200	1,983.00	8,328,600
ニチモウ	1,700	2,130.00	3,621,000
極東貿易	3,000	2,357.00	7,071,000
アステナホールディングス	15,200	674.00	10,244,800
三愛石油	26,100	1,195.00	31,189,500
稲畑産業	25,400	1,710.00	43,434,000
G S I クレオス	5,200	1,005.00	5,226,000
明和産業	9,800	475.00	4,655,000
クワザワホールディングス	3,800	619.00	2,352,200
ヤマエ久野	7,700	1,135.00	8,739,500
ワキタ	20,800	1,119.00	23,275,200
東邦ホールディングス	33,900	1,732.00	58,714,800
サンゲツ	28,600	1,565.00	44,759,000
ミツウロコグループホールディングス	15,600	1,235.00	19,266,000
シナネンホールディングス	3,900	2,882.00	11,239,800
伊藤忠エネクス	23,400	1,019.00	23,844,600
サンリオ	29,700	1,925.00	57,172,500
サンワテクノス	7,000	1,217.00	8,519,000
リョーサン	11,700	2,016.00	23,587,200
新光商事	14,300	769.00	10,996,700
トーホー	4,800	1,696.00	8,140,800
三信電気	5,700	2,135.00	12,169,500
東陽テクニカ	10,500	1,106.00	11,613,000
モスフードサービス	15,000	3,090.00	46,350,000
加賀電子	9,600	3,015.00	28,944,000
ソーダニッカ	10,100	574.00	5,797,400
立花エレテック	7,800	1,502.00	11,715,600
フォーバル	3,700	821.00	3,037,700
P A L T A C	17,000	5,850.00	99,450,000
三谷産業	14,000	391.00	5,474,000
西本Wismettacホールディングス	2,400	2,890.00	6,936,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,895.00	1,705,500
コア商事ホールディングス	8,000	725.00	5,800,000
国際紙パルプ商事	22,600	252.00	5,695,200
ヤマタネ	4,600	1,508.00	6,936,800
丸紅建材リース	1,000	1,817.00	1,817,000
日鉄物産	7,500	4,485.00	33,637,500

泉州電業	3,000	3,580.00	10,740,000
トラスコ中山	24,200	2,877.00	69,623,400
オートバックスセブン	39,300	1,492.00	58,635,600
モリト	7,700	613.00	4,720,100
加藤産業	15,300	3,305.00	50,566,500
北恵	2,700	988.00	2,667,600
イノテック	6,000	1,357.00	8,142,000
イエローハット	20,000	1,928.00	38,560,000
J Kホールディングス	9,600	787.00	7,555,200
日伝	8,800	2,126.00	18,708,800
北沢産業	7,300	250.00	1,825,000
杉本商事	5,300	2,204.00	11,681,200
因幡電機産業	28,200	2,562.00	72,248,400
東テク	3,500	2,696.00	9,436,000
ミスミグループ本社	132,700	3,510.00	465,777,000
アルテック	7,800	336.00	2,620,800
タキヒヨー	3,500	1,862.00	6,517,000
蔵王産業	2,100	1,461.00	3,068,100
スズケン	44,800	3,480.00	155,904,000
ジェコス	7,300	886.00	6,467,800
グローセル	11,500	427.00	4,910,500
ローソン	26,800	4,960.00	132,928,000
サンエー	8,100	4,300.00	34,830,000
カワチ薬品	7,500	2,283.00	17,122,500
エービーシー・マート	16,600	6,460.00	107,236,000
ハードオフコーポレーション	5,000	787.00	3,935,000
アスクル	17,200	1,869.00	32,146,800
ゲオホールディングス	14,400	1,211.00	17,438,400
アダストリア	14,800	2,040.00	30,192,000
くら寿司	12,500	3,900.00	48,750,000
キャンドゥ	5,200	1,963.00	10,207,600
アイケイ	3,400	786.00	2,672,400
パルグループホールディングス	9,400	1,718.00	16,149,200
エディオン	45,000	1,066.00	47,970,000
サーラコーポレーション	21,900	600.00	13,140,000
ワッツ	5,400	937.00	5,059,800
ハローズ	4,300	2,720.00	11,696,000
フジオフードグループ本社	8,900	1,383.00	12,308,700
あみやき亭	2,400	2,979.00	7,149,600
大黒天物産	3,400	7,800.00	26,520,000
ハニーズホールディングス	8,600	1,039.00	8,935,400
ファーマライズホールディングス	2,900	780.00	2,262,000

アルペン	8,200	2,873.00	23,558,600
ハブ	3,700	798.00	2,952,600
クオールホールディングス	14,400	1,512.00	21,772,800
ジーンズホールディングス	7,200	7,930.00	57,096,000
ビックカメラ	63,000	1,123.00	70,749,000
D C Mホールディングス	65,500	1,054.00	69,037,000
M o n o t a R O	150,500	2,625.00	395,062,500
東京一番フーズ	3,100	595.00	1,844,500
きちりホールディングス	2,800	616.00	1,724,800
アークランドサービスホールディングス	8,900	2,317.00	20,621,300
J . フロント リテイリング	126,500	1,163.00	147,119,500
ドトール・日レスホールディングス	16,900	1,735.00	29,321,500
マツモトキヨシホールディングス	43,800	4,960.00	217,248,000
ブロンコビリー	5,600	2,540.00	14,224,000
Z O Z O	62,400	3,745.00	233,688,000
トレジャー・ファクトリー	3,300	1,010.00	3,333,000
物語コーポレーション	5,700	7,290.00	41,553,000
ココカラファイン	9,500	8,330.00	79,135,000
三越伊勢丹ホールディングス	185,400	866.00	160,556,400
H a m e e	2,900	1,633.00	4,735,700
マーケットエンタープライズ	900	1,197.00	1,077,300
ウエルシアホールディングス	56,000	3,430.00	192,080,000
クリエイティブSDホールディングス	15,700	3,245.00	50,946,500
丸善C H Iホールディングス	12,300	401.00	4,932,300
ミサワ	2,500	678.00	1,695,000
ティーライフ	1,600	1,450.00	2,320,000
チムニー	3,200	1,413.00	4,521,600
シュッピン	7,500	1,037.00	7,777,500
オイシックス・ラ・大地	14,000	3,480.00	48,720,000
ネクステージ	18,800	1,651.00	31,038,800
ジョイフル本田	31,200	1,377.00	42,962,400
鳥貴族ホールディングス	4,000	1,959.00	7,836,000
ホットランド	8,100	1,422.00	11,518,200
すかいらーくホールディングス	134,900	1,605.00	216,514,500
S F Pホールディングス	5,200	1,540.00	8,008,000
綿半ホールディングス	8,100	1,247.00	10,100,700
ヨシックス	2,200	2,460.00	5,412,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	31,000	1,096.00	33,976,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,700	1,366.00	7,786,200
B E E N O S	5,400	3,725.00	20,115,000
あさひ	8,000	1,435.00	11,480,000
日本調剤	6,600	1,614.00	10,652,400

コスモス薬品	10,700	15,390.00	164,673,000
トーエル	5,400	819.00	4,422,600
オンリー	2,300	502.00	1,154,600
セブン&アイ・ホールディングス	413,800	4,857.00	2,009,826,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	56,800	934.00	53,051,200
ツルハホールディングス	23,100	13,600.00	314,160,000
サンマルクホールディングス	8,500	1,701.00	14,458,500
フェリシモ	2,500	1,392.00	3,480,000
トリドールホールディングス	26,300	1,871.00	49,207,300
TOKYO BASE	9,900	788.00	7,801,200
ウイルプラスホールディングス	1,800	1,262.00	2,271,600
JMホールディングス	7,200	2,214.00	15,940,800
サツドラホールディングス	1,700	2,092.00	3,556,400
アレンザホールディングス	8,200	1,278.00	10,479,600
串カツ田中ホールディングス	2,900	1,977.00	5,733,300
パロックジャパンリミテッド	7,700	808.00	6,221,600
クスリのアオキホールディングス	10,500	8,170.00	85,785,000
力の源ホールディングス	4,800	676.00	3,244,800
FOOD & LIFE COMPANIES	62,000	4,810.00	298,220,000
メディカルシステムネットワーク	9,500	735.00	6,982,500
はるやまホールディングス	5,300	671.00	3,556,300
ノジマ	18,900	2,996.00	56,624,400
カップ・クリエイト	14,800	1,507.00	22,303,600
ライトオン	7,900	699.00	5,522,100
良品計画	121,800	2,110.00	256,998,000
三城ホールディングス	14,000	274.00	3,836,000
アドヴァン	11,000	958.00	10,538,000
アルピス	3,500	2,286.00	8,001,000
コナカ	12,500	369.00	4,612,500
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,635.00	2,289,000
G-7ホールディングス	5,200	2,835.00	14,742,000
イオン北海道	14,100	1,043.00	14,706,300
コジマ	18,500	760.00	14,060,000
ヒマラヤ	3,900	1,020.00	3,978,000
コーナン商事	15,100	3,810.00	57,531,000
エコス	4,000	1,912.00	7,648,000
ワタミ	13,900	1,040.00	14,456,000
マルシェ	2,800	525.00	1,470,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	211,500	2,322.00	491,103,000
西松屋チェーン	23,400	1,500.00	35,100,000

ゼンショーホールディングス	56,900	2,806.00	159,661,400
幸楽苑ホールディングス	6,700	1,684.00	11,282,800
ハークスレイ	2,500	1,027.00	2,567,500
サイゼリヤ	15,800	2,707.00	42,770,600
V Tホールディングス	40,300	479.00	19,303,700
魚力	3,400	1,957.00	6,653,800
フジ・コーポレーション	5,800	1,268.00	7,354,400
ユナイテッドアローズ	12,200	2,317.00	28,267,400
ハイデイ日高	15,400	1,860.00	28,644,000
京都きもの友禅	7,700	284.00	2,186,800
コロワイド	35,100	2,056.00	72,165,600
ピーシーデポコーポレーション	12,800	456.00	5,836,800
鳧番屋	7,500	4,900.00	36,750,000
P L A N T	3,000	719.00	2,157,000
スギホールディングス	21,100	8,750.00	184,625,000
薬王堂ホールディングス	4,700	2,376.00	11,167,200
スクロール	15,400	855.00	13,167,000
ヨンドシーホールディングス	9,900	1,930.00	19,107,000
木曽路	13,900	2,423.00	33,679,700
S R Sホールディングス	13,900	839.00	11,662,100
リテールパートナーズ	13,100	1,166.00	15,274,600
ケーヨー	19,700	753.00	14,834,100
上新電機	12,200	2,761.00	33,684,200
日本瓦斯	52,400	1,774.00	92,957,600
ロイヤルホールディングス	18,500	2,353.00	43,530,500
いなげや	11,900	1,474.00	17,540,600
チヨダ	11,300	920.00	10,396,000
ライフコーポレーション	10,700	3,400.00	36,380,000
リンガーハット	13,000	2,372.00	30,836,000
M r M a x H D	14,900	650.00	9,685,000
A O K Iホールディングス	21,500	747.00	16,060,500
オークワ	16,700	1,126.00	18,804,200
コメリ	16,400	2,601.00	42,656,400
青山商事	23,800	855.00	20,349,000
しまむら	12,300	9,740.00	119,802,000
はせがわ	6,400	297.00	1,900,800
高島屋	77,100	1,338.00	103,159,800
松屋	23,200	989.00	22,944,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	50,200	977.00	49,045,400
近鉄百貨店	4,100	3,225.00	13,222,500
丸井グループ	89,500	2,254.00	201,733,000
アクシアル リテイリング	8,800	3,875.00	34,100,000

イオン	407,000	2,963.00	1,205,941,000
イズミ	21,500	4,230.00	90,945,000
平和堂	19,600	2,307.00	45,217,200
フジ	12,800	2,000.00	25,600,000
ヤオコー	12,000	6,450.00	77,400,000
ゼビオホールディングス	13,000	1,009.00	13,117,000
ケーズホールディングス	90,200	1,305.00	117,711,000
Olympicグループ	5,800	794.00	4,605,200
日産東京販売ホールディングス	16,500	242.00	3,993,000
シルバーライフ	2,200	2,420.00	5,324,000
Genky DrugStores	4,700	3,660.00	17,202,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,200	1,193.00	2,624,600
ブックオフグループホールディングス	6,200	940.00	5,828,000
ギフト	1,400	2,346.00	3,284,400
アインホールディングス	15,400	6,990.00	107,646,000
元気寿司	3,100	2,781.00	8,621,100
ヤマダホールディングス	355,000	515.00	182,825,000
アークランドサカモト	16,700	1,511.00	25,233,700
ニトリホールディングス	42,000	18,400.00	772,800,000
グルメ杵屋	7,800	985.00	7,683,000
愛眼	8,400	230.00	1,932,000
ケーユーホールディングス	5,800	968.00	5,614,400
吉野家ホールディングス	34,900	2,101.00	73,324,900
松屋フーズホールディングス	5,200	3,575.00	18,590,000
サガミホールディングス	15,200	1,055.00	16,036,000
関西スーパーマーケット	8,200	1,006.00	8,249,200
王将フードサービス	7,000	5,630.00	39,410,000
プレナス	12,000	2,038.00	24,456,000
ミニストップ	7,900	1,416.00	11,186,400
アークス	20,300	2,415.00	49,024,500
パローホールディングス	21,700	2,273.00	49,324,100
ベルク	5,300	5,650.00	29,945,000
大庄	5,900	1,150.00	6,785,000
ファーストリテイリング	14,100	83,280.00	1,174,248,000
サンドラッグ	39,900	3,555.00	141,844,500
サクスパー ホールディングス	9,400	655.00	6,157,000
ヤマザワ	2,600	1,717.00	4,464,200
やまや	2,200	2,328.00	5,121,600
ベルーナ	22,900	1,100.00	25,190,000
島根銀行	3,600	652.00	2,347,200
じもとホールディングス	7,200	654.00	4,708,800
めぶきフィナンシャルグループ	550,400	232.00	127,692,800

東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,300	1,442.00	19,178,600
九州フィナンシャルグループ	216,300	405.00	87,601,500
ゆうちょ銀行	300,100	930.00	279,093,000
富山第一銀行	25,200	276.00	6,955,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	645,300	409.00	263,927,700
西日本フィナンシャルホールディングス	69,200	665.00	46,018,000
三十三フィナンシャルグループ	9,200	1,350.00	12,420,000
第四北越フィナンシャルグループ	17,200	2,376.00	40,867,200
ひろぎんホールディングス	156,200	578.00	90,283,600
新生銀行	86,400	1,596.00	137,894,400
あおぞら銀行	63,100	2,498.00	157,623,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,245,700	622.30	4,508,999,110
りそなホールディングス	1,222,400	452.60	553,258,240
三井住友トラスト・ホールディングス	200,200	3,684.00	737,536,800
三井住友フィナンシャルグループ	733,000	3,951.00	2,896,083,000
千葉銀行	353,500	691.00	244,268,500
群馬銀行	218,000	355.00	77,390,000
武蔵野銀行	15,800	1,695.00	26,781,000
千葉興業銀行	27,000	265.00	7,155,000
筑波銀行	44,000	170.00	7,480,000
七十七銀行	33,200	1,296.00	43,027,200
青森銀行	8,200	2,129.00	17,457,800
秋田銀行	6,300	1,403.00	8,838,900
山形銀行	11,900	884.00	10,519,600
岩手銀行	6,900	1,772.00	12,226,800
東邦銀行	94,700	206.00	19,508,200
東北銀行	5,100	1,022.00	5,212,200
みちのく銀行	6,800	974.00	6,623,200
ふくおかフィナンシャルグループ	95,600	2,017.00	192,825,200
静岡銀行	258,000	874.00	225,492,000
十六銀行	13,300	1,961.00	26,081,300
スルガ銀行	92,900	345.00	32,050,500
八十二銀行	238,600	362.00	86,373,200
山梨中央銀行	12,300	836.00	10,282,800
大垣共立銀行	20,900	1,880.00	39,292,000
福井銀行	9,100	1,461.00	13,295,100
北國銀行	9,800	2,211.00	21,667,800
清水銀行	4,400	1,550.00	6,820,000
富山銀行	2,000	2,631.00	5,262,000
滋賀銀行	21,200	2,060.00	43,672,000
南都銀行	15,400	1,830.00	28,182,000
百五銀行	95,300	303.00	28,875,900



京都銀行	37,900	5,220.00	197,838,000
紀陽銀行	37,500	1,457.00	54,637,500
ほくほくフィナンシャルグループ	70,500	854.00	60,207,000
山陰合同銀行	66,700	533.00	35,551,100
中国銀行	91,200	860.00	78,432,000
鳥取銀行	3,400	1,122.00	3,814,800
伊予銀行	140,300	564.00	79,129,200
百十四銀行	11,300	1,471.00	16,622,300
四国銀行	15,000	694.00	10,410,000
阿波銀行	16,200	2,060.00	33,372,000
大分銀行	6,100	1,734.00	10,577,400
宮崎銀行	6,600	2,026.00	13,371,600
佐賀銀行	6,000	1,391.00	8,346,000
沖縄銀行	9,700	2,610.00	25,317,000
琉球銀行	23,000	740.00	17,020,000
セブン銀行	353,900	233.00	82,458,700
みずほフィナンシャルグループ	1,439,300	1,653.50	2,379,882,550
高知銀行	3,800	863.00	3,279,400
山口フィナンシャルグループ	132,200	644.00	85,136,800
長野銀行	3,500	1,124.00	3,934,000
名古屋銀行	8,500	2,647.00	22,499,500
北洋銀行	159,700	244.00	38,966,800
愛知銀行	3,600	2,823.00	10,162,800
中京銀行	3,800	1,509.00	5,734,200
大光銀行	3,600	1,418.00	5,104,800
愛媛銀行	14,800	835.00	12,358,000
トマト銀行	4,100	1,063.00	4,358,300
京葉銀行	45,200	413.00	18,667,600
栃木銀行	51,200	174.00	8,908,800
北日本銀行	3,300	1,729.00	5,705,700
東和銀行	18,600	534.00	9,932,400
福島銀行	12,100	232.00	2,807,200
大東銀行	5,100	605.00	3,085,500
トモニホールディングス	81,900	300.00	24,570,000
フィデアホールディングス	102,800	122.00	12,541,600
池田泉州ホールディングス	121,800	162.00	19,731,600
F P G	35,800	791.00	28,317,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	7,200	1,627.00	11,714,400
マーキュリアインベストメント	4,300	759.00	3,263,700
S B Iホールディングス	130,600	2,710.00	353,926,000
ジャフコ グループ	16,300	7,460.00	121,598,000
大和証券グループ本社	793,500	633.50	502,682,250

野村ホールディングス	1,617,500	592.00	957,560,000
岡三証券グループ	90,600	436.00	39,501,600
丸三証券	31,700	643.00	20,383,100
東洋証券	35,800	171.00	6,121,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	113,300	410.00	46,453,000
光世証券	2,700	654.00	1,765,800
水戸証券	28,700	304.00	8,724,800
いちよし証券	21,400	592.00	12,668,800
松井証券	52,000	829.00	43,108,000
マネックスグループ	95,200	767.00	73,018,400
極東証券	14,400	823.00	11,851,200
岩井コスモホールディングス	10,900	1,688.00	18,399,200
藍澤証券	19,100	1,094.00	20,895,400
マネーパートナーズグループ	11,900	250.00	2,975,000
スパークス・グループ	49,400	271.00	13,387,400
かんぽ生命保険	131,300	2,141.00	281,113,300
S O M P Oホールディングス	186,700	4,276.00	798,329,200
アニコム ホールディングス	29,800	939.00	27,982,200
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	257,200	3,365.00	865,478,000
第一生命ホールディングス	559,600	2,228.00	1,246,788,800
東京海上ホールディングス	348,800	5,134.00	1,790,739,200
T & Dホールディングス	316,600	1,470.00	465,402,000
アドバンスクリエイト	5,000	906.00	4,530,000
全国保証	27,600	4,815.00	132,894,000
イントラスト	3,200	720.00	2,304,000
日本モーゲージサービス	5,600	1,006.00	5,633,600
C a s a	3,100	969.00	3,003,900
アルヒ	15,700	1,579.00	24,790,300
プレミアグループ	4,900	3,515.00	17,223,500
クレディセゾン	62,000	1,442.00	89,404,000
芙蓉総合リース	11,100	7,240.00	80,364,000
みずほリース	16,400	3,585.00	58,794,000
東京センチュリー	24,600	6,140.00	151,044,000
日本証券金融	45,000	861.00	38,745,000
アイフル	178,200	378.00	67,359,600
リコーリース	8,400	3,475.00	29,190,000
イオンフィナンシャルサービス	65,000	1,348.00	87,620,000
アコム	213,200	501.00	106,813,200
ジャックス	11,800	2,639.00	31,140,200
オリエントコーポレーション	287,600	159.00	45,728,400
オリックス	643,100	1,966.50	1,264,656,150
三菱HCキャピタル	366,600	615.00	225,459,000

九州リースサービス	5,400	685.00	3,699,000
日本取引所グループ	286,200	2,526.50	723,084,300
イー・ギャランティ	12,300	2,231.00	27,441,300
アサックス	5,700	722.00	4,115,400
N E C キャピタルソリューション	4,400	2,136.00	9,398,400
いちご	120,600	368.00	44,380,800
日本駐車場開発	122,300	160.00	19,568,000
スター・マイカ・ホールディングス	6,400	1,121.00	7,174,400
S R E ホールディングス	1,700	6,150.00	10,455,000
A D ワークスグループ	21,300	167.00	3,557,100
ヒューリック	225,500	1,315.00	296,532,500
三栄建築設計	4,700	2,014.00	9,465,800
野村不動産ホールディングス	64,700	3,025.00	195,717,500
三重交通グループホールディングス	23,400	492.00	11,512,800
サムティ	15,500	2,052.00	31,806,000
ディア・ライフ	15,600	473.00	7,378,800
日本商業開発	7,200	1,884.00	13,564,800
プレサンスコーポレーション	18,000	1,506.00	27,108,000
ハウスコム	2,600	1,245.00	3,237,000
日本管理センター	6,500	1,316.00	8,554,000
サンセイランディック	4,200	888.00	3,729,600
フージャースホールディングス	17,300	752.00	13,009,600
オープンハウス	33,800	5,330.00	180,154,000
東急不動産ホールディングス	289,400	731.00	211,551,400
飯田グループホールディングス	88,700	3,035.00	269,204,500
イーランド	2,700	1,033.00	2,789,100
ムゲンエステート	8,400	529.00	4,443,600
ハウズドゥ	5,200	1,055.00	5,486,000
シーアールイー	3,400	1,584.00	5,385,600
グッドコムアセット	5,700	1,399.00	7,974,300
ジェイ・エス・ビー	2,200	3,545.00	7,799,000
テンポイノベーション	4,100	969.00	3,972,900
フェイスネットワーク	1,600	1,393.00	2,228,800
パーク24	57,300	2,511.00	143,880,300
パラカ	3,300	1,649.00	5,441,700
三井不動産	483,100	2,747.00	1,327,075,700
三菱地所	696,400	1,933.50	1,346,489,400
平和不動産	18,400	4,235.00	77,924,000
東京建物	105,200	1,761.00	185,257,200
ダイビル	27,600	1,349.00	37,232,400
京阪神ビルディング	18,900	1,428.00	26,989,200
住友不動産	238,400	4,090.00	975,056,000

テーオーシー	22,100	704.00	15,558,400	
東京楽天地	2,000	4,355.00	8,710,000	
スターツコーポレーション	12,900	2,840.00	36,636,000	
フジ住宅	13,800	633.00	8,735,400	
空港施設	12,100	694.00	8,397,400	
明和地所	6,500	627.00	4,075,500	
ゴールドクレスト	10,100	1,820.00	18,382,000	
エスリード	4,700	1,662.00	7,811,400	
日神グループホールディングス	17,700	466.00	8,248,200	
日本エスコン	19,200	788.00	15,129,600	
タカラレーベン	44,400	355.00	15,762,000	
A V A N T I A	6,500	898.00	5,837,000	
イオンモール	53,600	1,882.00	100,875,200	
毎日コムネット	4,900	700.00	3,430,000	
ファースト住建	5,300	1,230.00	6,519,000	
カチタス	26,500	3,190.00	84,535,000	
トーセイ	15,500	1,127.00	17,468,500	
穴吹興産	2,700	2,117.00	5,715,900	
サンフロンティア不動産	14,000	1,027.00	14,378,000	
エフ・ジェー・ネクスト	11,300	1,020.00	11,526,000	
インテリックス	2,400	770.00	1,848,000	
ランドビジネス	4,500	362.00	1,629,000	
サンネクスタグループ	4,300	1,015.00	4,364,500	
グランディハウス	9,400	430.00	4,042,000	
日本空港ビルデング	37,000	5,470.00	202,390,000	
明豊ファシリティワークス	4,900	843.00	4,130,700	
日本工営	6,400	3,120.00	19,968,000	
L I F U L L	31,800	363.00	11,543,400	
ミクシィ	26,100	2,841.00	74,150,100	
ジェイエイシーリクルートメント	7,100	1,806.00	12,822,600	
日本M & Aセンター	168,400	2,689.00	452,827,600	
メンバーズ	3,100	3,315.00	10,276,500	
中広	1,900	358.00	680,200	
UTグループ	14,900	2,978.00	44,372,200	
アイティメディア	3,500	1,752.00	6,132,000	
タケエイ	11,600	1,315.00	15,254,000	
E・Jホールディングス	5,500	1,104.00	6,072,000	
夢真ビーネックスグループ	27,400	1,295.00	35,483,000	
コシダカホールディングス	27,700	644.00	17,838,800	
アルトナー	2,700	846.00	2,284,200	
パソナグループ	11,200	2,033.00	22,769,600	
C D S	2,700	1,525.00	4,117,500	

リンクアンドモチベーション	18,800	634.00	11,919,200
G C A	13,600	1,013.00	13,776,800
エス・エム・エス	34,900	3,280.00	114,472,000
サニーサイドアップグループ	3,800	865.00	3,287,000
パーソルホールディングス	102,700	2,257.00	231,793,900
リニカル	6,000	843.00	5,058,000
クックパッド	32,900	260.00	8,554,000
アイ・ケイ・ケイ	5,300	684.00	3,625,200
学情	3,800	1,411.00	5,361,800
スタジオアリス	5,200	2,258.00	11,741,600
シミックホールディングス	5,800	1,561.00	9,053,800
エプロ	2,700	944.00	2,548,800
N J S	2,600	2,114.00	5,496,400
総合警備保障	40,900	5,060.00	206,954,000
カカクコム	75,900	3,445.00	261,475,500
アイロムグループ	3,700	2,120.00	7,844,000
セントケア・ホールディング	7,700	1,083.00	8,339,100
サイネックス	2,000	703.00	1,406,000
ルネサンス	6,600	1,355.00	8,943,000
ディップ	16,100	3,575.00	57,557,500
デジタルホールディングス	7,200	2,386.00	17,179,200
新日本科学	12,700	771.00	9,791,700
キャリアデザインセンター	2,700	1,100.00	2,970,000
ベネフィット・ワン	37,400	3,420.00	127,908,000
エムスリー	181,100	7,297.00	1,321,486,700
ツカダ・グローバルホールディング	8,200	429.00	3,517,800
アウトソーシング	58,900	2,068.00	121,805,200
ウェルネット	10,700	523.00	5,596,100
ワールドホールディングス	3,600	2,758.00	9,928,800
ディー・エヌ・エー	43,500	2,235.00	97,222,500
博報堂D Yホールディングス	142,900	1,795.00	256,505,500
ぐるなび	18,100	615.00	11,131,500
タカミヤ	12,800	531.00	6,796,800
ジャパンベストレスキューシステム	6,900	770.00	5,313,000
ファンコミュニケーションズ	28,700	385.00	11,049,500
ライク	2,800	2,099.00	5,877,200
ビジネス・ブレークスルー	4,700	426.00	2,002,200
エスプール	26,500	929.00	24,618,500
W D Bホールディングス	4,800	2,756.00	13,228,800
手間いらず	1,300	6,450.00	8,385,000
ティア	6,300	475.00	2,992,500
C D G	1,000	1,578.00	1,578,000

アドウェイズ	16,900	837.00	14,145,300
バリューコマース	7,000	3,125.00	21,875,000
インフォマート	104,000	970.00	100,880,000
J Pホールディングス	29,900	283.00	8,461,700
エコナックホールディングス	20,500	92.00	1,886,000
E P Sホールディングス	15,500	1,798.00	27,869,000
レグス	2,600	2,732.00	7,103,200
プレステージ・インターナショナル	38,700	710.00	27,477,000
アミューズ	5,700	2,369.00	13,503,300
ドリームインキュベータ	3,300	974.00	3,214,200
クイック	6,500	1,248.00	8,112,000
T A C	6,300	233.00	1,467,900
電通グループ	115,400	3,790.00	437,366,000
イオンファンタジー	4,000	2,354.00	9,416,000
シーティーエス	11,800	880.00	10,384,000
ネクシィーズグループ	3,800	946.00	3,594,800
H . U . グループホールディングス	28,800	2,902.00	83,577,600
アルプス技研	9,200	1,996.00	18,363,200
ダイオーズ	2,200	1,027.00	2,259,400
日本空調サービス	11,000	726.00	7,986,000
オリエンタルランド	109,100	16,225.00	1,770,147,500
ダスキン	23,900	2,588.00	61,853,200
明光ネットワークジャパン	12,300	592.00	7,281,600
ファルコホールディングス	5,000	1,730.00	8,650,000
ラウンドワン	35,100	1,478.00	51,877,800
リゾートトラスト	47,100	1,900.00	89,490,000
ビー・エム・エル	13,300	3,685.00	49,010,500
りらいあコミュニケーションズ	15,700	1,331.00	20,896,700
リソー教育	52,600	318.00	16,726,800
早稲田アカデミー	4,500	913.00	4,108,500
ユー・エス・エス	115,000	1,887.00	217,005,000
東京個別指導学院	9,300	618.00	5,747,400
サイバーエージェント	253,000	2,130.00	538,890,000
楽天グループ	479,100	1,279.00	612,768,900
クリーク・アンド・リバー社	5,500	1,526.00	8,393,000
モーニングスター	15,300	441.00	6,747,300
テー・オー・ダブリュー	18,500	346.00	6,401,000
山田コンサルティンググループ	6,100	1,210.00	7,381,000
セントラルスポーツ	3,900	2,655.00	10,354,500
フルキャストホールディングス	8,800	2,182.00	19,201,600
エン・ジャパン	18,300	3,810.00	69,723,000
リソルホールディングス	1,200	4,150.00	4,980,000

テクノプロ・ホールディングス	20,500	7,970.00	163,385,000
アトラグループ	2,400	346.00	830,400
インターワークス	3,400	433.00	1,472,200
アイ・アールジャパンホールディングス	4,200	13,570.00	56,994,000
K e e P e r 技研	6,700	2,571.00	17,225,700
ファーストロジック	2,200	723.00	1,590,600
三機サービス	2,100	1,035.00	2,173,500
G u n o s y	6,600	910.00	6,006,000
デザインワン・ジャパン	3,300	227.00	749,100
イー・ガーディアン	4,200	2,704.00	11,356,800
リブセンス	6,400	224.00	1,433,600
ジャパンマテリアル	31,700	1,314.00	41,653,800
ベクトル	13,000	946.00	12,298,000
ウチヤマホールディングス	5,500	408.00	2,244,000
チャーム・ケア・コーポレーション	7,800	1,137.00	8,868,600
キャリアリンク	3,400	2,256.00	7,670,400
I B J	8,600	1,154.00	9,924,400
アサンテ	3,800	1,781.00	6,767,800
バリューHR	4,200	1,762.00	7,400,400
M & A キャピタルパートナーズ	8,500	4,685.00	39,822,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,100	1,507.00	6,178,700
E R I ホールディングス	3,200	597.00	1,910,400
アビスト	1,700	2,971.00	5,050,700
シグマクシス	5,700	2,135.00	12,169,500
ウィルグループ	7,700	1,014.00	7,807,800
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	15,900	249.00	3,959,100
メドピア	7,900	4,610.00	36,419,000
レアジョブ	2,000	1,843.00	3,686,000
リクルートホールディングス	735,200	5,805.00	4,267,836,000
エラン	14,300	1,323.00	18,918,900
土木管理総合試験所	5,500	381.00	2,095,500
ネットマーケティング	5,400	422.00	2,278,800
日本郵政	776,600	905.50	703,211,300
ベルシステム24ホールディングス	17,300	1,728.00	29,894,400
鎌倉新書	10,500	1,200.00	12,600,000
S M N	2,400	812.00	1,948,800
グローバルキッズCOMPANY	2,000	999.00	1,998,000
エアトリ	6,400	3,025.00	19,360,000
アトラエ	7,200	2,162.00	15,566,400
ストライク	3,900	4,185.00	16,321,500
ソラスト	25,300	1,357.00	34,332,100
セラク	3,300	2,104.00	6,943,200

インソース	10,000	2,065.00	20,650,000
ペイカレント・コンサルティング	6,700	36,600.00	245,220,000
Orchestra Holdings	2,300	2,866.00	6,591,800
アイモバイル	3,000	1,366.00	4,098,000
キャリアインデックス	4,500	755.00	3,397,500
MS - Japan	4,300	1,098.00	4,721,400
船場	2,200	823.00	1,810,600
グレイステクノロジー	10,500	1,698.00	17,829,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	29,700	2,473.00	73,448,100
フルテック	1,600	1,401.00	2,241,600
GameWith	3,300	623.00	2,055,900
ソウルドアウト	2,600	1,670.00	4,342,000
MS&Consulting	1,900	612.00	1,162,800
ウェルビー	3,900	1,434.00	5,592,600
エル・ティー・エス	1,000	3,620.00	3,620,000
ミダック	2,300	6,690.00	15,387,000
日総工産	8,200	834.00	6,838,800
キュービーネットホールディングス	4,800	1,895.00	9,096,000
RPAホールディングス	12,200	757.00	9,235,400
スプリックス	3,100	1,375.00	4,262,500
マネジメントソリューションズ	5,100	2,006.00	10,230,600
プロレド・パートナーズ	1,900	3,150.00	5,985,000
テノ・ホールディングス	1,200	1,175.00	1,410,000
フロンティア・マネジメント	2,400	1,302.00	3,124,800
ピアラ	900	1,112.00	1,000,800
コプロ・ホールディングス	1,500	1,284.00	1,926,000
ギークス	1,800	1,822.00	3,279,600
カーブスホールディングス	28,400	916.00	26,014,400
フォーラムエンジニアリング	7,300	979.00	7,146,700
ダイレクトマーケティングミックス	5,500	4,015.00	22,082,500
ポピンズホールディングス	2,800	4,875.00	13,650,000
LITALICO	4,200	5,180.00	21,756,000
アドバンテッジリスクマネジメント	5,400	1,043.00	5,632,200
リログループ	56,200	2,477.00	139,207,400
東祥	6,500	2,037.00	13,240,500
エイチ・アイ・エス	16,000	2,597.00	41,552,000
ラックランド	3,000	2,673.00	8,019,000
共立メンテナンス	17,000	4,050.00	68,850,000
イチネンホールディングス	10,800	1,237.00	13,359,600
建設技術研究所	6,700	2,481.00	16,622,700
スペース	6,800	925.00	6,290,000
長大	4,200	1,925.00	8,085,000



燦ホールディングス	4,600	1,233.00	5,671,800	
スバル興業	600	8,390.00	5,034,000	
東京テアトル	4,000	1,270.00	5,080,000	
タナベ経営	2,100	1,442.00	3,028,200	
ナガワ	3,300	8,020.00	26,466,000	
東京都競馬	6,700	4,750.00	31,825,000	
カナモト	18,100	2,702.00	48,906,200	
西尾レントオール	9,500	3,280.00	31,160,000	
トランス・コスモス	9,800	2,933.00	28,743,400	
乃村工藝社	44,200	971.00	42,918,200	
藤田観光	4,100	2,522.00	10,340,200	
KNT-CTホールディングス	5,500	1,543.00	8,486,500	
日本管財	11,100	2,345.00	26,029,500	
トーカイ	10,000	2,374.00	23,740,000	
セコム	101,100	8,666.00	876,132,600	
セントラル警備保障	5,000	3,175.00	15,875,000	
丹青社	19,600	906.00	17,757,600	
メイテック	12,400	6,270.00	77,748,000	
応用地質	11,700	1,294.00	15,139,800	
船井総研ホールディングス	21,100	2,370.00	50,007,000	
進学会ホールディングス	4,400	421.00	1,852,400	
オオバ	7,400	757.00	5,601,800	
いであ	2,600	1,794.00	4,664,400	
学究社	3,100	1,368.00	4,240,800	
ベネッセホールディングス	37,700	2,672.00	100,734,400	
イオンディライト	12,700	3,400.00	43,180,000	
ナック	5,000	924.00	4,620,000	
ダイセキ	17,200	4,345.00	74,734,000	
ステップ	3,900	1,602.00	6,247,800	
合計	112,572,500		288,439,459,900	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)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

	2021年 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	8,204,971,570
コール・ローン	1,309,901,292
株式	267,906,197,156
投資信託受益証券	163,667,945
投資証券	6,272,294,141
派生商品評価勘定	519,880,876
未収入金	42,019,690
未収配当金	345,417,613
差入委託証拠金	2,032,731,604
流動資産合計	286,797,081,887
資産合計	286,797,081,887
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	205,448
前受金	518,023,974
未払金	32,637,268
未払解約金	318,683,070
未払利息	1,444
流動負債合計	869,551,204
負債合計	869,551,204
純資産の部	
元本等	
元本	70,987,930,886
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	214,939,599,797
元本等合計	285,927,530,683
純資産合計	285,927,530,683
負債純資産合計	286,797,081,887

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021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>

	2021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）

	2021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		70,987,930,886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)	4.0278円 (40,278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

	2021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

	2021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

	2021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	2021年 6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	14,062,267,352円
期中一部解約元本額	19,823,060,054円
期末元本額	70,987,930,886円
期末元本額の内訳	

区分	2021年 6月10日現在
外国株式インデックスファンド	1,550,228,692円
D C外国株式インデックスファンド	4,548,837,411円
D C外国株式インデックスファンドL	24,190,981,589円
D Cバランスファンド30	650,883,034円
D Cバランスファンド50	1,332,085,056円
D Cバランスファンド70	805,330,153円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	302,024,720円
外国株式インデックスe	4,829,479,449円
インデックスコレクション（外国株式）	11,640,901,772円
インデックスコレクション（バランス株式30）	3,476,329,902円
インデックスコレクション（バランス株式50）	934,287,421円
インデックスコレクション（バランス株式70）	852,581,893円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,210,579,926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）	1,576,225,956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）	519,242,488円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	32,716,782円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	364,616,622円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	42,411,828円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	77,812,977円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	201,212円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	700,070,560円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	332,871,246円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	234,954,514円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	4,579,109,635円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	489,876,870円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	143,537,472円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	722,911,184円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	17,161,477円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	92,412,676円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	100,817,822円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	313,881,183円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	14,564,193円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	74,291,555円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	222,501,013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）	11,210,603円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021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	19,717,482,375

投資信託受益証券	306,833
投資証券	951,056,767
合計	20,668,232,309

(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

(2021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	11,066,037,719	-	11,584,061,693	518,023,974
	合計	11,066,037,719	-	11,584,061,693	518,023,974

(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

(2021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	1,009,531,530	-	1,011,182,984	1,651,454
	アメリカドル	804,308,640	-	804,566,204	257,564
	ユーロ	158,978,520	-	160,193,640	1,215,120
	イギリスポンド	46,244,370	-	46,423,140	178,770
	合計	1,009,531,530	-	1,011,182,984	1,651,454

(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	25.81	901,285.20	
	CHENIERE ENERGY INC	11,266	88.22	993,886.52	
	CHEVRON CORP	90,349	107.78	9,737,815.22	
	CONOCOPHILLIPS	63,467	59.68	3,787,710.56	
	DEVON ENERGY CORPORATION	27,923	29.93	835,735.39	
	EOG RESOURCES INC	27,260	85.81	2,339,180.60	
	EXXON MOBIL	198,480	62.65	12,434,772.00	
	HALLIBURTON CO	41,018	24.26	995,096.68	
	HESS CORP	12,829	88.88	1,140,241.52	
	KINDER MORGAN INC	95,062	18.83	1,790,017.46	
	MARATHON PETROLEUM CORP	30,365	63.61	1,931,517.65	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	43,347	28.35	1,228,887.45	
	ONEOK INC	20,659	54.84	1,132,939.56	
	PHILLIPS 66	20,389	92.45	1,884,963.05	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	9,578	167.75	1,606,709.50	
	SCHLUMBERGER	64,999	35.76	2,324,364.24	
	VALERO ENERGY CORP	19,008	81.93	1,557,325.44	
	WILLIAMS COS	56,474	28.13	1,588,613.62	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	10,347	297.35	3,076,680.45	
	ALBEMARLE CORP	5,325	174.37	928,520.25	
	AMCOR PLC	72,748	12.07	878,068.36	
	AVERY DENNISON CORP	4,144	218.12	903,889.28	
	BALL CORP	15,147	80.90	1,225,392.30	
	CELANESE CORP-SERIES A	5,419	162.28	879,395.32	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	55.50	576,034.50	
	CORTEVA INC	34,769	45.49	1,581,641.81	
	CROWN HOLDINGS INC	6,218	99.69	619,872.42	
	DOW INC	34,681	68.84	2,387,440.04	
	DUPONT DE NEMOURS INC	25,064	84.17	2,109,636.88	
	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,266	126.74	794,152.84	
	ECOLAB INC	12,020	212.76	2,557,375.20	
	FMC CORP	5,984	118.31	707,967.04	
	FREEMPORT-MCMORAN INC	67,926	40.70	2,764,588.20	
INT'L PAPER CO	17,345	63.28	1,097,591.60		
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,577	147.09	1,702,860.93		



LINDE PLC	24,622	290.48	7,152,198.56
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,432	112.05	1,393,005.60
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,894	359.10	1,039,235.40
MOSAIC CO/THE	16,566	34.95	578,981.70
NEWMONT CORPORATION	37,562	69.99	2,628,964.38
NUCOR CORP	14,049	107.58	1,511,391.42
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,374	142.99	625,438.26
PPG INDUSTRIES INC	11,026	177.11	1,952,814.86
RPM INTERNATIONAL INC	5,987	91.61	548,469.07
SEALED AIR CORP	7,368	57.88	426,459.84
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	11,916	276.96	3,300,255.36
STEEL DYNAMICS INC	9,667	64.51	623,618.17
VULCAN MATERIALS CO	6,162	178.62	1,100,656.44
WESTROCK CO	12,132	56.92	690,553.44
3 M COMPANY	27,047	202.74	5,483,508.78
ALLEGION PLC	4,638	138.09	640,461.42
AMETEK INC	10,723	135.71	1,455,218.33
BOEING CO	25,870	248.06	6,417,312.20
CARRIER GLOBAL CORP	38,424	46.19	1,774,804.56
CATERPILLAR	25,479	234.65	5,978,647.35
CUMMINS INC	6,913	256.77	1,775,051.01
DEERE&CO	13,959	349.53	4,879,089.27
DOVER CORP	6,691	150.66	1,008,066.06
EATON CORP	18,650	146.41	2,730,546.50
EMERSON ELECTRIC CO	27,979	97.90	2,739,144.10
FASTENAL CO	26,712	52.61	1,405,318.32
FORTIVE CORP	14,104	71.07	1,002,371.28
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,412	100.24	642,738.88
GENERAC HOLDINGS INC	2,918	343.71	1,002,945.78
GENERAL DYNAMICS CORP	11,401	191.87	2,187,509.87
GENERAL ELECTRIC CO	410,769	13.73	5,639,858.37
GRAINGER (WW) INC	2,116	458.55	970,291.80
HEICO CORP	2,252	145.23	327,057.96
HEICO CORP-CLASS A	3,318	134.14	445,076.52
HONEYWELL INTL INC	32,494	227.81	7,402,458.14
HOWMET AEROSPACE INC	18,227	35.03	638,491.81
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	221.03	440,512.79
IDEX CORP	3,505	221.01	774,640.05
ILLINOIS TOOL WORKS	14,823	232.32	3,443,679.36
INGERSOLL-RAND INC	16,458	47.67	784,552.86
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,600	62.75	602,400.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	33,831	66.86	2,261,940.66

L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	9,818	217.51	2,135,513.18
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,584	338.23	535,756.32
LOCKHEED MARTIN CORP	11,802	386.80	4,565,013.60
MASCO CORP	12,110	58.41	707,345.10
NORDSON CORP	2,536	222.10	563,245.60
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,408	372.60	2,760,220.80
OTIS WORLDWIDE CORP	19,169	80.75	1,547,896.75
OWENS CORNING	4,965	102.25	507,671.25
PACCAR INC	16,159	92.59	1,496,161.81
PARKER HANNIFIN CORP	6,017	305.40	1,837,591.80
PENTAIR PLC	7,637	69.20	528,480.40
PLUG POWER INC	23,605	32.43	765,510.15
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	71,218	88.85	6,327,719.30
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,418	279.15	1,512,434.70
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,901	450.95	2,210,105.95
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,602	59.59	453,003.18
SMITH (A.O.) CORP	6,846	68.44	468,540.24
SNAP-ON INC	2,372	244.42	579,764.24
STANLEY BLACK&DECKER	7,473	206.57	1,543,697.61
SUNRUN INC	7,884	43.29	341,298.36
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,150	418.77	900,355.50
TEXTRON	10,911	69.06	753,513.66
TRANE TECHNOLOGIES PLC	11,217	182.29	2,044,746.93
TRANSDIGM GROUP INC	2,411	664.00	1,600,904.00
UNITED RENTALS INC	3,357	314.71	1,056,481.47
WABTEC CORP	8,356	81.39	680,094.84
XYLEM INC	8,363	118.45	990,597.35
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	6,342	87.39	554,227.38
CINTAS CORP	4,399	347.88	1,530,324.12
CLARIVATE PLC	15,370	26.39	405,614.30
COPART INC	9,881	122.53	1,210,718.93
COSTAR GROUP INC	1,839	848.31	1,560,042.09
EQUIFAX INC	5,655	228.64	1,292,959.20
IHS MARKIT LTD	17,667	106.74	1,885,775.58
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,004	141.52	849,686.08
LEIDOS HOLDINGS	6,238	104.93	654,553.34
REPUBLIC SERVICES INC	10,373	109.23	1,133,042.79
ROBERT HALF INTL INC	5,212	91.31	475,907.72
ROLLINS INC	10,710	33.05	353,965.50
TRANSUNION	8,818	105.47	930,034.46
VERISK ANALYTICS INC	7,189	169.92	1,221,554.88
WASTE CONNECTIONS INC	12,201	120.29	1,467,658.29

WASTE MANAGEMENT INC	19,771	139.58	2,759,636.18
AMERCO	564	561.72	316,810.08
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,274	99.00	621,126.00
CSX CORP	35,820	97.82	3,503,912.40
DELTA AIR LINES INC	7,841	46.52	364,763.32
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,850	123.74	971,359.00
FEDEX CORP	11,683	293.11	3,424,404.13
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,907	165.58	646,921.06
KANSAS CITY SOUTHERN	4,469	296.07	1,323,136.83
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,000	47.49	332,430.00
LYFT INC-A	11,829	55.38	655,090.02
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,893	273.76	3,255,827.68
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,619	249.77	1,153,687.63
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,754	58.42	394,568.68
UBER TECHNOLOGIES INC	56,121	49.14	2,757,785.94
UNION PACIFIC CORP	31,614	221.50	7,002,501.00
UNITED PARCEL SERVICE B	33,541	201.06	6,743,753.46
XPO LOGISTICS INC	4,206	143.89	605,201.34
APTIV PLC	12,607	158.33	1,996,066.31
AUTOLIV INC	3,858	103.85	400,653.30
BORGWARNER INC	11,533	53.12	612,632.96
FORD MOTOR COMPANY	182,713	15.48	2,828,397.24
GENERAL MOTORS CO	60,338	62.77	3,787,416.26
LEAR CORP	2,989	194.44	581,181.16
TESLA INC	35,900	598.78	21,496,202.00
DR HORTON INC	16,141	90.68	1,463,665.88
GARMIN LTD	6,654	142.17	945,999.18
HASBRO INC	6,002	95.40	572,590.80
LENNAR CORP-CL A	12,818	93.90	1,203,610.20
LULULEMON ATHLETICA INC	5,782	327.22	1,891,986.04
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,830	198.40	561,472.00
NEWELL BRANDS INC	17,598	27.97	492,216.06
NIKE B	59,408	131.84	7,832,350.72
NVR INC	164	4,792.95	786,043.80
PELOTON INTERACTIVE INC-A	11,302	106.97	1,208,974.94
PULTE GROUP INC	12,386	55.84	691,634.24
VF CORP	16,318	78.46	1,280,310.28
WHIRLPOOL CORP	3,060	229.90	703,494.00
AIRBNB INC-CLASS A	2,569	144.85	372,119.65
ARAMARK	11,643	37.22	433,352.46
BOOKING HOLDINGS INC	1,920	2,314.06	4,442,995.20
CAESARS ENTERTAINMENT INC	9,663	110.83	1,070,950.29

CARNIVAL CORPORATION	36,154	30.45	1,100,889.30
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,310	1,328.57	1,740,426.70
DARDEN RESTAURANTS INC	6,041	138.67	837,705.47
DOMINO'S PIZZA INC	1,797	442.71	795,549.87
DRAFTKINGS INC - CL A	8,917	54.48	485,798.16
EXPEDIA GROUP INC	6,324	172.80	1,092,787.20
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	12,946	126.45	1,637,021.70
LAS VEGAS SANDS CORP	15,969	55.09	879,732.21
MARRIOTT INTL A	12,879	143.82	1,852,257.78
MCDONALD'S CORP	34,962	231.47	8,092,654.14
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	10,511	17.29	181,735.19
MGM RESORTS INTERNATIONAL	18,299	43.54	796,738.46
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,621	92.79	985,522.59
STARBUCKS CORP	55,049	111.39	6,131,908.11
VAIL RESORTS INC	1,853	319.94	592,848.82
WYNN RESORTS LTD	5,210	126.67	659,950.70
YUM BRANDS INC	14,073	117.53	1,653,999.69
ACTIVISION BLIZZARD INC	36,195	96.53	3,493,903.35
ALPHABET INC-CL A	14,062	2,407.94	33,860,452.28
ALPHABET INC-CL C	13,785	2,491.40	34,343,949.00
ALTICE USA INC- A	12,390	34.49	427,331.10
CABLE ONE INC	247	1,772.56	437,822.32
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	6,332	676.47	4,283,408.04
COMCAST CORP-CL A	214,339	56.26	12,058,712.14
DISCOVERY INC - A	7,886	30.56	240,996.16
DISCOVERY INC-C	14,119	28.65	404,509.35
DISH NETWORK CORPORATION-A	12,603	40.44	509,665.32
ELECTRONIC ARTS INC	13,548	145.82	1,975,569.36
FACEBOOK INC-A	112,478	330.25	37,145,859.50
FOX CORP - CLASS A	15,560	37.64	585,678.40
FOX CORP- CLASS B	6,975	36.03	251,309.25
IAC/INTERACTIVECORP	3,853	153.83	592,706.99
INTERPUBLIC GROUP OF COS	17,946	33.52	601,549.92
LIBERTY BROADBAND-A	1,450	155.79	225,895.50
LIBERTY BROADBAND-C	7,402	159.33	1,179,360.66
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,885	45.29	447,691.65
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,928	45.36	359,614.08
LIBERTY SIRIUSXM-A	3,171	45.36	143,836.56
LIVE NATION ENTERTAINMENT	7,518	88.17	662,862.06
MATCH GROUP INC	11,789	141.77	1,671,326.53
NETFLIX INC	20,738	485.81	10,074,727.78
NEWS CORP-CLASS A	17,936	26.53	475,842.08

OMNICOM GROUP	9,954	83.53	831,457.62
PINTEREST INC- CLASS A	23,843	66.12	1,576,499.16
ROKU INC	5,086	339.64	1,727,409.04
SEA LTD-ADR	617	263.08	162,320.36
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,096	6.85	322,607.60
SNAP INC - A	43,288	61.77	2,673,899.76
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,342	183.59	980,737.78
THE WALT DISNEY CO	85,011	176.04	14,965,336.44
TWITTER INC	37,195	59.71	2,220,913.45
VIACOMCBS INC-CLASS B	26,308	42.25	1,111,513.00
ZILLOW GROUP INC-A	3,140	113.80	357,332.00
ZILLOW GROUP INC-C	7,537	111.40	839,621.80
ADVANCE AUTO PARTS	3,129	197.03	616,506.87
AMAZON.COM	20,037	3,281.15	65,744,402.55
AUTOZONE INC	1,082	1,386.85	1,500,571.70
BEST BUY COMPANY INC	10,832	114.99	1,245,571.68
BURLINGTON STORES INC	3,076	304.99	938,149.24
CARMAX INC	7,628	115.00	877,220.00
CARVANA CO	3,266	264.51	863,889.66
CHEWY INC - CLASS A	3,947	77.77	306,958.19
DOLLAR GENERAL CORP	11,647	204.93	2,386,819.71
DOLLAR TREE INC	10,956	98.87	1,083,219.72
EBAY	32,206	65.96	2,124,307.76
ETSY INC	5,869	167.30	981,883.70
GENUINE PARTS CO	6,685	128.39	858,287.15
HOME DEPOT	50,551	307.34	15,536,344.34
L BRANDS INC	10,967	65.46	717,899.82
LKQ CORP	13,325	49.49	659,454.25
LOWES COMPANIES	34,371	190.60	6,551,112.60
MERCADOLIBRE INC	2,098	1,316.66	2,762,352.68
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,383	527.98	1,786,156.34
POOL CORP	1,855	433.62	804,365.10
ROSS STORES INC	16,636	120.09	1,997,817.24
TARGET (DAYTON HUDSON)	23,475	231.94	5,444,791.50
TJX COMPANIES INC	56,174	65.03	3,652,995.22
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,411	181.04	979,607.44
ULTA BEAUTY INC	2,478	332.68	824,381.04
WAYFAIR INC- CLASS A	3,215	323.50	1,040,052.50
COSTCO WHOLESALE CORP	20,701	379.96	7,865,551.96
KROGER CO	33,615	38.28	1,286,782.20
SYSCO CORP	23,775	79.46	1,889,161.50
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	34,374	53.43	1,836,602.82

WALMART INC	72,724	139.08	10,114,453.92
ALTRIA GROUP INC	87,106	49.90	4,346,589.40
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	25,951	68.11	1,767,522.61
BOSTON BEER COMPANY INC-A	418	1,038.51	434,097.18
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14,377	75.19	1,081,006.63
BUNGE LIMITED	6,422	88.79	570,209.38
CAMPBELL SOUP CO (US)	9,742	45.92	447,352.64
COCA-COLA CO	191,622	55.48	10,631,188.56
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	9,216	61.75	569,088.00
CONAGRA BRANDS INC	22,663	37.31	845,556.53
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,917	236.67	1,873,716.39
GENERAL MILLS INC	28,545	62.12	1,773,215.40
HERSHEY FOODS CORPORATION	6,862	172.86	1,186,165.32
HORMEL FOODS CORP	13,714	48.28	662,111.92
JM SMUCKER CO	5,275	135.97	717,241.75
KELLOGG CO	11,938	64.80	773,582.40
KEURIG DR PEPPER INC	32,694	34.98	1,143,636.12
KRAFT HEINZ CO/THE	32,632	43.04	1,404,481.28
LAMB WESTON HOLDINGS INC	6,735	82.50	555,637.50
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,562	88.13	1,018,959.06
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	8,727	60.74	530,077.98
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	67,011	63.31	4,242,466.41
MONSTER BEVERAGE CORP	18,482	93.24	1,723,261.68
PEPSICO INC	64,857	146.10	9,475,607.70
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	73,051	96.75	7,067,684.25
TYSON FOODS INC	13,674	77.40	1,058,367.60
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,548	84.54	976,267.92
CLOROX COMPANY	5,866	175.70	1,030,656.20
COLGATE-PALMOLIVE CO	38,122	82.56	3,147,352.32
ESTEE LAUDER CO-CL A	10,607	297.84	3,159,188.88
KIMBERLY-CLARK CORP	15,902	129.30	2,056,128.60
PROCTER & GAMBLE CO	115,113	134.79	15,516,081.27
ABBOTT LABORATORIES	83,187	109.05	9,071,542.35
ABIOMED INC	2,088	293.82	613,496.16
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,499	585.50	2,048,664.50
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,105	117.40	834,127.00
ANTHEM INC	11,435	385.96	4,413,452.60
BAXTER INTERNATIONAL	23,872	82.35	1,965,859.20
BECTON DICKINSON & CO	13,583	243.35	3,305,423.05
BOSTON SCIENTIFIC CORP	66,997	42.33	2,835,983.01
CARDINAL HEALTH	13,608	58.56	796,884.48
CENTENE CORP	27,073	71.66	1,940,051.18

CERNER CORP	14,251	80.03	1,140,507.53
CIGNA CORP	16,426	242.01	3,975,256.26
CVS HEALTH CORP	61,357	84.95	5,212,277.15
DANAHER CORP	29,992	240.70	7,219,074.40
DAVITA INC	3,582	120.44	431,416.08
DENTSPLY SIRONA INC	10,094	65.69	663,074.86
DEXCOM INC	4,480	390.03	1,747,334.40
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	29,151	97.08	2,829,979.08
HCA HEALTHCARE INC	12,661	208.31	2,637,412.91
HENRY SCHEIN INC	6,547	77.60	508,047.20
HOLOGIC INC	11,926	61.00	727,486.00
HUMANA INC	6,010	422.75	2,540,727.50
IDEXX LABORATORIES INC	3,985	566.66	2,258,140.10
INSULET CORP	3,056	272.93	834,074.08
INTUITIVE SURGICAL INC	5,509	840.24	4,628,882.16
LABORATORY CRP OF AMER	4,533	259.19	1,174,908.27
MASIMO CORP	2,735	212.62	581,515.70
MCKESSON CORP	7,488	190.55	1,426,838.40
MEDTRONIC PLC	63,131	123.11	7,772,057.41
MOLINA HEALTHCARE INC	2,739	248.35	680,230.65
NOVOCURE LTD	4,504	211.89	954,352.56
OAK STREET HEALTH INC	4,376	57.91	253,414.16
QUEST DIAGNOSTICS	6,246	127.50	796,365.00
RESMED INC	6,751	211.96	1,430,941.96
STERIS PLC	3,951	195.54	772,578.54
STRYKER CORP	15,846	253.13	4,011,097.98
TELADOC HEALTH INC	6,270	150.43	943,196.10
TELEFLEX INC	2,162	393.31	850,336.22
THE COOPER COS INC	2,279	372.41	848,722.39
UNITEDHEALTH GROUP INC	44,358	401.10	17,791,993.80
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	159.47	621,614.06
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,333	290.64	1,840,623.12
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,434	335.93	1,153,583.62
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,671	158.22	1,530,145.62
10X GENOMICS INC-CLASS A	3,216	186.25	598,980.00
ABBVIE INC	82,852	114.00	9,445,128.00
AGILENT TECHNOLOGIES	14,398	140.13	2,017,591.74
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,211	179.18	1,829,606.98
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,417	157.41	852,689.97
AMGEN	26,982	239.52	6,462,728.64
AVANTOR INC	24,065	31.87	766,951.55
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,027	581.16	596,851.32

BIO-TECHNE CORP	1,796	429.16	770,771.36
BIOGEN INC	7,191	406.94	2,926,305.54
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,381	82.05	687,661.05
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	104,670	65.40	6,845,418.00
CATALENT INC	8,308	107.30	891,448.40
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,324	345.91	803,894.84
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,778	33.90	704,374.20
EXACT SCIENCES CORP	7,383	119.20	880,053.60
GILEAD SCIENCES INC	58,731	68.65	4,031,883.15
HORIZON THERAPEUTICS PLC	10,243	90.83	930,371.69
ILLUMINA INC	6,830	433.94	2,963,810.20
INCYTE CORP	8,608	86.20	742,009.60
IQVIA HOLDINGS INC	8,951	239.38	2,142,690.38
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,663	181.84	484,239.92
JOHNSON & JOHNSON	122,897	165.59	20,350,514.23
LILLY (ELI) & CO	38,063	226.00	8,602,238.00
MERCK & CO	118,737	74.04	8,791,287.48
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,109	1,269.09	1,407,420.81
MODERNA INC	14,757	217.44	3,208,762.08
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,708	98.42	463,361.36
NOVAVAX INC	3,227	209.64	676,508.28
PERKINELMER INC	5,174	141.40	731,603.60
PFIZER	260,869	39.81	10,385,194.89
PPD INC	6,368	46.50	296,112.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,904	521.85	2,559,152.40
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	8,453	45.99	388,753.47
SEAGEN INC	6,223	155.59	968,236.57
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56,857	10.73	610,075.61
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	18,401	448.21	8,247,512.21
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,167	213.56	2,598,384.52
VIATRIS INC	57,073	15.45	881,777.85
WATERS CORP	2,876	328.00	943,328.00
ZOETIS INC	22,261	176.69	3,933,296.09
BANK OF AMERICA CORP	363,211	42.32	15,371,089.52
CITIGROUP	97,674	78.14	7,632,246.36
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,818	48.44	959,983.92
FIFTH THIRD BANCORP	33,182	41.15	1,365,439.30
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,108	194.65	1,578,222.20
HUNTINGTON BANCSHARES INC	69,030	14.99	1,034,759.70
JPMORGAN CHASE & CO	142,670	162.94	23,246,649.80
KEY CORP	44,974	22.26	1,001,121.24
M & T BANK CORP	5,956	157.66	939,022.96



PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	19,846	190.79	3,786,418.34
REGIONS FINL CORP	46,064	21.90	1,008,801.60
SVB FINANCIAL GROUP	2,412	594.23	1,433,282.76
TRUIST FINANCIAL CORP	63,156	58.45	3,691,468.20
US BANCORP	66,613	59.25	3,946,820.25
WELLS FARGO & CO	193,181	45.92	8,870,871.52
ALLY FINANCIAL INC	18,129	54.69	991,475.01
AMERICAN EXPRESS	32,082	164.09	5,264,335.38
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,496	260.72	1,432,917.12
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	8,001	57.20	457,657.20
BANK NEW YORK CO	38,892	50.62	1,968,713.04
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	64,092	288.58	18,495,669.36
BLACKROCK INC	7,152	870.94	6,228,962.88
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	21,406	160.60	3,437,803.60
CARLYLE GROUP INC/THE	7,865	43.74	344,015.10
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,962	114.11	566,213.82
CME GROUP INC	16,814	215.51	3,623,585.14
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,285	123.03	1,757,483.55
EQUITABLE HOLDINGS INC	18,461	31.02	572,660.22
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,750	321.78	563,115.00
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	34.79	513,082.92
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,286	145.69	333,047.34
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,151	382.78	6,182,279.78
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	26,274	110.85	2,912,472.90
INVESCO LTD	19,405	28.70	556,923.50
KKR & CO INC	24,952	55.28	1,379,346.56
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,762	433.62	764,038.44
MOODY'S CORP	7,905	338.78	2,678,055.90
MORGAN STANLEY	65,965	92.67	6,112,976.55
MSCI INC	3,869	465.83	1,802,296.27
NASDAQ INC	5,320	169.12	899,718.40
NORTHERN TRUST CORP	9,186	118.62	1,089,643.32
PRICE T ROWE GROUP INC	10,575	194.48	2,056,626.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,700	129.22	736,554.00
S&P GLOBAL INC	11,274	384.61	4,336,093.14
SCHWAB (CHARLES) CORP	67,355	72.85	4,906,811.75
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	63.18	397,339.02
STATE STREET CORP	17,185	84.57	1,453,335.45
SYNCHRONY FINANCIAL	27,139	50.07	1,358,849.73
THE BLACKSTONE GROUP INC	31,520	94.20	2,969,184.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,522	83.22	376,320.84
VOYA FINANCIAL INC	6,370	64.32	409,718.40

AFLAC	31,141	56.59	1,762,269.19
ALLEGHANY CORP	647	701.51	453,876.97
ALLSTATE CORP	14,193	133.03	1,888,094.79
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,803	124.01	471,610.03
AMERICAN INT'L GROUP	40,246	52.16	2,099,231.36
AON PLC	10,695	245.75	2,628,296.25
ARCH CAPITAL GROUP LTD	18,793	39.06	734,054.58
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,948	144.39	1,292,001.72
ASSURANT INC	2,684	162.76	436,847.84
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	6,517	62.53	407,508.01
BROWN & BROWN INC	11,065	51.72	572,281.80
CHUBB LTD	21,140	167.30	3,536,722.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,076	121.14	857,186.64
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,444	190.31	274,807.64
EVEREST RE GROUP LTD	1,834	257.65	472,530.10
FNF GROUP	12,836	47.35	607,784.60
GLOBE LIFE INC	4,559	104.82	477,874.38
HARTFORD FINANCIAL SVCS	16,673	66.00	1,100,418.00
LINCOLN NATIONAL CORP	8,416	68.28	574,644.48
LOEWS CORP	10,482	56.45	591,708.90
MARKEL CORP	639	1,197.26	765,049.14
MARSH & MCLENNAN COS	23,740	137.42	3,262,350.80
METLIFE INC	35,762	64.68	2,313,086.16
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,725	65.08	828,143.00
PROGRESSIVE CORP	27,400	94.82	2,598,068.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,486	106.09	1,961,179.74
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,361	124.85	419,620.85
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,776	149.81	415,872.56
TRAVELERS COS INC/THE	11,830	154.74	1,830,574.20
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,009	254.51	1,529,350.59
WR BERKLEY CORP	6,553	75.45	494,423.85
CBRE GROUP INC-A	16,391	89.04	1,459,454.64
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	64,300	4.89	314,427.00
WEYERHAEUSER CO	36,674	36.03	1,321,364.22
ACCENTURE PLC-CL A	29,730	282.11	8,387,130.30
ADOBE INC	22,518	514.68	11,589,564.24
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	7,539	117.79	888,018.81
ANSYS INC	4,002	326.85	1,308,053.70
AUTODESK INC	10,262	275.50	2,827,181.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	20,090	198.19	3,981,637.10
AVALARA INC	4,011	130.32	522,713.52
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,879	62.71	494,092.09

BLACK KNIGHT INC	8,009	73.26	586,739.34
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	5,360	159.07	852,615.20
CADENCE DESIGN SYSTEMS	13,022	125.19	1,630,224.18
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,963	86.21	600,280.23
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,676	119.70	679,417.20
CITRIX SYSTEMS INC	5,416	118.07	639,467.12
CLOUDFLARE INC - CLASS A	9,908	90.13	893,008.04
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	24,980	71.25	1,779,825.00
COUPA SOFTWARE INC	3,189	217.36	693,161.04
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	8,169	213.95	1,747,757.55
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,100	132.59	278,439.00
DATADOG INC - CLASS A	8,853	91.72	811,997.16
DOCUSIGN INC	8,685	237.75	2,064,858.75
DROPBOX INC-CLASS A	16,505	29.07	479,800.35
DYNATRACE INC	8,780	53.23	467,359.40
EPAM SYSTEMS INC	2,602	492.98	1,282,733.96
FAIR ISAAC CORP	1,345	491.19	660,650.55
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	29,079	145.13	4,220,235.27
FISERV INC	28,111	111.11	3,123,413.21
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,879	271.23	1,052,101.17
FORTINET INC	6,422	225.52	1,448,289.44
GARTNER INC	4,134	230.29	952,018.86
GLOBAL PAYMENTS INC	14,011	191.95	2,689,411.45
GODADDY INC - CLASS A	8,747	81.14	709,731.58
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3,640	106.56	387,878.40
HUBSPOT INC	2,023	497.35	1,006,139.05
INTL BUSINESS MACHINES CORP	41,787	150.67	6,296,047.29
INTUIT INC	12,789	468.33	5,989,472.37
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,514	159.72	561,256.08
MASTERCARD INC-CLASS A	41,447	363.33	15,058,938.51
MICROSOFT CORP	335,078	253.59	84,972,430.02
MONGODB INC	2,666	330.30	880,579.80
NORTONLIFELOCK INC	25,891	28.60	740,482.60
OKTA INC	5,585	217.16	1,212,838.60
ORACLE CORP	89,401	84.52	7,556,172.52
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	24,206	24.17	585,059.02
PALO ALTO NETWORKS INC	4,439	352.39	1,564,259.21
PAYCHEX INC	15,091	103.58	1,563,125.78
PAYCOM SOFTWARE INC	2,306	327.68	755,630.08
PAYPAL HOLDINGS INC	52,256	263.60	13,774,681.60
PTC INC	5,381	134.74	725,035.94
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,503	261.27	915,228.81

SALESFORCE.COM INC	42,706	236.09	10,082,459.54
SERVICENOW INC	9,145	464.71	4,249,772.95
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	23,043	44.02	1,014,352.86
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,141	247.01	281,838.41
SPLUNK INC	7,452	116.07	864,953.64
SQUARE INC - A	17,982	210.21	3,779,996.22
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,662	73.02	778,539.24
SYNOPSYS INC	7,085	256.06	1,814,185.10
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,954	585.30	1,143,676.20
TWILIO INC - A	7,460	314.61	2,346,990.60
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,028	416.31	844,276.68
UNITY SOFTWARE INC	2,516	98.66	248,228.56
VERISIGN INC	4,769	217.81	1,038,735.89
VISA INC-CLASS A SHARES	79,470	232.31	18,461,675.70
VMWARE INC-CLASS A	3,884	162.00	629,208.00
WESTERN UNION CO	20,387	25.17	513,140.79
WIX.COM LTD	2,353	266.04	625,992.12
WORKDAY INC-CLASS A	8,412	225.46	1,896,569.52
ZENDESK INC	5,395	136.50	736,417.50
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	9,544	333.63	3,184,164.72
ZSCALER INC	3,401	195.99	666,561.99
AMPHENOL CORPORATION	27,943	68.14	1,904,036.02
APPLE INC	785,112	127.13	99,811,288.56
ARISTA NETWORKS INC	2,873	359.73	1,033,504.29
ARROW ELECTRONICS INC	3,851	121.11	466,394.61
CDW CORP/DE	6,651	165.81	1,102,802.31
CISCO SYSTEMS	198,333	54.02	10,713,948.66
COGNEX CORP	8,069	78.95	637,047.55
CORNING	35,643	42.76	1,524,094.68
DELL TECHNOLOGIES -C	12,252	103.96	1,273,717.92
F5 NETWORKS INC	2,841	187.74	533,369.34
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	59,737	15.65	934,884.05
HP INC	58,057	30.05	1,744,612.85
IPG PHOTONICS CORP	1,782	203.20	362,102.40
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	28.48	464,451.84
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	8,628	146.97	1,268,057.16
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,906	209.12	1,653,302.72
NETAPP INC	10,843	82.01	889,234.43
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,880	99.33	981,380.40
TE CONNECTIVITY LTD	15,454	135.69	2,096,953.26
TRIMBLE IMS HOLDINGS	11,609	78.16	907,359.44
WESTERN DIGITAL CORP	15,203	74.86	1,138,096.58

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,482	505.35	1,254,278.70
AT&T INC	334,473	29.01	9,703,061.73
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,831	27.62	216,292.22
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,877	27.64	521,760.28
LUMEN TECHNOLOGIES INC	42,975	15.28	656,658.00
T-MOBILE US INC	29,005	147.27	4,271,566.35
VERIZON COMMUNICATIONS	194,251	57.05	11,082,019.55
AES CORP	30,838	25.20	777,117.60
ALLIANT ENERGY CORPORATION	12,663	58.30	738,252.90
AMEREN CORPORATION	11,479	85.36	979,847.44
AMERICAN ELECTRIC POWER	23,193	84.45	1,958,648.85
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,442	157.60	1,330,459.20
ATMOS ENERGY CORP	6,189	101.15	626,017.35
CENTERPOINT ENERGY INC	27,008	25.77	695,996.16
CMS ENERGY CORP	13,272	59.93	795,390.96
CONSOLIDATED EDISON INC	15,585	76.88	1,198,174.80
DOMINION ENERGY INC	38,186	76.50	2,921,229.00
DTE ENERGY COMPANY	9,012	138.99	1,252,577.88
DUKE ENERGY CORP	35,874	101.39	3,637,264.86
EDISON INTL	17,598	56.89	1,001,150.22
ENTERGY CORP	9,296	107.62	1,000,435.52
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,385	47.51	540,901.35
EVERGY INC	10,471	63.36	663,442.56
EVERSOURCE ENERGY	15,980	82.56	1,319,308.80
EXELON CORP	45,584	46.36	2,113,274.24
FIRSTENERGY CORP	25,172	38.49	968,870.28
NEXTERA ENERGY INC	90,964	72.45	6,590,341.80
NISOURCE INC	20,005	25.62	512,528.10
NRG ENERGY INC	12,298	36.67	450,967.66
PG&E CORP	68,966	10.28	708,970.48
PINNACLE WEST CAPITAL	6,029	87.16	525,487.64
PPL CORPORATION	35,742	28.99	1,036,160.58
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	23,582	61.13	1,441,567.66
SEMPRA ENERGY	14,758	139.44	2,057,855.52
SOUTHERN CO	49,296	63.63	3,136,704.48
UGI CORP	9,579	47.86	458,450.94
VISTRA CORP	23,603	18.28	431,462.84
WEC ENERGY GROUP INC	14,672	92.91	1,363,175.52
XCEL ENERGY INC	24,521	69.35	1,700,531.35
ADVANCED MICRO DEVICES	56,366	79.96	4,507,025.36
ANALOG DEVICES	17,289	166.37	2,876,370.93
APPLIED MATERIALS	42,826	134.65	5,766,520.90

	BROADCOM INC	18,983	463.93	8,806,783.19
	ENPHASE ENERGY INC	5,566	136.97	762,375.02
	INTEL CORP	189,887	57.00	10,823,559.00
	KLA CORP	7,254	314.16	2,278,916.64
	LAM RESEARCH CORP	6,748	634.09	4,278,839.32
	MARVELL TECHNOLOGY INC	37,654	50.35	1,895,878.90
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	12,436	102.98	1,280,659.28
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,161	151.81	1,846,161.41
	MICRON TECHNOLOGY	52,179	78.66	4,104,400.14
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,981	340.51	674,550.31
	NVIDIA CORP	28,938	694.33	20,092,521.54
	NXP SEMICONDUCTORS NV	13,089	197.38	2,583,506.82
	ON SEMICONDUCTOR CORP	19,043	37.24	709,161.32
	QORVO INC	5,297	181.55	961,670.35
	QUALCOMM	53,058	132.89	7,050,877.62
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,742	168.53	1,304,759.26
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2,629	235.24	618,445.96
	TERADYNE INC	7,707	124.71	961,139.97
	TEXAS INSTRUMENTS	43,073	186.45	8,030,960.85
	XILINX INC	11,425	125.94	1,438,864.50
	アメリカドル 小計	14,833,670		1,741,063,394.30 (190,907,601,184)
カナダドル	CAMECO CORP	19,186	25.87	496,341.82
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	54,987	44.83	2,465,067.21
	CENOVUS ENERGY INC	65,155	12.01	782,511.55
	ENBRIDGE	94,735	48.19	4,565,279.65
	IMPERIAL OIL	11,645	41.25	480,356.25
	INTER PIPELINE LTD	18,856	20.20	380,891.20
	KEYERA CORP	10,963	34.62	379,539.06
	PARKLAND CORP	8,544	41.40	353,721.60
	PEMBINA PIPELINE CORP	25,294	39.17	990,765.98
	SUNCOR ENERGY	70,924	30.32	2,150,415.68
	TC ENERGY CORP	43,831	64.47	2,825,784.57
	AGNICO EAGLE MINES	11,143	85.67	954,620.81
	B2GOLD CORP	46,547	5.91	275,092.77
	BARRICK GOLD CORP	82,748	27.89	2,307,841.72
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	68.34	499,018.68
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	26,720	28.55	762,856.00
	FRANCO-NEVADA CORP	9,313	185.89	1,731,193.57
	IVANHOE MINES LTD-CL A	26,291	8.70	228,731.70
	KINROSS GOLD CORP	56,706	9.42	534,170.52
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	11,734	51.90	608,994.60

LUNDIN MINING CORP	30,173	12.85	387,723.05
NUTRIEN LTD	26,457	78.87	2,086,663.59
PAN AMERICAN SILVER CORP	9,343	38.23	357,182.89
TECK RESOURCES LTD-CL B	20,669	28.35	585,966.15
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,500	89.11	400,995.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	20,697	57.36	1,187,179.92
YAMANA GOLD INC	42,412	6.14	260,409.68
BALLARD POWER SYSTEMS INC	10,643	21.95	233,613.85
CAE INC	11,940	38.25	456,705.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,269	107.24	457,807.56
WSP GLOBAL INC	5,400	136.60	737,640.00
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	6,920	39.03	270,087.60
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,665	69.90	395,983.50
THOMSON REUTERS CORP	7,995	117.99	943,330.05
AIR CANADA	6,737	28.73	193,554.01
CANADIAN NATL RAILWAY CO	33,237	133.14	4,425,174.18
CP RAILWAY LIMITED	31,390	97.43	3,058,327.70
MAGNA INTERNATIONAL INC	13,183	119.40	1,574,050.20
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	43.49	434,900.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	13,329	82.05	1,093,644.45
QUEBECOR INC -CL B	5,999	32.36	194,127.64
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	21,310	36.34	774,405.40
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,586	202.77	524,363.22
DOLLARAMA INC	13,514	53.34	720,836.76
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	39,890	44.81	1,787,470.90
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	41.42	303,608.60
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	75.46	684,271.28
METRO INC	11,419	58.49	667,897.31
WESTON (GEORGE) LTD	3,705	117.91	436,856.55
SAPUTO INC	11,041	36.49	402,886.09
BAUSCH HEALTH COS INC	14,544	37.85	550,490.40
CANOPY GROWTH CORP	9,718	31.13	302,521.34
BANK MONTREAL	30,030	127.15	3,818,314.50
BANK NOVA SCOTIA	56,675	80.97	4,588,974.75
CANADIAN IMPERIAL BANK	20,799	144.40	3,003,375.60
NATIONAL BANK OF CANADA	16,160	91.91	1,485,265.60
ROYAL BANK OF CANADA	66,677	124.92	8,329,290.84
TORONTO-DOMINION BANK	84,951	87.37	7,422,168.87
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	59,948	60.02	3,598,078.96
IGM FINANCIAL INC	3,890	44.45	172,910.50
ONEX CORP	3,361	86.40	290,390.40
TMX GROUP LTD	2,508	130.77	327,971.16

	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,198	562.78	674,210.44
	GREAT-WEST LIFECO INC	12,491	36.67	458,044.97
	IA FINANCIAL CORP INC	5,415	70.14	379,808.10
	INTACT FINANCIAL CORP	6,593	167.58	1,104,854.94
	MANULIFE FINANCIAL CORP	90,426	25.00	2,260,650.00
	POWER CORP OF CANADA	25,684	39.68	1,019,141.12
	SUN LIFE FINANCIAL INC	27,175	64.55	1,754,146.25
	FIRSTSERVICE CORP	2,028	205.91	417,585.48
	BLACKBERRY LIMITED	25,075	18.30	458,872.50
	CGI INC - CL A	11,043	108.71	1,200,484.53
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	932	1,772.76	1,652,212.32
	LIGHTSPEED POS INC-SUB VOTE	4,310	85.74	369,539.40
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,153	83.00	178,699.00
	OPEN TEXT CORP	12,469	59.59	743,027.71
	SHOPIFY INC - CLASS A	5,243	1,472.02	7,717,800.86
	BCE INC	3,102	61.26	190,028.52
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	16,322	62.47	1,019,635.34
	TELUS CORP	23,120	27.49	635,568.80
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,057	19.16	518,412.12
	ALTAGAS INCOME LTD	14,516	24.90	361,448.40
	ATCO LTD -CLASS I	4,372	45.16	197,439.52
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,264	50.99	319,401.36
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	35.63	212,996.14
	EMERA INC	11,366	57.03	648,202.98
	FORTIS INC	22,342	55.97	1,250,481.74
	HYDRO ONE LTD	14,776	30.45	449,929.20
	NORTHLAND POWER INC	9,907	41.00	406,187.00
	カナダドル 小計	1,904,063		110,299,418.73 (9,983,200,389)
ユーロ	ENI	116,874	10.44	1,220,632.05
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	23,722	9.62	228,395.41
	NESTE OIL OYJ	19,525	55.44	1,082,466.00
	OMV AG	5,822	50.32	292,963.04
	REPSOL SA	68,089	11.25	766,409.78
	TENARIS SA	19,529	9.53	186,228.54
	TOTALENERGIES SE	117,879	40.01	4,716,928.18
	VOPAK	3,661	39.35	144,060.35
	AIR LIQUIDE	22,094	141.98	3,136,906.12
	AKZO NOBEL	9,224	105.45	972,670.80
	ARCELORMITTAL	35,308	26.47	934,602.76
	ARKEMA	2,799	107.60	301,172.40
	BASF SE	42,880	67.45	2,892,256.00



COVESTRO AG	8,282	54.68	452,859.76
CRH PLC	36,478	42.71	1,557,975.38
EVONIK INDUSTRIES AG	9,603	28.76	276,182.28
FUCHS PETROLUB SE -PREF	3,246	41.30	134,059.80
HEIDELBERGCEMENT AG	6,738	74.00	498,612.00
KONINKLIJKE DSM NV	7,981	152.30	1,215,506.30
LANXESS	3,921	61.52	241,219.92
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,335	43.60	494,206.00
SOLVAY SA	3,676	112.45	413,366.20
STORA ENSO OYJ R	26,361	14.68	387,111.28
SYMRISE AG	5,851	110.90	648,875.90
UMICORE	9,946	49.58	493,122.68
UPM KYMMENE OYJ	24,581	31.89	783,888.09
VOESTALPINE AG	5,948	35.30	209,964.40
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	10,181	25.28	257,375.68
AIRBUS SE	27,407	110.60	3,031,214.20
ALSTOM	12,580	45.62	573,899.60
BOUYGUES ORD	11,344	33.95	385,128.80
BRENTAG SE	6,989	76.76	536,475.64
CNH INDUSTRIAL NV	46,753	14.82	692,879.46
DASSAULT AVIATION SA	121	1,019.00	123,299.00
EIFFAGE	3,659	90.86	332,456.74
FERROVIAL SA	21,875	25.25	552,343.75
GEA GROUP AG	7,649	33.98	259,913.02
KINGSPAN GROUP PLC	7,694	78.86	606,748.84
KION GROUP AG	3,430	90.26	309,591.80
KNORR-BREMSE AG	3,221	99.94	321,906.74
KONE OYJ-B	15,737	66.62	1,048,398.94
LEGRAND SA	13,075	88.22	1,153,476.50
MTU AERO ENGINES AG	2,396	209.90	502,920.40
PRYSMIAN SPA	11,275	29.78	335,769.50
RATIONAL AG	268	714.60	191,512.80
SAFRAN SA	15,920	124.66	1,984,587.20
SAINT-GOBAIN	23,479	56.96	1,337,363.84
SCHNEIDER ELECTRIC SE	25,140	131.76	3,312,446.40
SIEMENS	35,805	136.00	4,869,480.00
SIEMENS ENERGY AG	18,121	25.33	459,004.93
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	12,322	25.29	311,623.38
THALES SA	4,746	86.18	409,010.28
VINCI S.A.	24,815	95.64	2,373,306.60
WARTSILA OYJ	18,738	12.14	227,573.01
BUREAU VERITAS SA	12,892	26.29	338,930.68

RANDSTAD NV	5,866	64.08	375,893.28
TELEPERFORMANCE	2,688	314.50	845,376.00
WOLTERS KLUWER	12,334	80.52	993,133.68
ADP	1,532	122.70	187,976.40
AENA SME SA	3,518	144.95	509,934.10
ATLANTIA SPA	26,089	15.78	411,814.86
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	18,089	10.89	197,025.38
DEUTSCHE POST AG-REG	46,149	56.67	2,615,263.83
GETLINK	18,993	12.73	241,780.89
INPOST SA	7,867	15.78	124,204.19
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	15,333	94.60	1,450,501.80
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,582	80.30	207,334.60
CONTINENTAL AG	4,993	129.38	645,994.34
DAIMLER AG	39,953	78.38	3,131,516.14
FAURECIA	5,347	44.61	238,529.67
FERRARI NV	5,821	174.80	1,017,510.80
MICHELIN	8,304	130.50	1,083,672.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	6,979	97.18	678,219.22
RENAULT SA	8,441	34.61	292,185.21
STELLANTIS NV	95,050	17.23	1,637,901.60
VALEO SA	10,032	27.70	277,886.40
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,638	231.00	1,995,378.00
VOLKSWAGEN STAMM	1,657	301.40	499,419.80
ADIDAS AG	8,871	293.50	2,603,638.50
ESSILORLUXOTTICA	13,235	146.40	1,937,604.00
HERMES INTERNATIONAL	1,465	1,193.00	1,747,745.00
KERING	3,523	744.60	2,623,225.80
LVMH	13,006	662.50	8,616,475.00
MONCLER SPA	9,963	57.60	573,868.80
PUMA SE	4,644	92.70	430,498.80
SEB SA	1,310	153.20	200,692.00
ACCOR	7,911	35.37	279,812.07
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,577	160.70	1,217,623.90
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,332	48.16	256,789.12
SODEXO	3,888	81.96	318,660.48
BOLLORE	37,200	4.45	165,837.60
PUBLICIS GROUPE	10,059	55.96	562,901.64
SCOUT24 AG	4,128	66.64	275,089.92
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,969	58.14	288,897.66
VIVENDI	33,016	29.00	957,464.00
DELIVERY HERO SE	7,305	110.55	807,567.75
HELLOFRESH SE	7,756	83.76	649,642.56

INDITEX	50,337	31.60	1,590,649.20
JUST EAT TAKEAWAY	5,259	77.55	407,835.45
PROSUS	22,719	84.81	1,926,798.39
ZALANDO SE	6,975	93.80	654,255.00
CARREFOUR	30,831	17.15	528,751.65
COLRUYT SA	2,228	52.02	115,900.56
JERONIMO MARTINS	13,062	15.86	207,163.32
KESKO OYJ-B SHS	14,326	29.91	428,490.66
KONINKLIJKE AHOLD NV	50,995	24.52	1,250,652.37
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	34,760	64.74	2,250,362.40
DANONE (GROUPE)	30,378	58.81	1,786,530.18
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	26,648	11.13	296,725.48
HEINEKEN HOLDING NV	5,127	83.70	429,129.90
HEINEKEN NV	11,984	98.70	1,182,820.80
JDE PEET'S BV	4,123	31.78	131,028.94
KERRY GROUP PLC-A	7,323	108.45	794,179.35
PERNOD-RICARD	9,706	180.80	1,754,844.80
REMY COINTREAU	1,020	166.70	170,034.00
BEIERSDORF AG	4,515	100.50	453,757.50
HENKEL AG & CO KGAA	4,647	80.20	372,689.40
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	8,553	93.08	796,113.24
LOREAL	11,771	382.00	4,496,522.00
AMPLIFON SPA	6,606	39.43	260,474.58
BIOMERIEUX	2,374	91.42	217,031.08
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,091	152.55	318,982.05
DIASORIN SPA	1,418	144.85	205,397.30
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	9,705	68.28	662,657.40
FRESENIUS SE&CO KGAA	20,026	45.23	905,876.11
KONINKLIJKE PHILIPS	42,449	46.47	1,972,817.27
ORPEA	2,344	106.15	248,815.60
SARTORIUS AG-VORZUG	1,216	409.70	498,195.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,190	47.43	578,171.70
ARGENX SE	2,207	236.40	521,734.80
BAYER	45,791	53.01	2,427,380.91
EUROFINS SCIENTIFIC	6,490	84.86	550,741.40
GRIFOLS SA	14,240	22.10	314,704.00
IPSEN	1,866	90.60	169,059.60
MERCK KGAA	5,937	154.55	917,563.35
ORION OYJ-CLASS B	5,393	37.57	202,615.01
QIAGEN N.V.	11,006	38.62	425,051.72
RECORDATI SPA	5,195	47.80	248,321.00
SANOFI	52,976	86.50	4,582,424.00

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,235	365.30	451,145.50
UCB (GROUPE)	5,237	79.94	418,645.78
ABN AMRO BANK NV-CVA	19,718	10.75	212,047.37
BANCO BILBAO VIZCAYA	307,517	5.26	1,619,077.00
BANCO SANTANDER SA	805,941	3.38	2,724,886.52
BNP PARIBAS	52,430	56.23	2,948,138.90
CAIXABANK	190,947	2.77	530,450.76
COMMERZBANK AG	46,222	6.62	305,989.64
CREDIT AGRICOLE SA	52,435	12.10	634,568.37
ERSTE GROUP BANK AG	14,009	33.90	474,905.10
FINECOBANK SPA	27,362	13.94	381,426.28
ING GROEP NV-CVA	181,624	11.03	2,003,675.96
INTESA SANPAOLO	768,339	2.45	1,885,119.73
KBC GROEP NV	10,838	67.40	730,481.20
MEDIOBANCA	29,447	9.96	293,468.80
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,866	20.72	162,983.52
SOCIETE GENERALE	38,744	26.17	1,014,124.20
UNICREDIT SPA	97,909	10.76	1,054,088.29
AMUNDI SA	2,812	74.10	208,369.20
DEUTSCHE BANK NAMEN	95,207	12.01	1,144,197.72
DEUTSCHE BOERSE	8,787	133.35	1,171,746.45
EURAZEO SA	2,340	73.05	170,937.00
EXOR NV	4,845	70.60	342,057.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,582	93.88	524,038.16
NATIXIS	40,748	4.00	162,992.00
SOFINA	752	355.80	267,561.60
WENDEL	1,047	115.00	120,405.00
AEGON	79,881	3.73	298,195.77
AGEAS	8,621	48.98	422,256.58
ALLIANZ SE-REG	19,282	217.60	4,195,763.20
ASSICURAZIONI GENERALI	50,794	17.18	872,640.92
AXA SA	89,924	22.46	2,019,693.04
CNP ASSURANCES	8,406	14.56	122,391.36
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,976	141.45	420,955.20
MUENCHENER RUECKVERSICH.	6,508	231.30	1,505,300.40
NN GROUP NV	13,557	40.86	553,939.02
POSTE ITALIANE SPA	25,777	12.08	311,386.16
SAMPO OYJ-A SHS	22,572	38.45	867,893.40
SCOR SE	6,702	25.95	173,916.90
AROUNDTOWN SA	52,418	7.10	372,587.14
DEUTSCHE WOHNEN SE	16,289	51.20	833,996.80
LEG IMMOBILIEN SE	3,774	121.20	457,408.80

VONOVIA SE	24,902	53.78	1,339,229.56
ADYEN NV	911	1,924.40	1,753,128.40
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	20,738	64.54	1,338,430.52
ATOS SE	5,368	53.20	285,577.60
BECHTLE AG	1,432	156.30	223,821.60
CAPGEMINI SA	7,448	150.30	1,119,434.40
DASSAULT SYSTEMES SA	6,086	189.10	1,150,862.60
EDEXRED	12,673	47.22	598,419.06
NEMETSCHEK SE	3,320	60.12	199,598.40
NEXI SPA	19,721	17.41	343,441.21
SAP SE	48,874	115.06	5,623,442.44
TEAMVIEWER AG	7,213	30.79	222,088.27
WORLDLINE SA	10,832	76.78	831,680.96
NOKIA OYJ	272,288	4.57	1,246,262.17
CELLNEX TELECOM SA	22,819	50.68	1,156,466.92
DEUTSCHE TELEKOM	155,446	17.38	2,702,584.15
ELISA A	6,367	50.02	318,477.34
ILIAD SA	637	134.30	85,549.10
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,877	9.46	140,855.43
KPN (KON.)	173,861	2.63	458,645.31
ORANGE	97,536	10.58	1,032,711.16
PROXIMUS	7,531	17.32	130,436.92
TELECOM ITALIA ORD	489,749	0.45	222,346.04
TELECOM ITALIA RNC	345,204	0.49	171,221.18
TELEFONICA	231,063	3.96	916,626.92
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	2.24	91,732.47
TELEFONICA SA-RTS	231,063	0.20	46,212.60
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,889	33.85	199,342.65
E.ON SE	109,829	10.10	1,109,272.90
EDP RENOVAVEIS SA	11,245	18.97	213,317.65
ELECTRICITE DE FRANCE	21,082	11.96	252,246.13
ELIA GROUP SA/NV	1,959	90.40	177,093.60
ENAGAS	11,944	19.54	233,385.76
ENDESA	17,138	21.71	372,065.98
ENEL	380,046	8.01	3,045,308.59
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	139,324	4.52	630,719.74
ENGIE	83,973	12.29	1,032,196.11
FORTUM OYJ	20,155	23.76	478,882.80
IBERDROLA SA	272,601	10.66	2,907,289.66
NATURGY ENERGY GROUP SA	14,147	21.78	308,121.66
RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,296	16.90	393,702.40
RWE STAMM	31,648	30.88	977,290.24

	SNAM SPA	90,959	4.98	453,430.61
	SUEZ	17,194	20.08	345,255.52
	TERNA SPA	63,339	6.42	407,143.09
	UNIPER SE	4,137	29.81	123,323.97
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,290	25.81	626,924.90
	VERBUND AG	3,100	74.95	232,345.00
	ASM INTERNATIONAL NV	2,248	266.90	599,991.20
	ASML HOLDING NV	19,578	562.40	11,010,667.20
	INFINEON TECHNOLOGIES	60,801	33.00	2,006,433.00
	STMICROELECTRONICS	31,427	30.56	960,566.25
	ユーロ 小計	9,146,813		222,178,465.69 (29,658,603,384)
イギリスポンド	BP PLC	949,608	3.24	3,083,851.98
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	192,131	14.02	2,694,060.88
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	173,536	13.33	2,313,234.88
	ANGLO AMERICAN PLC	59,983	31.02	1,860,972.57
	ANTOFAGASTA PLC	17,358	15.28	265,317.03
	BHP GROUP PLC	98,845	21.31	2,106,386.95
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,013	69.52	487,543.76
	EVRAZ PLC	16,676	6.24	104,191.64
	GLENCORE PLC	466,638	3.18	1,486,941.98
	JOHNSON MATTHEY PLC	8,824	31.45	277,514.80
	MONDI PLC	22,378	19.04	426,077.12
	RIO TINTO PLC REG	52,576	60.68	3,190,311.68
	ASHTREAD GROUP PLC	20,655	51.36	1,060,840.80
	BAE SYSTEMS PLC	156,168	5.34	834,249.45
	BUNZL PLC	15,472	22.82	353,071.04
	DCC PLC	4,499	60.86	273,809.14
	FERGUSON PLC	10,338	97.26	1,005,473.88
	MELROSE INDUSTRIES PLC	238,890	1.64	392,376.82
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	385,471	1.12	433,886.15
	SMITHS GROUP PLC	20,046	15.88	318,330.48
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,672	130.25	478,278.00
	EXPERIAN PLC	42,767	27.03	1,155,992.01
	INTERTEK GROUP PLC	7,435	53.54	398,069.90
	RELX PLC	90,321	18.86	1,703,454.06
	RENTOKIL INITIAL PLC	85,410	4.76	407,320.29
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	7.41	377,848.93
	BURBERRY GROUP PLC	18,587	22.37	415,791.19
	PERSIMMON PLC	14,327	31.13	445,999.51
	TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.67	277,632.25
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,550	46.03	301,496.50

COMPASS GROUP PLC	83,254	16.46	1,370,360.84
ENTAIN PLC	26,944	17.72	477,582.40
INTERCONTINENTAL HOTELS	7,987	52.10	416,122.70
WHITBREAD PLC	10,170	33.31	338,762.70
AUTO TRADER GROUP PLC	43,890	5.77	253,596.42
INFORMA PLC	69,112	5.64	390,344.57
PEARSON	34,302	8.52	292,321.64
WPP PLC	56,693	10.04	569,481.18
JD SPORTS FASHION PLC	22,866	9.21	210,778.78
KINGFISHER PLC	96,593	3.39	328,126.42
NEXT PLC	6,143	81.74	502,128.82
OCADO GROUP PLC	23,500	19.15	450,025.00
MORRISON SUPERMARKETS	111,872	1.76	197,677.82
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.62	214,969.17
TESCO PLC	359,660	2.26	814,809.73
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	15,871	23.54	373,603.34
BRITISH AMERICAN TOBACCO	101,284	28.11	2,847,093.24
COCA-COLA HBC AG-CDI	9,115	26.39	240,544.85
DIAGEO	109,617	34.60	3,792,748.20
IMPERIAL BRANDS PLC	45,617	16.20	739,223.48
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	33,311	64.55	2,150,225.05
UNILEVER PLC	123,338	42.76	5,273,932.88
SMITH & NEPHEW PLC	42,096	15.06	633,965.76
ASTRAZENECA	61,548	81.30	5,003,852.40
GLAXOSMITHKLINE	235,119	13.80	3,245,582.67
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	8,586	24.46	210,013.56
BARCLAYS	811,088	1.80	1,464,013.84
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	955,091	4.38	4,184,253.67
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,308,712	0.48	1,595,957.23
NATWEST GROUP PLC	223,727	2.04	456,626.80
STANDARD CHARTERED PLC	124,429	4.97	618,785.41
3I GROUP PLC	45,010	12.08	543,720.80
HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,246	16.43	299,873.01
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	14,742	74.96	1,105,060.32
M&G PLC	118,170	2.41	285,616.89
SCHRODERS PLC	5,525	35.58	196,579.50
ST JAMES'S PLACE PLC	26,728	14.26	381,141.28
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	100,722	2.77	278,999.94
ADMIRAL GROUP PLC	9,872	30.39	300,010.08
AVIVA PIC	182,528	4.14	755,665.92
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	68,857	2.92	201,613.29
LEGAL & GENERAL GROUP	289,782	2.74	794,292.46

	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	29,063	7.15	207,974.82
	PRUDENTIAL	122,059	14.51	1,771,686.38
	AVEVA GROUP PLC	4,523	34.89	157,807.47
	SAGE GROUP PLC	48,541	6.52	316,681.48
	HALMA PLC	17,484	26.80	468,571.20
	BT GROUP PLC	413,941	1.83	758,132.94
	VODAFONE GROUP PLC	1,254,547	1.28	1,608,831.07
	NATIONAL GRID PLC	164,441	9.13	1,501,346.33
	SEVERN TRENT PLC	11,927	24.69	294,477.63
	SSE PLC	50,382	15.46	778,905.72
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	10.05	348,895.80
	イギリスポンド 小計	13,678,559		81,943,720.57 (12,680,790,758)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	8,748	19.50	170,629.74
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	310	848.00	262,880.00
	GIVAUDAN-REG	429	4,169.00	1,788,501.00
	HOLCIM LTD	24,228	55.52	1,345,138.56
	SIKA AG-BR	6,585	291.80	1,921,503.00
	ABB LTD	80,625	31.15	2,511,468.75
	GEBERIT AG-REG	1,777	667.40	1,185,969.80
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	911	261.80	238,499.80
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,021	270.40	546,478.40
	ADECCO GROUP AG-REG	6,959	61.70	429,370.30
	SGS SA	277	2,806.00	777,262.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,730	318.00	868,140.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	24,303	116.25	2,825,223.75
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,285	330.80	425,078.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	63.95	192,105.80
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	149	2,074.00	309,026.00
	CHOCOLAFABRIKEN LINDT-REG	5	92,500.00	462,500.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	55	8,770.00	482,350.00
	NESTLE SA - REGISTERED	135,176	113.92	15,399,249.92
	ALCON INC	22,791	62.42	1,422,614.22
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,490	325.50	810,495.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	468	1,388.50	649,818.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,460	645.00	2,231,700.00
	NOVARTIS	104,076	82.25	8,560,251.00
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,599	361.20	577,558.80
	ROCHE HOLDING GENUSS	32,944	340.15	11,205,901.60
	VIFOR PHARMA AG	2,126	136.85	290,943.10
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,566	82.20	128,725.20
	CREDIT SUISSE GROUP AG	113,012	9.66	1,092,147.96



	JULIUS BAER GROUP LTD	10,425	60.54	631,129.50	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,050	1,372.50	1,441,125.00	
	UBS GROUP AG	170,843	14.60	2,495,162.01	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	146.30	341,464.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,385	456.20	631,837.00	
	SWISS RE LTD	13,932	83.88	1,168,616.16	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,019	370.90	2,603,347.10	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,622	94.25	341,373.50	
	TEMENOS AG - REG	3,520	142.60	501,952.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,298	124.65	1,034,345.70	
	SWISSCOM	1,176	522.60	614,577.60	
	スイスフラン 小計	807,713		70,916,459.47 (8,676,628,816)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	9,250	298.10	2,757,425.00	
	BOLIDEN AB	13,081	347.90	4,550,879.90	
	SCA SV CELLULOSA B	26,880	134.80	3,623,424.00	
	ALFA LAVAL AB	14,260	302.50	4,313,650.00	
	ASSA ABLOY AB-B	46,068	259.60	11,959,252.80	
	ATLAS COPCO A	31,072	509.80	15,840,505.60	
	ATLAS COPCO B	17,773	436.30	7,754,359.90	
	EPIROC AB-A	29,649	182.70	5,416,872.30	
	EPIROC AB-A RED SHS	29,649	3.00	88,947.00	
	EPIROC AB-B	17,442	161.05	2,809,034.10	
	EPIROC AB-B RED SHS	21,132	3.00	63,396.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,081	275.50	2,226,315.50	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	65,860	88.40	5,822,024.00	
	SANDVIK AB	51,973	227.70	11,834,252.10	
	SKANSKA B	14,869	243.10	3,614,653.90	
	SKF AB-B	18,340	223.60	4,100,824.00	
	VOLVO AB-A SHS	8,748	233.00	2,038,284.00	
	VOLVO B	65,760	226.10	14,868,336.00	
	SECURITAS B	15,577	132.70	2,067,067.90	
	ELECTROLUX AB-SER B	12,053	235.10	2,833,660.30	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	117.60	2,568,501.60	
	EVOLUTION AB	7,849	1,594.00	12,511,306.00	
	EMBRACER GROUP AB	11,439	249.00	2,848,311.00	
	HENNES & MAURITZ B	33,524	210.55	7,058,478.20	
	ICA GRUPPEN AB	4,719	406.10	1,916,385.90	
	SWEDISH MATCH AB	74,128	78.64	5,829,425.92	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	27,655	291.20	8,053,136.00	
	NORDEA BANK ABP	149,277	91.66	13,682,729.82	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	74,165	108.15	8,020,944.75	

	SVENSKA HANDELSBK A	70,420	92.60	6,520,892.00	
	SWEDBANK AB-A	40,897	151.52	6,196,713.44	
	EQT AB	12,798	325.00	4,159,350.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	5,765	340.60	1,963,559.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	325.00	2,805,075.00	
	INVESTOR AB-B SHS	84,132	194.95	16,401,533.40	
	KINNEVIK AB - B	10,757	311.90	3,355,108.30	
	KINNEVIK AB-B-RED	10,757	174.00	1,871,718.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,093	543.80	2,225,773.40	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	5,413	573.20	3,102,731.60	
	SINCH AB	2,028	1,586.50	3,217,422.00	
	ERICSSON (LM) B	134,930	108.42	14,629,110.60	
	HEXAGON AB-B SHS	90,307	121.00	10,927,147.00	
	TELE2 AB-B SHS	24,520	114.40	2,805,088.00	
	TELIA CO AB	108,487	36.45	3,954,893.58	
	スウェーデンクローナ 小計	1,536,049		255,208,498.81 (3,384,064,694)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	43,502	191.10	8,313,232.20	
	NORSK HYDRO	61,358	53.26	3,267,927.08	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,270	466.30	3,390,001.00	
	ADEVINTA ASA	16,857	161.90	2,729,148.30	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	4,706	362.20	1,704,513.20	
	SCHIBSTED ASA-CL A	4,047	420.00	1,699,740.00	
	MOWI ASA	23,314	230.10	5,364,551.40	
	ORKLA	39,803	88.38	3,517,789.14	
	DNB ASA	41,479	186.45	7,733,759.55	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	187.05	2,086,168.65	
	TELENOR ASA	30,180	143.15	4,320,267.00	
	ノルウェークローネ 小計	283,669		44,127,097.52 (584,684,042)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,314	556.00	2,954,584.00	
	NOVOZYMES A/S	9,034	455.40	4,114,083.60	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	428	3,058.00	1,308,824.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	48,316	217.80	10,523,224.80	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	152	17,500.00	2,660,000.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	301	18,290.00	5,505,290.00	
	DSV PANALPINA A S	9,482	1,477.00	14,004,914.00	
	PANDORA A/S	4,249	819.20	3,480,780.80	
	CARLSBERG AS-B	4,526	1,126.00	5,096,276.00	
	AMBU A/S-B	8,639	241.70	2,088,046.30	
	COLOPLAST-B	5,263	981.40	5,165,108.20	
	DEMANT A/S	4,463	343.20	1,531,701.60	

	GN STORE NORD A/S	6,740	529.80	3,570,852.00
	GENMAB A/S	3,223	2,607.00	8,402,361.00
	NOVO NORDISK A/S-B	80,231	506.90	40,669,093.90
	DANSKE BANK A/S	31,666	113.35	3,589,341.10
	TRYG A/S	16,972	145.15	2,463,485.80
	ORSTED A/S	8,594	857.60	7,370,214.40
	デンマーククローネ 小計	247,593		124,498,181.50 (2,234,742,357)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	12,821	29.72	381,040.12
	OIL SEARCH LTD	110,184	4.21	463,874.64
	ORIGIN ENERGY LIMITED	87,883	4.84	425,353.72
	SANTOS	83,906	7.67	643,559.02
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	4,845	30.79	149,177.55
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	48,027	23.76	1,141,121.52
	BHP GROUP LTD	137,818	48.67	6,707,602.06
	BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	22.32	480,973.68
	EVOLUTION MINING LTD	88,310	4.90	432,719.00
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	78,225	22.65	1,771,796.25
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	20,170	43.51	877,596.70
	NEWCREST MINING LIMITED	37,270	27.50	1,024,925.00
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	58,122	10.90	633,529.80
	ORICA LTD	19,570	14.20	277,894.00
	RIO TINTO LTD	17,196	124.80	2,146,060.80
	SOUTH32 LTD	217,613	2.99	650,662.87
	REECE LTD	12,870	23.02	296,267.40
	BRAMBLES LTD	66,936	11.11	743,658.96
	AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	3.72	348,206.88
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	39,948	4.81	192,149.88
	TRANSURBAN GROUP	126,500	14.42	1,824,130.00
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	26,199	40.80	1,068,919.20
	CROWN RESORTS LTD	18,801	12.47	234,448.47
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,685	116.22	312,050.70
	TABCORP HOLDINGS LTD	98,817	5.08	501,990.36
	REA GROUP LTD	3,000	165.03	495,090.00
	SEEK LTD	17,113	29.95	512,534.35
WESFARMERS LTD	52,759	54.33	2,866,396.47	
COLES GROUP LTD	60,959	16.76	1,021,672.84	
WOOLWORTHS GROUP LTD	58,785	42.63	2,506,004.55	
TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	11.91	410,656.80	
COCHLEAR LIMITED	3,460	234.55	811,543.00	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,641	63.49	612,107.09	
SONIC HEALTHCARE LTD	20,560	35.63	732,552.80	

	CSL LIMITED	21,276	294.11	6,257,484.36
	AUST AND NZ BANKING GROUP	132,501	28.73	3,806,753.73
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	83,045	101.08	8,394,188.60
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	153,560	26.56	4,078,553.60
	WESTPAC BANKING	168,595	26.55	4,476,197.25
	ASX LTD	8,713	74.11	645,720.43
	MACQUARIE GROUP LIMITED	15,958	151.41	2,416,200.78
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	6,690	49.35	330,151.50
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	114,505	5.22	597,716.10
	MEDIBANK PRIVATE LTD	129,252	3.11	401,973.72
	QBE INSURANCE GROUP	66,253	11.23	744,021.19
	SUNCORP GROUP LIMITED	57,398	11.26	646,301.48
	AFTERPAY LTD	9,769	98.84	965,567.96
	COMPUTERSHARE LIMITED	21,970	16.13	354,376.10
	WISETECH GLOBAL LTD	6,445	29.89	192,641.05
	XERO LTD	5,491	129.28	709,876.48
	TELSTRA CORP	199,810	3.57	713,321.70
	AGL ENERGY LTD	32,928	9.16	301,620.48
	AUSNET SERVICES	80,543	1.80	144,977.40
	オーストラリアドル 小計	3,105,328		69,875,910.39 (5,917,790,850)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	64,661	7.70	497,889.70
	A2 MILK CO LTD	40,302	6.15	247,857.30
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	24,554	29.35	720,659.90
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,000	12.90	283,800.00
	SPARK NEW ZEALAND LTD	104,543	4.79	500,760.97
	MERCURY NZ LTD	19,343	6.52	126,116.36
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	5.40	345,783.60
	ニュージーランドドル 小計	339,437		2,722,867.83 (213,990,182)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	121,448	60.00	7,286,880.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	62,000	135.70	8,413,400.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	102,000	30.25	3,085,500.00
	MTR CORP	82,500	43.25	3,568,125.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	97,000	62.75	6,086,750.00
	SANDS CHINA LTD	127,000	33.95	4,311,650.00
	SJM HOLDINGS LTD	92,000	8.72	802,240.00
	WYNN MACAU LTD	60,800	13.06	794,048.00
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	89,600	16.00	1,433,600.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	83,000	25.95	2,153,850.00
	WH GROUP LTD	516,000	7.31	3,771,960.00
	BANK EAST ASIA	46,964	15.74	739,213.36

	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	161,500	28.50	4,602,750.00	
	HANG SENG BANK	33,600	160.80	5,402,880.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	55,900	466.40	26,071,760.00	
	AIA GROUP LTD	564,600	96.35	54,399,210.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	111,948	51.60	5,776,516.80	
	ESR CAYMAN LTD	92,400	24.40	2,254,560.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	115,000	19.78	2,274,700.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	79,761	38.40	3,062,822.40	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	76,250	41.90	3,194,875.00	
	SINO LAND CO	116,600	12.70	1,480,820.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	58,500	122.20	7,148,700.00	
	SWIRE PACIFIC A	20,000	58.55	1,171,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,000	23.20	1,600,800.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	81,000	44.60	3,612,600.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	47.90	1,532,800.00	
	CLP HOLDINGS	72,500	78.00	5,655,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	519,990	12.20	6,343,878.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	48.45	3,561,075.00	
	香港ドル 小計	3,814,361		181,593,963.56 (2,565,922,705)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	80,200	5.21	417,842.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	3.88	290,224.00	
	SINGAPORE AIRLINES	54,650	5.02	274,343.00	
	SINGAPORE AIRLINES-MCB RTS	114,218	0.00	114.21	
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	0.88	281,336.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	81,700	4.78	390,526.00	
	DBS GROUP	82,800	29.72	2,460,816.00	
	OCBC BANK	153,850	12.36	1,901,586.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	53,600	26.03	1,395,208.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	10.47	444,975.00	
	CAPITALAND LTD	118,900	3.70	439,930.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	7.66	168,520.00	
	UOL GROUP LIMITED	24,800	7.42	184,016.00	
	VENTURE CORP LTD	14,300	19.00	271,700.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	364,580	2.34	853,117.20	
	シンガポールドル 小計	1,602,598		9,774,253.41 (809,014,954)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	28,484	23.84	679,058.56	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,248	424.00	529,152.00	
	BANK HAPUALIM BM	44,385	27.15	1,205,052.75	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,692	25.45	1,799,111.40	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,227	16.25	1,043,688.75	

	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,272	102.40	642,252.80	
	AZRIELI GROUP	1,471	241.20	354,805.20	
	NICE LTD	3,165	726.80	2,300,322.00	
	イスラエルシェケル 小計	219,944		8,553,443.46 (289,162,841)	
	合 計	51,519,797		267,906,197,156 (267,906,197,156)	

## (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	583,960.05	
		LENDLEASE GROUP	36,448	459,973.76	
		SYDNEY AIRPORT	64,383	392,092.47	
		オーストラリアドル 小計	164,236	1,436,026.28 (121,617,065)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000	1,033,500.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	1,942,500.00	
		香港ドル 小計	315,000	2,976,000.00 (42,050,880)	
	投資信託受益証券合計	479,236	163,667,945 (163,667,945)		
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	24,811	462,973.26	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6,274	1,194,695.08	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	20,560	5,489,725.60	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	71,103	678,322.62	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,501	1,370,150.76	
		BOSTON PROPERTIES	6,840	837,079.20	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,093	676,503.19	
		CROWN CASTLE INTL CORP	20,201	3,981,415.09	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	13,086	2,105,275.68	
		DUKE REALTY CORP	17,311	845,123.02	
		EQUINIX INC	4,103	3,323,471.03	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,979	682,852.95	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	16,454	1,305,624.90	
		ESSEX PROPERTY TRUST	3,024	937,560.96	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,989	949,675.73	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	24,947	863,415.67	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,496	578,753.76	
		INVITATION HOMES INC	27,833	1,042,345.85	
IRON MOUNTAIN INC	13,240	622,544.80			

	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	27,097	586,379.08	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,299	893,888.31	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	12,315	460,211.55	
	PROLOGIS INC	34,369	4,248,352.09	
	PUBLIC STORAGE	7,348	2,159,136.32	
	REALTY INCOME CORP	17,346	1,230,872.16	
	REGENCY CENTERS CORP	7,026	474,536.04	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,181	1,640,874.51	
	SIMON PROPERTY GROUP	15,322	2,077,509.98	
	SUN COMMUNITIES INC	5,410	948,427.10	
	UDR INC	14,820	736,109.40	
	VENTAS INC	17,397	1,003,806.90	
	VEREIT INC	11,046	544,346.88	
	VICI PROPERTIES INC	24,821	810,405.65	
	VORNADO REALTY TRUST	7,639	383,554.19	
	WELLTOWER INC	19,456	1,533,911.04	
	WP CAREY INC	8,887	685,187.70	
	アメリカドル 小計	569,624	48,365,018.05 (5,303,224,229)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,069	288,628.86	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	195,716.60	
	カナダドル 小計	14,014	484,345.46 (43,838,107)	
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	-	
	COVIVIO(FP)	3,076	251,001.60	
	GECINA SA	1,966	267,474.30	
	KLEPIERRE	8,356	215,250.56	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,185	510,819.15	
	ユーロ 小計	1,625,167	1,244,545.61 (166,134,393)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	39,175	202,926.50	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	233,021.26	
	SEGRO PLC	55,104	594,847.68	
	イギリスポンド 小計	126,411	1,030,795.44 (159,515,594)	
オーストラリアドル	DEXUS	49,283	523,878.29	
	GOODMAN GROUP	76,627	1,551,696.75	
	GPT GROUP	85,529	406,262.75	
	MIRVAC GROUP	176,235	516,368.55	
	SCENTRE GROUP	234,255	665,284.20	
	STOCKLAND	121,481	572,175.51	
	VICINITY CENTERS	163,023	270,618.18	

オーストラリアドル 小計		906,433	4,506,284.23 (381,637,211)
香港ドル	LINK REIT	91,900	6,961,425.00
香港ドル 小計		91,900	6,961,425.00 (98,364,935)
シンガポールドドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	135,809	400,636.55
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	196,300	422,045.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	132,200	281,586.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	168,542	340,454.84
シンガポールドドル 小計		632,851	1,444,722.39 (119,579,672)
投資証券合計		3,966,400	6,272,294,141 (6,272,294,141)
合計			6,435,962,086 (6,435,962,086)

(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 601銘柄	97.3%			69.6%
	投資証券 36銘柄			2.7%	1.9%
カナダドル	株式 89銘柄	99.6%			3.6%
	投資証券 2銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式 233銘柄	99.4%			10.8%
	投資証券 5銘柄			0.6%	0.1%
イギリスポンド	株式 83銘柄	98.8%			4.6%
	投資証券 3銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.0%			3.2%
スウェーデンクローナ	株式 44銘柄	100.0%			1.2%
ノルウェークローネ	株式 11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 53銘柄	92.2%			2.2%
	投資信託受 益証券 3銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.9%	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	30銘柄	94.8%			0.9%
	投資信託受益証券	2銘柄		1.6%		0.0%
	投資証券	1銘柄			3.6%	0.0%
シンガポールドル	株式	15銘柄	87.1%			0.3%
	投資証券	4銘柄			12.9%	0.0%
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

	2021年 6月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	75,883,724
コール・ローン	1,756,634,764
国債証券	145,328,625,001
派生商品評価勘定	18,355,956
未収入金	14,520,242
未収利息	803,485,220
前払費用	26,433,931
差入委託証拠金	324,339,089
流動資産合計	148,348,277,927
資産合計	148,348,277,927
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	189,534
前受金	8,877,428
未払金	11,760
未払解約金	168,816,099
未払利息	1,937
流動負債合計	177,896,758
負債合計	177,896,758
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	55,650,103,041
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	92,520,278,128

	2021年 6月10日現在
項目	金額（円）
元本等合計	148,170,381,169
純資産合計	148,170,381,169
負債純資産合計	148,348,277,927

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021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）

		2021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			55,650,103,041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)		2.6625円 (26,625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

		2021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

		2021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。	

	2021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>(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	2021年 6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	6,619,254,526円
期中一部解約元本額	6,687,594,235円
期末元本額	55,650,103,041円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,076,378,992円
D C 外国債券インデックスファンド	1,921,887,522円

区分	2021年 6月10日現在
D C 外国債券インデックスファンド L	13,869,251,530円
D C バランスファンド 3 0	860,819,938円
D C バランスファンド 5 0	878,602,457円
D C バランスファンド 7 0	202,587,759円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	455,976,490円
外国債券インデックス e	1,090,400,235円
インデックスコレクション(外国債券)	7,733,680,109円
インデックスコレクション(バランス株式 3 0)	4,547,048,015円
インデックスコレクション(バランス株式 5 0)	674,299,959円
インデックスコレクション(バランス株式 7 0)	178,607,239円
私募外国債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	3,939,639,460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)	1,814,484,814円
外国債券インデックスファンド V A (適格機関投資家専用)	502,602,440円
バランス V A 3 0 (適格機関投資家専用)	106,766,127円
バランス V A 5 0 (適格機関投資家専用)	521,581,452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)	306,295,920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)	187,320,599円
V A バランス株式 3 0 (適格機関投資家専用)	141,857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)	526,512,662円
バランス V A 2 5 (適格機関投資家専用)	1,574,740,185円
バランス V A 3 7 . 5 (適格機関投資家専用)	611,259,927円
バランス V A 5 0 L (適格機関投資家専用)	6,482,352,202円
バランス V A 7 5 (適格機関投資家専用)	363,996,249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)	251,947,258円
V A ポートフォリオ 4 0 (適格機関投資家専用)	1,631,436,793円
V A ポートフォリオ 2 0 (適格機関投資家専用)	103,280,149円
バランス V A 4 0 (適格機関投資家専用)	195,895,783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)	101,124,085円
V A バランス 5 0 - 5 0 (適格機関投資家専用)	52,468,733円
V A ファンド 2 5 (適格機関投資家専用)	87,648,762円
バランス V A 2 5 L (適格機関投資家専用)	251,882,865円
世界バランス V A 2 5 (適格機関投資家専用)	72,968,073円
V A バランス 2 0 - 8 0 (適格機関投資家専用)	1,450,606,844円
私募外国債券インデックスファンド A L (適格機関投資家専用)	23,609,557円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021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	3,284,638,975
合計	3,284,638,975

(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

(2021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	1,769,838,047	-	1,778,715,475	8,877,428
	合計	1,769,838,047	-	1,778,715,475	8,877,428

(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

(2021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	1,622,984,319	-	1,632,233,706	9,249,387
	アメリカドル	724,472,031	-	728,034,832	3,562,801
	カナダドル	89,052,537	-	89,598,762	546,225
	ユーロ	681,378,584	-	686,162,758	4,784,174
	イギリスポンド	128,081,167	-	128,437,354	356,187
	売建	32,589,082	-	32,549,475	39,607
	イギリスポンド	32,589,082	-	32,549,475	39,607
	合計	1,655,573,401	-	1,664,783,181	9,288,994

(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 0.125% 01/15/24	5,000,000.00	4,986,328.15	
		T 0.125% 10/15/23	5,200,000.00	5,191,875.00	
		T 0.25% 03/15/24	4,500,000.00	4,499,648.46	
		T 0.25% 04/15/23	6,500,000.00	6,512,949.23	
		T 0.25% 05/31/25	1,180,000.00	1,167,001.56	
		T 0.25% 06/30/25	4,310,000.00	4,259,155.49	
		T 0.25% 07/31/25	2,200,000.00	2,171,382.81	
		T 0.25% 09/30/25	7,000,000.00	6,894,179.67	
		T 0.375% 01/31/26	1,700,000.00	1,676,359.37	
		T 0.375% 07/31/27	4,000,000.00	3,849,843.76	
		T 0.375% 09/30/27	4,000,000.00	3,837,343.76	
		T 0.375% 11/30/25	3,770,000.00	3,725,525.80	
		T 0.5% 03/15/23	3,980,000.00	4,005,885.56	
		T 0.5% 03/31/25	4,000,000.00	4,002,343.76	
		T 0.5% 06/30/27	6,000,000.00	5,828,671.86	
		T 0.5% 08/31/27	1,100,000.00	1,065,238.28	
		T 0.5% 10/31/27	3,580,000.00	3,455,399.20	
		T 0.625% 03/31/27	3,400,000.00	3,343,023.44	
		T 0.625% 05/15/30	7,400,000.00	6,906,859.41	
		T 0.625% 08/15/30	9,130,000.00	8,488,760.20	
		T 0.625% 11/30/27	3,700,000.00	3,595,792.97	
		T 0.625% 12/31/27	3,000,000.00	2,911,171.89	
		T 0.75% 01/31/28	3,500,000.00	3,419,882.83	
		T 0.75% 03/31/26	2,750,000.00	2,755,048.83	
		T 0.875% 11/15/30	6,160,000.00	5,844,781.28	
		T 1.125% 02/15/31	4,600,000.00	4,453,734.39	
		T 1.125% 05/15/40	3,920,000.00	3,328,937.50	
		T 1.125% 08/15/40	4,000,000.00	3,384,062.52	
		T 1.25% 03/31/28	5,300,000.00	5,339,335.96	
		T 1.25% 05/15/50	5,120,000.00	4,085,200.02	
		T 1.25% 07/31/23	3,950,000.00	4,041,806.65	
		T 1.375% 08/15/50	4,000,000.00	3,296,875.00	

T 1.375% 08/31/23	3,450,000.00	3,541,775.38	
T 1.375% 09/30/23	3,550,000.00	3,647,208.97	
T 1.375% 10/15/22	2,250,000.00	2,288,540.04	
T 1.375% 11/15/40	4,650,000.00	4,109,800.80	
T 1.5% 01/15/23	2,000,000.00	2,043,984.38	
T 1.5% 02/15/30	1,820,000.00	1,837,204.69	
T 1.5% 02/28/23	1,760,000.00	1,801,318.74	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,098,281.24	
T 1.5% 08/15/22	5,800,000.00	5,897,082.02	
T 1.5% 08/15/26	5,300,000.00	5,490,261.73	
T 1.5% 09/15/22	4,000,000.00	4,071,093.76	
T 1.5% 09/30/24	8,000,000.00	8,297,812.48	
T 1.625% 02/15/26	5,750,000.00	6,000,439.46	
T 1.625% 04/30/23	5,800,000.00	5,961,539.04	
T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	5,632,664.07	
T 1.625% 05/31/23	4,350,000.00	4,475,912.09	
T 1.625% 08/15/22	1,400,000.00	1,425,539.06	
T 1.625% 08/15/29	2,260,000.00	2,313,321.87	
T 1.625% 08/31/22	500,000.00	509,375.00	
T 1.625% 09/30/26	2,150,000.00	2,240,535.16	
T 1.625% 11/15/22	4,000,000.00	4,086,640.64	
T 1.625% 11/15/50	3,600,000.00	3,162,937.50	
T 1.625% 11/30/26	3,030,000.00	3,155,579.28	
T 1.75% 01/31/23	2,650,000.00	2,720,545.88	
T 1.75% 05/15/23	1,750,000.00	1,803,901.36	
T 1.75% 05/31/22	2,650,000.00	2,693,321.29	
T 1.75% 06/30/22	2,500,000.00	2,544,140.62	
T 1.75% 06/30/24	2,000,000.00	2,087,812.50	
T 1.75% 07/15/22	1,200,000.00	1,221,984.37	
T 1.75% 09/30/22	1,050,000.00	1,072,620.11	
T 1.75% 11/15/29	3,220,000.00	3,325,907.82	
T 1.875% 02/15/41	1,450,000.00	1,398,230.47	
T 1.875% 02/15/51	4,500,000.00	4,202,578.11	
T 1.875% 05/31/22	2,350,000.00	2,391,308.60	
T 1.875% 06/30/26	3,980,000.00	4,199,677.33	
T 1.875% 07/31/22	2,880,000.00	2,938,837.50	
T 1.875% 07/31/26	1,800,000.00	1,899,914.05	
T 1.875% 08/31/22	2,600,000.00	2,656,722.66	
T 1.875% 09/30/22	1,500,000.00	1,534,833.99	
T 1.875% 10/31/22	2,000,000.00	2,049,101.56	
T 2.125% 02/29/24	1,400,000.00	1,471,476.56	
T 2.125% 03/31/24	1,200,000.00	1,262,671.87	



T 2.125% 05/15/25	7,250,000.00	7,706,523.43
T 2.125% 06/30/22	1,100,000.00	1,123,826.17
T 2.125% 07/31/24	1,500,000.00	1,584,140.62
T 2.125% 09/30/24	2,200,000.00	2,327,101.56
T 2.125% 11/30/23	2,700,000.00	2,827,722.66
T 2.125% 11/30/24	1,400,000.00	1,483,070.31
T 2.125% 12/31/22	3,800,000.00	3,918,378.89
T 2.25% 01/31/24	5,090,000.00	5,360,406.25
T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	4,192,195.33
T 2.25% 03/31/26	1,500,000.00	1,609,628.91
T 2.25% 04/30/24	2,600,000.00	2,747,570.30
T 2.25% 08/15/27	2,320,000.00	2,493,818.76
T 2.25% 08/15/46	4,180,000.00	4,250,537.50
T 2.25% 08/15/49	4,110,000.00	4,174,860.93
T 2.25% 10/31/24	2,500,000.00	2,656,738.27
T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	5,316,406.25
T 2.25% 11/15/25	5,500,000.00	5,891,875.00
T 2.25% 11/15/27	5,260,000.00	5,653,472.66
T 2.25% 12/31/23	3,500,000.00	3,681,015.62
T 2.25% 12/31/24	2,900,000.00	3,087,140.62
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,184,277.35
T 2.375% 02/29/24	4,280,000.00	4,526,935.92
T 2.375% 04/30/26	1,820,000.00	1,964,817.96
T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,896,437.50
T 2.375% 05/15/29	3,890,000.00	4,206,670.31
T 2.375% 08/15/24	6,700,000.00	7,134,453.12
T 2.375% 11/15/49	2,010,000.00	2,097,780.47
T 2.5% 01/31/25	4,000,000.00	4,298,125.00
T 2.5% 02/15/45	2,150,000.00	2,290,589.85
T 2.5% 02/15/46	2,250,000.00	2,398,886.73
T 2.5% 02/28/26	650,000.00	704,818.36
T 2.5% 05/15/24	3,700,000.00	3,940,210.95
T 2.5% 05/15/46	1,050,000.00	1,119,398.43
T 2.5% 08/15/23	3,450,000.00	3,624,521.49
T 2.625% 01/31/26	1,350,000.00	1,470,761.72
T 2.625% 02/15/29	5,390,000.00	5,927,315.62
T 2.625% 03/31/25	2,500,000.00	2,702,832.02
T 2.625% 06/30/23	6,000,000.00	6,303,750.00
T 2.75% 02/15/24	3,900,000.00	4,162,640.62
T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	5,168,741.42
T 2.75% 04/30/23	4,200,000.00	4,406,144.52
T 2.75% 06/30/25	2,000,000.00	2,177,890.62
T 2.75% 07/31/23	4,000,000.00	4,220,781.24

T 2.75% 08/15/42	1,450,000.00	1,612,558.60	
T 2.75% 08/15/47	2,450,000.00	2,740,171.87	
T 2.75% 08/31/25	5,000,000.00	5,453,710.95	
T 2.75% 11/15/23	4,450,000.00	4,724,648.43	
T 2.75% 11/15/42	1,040,000.00	1,155,618.75	
T 2.75% 11/15/47	2,500,000.00	2,797,070.32	
T 2.875% 04/30/25	2,300,000.00	2,511,402.33	
T 2.875% 05/15/28	4,460,000.00	4,975,339.08	
T 2.875% 05/15/43	1,050,000.00	1,191,093.75	
T 2.875% 05/15/49	4,400,000.00	5,058,968.77	
T 2.875% 07/31/25	5,000,000.00	5,474,804.70	
T 2.875% 08/15/28	4,200,000.00	4,688,250.00	
T 2.875% 08/15/45	1,480,000.00	1,685,234.38	
T 2.875% 09/30/23	1,650,000.00	1,752,029.30	
T 2.875% 11/30/23	6,000,000.00	6,394,921.86	
T 2% 02/15/23	6,500,000.00	6,704,013.68	
T 2% 02/15/25	6,050,000.00	6,391,730.49	
T 2% 02/15/50	3,370,000.00	3,240,992.18	
T 2% 04/30/24	3,000,000.00	3,148,710.93	
T 2% 05/31/24	1,500,000.00	1,575,644.53	
T 2% 06/30/24	1,000,000.00	1,051,406.25	
T 2% 07/31/22	3,900,000.00	3,985,541.00	
T 2% 08/15/25	3,750,000.00	3,972,949.23	
T 2% 10/31/22	4,500,000.00	4,618,388.65	
T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,865,585.95	
T 2% 11/30/22	5,500,000.00	5,652,861.33	
T 3.125% 02/15/42	1,000,000.00	1,177,968.75	
T 3.125% 02/15/43	1,100,000.00	1,296,195.31	
T 3.125% 05/15/48	1,400,000.00	1,679,343.75	
T 3.125% 08/15/44	1,550,000.00	1,834,570.31	
T 3.125% 11/15/28	3,960,000.00	4,494,290.64	
T 3.125% 11/15/41	870,000.00	1,023,133.59	
T 3.375% 05/15/44	1,700,000.00	2,090,203.12	
T 3.375% 11/15/48	2,500,000.00	3,139,453.12	
T 3.5% 02/15/39	900,000.00	1,112,976.56	
T 3.625% 02/15/44	1,600,000.00	2,040,250.00	
T 3.625% 08/15/43	1,600,000.00	2,034,500.00	
T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,410,664.06	
T 3.75% 11/15/43	2,000,000.00	2,591,718.76	
T 3.875% 08/15/40	680,000.00	882,990.62	
T 3% 02/15/47	2,400,000.00	2,805,750.00	
T 3% 02/15/48	3,100,000.00	3,632,328.12	

T 3% 02/15/49	1,940,000.00	2,281,773.44	
T 3% 05/15/42	1,100,000.00	1,270,671.87	
T 3% 05/15/45	2,100,000.00	2,440,265.62	
T 3% 05/15/47	1,900,000.00	2,222,851.57	
T 3% 08/15/48	2,710,000.00	3,180,015.62	
T 3% 09/30/25	3,660,000.00	4,035,150.00	
T 3% 10/31/25	1,000,000.00	1,103,476.56	
T 3% 11/15/44	2,050,000.00	2,378,960.93	
T 4.25% 05/15/39	850,000.00	1,149,757.81	
T 4.25% 11/15/40	900,000.00	1,225,898.44	
T 4.375% 02/15/38	500,000.00	681,210.94	
T 4.375% 05/15/40	750,000.00	1,035,644.53	
T 4.375% 05/15/41	550,000.00	762,824.22	
T 4.375% 11/15/39	650,000.00	893,902.34	
T 4.5% 02/15/36	600,000.00	815,812.50	
T 4.5% 05/15/38	970,000.00	1,341,025.00	
T 4.5% 08/15/39	750,000.00	1,045,429.68	
T 4.625% 02/15/40	1,500,000.00	2,128,359.37	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,086,386.72	
T 5.0% 05/15/37	650,000.00	938,843.75	
T 5.25% 11/15/28	900,000.00	1,160,296.87	
T 5.375% 02/15/31	750,000.00	1,019,003.91	
T 5.5% 08/15/28	250,000.00	325,058.59	
T 6.0% 02/15/26	600,000.00	747,398.43	
T 6.125% 11/15/27	1,050,000.00	1,383,990.23	
T 6.25% 05/15/30	720,000.00	1,017,675.00	
T 6.25% 08/15/23	1,350,000.00	1,528,980.47	
アメリカドル 小計	560,480,000.00	585,774,698.35 (64,230,195,674)	
カナダドル			
CAN 0.25% 02/01/23	1,000,000.00	999,830.00	
CAN 0.25% 03/01/26	890,000.00	865,364.80	
CAN 0.25% 04/01/24	600,000.00	596,004.00	
CAN 0.25% 05/01/23	300,000.00	299,628.00	
CAN 0.25% 11/01/22	810,000.00	810,097.20	
CAN 0.5% 09/01/25	1,330,000.00	1,316,114.80	
CAN 0.5% 12/01/30	970,000.00	892,031.40	
CAN 1.25% 03/01/25	450,000.00	460,170.00	
CAN 1.25% 06/01/30	2,560,000.00	2,540,057.60	
CAN 1.5% 06/01/23	2,010,000.00	2,056,953.60	
CAN 1.5% 06/01/26	840,000.00	866,132.40	
CAN 1.5% 06/01/31	700,000.00	701,589.00	
CAN 1.5% 09/01/24	660,000.00	680,163.00	
CAN 1.75% 03/01/23	700,000.00	717,633.00	

	CAN 1% 06/01/27	940,000.00	940,432.40
	CAN 1% 09/01/22	2,680,000.00	2,706,103.20
	CAN 2.25% 03/01/24	670,000.00	702,742.90
	CAN 2.25% 06/01/25	1,530,000.00	1,625,778.00
	CAN 2.25% 06/01/29	390,000.00	420,919.20
	CAN 2.5% 06/01/24	1,780,000.00	1,886,105.80
	CAN 2.75% 06/01/22	1,000,000.00	1,024,930.00
	CAN 2.75% 12/01/48	810,000.00	953,410.50
	CAN 2.75% 12/01/64	290,000.00	353,472.30
	CAN 2% 06/01/28	800,000.00	848,000.00
	CAN 2% 09/01/23	1,180,000.00	1,222,680.60
	CAN 2% 12/01/51	2,060,000.00	2,085,255.60
	CAN 3.5% 12/01/45	690,000.00	906,563.40
	CAN 4.0% 06/01/41	490,000.00	669,952.50
	CAN 5.75% 06/01/29	960,000.00	1,289,769.60
	CAN 5.75% 06/01/33	670,000.00	974,414.50
	CAN 5% 06/01/37	490,000.00	717,369.80
	<b>カナダドル 小計</b>	<b>31,250,000.00</b>	<b>33,129,669.10</b> <b>(2,998,566,350)</b>
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	8,229,248.00
	MBONO 10% 12/05/24	24,100,000.00	27,397,603.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	13,590,000.00	13,465,107.90
	MBONO 6.5% 06/09/22	16,230,000.00	16,527,495.90
	MBONO 6.75% 03/09/23	20,920,000.00	21,553,666.80
	MBONO 7.5% 06/03/27	22,800,000.00	24,224,316.00
	MBONO 7.75% 05/29/31	10,950,000.00	11,984,665.50
	MBONO 7.75% 11/13/42	13,980,000.00	14,773,644.60
	MBONO 7.75% 11/23/34	4,970,000.00	5,349,409.80
	MBONO 8.5% 05/31/29	20,740,000.00	23,391,609.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	10,170,000.00	11,500,642.80
	MBONO 8% 09/05/24	5,910,000.00	6,313,653.00
	MBONO 8% 11/07/47	11,460,000.00	12,416,222.40
	MBONO 8% 12/07/23	15,420,000.00	16,410,272.40
	<b>メキシコペソ 小計</b>	<b>197,640,000.00</b>	<b>213,537,557.10</b> <b>(1,186,115,714)</b>
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	730,000.00	740,782.10
	BGB 0.2% 10/22/23	640,000.00	653,260.80
	BGB 0.4% 06/22/40	290,000.00	279,557.10
	BGB 0.5% 10/22/24	490,000.00	508,747.40
	BGB 0.65% 06/22/71	300,000.00	250,218.00
	BGB 0.8% 06/22/25	1,100,000.00	1,161,721.00
	BGB 0.8% 06/22/27	750,000.00	803,805.00

BGB 0.8% 06/22/28	980,000.00	1,054,725.00
BGB 0.9% 06/22/29	990,000.00	1,074,694.50
BGB 0% 10/22/27	600,000.00	612,738.00
BGB 1.25% 04/22/33	330,000.00	372,570.00
BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	461,956.00
BGB 1.6% 06/22/47	690,000.00	815,166.00
BGB 1.7% 06/22/50	490,000.00	592,748.10
BGB 1.9% 06/22/38	510,000.00	627,626.40
BGB 1% 06/22/26	1,080,000.00	1,161,097.20
BGB 1% 06/22/31	1,140,000.00	1,252,369.80
BGB 2.15% 06/22/66	440,000.00	616,924.00
BGB 2.25% 06/22/23	970,000.00	1,028,258.20
BGB 2.25% 06/22/57	380,000.00	530,145.60
BGB 2.6% 06/22/24	1,200,000.00	1,319,436.00
BGB 3.75% 06/22/45	650,000.00	1,080,865.50
BGB 3% 06/22/34	680,000.00	919,747.60
BGB 4.25% 03/28/41	1,110,000.00	1,866,243.00
BGB 4.25% 09/28/22	890,000.00	947,538.50
BGB 4.5% 03/28/26	750,000.00	933,225.00
BGB 4% 03/28/32	620,000.00	883,233.40
BGB 5.5% 03/28/28	1,190,000.00	1,668,939.30
BGB 5% 03/28/35	1,270,000.00	2,084,095.40
BKO 0% 03/10/23	780,000.00	789,367.80
BKO 0% 06/10/22	2,150,000.00	2,164,426.50
BKO 0% 06/16/23	620,000.00	628,599.40
BTPS 0.05% 01/15/23	330,000.00	332,557.50
BTPS 0.25% 03/15/28	1,250,000.00	1,238,262.50
BTPS 0.3% 08/15/23	1,100,000.00	1,115,543.00
BTPS 0.35% 02/01/25	1,740,000.00	1,770,171.60
BTPS 0.5% 02/01/26	1,500,000.00	1,531,725.00
BTPS 0.6% 06/15/23	720,000.00	734,364.00
BTPS 0.6% 08/01/31	850,000.00	831,376.50
BTPS 0.65% 10/15/23	560,000.00	572,980.80
BTPS 0.85% 01/15/27	1,100,000.00	1,139,622.00
BTPS 0.9% 04/01/31	1,300,000.00	1,315,301.00
BTPS 0.9% 08/01/22	1,500,000.00	1,523,145.00
BTPS 0.95% 03/01/23	1,720,000.00	1,760,196.40
BTPS 0.95% 03/01/37	320,000.00	304,547.20
BTPS 0.95% 03/15/23	860,000.00	880,382.00
BTPS 0.95% 08/01/30	1,630,000.00	1,666,055.60
BTPS 0.95% 09/15/27	1,000,000.00	1,039,650.00
BTPS 0% 01/15/24	300,000.00	302,190.00
BTPS 0% 04/01/26	400,000.00	398,448.00

BTPS 0% 04/15/24	980,000.00	986,340.60	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,170,000.00	1,239,369.30	
BTPS 1.35% 04/01/30	350,000.00	370,846.00	
BTPS 1.45% 03/01/36	1,130,000.00	1,164,950.90	
BTPS 1.45% 05/15/25	1,070,000.00	1,134,424.70	
BTPS 1.45% 09/15/22	1,550,000.00	1,586,766.00	
BTPS 1.45% 11/15/24	600,000.00	633,234.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	1,500,000.00	1,594,635.00	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,450,764.00	
BTPS 1.65% 03/01/32	1,340,000.00	1,445,739.40	
BTPS 1.65% 12/01/30	1,330,000.00	1,440,137.30	
BTPS 1.7% 09/01/51	750,000.00	729,015.00	
BTPS 1.75% 07/01/24	990,000.00	1,049,637.60	
BTPS 1.8% 03/01/41	650,000.00	679,497.00	
BTPS 1.85% 05/15/24	750,000.00	796,132.50	
BTPS 1.85% 07/01/25	820,000.00	883,033.40	
BTPS 2.05% 08/01/27	1,040,000.00	1,151,280.00	
BTPS 2.1% 07/15/26	1,470,000.00	1,618,528.80	
BTPS 2.15% 03/01/72	370,000.00	365,645.10	
BTPS 2.2% 06/01/27	1,700,000.00	1,896,163.00	
BTPS 2.25% 09/01/36	990,000.00	1,127,649.60	
BTPS 2.45% 09/01/33	990,000.00	1,151,469.00	
BTPS 2.45% 09/01/50	720,000.00	826,185.60	
BTPS 2.45% 10/01/23	870,000.00	926,115.00	
BTPS 2.5% 11/15/25	660,000.00	733,497.60	
BTPS 2.5% 12/01/24	1,300,000.00	1,419,717.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	1,240,000.00	1,490,827.20	
BTPS 2.8% 03/01/67	600,000.00	717,234.00	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,260,000.00	1,475,157.60	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,100,000.00	1,364,187.00	
BTPS 2% 02/01/28	930,000.00	1,029,807.60	
BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,144,227.00	
BTPS 3.1% 03/01/40	670,000.00	848,307.10	
BTPS 3.25% 09/01/46	680,000.00	894,451.60	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,100,000.00	1,405,162.00	
BTPS 3.45% 03/01/48	1,120,000.00	1,526,537.60	
BTPS 3.5% 03/01/30	1,950,000.00	2,424,045.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	1,740,000.00	1,961,954.40	
BTPS 3.85% 09/01/49	1,210,000.00	1,766,938.80	
BTPS 3% 08/01/29	1,210,000.00	1,444,982.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	1,130,000.00	1,276,843.50	
BTPS 4.5% 03/01/26	930,000.00	1,126,044.00	

BTPS 4.5% 05/01/23	1,050,000.00	1,147,629.00
BTPS 4.75% 08/01/23	1,610,000.00	1,787,148.30
BTPS 4.75% 09/01/28	1,810,000.00	2,362,140.50
BTPS 4.75% 09/01/44	1,560,000.00	2,498,964.00
BTPS 4% 02/01/37	1,800,000.00	2,484,792.00
BTPS 5.0% 08/01/39	1,440,000.00	2,267,193.60
BTPS 5.25% 11/01/29	1,770,000.00	2,448,724.20
BTPS 5.5% 09/01/22	1,700,000.00	1,823,556.00
BTPS 5.5% 11/01/22	1,630,000.00	1,764,475.00
BTPS 5.75% 02/01/33	1,570,000.00	2,399,682.20
BTPS 5% 03/01/25	1,740,000.00	2,072,566.20
BTPS 5% 08/01/34	1,260,000.00	1,858,991.40
BTPS 5% 09/01/40	1,600,000.00	2,542,176.00
BTPS 6.5% 11/01/27	2,070,000.00	2,878,086.60
BTPS 6% 05/01/31	1,940,000.00	2,906,993.00
BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	483,570.50
BTPS 9% 11/01/23	1,800,000.00	2,202,012.00
DBR 0.25% 02/15/27	1,920,000.00	2,011,392.00
DBR 0.25% 02/15/29	1,880,000.00	1,979,583.60
DBR 0.25% 08/15/28	1,300,000.00	1,367,314.00
DBR 0.5% 02/15/25	1,140,000.00	1,191,083.40
DBR 0.5% 02/15/26	2,300,000.00	2,425,258.00
DBR 0.5% 02/15/28	1,510,000.00	1,612,604.50
DBR 0.5% 08/15/27	900,000.00	958,662.00
DBR 0% 02/15/30	2,060,000.00	2,120,296.20
DBR 0% 02/15/31	1,240,000.00	1,270,070.00
DBR 0% 05/15/35	1,500,000.00	1,500,735.00
DBR 0% 05/15/36	510,000.00	505,512.00
DBR 0% 08/15/26	1,620,000.00	1,671,580.80
DBR 0% 08/15/29	2,430,000.00	2,504,382.30
DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,521,070.00
DBR 0% 08/15/50	1,960,000.00	1,790,910.80
DBR 0% 11/15/27	1,580,000.00	1,631,318.40
DBR 1.25% 08/15/48	1,730,000.00	2,173,295.20
DBR 1.5% 02/15/23	950,000.00	985,511.00
DBR 1.5% 05/15/23	2,290,000.00	2,388,149.40
DBR 1.5% 05/15/24	1,020,000.00	1,087,075.20
DBR 1.5% 09/04/22	920,000.00	945,088.40
DBR 1.75% 02/15/24	1,250,000.00	1,333,775.00
DBR 1.75% 07/04/22	1,650,000.00	1,692,916.50
DBR 1% 08/15/24	1,610,000.00	1,698,807.60
DBR 1% 08/15/25	1,880,000.00	2,013,310.80
DBR 2.5% 07/04/44	1,740,000.00	2,662,113.00

DBR 2.5% 08/15/46	1,980,000.00	3,088,087.20
DBR 2% 08/15/23	1,890,000.00	2,003,078.70
DBR 3.25% 07/04/42	1,240,000.00	2,050,625.20
DBR 4.0% 01/04/37	1,670,000.00	2,717,925.00
DBR 4.25% 07/04/39	1,240,000.00	2,182,561.20
DBR 4.75% 07/04/28	700,000.00	966,007.00
DBR 4.75% 07/04/34	1,440,000.00	2,372,256.00
DBR 4.75% 07/04/40	1,310,000.00	2,477,982.90
DBR 5.5% 01/04/31	1,640,000.00	2,576,194.00
DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	2,123,130.00
DBR 6.25% 01/04/24	1,370,000.00	1,619,024.90
DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	965,495.80
DBR 6.5% 07/04/27	1,270,000.00	1,828,546.00
FRTR 0.25% 11/25/26	2,050,000.00	2,124,907.00
FRTR 0.5% 05/25/25	3,350,000.00	3,489,427.00
FRTR 0.5% 05/25/26	2,930,000.00	3,070,405.60
FRTR 0.5% 05/25/29	2,830,000.00	2,975,263.90
FRTR 0.5% 05/25/40	980,000.00	961,879.80
FRTR 0.5% 05/25/72	390,000.00	303,100.20
FRTR 0.5% 06/25/44	300,000.00	287,124.00
FRTR 0.75% 05/25/28	2,960,000.00	3,170,189.60
FRTR 0.75% 05/25/52	1,700,000.00	1,621,256.00
FRTR 0.75% 11/25/28	2,510,000.00	2,687,858.60
FRTR 0% 02/25/23	610,000.00	616,911.30
FRTR 0% 02/25/24	1,420,000.00	1,443,202.80
FRTR 0% 02/25/26	1,690,000.00	1,726,943.40
FRTR 0% 02/25/27	320,000.00	326,259.20
FRTR 0% 03/25/23	1,880,000.00	1,902,522.40
FRTR 0% 03/25/24	2,240,000.00	2,278,998.40
FRTR 0% 03/25/25	2,310,000.00	2,358,232.80
FRTR 0% 11/25/29	3,300,000.00	3,325,146.00
FRTR 0% 11/25/30	2,480,000.00	2,476,304.80
FRTR 0% 11/25/31	400,000.00	395,580.00
FRTR 1.25% 05/25/34	2,400,000.00	2,697,816.00
FRTR 1.25% 05/25/36	2,410,000.00	2,704,020.00
FRTR 1.5% 05/25/31	2,950,000.00	3,376,835.50
FRTR 1.5% 05/25/50	1,960,000.00	2,275,716.80
FRTR 1.75% 05/25/23	2,600,000.00	2,723,370.00
FRTR 1.75% 05/25/66	850,000.00	1,072,419.50
FRTR 1.75% 06/25/39	2,010,000.00	2,443,255.50
FRTR 1.75% 11/25/24	3,180,000.00	3,439,551.60
FRTR 1% 05/25/27	2,480,000.00	2,681,723.20



FRTR 1% 11/25/25	2,240,000.00	2,392,499.20
FRTR 2.25% 05/25/24	2,040,000.00	2,214,991.20
FRTR 2.25% 10/25/22	3,120,000.00	3,246,328.80
FRTR 2.5% 05/25/30	2,900,000.00	3,566,449.00
FRTR 2.75% 10/25/27	2,730,000.00	3,273,324.60
FRTR 2% 05/25/48	2,140,000.00	2,754,222.80
FRTR 3.25% 05/25/45	1,710,000.00	2,666,881.80
FRTR 3.5% 04/25/26	3,120,000.00	3,731,800.80
FRTR 4.25% 10/25/23	2,870,000.00	3,207,024.10
FRTR 4.5% 04/25/41	2,340,000.00	4,068,230.40
FRTR 4.75% 04/25/35	1,810,000.00	2,909,828.40
FRTR 4% 04/25/55	1,070,000.00	2,027,510.90
FRTR 4% 04/25/60	1,080,000.00	2,137,546.80
FRTR 4% 10/25/38	1,600,000.00	2,545,344.00
FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	3,627,075.00
FRTR 5.75% 10/25/32	2,150,000.00	3,520,754.00
FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	1,869,847.50
FRTR 8.5% 04/25/23	1,100,000.00	1,290,355.00
IRISH 0.2% 05/15/27	460,000.00	473,804.60
IRISH 0.2% 10/18/30	470,000.00	476,923.10
IRISH 0.4% 05/15/35	180,000.00	180,970.20
IRISH 0.55% 04/22/41	110,000.00	108,115.70
IRISH 0.9% 05/15/28	440,000.00	473,941.60
IRISH 0% 10/18/31	80,000.00	78,880.80
IRISH 1.1% 05/15/29	550,000.00	602,453.50
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	755,043.10
IRISH 1.35% 03/18/31	340,000.00	382,945.40
IRISH 1.5% 05/15/50	400,000.00	466,184.00
IRISH 1.7% 05/15/37	470,000.00	560,630.10
IRISH 1% 05/15/26	730,000.00	781,618.30
IRISH 2.4% 05/15/30	770,000.00	937,605.90
IRISH 2% 02/18/45	580,000.00	747,011.00
IRISH 3.4% 03/18/24	510,000.00	566,487.60
IRISH 3.9% 03/20/23	700,000.00	756,336.00
IRISH 5.4% 03/13/25	700,000.00	857,122.00
NETHER 0.25% 07/15/25	920,000.00	953,359.20
NETHER 0.25% 07/15/29	630,000.00	656,869.50
NETHER 0.5% 01/15/40	620,000.00	653,008.80
NETHER 0.5% 07/15/26	1,260,000.00	1,327,964.40
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	966,906.00
NETHER 0.75% 07/15/28	1,040,000.00	1,123,616.00
NETHER 0% 01/15/24	780,000.00	794,515.80
NETHER 0% 01/15/27	480,000.00	492,936.00

NETHER 0% 01/15/38	350,000.00	338,632.00	
NETHER 0% 01/15/52	420,000.00	373,850.40	
NETHER 0% 07/15/30	850,000.00	864,305.50	
NETHER 0% 07/15/31	530,000.00	535,808.80	
NETHER 1.75% 07/15/23	1,000,000.00	1,052,280.00	
NETHER 2.25% 07/15/22	750,000.00	774,240.00	
NETHER 2.5% 01/15/33	920,000.00	1,193,893.20	
NETHER 2.75% 01/15/47	1,110,000.00	1,785,934.50	
NETHER 2% 07/15/24	1,460,000.00	1,582,508.60	
NETHER 3.75% 01/15/23	300,000.00	321,618.00	
NETHER 3.75% 01/15/42	1,060,000.00	1,818,885.80	
NETHER 4% 01/15/37	1,020,000.00	1,639,599.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,010,000.00	1,410,848.80	
NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	792,974.00	
OBL 0% 04/05/24	1,760,000.00	1,795,305.60	
OBL 0% 04/10/26	900,000.00	927,387.00	
OBL 0% 04/11/25	1,420,000.00	1,457,204.00	
OBL 0% 04/14/23	1,110,000.00	1,124,463.30	
OBL 0% 10/07/22	1,530,000.00	1,544,106.60	
OBL 0% 10/10/25	1,170,000.00	1,203,707.70	
OBL 0% 10/18/24	2,150,000.00	2,200,632.50	
RAGB 0.5% 02/20/29	700,000.00	739,018.00	
RAGB 0.5% 04/20/27	650,000.00	685,360.00	
RAGB 0.75% 02/20/28	620,000.00	665,129.80	
RAGB 0.75% 03/20/51	290,000.00	298,383.90	
RAGB 0.75% 10/20/26	660,000.00	704,114.40	
RAGB 0.85% 06/30/20	200,000.00	182,178.00	
RAGB 0% 02/20/30	660,000.00	666,791.40	
RAGB 0% 02/20/31	480,000.00	480,734.40	
RAGB 0% 04/20/25	50,000.00	51,112.50	
RAGB 0% 07/15/23	650,000.00	658,846.50	
RAGB 0% 07/15/24	590,000.00	601,339.80	
RAGB 0% 09/20/22	430,000.00	433,586.20	
RAGB 0% 10/20/40	220,000.00	201,537.60	
RAGB 1.2% 10/20/25	640,000.00	689,657.60	
RAGB 1.5% 02/20/47	540,000.00	660,576.60	
RAGB 1.5% 11/02/86	200,000.00	260,458.00	
RAGB 1.65% 10/21/24	560,000.00	603,422.40	
RAGB 1.75% 10/20/23	750,000.00	792,855.00	
RAGB 2.1% 09/20/17	340,000.00	558,827.40	
RAGB 2.4% 05/23/34	530,000.00	682,655.90	
RAGB 3.15% 06/20/44	470,000.00	745,828.90	

RAGB 3.4% 11/22/22	1,210,000.00	1,281,571.50
RAGB 3.8% 01/26/62	230,000.00	477,183.30
RAGB 4.15% 03/15/37	920,000.00	1,474,116.00
RAGB 4.85% 03/15/26	730,000.00	920,004.40
RAGB 6.25% 07/15/27	690,000.00	974,169.60
RFGB 0.125% 04/15/36	270,000.00	263,754.90
RFGB 0.125% 04/15/52	210,000.00	183,130.50
RFGB 0.125% 09/15/31	200,000.00	202,488.00
RFGB 0.25% 09/15/40	200,000.00	193,906.00
RFGB 0.5% 04/15/26	470,000.00	493,829.00
RFGB 0.5% 09/15/27	380,000.00	401,793.00
RFGB 0.5% 09/15/28	470,000.00	497,363.40
RFGB 0.5% 09/15/29	290,000.00	306,469.10
RFGB 0.75% 04/15/31	270,000.00	291,394.80
RFGB 0.875% 09/15/25	300,000.00	318,744.00
RFGB 0% 09/15/23	100,000.00	101,545.00
RFGB 0% 09/15/24	300,000.00	306,282.00
RFGB 0% 09/15/30	250,000.00	251,977.50
RFGB 1.125% 04/15/34	270,000.00	303,212.70
RFGB 1.375% 04/15/47	230,000.00	280,901.30
RFGB 1.5% 04/15/23	440,000.00	457,798.00
RFGB 1.625% 09/15/22	380,000.00	391,073.20
RFGB 2.625% 07/04/42	340,000.00	493,455.60
RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	463,919.20
RFGB 2% 04/15/24	310,000.00	333,888.60
RFGB 4% 07/04/25	320,000.00	380,793.60
SPGB 0.1% 04/30/31	1,220,000.00	1,184,607.80
SPGB 0.25% 07/30/24	1,000,000.00	1,022,660.00
SPGB 0.35% 07/30/23	1,170,000.00	1,192,885.20
SPGB 0.45% 10/31/22	800,000.00	811,648.00
SPGB 0.5% 04/30/30	1,980,000.00	2,021,065.20
SPGB 0.6% 10/31/29	1,200,000.00	1,240,104.00
SPGB 0.8% 07/30/27	480,000.00	506,544.00
SPGB 0.85% 07/30/37	460,000.00	455,119.40
SPGB 0% 01/31/25	1,240,000.00	1,258,587.60
SPGB 0% 01/31/26	500,000.00	506,735.00
SPGB 0% 01/31/28	680,000.00	680,557.60
SPGB 0% 04/30/23	1,360,000.00	1,374,239.20
SPGB 0% 05/31/24	350,000.00	354,714.50
SPGB 1.2% 10/31/40	750,000.00	765,742.50
SPGB 1.25% 10/31/30	1,200,000.00	1,302,204.00
SPGB 1.3% 10/31/26	1,460,000.00	1,581,340.60
SPGB 1.4% 04/30/28	1,020,000.00	1,118,511.60

	SPGB 1.4% 07/30/28	1,320,000.00	1,449,690.00	
	SPGB 1.45% 04/30/29	750,000.00	827,542.50	
	SPGB 1.45% 10/31/27	1,840,000.00	2,019,197.60	
	SPGB 1.45% 10/31/71	220,000.00	196,460.00	
	SPGB 1.5% 04/30/27	1,970,000.00	2,163,729.80	
	SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,348,450.00	
	SPGB 1.85% 07/30/35	1,290,000.00	1,479,617.10	
	SPGB 1.95% 04/30/26	1,340,000.00	1,487,574.20	
	SPGB 1.95% 07/30/30	1,350,000.00	1,553,121.00	
	SPGB 1% 10/31/50	940,000.00	858,088.40	
	SPGB 2.15% 10/31/25	1,760,000.00	1,955,254.40	
	SPGB 2.35% 07/30/33	1,290,000.00	1,555,752.90	
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,060,000.00	1,398,659.40	
	SPGB 2.75% 10/31/24	1,560,000.00	1,731,178.80	
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,100,000.00	1,493,646.00	
	SPGB 3.45% 07/30/66	980,000.00	1,525,850.20	
	SPGB 3.8% 04/30/24	1,500,000.00	1,687,050.00	
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,310,000.00	1,961,004.50	
	SPGB 4.4% 10/31/23	1,320,000.00	1,477,396.80	
	SPGB 4.65% 07/30/25	1,410,000.00	1,706,480.70	
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,300,000.00	2,158,585.00	
	SPGB 4.8% 01/31/24	1,150,000.00	1,312,518.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,310,000.00	2,204,664.50	
	SPGB 5.15% 10/31/28	1,100,000.00	1,513,919.00	
	SPGB 5.15% 10/31/44	950,000.00	1,725,504.00	
	SPGB 5.4% 01/31/23	1,790,000.00	1,966,297.10	
	SPGB 5.75% 07/30/32	1,450,000.00	2,281,401.00	
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,360,000.00	1,793,690.40	
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	3,411,119.00	
	ユーロ 小計	380,030,000.00	446,527,811.10 (59,606,997,503)	
イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,750,000.00	1,735,335.00	
	UKT 0.125% 01/31/23	2,050,000.00	2,052,419.00	
	UKT 0.125% 01/31/24	980,000.00	979,676.60	
	UKT 0.125% 01/31/28	1,320,000.00	1,285,020.00	
	UKT 0.25% 07/31/31	620,000.00	583,575.00	
	UKT 0.375% 10/22/30	1,420,000.00	1,369,320.20	
	UKT 0.5% 07/22/22	1,800,000.00	1,809,630.00	
	UKT 0.5% 10/22/61	670,000.00	523,249.90	
	UKT 0.625% 06/07/25	1,160,000.00	1,179,917.20	
	UKT 0.625% 07/31/35	1,140,000.00	1,069,479.60	
	UKT 0.625% 10/22/50	1,200,000.00	1,011,936.00	

UKT 0.75% 07/22/23	940,000.00	953,921.40	
UKT 0.875% 01/31/46	350,000.00	320,117.00	
UKT 0.875% 10/22/29	550,000.00	559,097.00	
UKT 1.25% 07/22/27	1,190,000.00	1,247,881.60	
UKT 1.25% 07/31/51	60,000.00	59,612.40	
UKT 1.25% 10/22/41	1,440,000.00	1,443,672.00	
UKT 1.5% 07/22/26	820,000.00	868,117.60	
UKT 1.5% 07/22/47	1,310,000.00	1,377,504.30	
UKT 1.625% 10/22/28	1,400,000.00	1,508,150.00	
UKT 1.625% 10/22/54	850,000.00	935,153.00	
UKT 1.625% 10/22/71	430,000.00	515,135.70	
UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	667,956.00	
UKT 1.75% 07/22/57	1,140,000.00	1,314,328.80	
UKT 1.75% 09/07/22	1,640,000.00	1,674,981.20	
UKT 1.75% 09/07/37	1,340,000.00	1,460,613.40	
UKT 1% 04/22/24	1,450,000.00	1,486,612.50	
UKT 2.25% 09/07/23	1,160,000.00	1,216,840.00	
UKT 2.5% 07/22/65	940,000.00	1,367,474.40	
UKT 2.75% 09/07/24	820,000.00	889,011.20	
UKT 2% 09/07/25	420,000.00	451,617.60	
UKT 3.25% 01/22/44	1,430,000.00	1,994,463.90	
UKT 3.5% 01/22/45	1,280,000.00	1,869,171.20	
UKT 3.5% 07/22/68	910,000.00	1,683,554.60	
UKT 3.75% 07/22/52	800,000.00	1,315,032.00	
UKT 4.25% 03/07/36	1,200,000.00	1,723,428.00	
UKT 4.25% 06/07/32	1,290,000.00	1,747,704.90	
UKT 4.25% 09/07/39	820,000.00	1,237,002.80	
UKT 4.25% 12/07/27	750,000.00	931,192.50	
UKT 4.25% 12/07/40	970,000.00	1,487,330.10	
UKT 4.25% 12/07/46	1,060,000.00	1,750,250.80	
UKT 4.25% 12/07/49	810,000.00	1,391,563.80	
UKT 4.25% 12/07/55	1,040,000.00	1,920,703.20	
UKT 4.5% 09/07/34	1,080,000.00	1,550,653.20	
UKT 4.5% 12/07/42	1,170,000.00	1,895,481.90	
UKT 4.75% 12/07/30	850,000.00	1,162,825.50	
UKT 4.75% 12/07/38	880,000.00	1,386,008.80	
UKT 4% 01/22/60	840,000.00	1,566,902.40	
UKT 5% 03/07/25	600,000.00	707,856.00	
UKT 6.0% 12/07/28	450,000.00	628,321.50	
イギリスbond 小計	51,190,000.00	61,866,802.70 (9,573,887,717)	
スウェーデン ンクローナ			
SGB 0.125% 05/12/31	2,340,000.00	2,293,574.40	
SGB 0.75% 05/12/28	3,860,000.00	4,037,367.00	

	SGB 0.75% 11/12/29	3,770,000.00	3,934,711.30
	SGB 1.5% 11/13/23	5,670,000.00	5,919,536.70
	SGB 1% 11/12/26	4,940,000.00	5,223,506.60
	SGB 2.25% 06/01/32	1,850,000.00	2,213,136.50
	SGB 2.5% 05/12/25	4,630,000.00	5,123,233.90
	SGB 3.5% 03/30/39	3,020,000.00	4,415,209.80
	SGB 3.5% 06/01/22	7,220,000.00	7,491,472.00
スウェーデンクローナ 小計		37,300,000.00	40,651,748.20 (539,042,181)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	1,730,000.00	1,686,490.50
	NGB 1.375% 08/19/30	3,120,000.00	3,096,069.60
	NGB 1.5% 02/19/26	3,110,000.00	3,163,243.20
	NGB 1.75% 02/17/27	2,900,000.00	2,984,593.00
	NGB 1.75% 03/13/25	3,120,000.00	3,208,389.60
	NGB 1.75% 09/06/29	2,470,000.00	2,535,158.60
	NGB 2% 04/26/28	2,510,000.00	2,620,515.30
	NGB 2% 05/24/23	4,940,000.00	5,080,049.00
	NGB 3% 03/14/24	3,640,000.00	3,856,980.40
ノルウェークローネ 小計		27,540,000.00	28,231,489.20 (374,067,231)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/22	3,190,000.00	3,226,780.70
	DGB 0.25% 11/15/52	1,630,000.00	1,504,082.50
	DGB 0.5% 11/15/27	5,260,000.00	5,523,420.80
	DGB 0.5% 11/15/29	6,410,000.00	6,739,858.60
	DGB 0% 11/15/31	810,000.00	803,349.90
	DGB 1.5% 11/15/23	4,170,000.00	4,380,459.90
	DGB 1.75% 11/15/25	4,230,000.00	4,648,347.00
	DGB 4.5% 11/15/39	8,240,000.00	14,461,200.00
デンマーククローネ 小計		33,940,000.00	41,287,499.40 (741,110,614)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.75% 04/25/25	720,000.00	715,953.60
	POLGB 0% 07/25/22	2,580,000.00	2,576,929.80
	POLGB 1.25% 10/25/30	1,200,000.00	1,141,212.00
	POLGB 2.25% 10/25/24	2,860,000.00	3,003,371.80
	POLGB 2.5% 01/25/23	1,700,000.00	1,757,800.00
	POLGB 2.5% 04/25/24	1,880,000.00	1,980,993.60
	POLGB 2.5% 07/25/26	3,420,000.00	3,627,730.80
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,910,000.00	2,030,043.50
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,590,000.00	2,801,654.80
	POLGB 2.75% 10/25/29	3,640,000.00	3,944,595.20
	POLGB 3.25% 07/25/25	2,470,000.00	2,693,386.80
	POLGB 4% 10/25/23	2,080,000.00	2,253,576.00

	POLGB 5.75% 04/25/29	900,000.00	1,174,761.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	1,500,000.00	1,606,155.00	
ポーランドズロチ 小計		29,450,000.00	31,308,163.90	(933,750,334)
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	1,730,000.00	1,730,103.80	
	ACGB 0.25% 11/21/25	1,000,000.00	987,390.00	
	ACGB 0.5% 09/21/26	1,540,000.00	1,520,981.00	
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,140,000.00	1,101,741.60	
	ACGB 1.5% 06/21/31	1,190,000.00	1,192,499.00	
	ACGB 1.75% 06/21/51	990,000.00	848,519.10	
	ACGB 1.75% 11/21/32	850,000.00	862,435.50	
	ACGB 1% 11/21/31	1,810,000.00	1,718,757.90	
	ACGB 1% 12/21/30	2,220,000.00	2,134,041.60	
	ACGB 2.25% 05/21/28	630,000.00	681,439.50	
	ACGB 2.25% 11/21/22	430,000.00	443,815.90	
	ACGB 2.5% 05/21/30	1,860,000.00	2,042,298.60	
	ACGB 2.75% 04/21/24	620,000.00	667,709.00	
	ACGB 2.75% 05/21/41	810,000.00	880,081.20	
	ACGB 2.75% 06/21/35	630,000.00	702,695.70	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,400,000.00	1,558,718.00	
	ACGB 2.75% 11/21/28	770,000.00	860,390.30	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,640,000.00	1,834,750.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,750,000.00	1,942,640.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,630,000.00	1,884,703.80	
	ACGB 3.25% 06/21/39	650,000.00	761,520.50	
	ACGB 3.75% 04/21/37	810,000.00	1,008,587.70	
	ACGB 3% 03/21/47	730,000.00	819,052.70	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,200,000.00	1,408,392.00	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,220,000.00	1,603,092.20	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,430,000.00	1,751,478.30	
ACGB 5.5% 04/21/23	1,810,000.00	1,994,203.70		
ACGB 5.75% 07/15/22	2,090,000.00	2,221,356.50		
オーストラリアドル 小計		34,580,000.00	37,163,395.10	(3,147,367,931)
シンガポールドル	SIGB 1.75% 02/01/23	410,000.00	419,557.10	
	SIGB 1.875% 03/01/50	160,000.00	161,400.00	
	SIGB 2.125% 06/01/26	450,000.00	478,809.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	440,000.00	466,474.80	
	SIGB 2.375% 06/01/25	500,000.00	534,615.00	
	SIGB 2.375% 07/01/39	230,000.00	249,632.80	
	SIGB 2.625% 05/01/28	190,000.00	208,386.30	
	SIGB 2.75% 03/01/46	710,000.00	838,914.70	
	SIGB 2.75% 04/01/42	300,000.00	347,625.00	

	SIGB 2.75% 07/01/23	540,000.00	566,605.80
	SIGB 2.875% 07/01/29	560,000.00	625,850.40
	SIGB 2.875% 09/01/30	460,000.00	516,653.60
	SIGB 2% 02/01/24	90,000.00	93,734.10
	SIGB 3.125% 09/01/22	570,000.00	590,012.70
	SIGB 3.375% 09/01/33	340,000.00	402,685.80
	SIGB 3.5% 03/01/27	530,000.00	603,288.40
	SIGB 3% 09/01/24	510,000.00	550,539.90
	シンガポールドル 小計	6,990,000.00	7,654,785.40 (633,586,587)
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,220,000.00	1,242,960.40
	MGS 3.48% 03/15/23	1,300,000.00	1,335,048.00
	MGS 3.502% 05/31/27	100,000.00	103,529.00
	MGS 3.733% 06/15/28	300,000.00	314,412.00
	MGS 3.757% 05/22/40	150,000.00	142,471.50
	MGS 3.795% 09/30/22	800,000.00	820,224.00
	MGS 3.8% 08/17/23	550,000.00	571,213.50
	MGS 3.828% 07/05/34	250,000.00	249,535.00
	MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	866,269.40
	MGS 3.882% 03/14/25	690,000.00	725,328.00
	MGS 3.885% 08/15/29	1,890,000.00	1,986,635.70
	MGS 3.892% 03/15/27	780,000.00	823,407.00
	MGS 3.899% 11/16/27	1,160,000.00	1,227,918.00
	MGS 3.9% 11/30/26	360,000.00	384,181.20
	MGS 3.906% 07/15/26	820,000.00	867,428.80
	MGS 3.955% 09/15/25	1,030,000.00	1,089,400.10
	MGS 4.059% 09/30/24	750,000.00	791,302.50
	MGS 4.181% 07/15/24	1,090,000.00	1,151,377.90
	MGS 4.232% 06/30/31	850,000.00	909,738.00
	MGS 4.254% 05/31/35	1,270,000.00	1,319,415.70
	MGS 4.392% 04/15/26	1,160,000.00	1,251,616.80
	MGS 4.498% 04/15/30	1,260,000.00	1,374,408.00
	MGS 4.642% 11/07/33	1,160,000.00	1,253,635.20
MGS 4.736% 03/15/46	1,090,000.00	1,151,715.80	
MGS 4.762% 04/07/37	1,160,000.00	1,254,203.60	
MGS 4.893% 06/08/38	1,360,000.00	1,477,272.80	
MGS 4.921% 07/06/48	900,000.00	972,234.00	
MGS 4.935% 09/30/43	530,000.00	576,989.80	
	マレーシアリンギット 小計	24,840,000.00	26,233,871.70 (697,915,429)
イスラエル シェゲル	ILGOV 0.15% 07/31/23	110,000.00	109,946.05
	ILGOV 0.5% 04/30/25	620,000.00	622,131.80
	ILGOV 0.75% 07/31/22	3,180,000.00	3,205,592.32



	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,020,000.00	952,923.78
	ILGOV 1.5% 11/30/23	370,000.00	382,306.05
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,040,000.00	1,100,872.76
	ILGOV 1% 03/31/30	1,310,000.00	1,284,068.28
	ILGOV 2.25% 09/28/28	1,400,000.00	1,523,415.73
	ILGOV 3.75% 03/31/24	2,000,000.00	2,196,711.00
	ILGOV 3.75% 03/31/47	1,460,000.00	1,833,549.02
	ILGOV 4.25% 03/31/23	200,000.00	214,836.58
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,270,000.00	1,994,929.97
	ILGOV 6.25% 10/30/26	3,300,000.00	4,279,654.83
	イスラエルシェケル 小計	17,280,000.00	19,700,938.17 (666,021,736)
	合計		145,328,625,001 (145,328,625,001)

## 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 186銘柄	100.0%	44.2%
カナダドル	国債証券 31銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 334銘柄	100.0%	41.0%
イギリスポンド	国債証券 50銘柄	100.0%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 28銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドル	国債証券 17銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%

(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。

## 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】

(2021年 6月30日現在)

資産総額	3,682,315,869円
負債総額	1,723,035円
純資産総額( - )	3,680,592,834円
発行済口数	1,788,082,944口
1口当たり純資産額( / )	2.0584円
(1万口当たり純資産額)	(20,584円)

(参考)

## 日本株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 6月30日現在)

資産総額	291,560,465,978円
負債総額	110,339,295円
純資産総額( - )	291,450,126,683円
発行済口数	133,906,026,347口
1口当たり純資産額( / )	2.1765円
(1万口当たり純資産額)	(21,765円)

## 外国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 6月30日現在)

資産総額	293,552,066,768円
負債総額	284,582,659円
純資産総額( - )	293,267,484,109円
発行済口数	71,381,871,039口
1口当たり純資産額( / )	4.1084円
(1万口当たり純資産額)	(41,084円)

## 外国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 6月30日現在)

資産総額	148,453,691,608円
負債総額	40,104,754円
純資産総額（ - ）	148,413,586,854円
発行済口数	56,040,829,284口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6483円
（1万口当たり純資産額）	（26,483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ます。）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（2021年 6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年間ににお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 9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。

2021年6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	526	14,842,977
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	76	281,570
単位型公社債投資信託	48	305,807
合計	650	15,430,355

## 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。

なお、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、当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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。

(1) 【貸借対照表】

(単位: 百万円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	24,869	21,589
金銭の信託	5,823	10,857
前払費用	348	397
未収委託者報酬	7,284	8,471
未収運用受託報酬	5,842	6,151
未収収益	190	177
その他	4,624	3,428
流動資産合計	48,983	51,072
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 256	1 301
器具備品	1 576	1 692
その他	1 0	1 0
有形固定資産合計	832	993
無形固定資産		
ソフトウェア	3,030	4,104
その他	40	41
無形固定資産合計	3,070	4,145
投資その他の資産		
投資有価証券	8,469	9,950
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	700	311
その他	35	39
投資その他の資産合計	14,842	15,937
固定資産合計	18,745	21,077
資産合計	67,729	72,149

(単位: 百万円)



	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	38	44
未払金	7,988	7,572
未払収益分配金	0	0
未払手数料	3,355	4,154
その他未払金	4,632	3,417
未払費用	204	1,046
未払法人税等	897	517
賞与引当金	324	556
その他	1,070	818
流動負債合計	10,524	10,555
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	600	626
資産除去債務	132	133
その他	7	8
固定負債合計	740	768
負債合計	11,264	11,324
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
<b>資本剰余金</b>		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	305	500
<b>その他利益剰余金</b>		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	35,122	38,258
利益剰余金合計	37,528	40,858
株主資本合計	56,767	60,098
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額	587	791
金		
繰延ヘッジ損益	284	65
評価・換算差額等合計	302	726
純資産合計	56,464	60,824
負債・純資産合計	67,729	72,149

## (2) 【損益計算書】

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	34,967	37,224
運用受託報酬	11,091	10,982
その他営業収益	500	403
営業収益合計	46,559	48,611
営業費用		
支払手数料	15,998	17,936
広告宣伝費	331	203
公告費	0	-
調査費	5,018	5,064
調査費	788	898
委託調査費	4,217	4,154
図書費	11	11
営業雑経費	3,434	4,492
通信費	52	56
印刷費	470	449
協会費	53	58
諸会費	16	18
情報機器関連費	2,726	3,815
その他営業雑経費	114	93
営業費用合計	24,783	27,696
一般管理費		
給料	5,756	5,976
役員報酬	244	214
給料・手当	4,962	4,861
賞与	549	901
退職給付費用	118	170
福利費	535	608
交際費	14	1
旅費交通費	190	13
租税公課	344	315
不動産賃借料	269	276
寄付金	7	3
減価償却費	334	748
業務委託費	864	966
諸経費	750	848
一般管理費合計	9,185	9,929
営業利益	12,589	10,984

（単位：百万円）

前事業年度

当事業年度

(自 2019年4月1日  
至 2020年3月31日)(自 2020年4月1日  
至 2021年3月31日)

営業外収益		
受取利息	15	2
収益分配金	119	101
金銭の信託運用益	-	3,038
投資有価証券売却益	483	1
投資有価証券償還益	316	54
為替差益	273	-
デリバティブ利益	666	-
その他	30	45
営業外収益合計	1,906	3,243
営業外費用		
金銭の信託運用損	1,076	-
投資有価証券売却損	4	0
投資有価証券償還損	19	0
為替差損	-	158
デリバティブ費用	-	3,782
その他	19	5
営業外費用合計	1,118	3,946
経常利益	13,377	10,281
特別損失		
システム統合費用	149	110
特別損失合計	149	110
税引前当期純利益	13,227	10,170
法人税、住民税及び事業税	4,263	3,242
法人税等調整額	193	65
法人税等合計	4,070	3,177
当期純利益	9,157	6,993

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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			
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				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	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
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				
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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		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			
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				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
当期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	-	3,136	3,330	3,330

当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
-------	-----	-------	--------	--------	--------

	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
当期変動額				
剰余金の配当				3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,379	349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	349	1,029	4,360
当期末残高	791	65	726	60,824

## 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、決算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

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 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
建 物	77	百万円	106	百万円
器具備品	285	"	391	"
そ の 他	4	"	4	"
計	367	"	503	"

### （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

### 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

2021年6月23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
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	利益剰余金	932,488	2021年3月31日	2021年6月24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. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、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（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 その他有価証券	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。

当事業年度（2021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	21,589	21,589	-
（2）金銭の信託	10,857	10,857	-
（3）未収委託者報酬	8,471	8,471	-
（4）未収運用受託報酬	6,151	6,151	-
（5）投資有価証券 その他有価証券	9,950	9,950	-
（6）未払金	(7,572)	(7,572)	-
（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	(357)	(357)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)	(73)	-
デリバティブ取引計	(431)	(431)	-



(\*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

現金及び預金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 その他有価証券

投資有価証券の時価について、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

未払金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 2020年3月31日	当事業年度 2021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)投資有価証券 その他有価証券」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(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	-

当事業年度(2021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	21,589	-	-	-
未収委託者報酬	8,471	-	-	-
未収運用受託報酬	6,151	-	-	-

投資有価証券 投資信託	-	10	5,751	0
----------------	---	----	-------	---

## （有価証券関係）

## 1. 子会社株式

前事業年度（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

当事業年度（2021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. その他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（2021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	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9	10	1
小計	9	10	1
合計	9,950	8,809	1,141

(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(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

当事業年度(2021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
109	1	0

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(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	種類	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		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。

当事業年度（2021年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 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	2,889	-	41	41
	英ポンド	128	-	0	0
	カナダドル	21	-	0	0
	スイスフラン	51	-	0	0
	香港ドル	128	-	1	1
	ユーロ	246	-	0	0
	買建				
	米ドル	99	-	1	1
	香港ドル	2	-	0	0
	合計	3,567	-	41	41

(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	13,711	-	315	315
	合計	13,711	-	315	315

(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	種類	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		3,993	-	57	
	英ポンド		3,108	-	15	
	カナダドル		3	-	0	
	スイスフラン		57	-	0	
	香港ドル		110	-	1	
	ユーロ		108	-	0	
	人民元		6	-	0	
	買建					
	米ドル		38	-	0	
	香港ドル		3	-	0	
	人民元		1	-	0	
	合計		7,431	-	73	

(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。当社が有する退職一時金制度は簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

#### 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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	537	600
退職給付費用	74	77
転籍者受入	-	18
退職給付の支払額	11	69
退職給付債務の期末残高	600	626

##### (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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626
退職給付引当金	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626

##### (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74百万円 当事業年度77百万円

#### 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44百万円、当事業年度92百万円であります。

#### 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 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	168	百万円	107	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	99	"	170	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	183	"	191	"
税務上の収益認識差額	-	"	71	"
有価証券評価差額	259	"	-	"
繰延ヘッジ損益	-	"	28	"
その他	151	"	123	"
繰延税金資産 合計	862	"	693	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	-	"	349	"
繰延ヘッジ損益	125	"	-	"
その他	35	"	32	"
繰延税金負債 合計	161	"	382	"
繰延税金資産の純額	700	"	311	"

## 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 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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*1)	6,372百万円

(\*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あります。

[ 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 ]

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 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。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	9,365	未収運用 受託報酬	5,402
							投信販売 代行手数料 等	9,124	未払 手数料	1,888

(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（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）

当事業年度（2021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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	18,821,541円72銭	20,274,967円09銭
1株当たり当期純利益金額	3,052,463円23銭	2,331,221円85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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

#### 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) 通常の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



通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）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 9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（2021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） （2021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（2021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。  
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**

2021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2021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。

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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2021年8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 公認会計士 中島紀子 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、「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2021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2021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。