【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】	2022年4月26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】	インデックスコレクション（バランス株式３０） インデックスコレクション（バランス株式５０） インデックスコレクション（バランス株式７０）
【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】	インデックスコレクション（バランス株式３０） 10兆円を上限とします。 インデックスコレクション（バランス株式５０） 10兆円を上限とします。 インデックスコレクション（バランス株式７０） 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】

インデックスコレクション（バランス株式３０）
インデックスコレクション（バランス株式５０）
インデックスコレクション（バランス株式７０）
（以下、上記ファンドを総称して「当ファンド」という場合があります。また、インデックスコレクション（バランス株式３０）を「バランス株式３０」、インデックスコレクション（バランス株式５０）を「バランス株式５０」、インデックスコレクション（バランス株式７０）を「バランス株式７０」という場合があります。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

①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。
②三井住友トラスト・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。
③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】

各ファンドについて、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】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

2022年 4月27日から2022年10月25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＞

当ファンドは「分配金再投資コース」（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）専用ファンドです。

＜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号ロ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。）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。

＜受付不可日＞

分配金再投資コースの収益分配金の再投資の場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

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、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

＜信託金限度額＞

各ファンドについて、1兆円を上限とします。

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 追加型	国内 海外 内外	株式 債券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合	ＭＭＦ ＭＲＦ ＥＴＦ	インデックス型 特殊型

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

（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、対円での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

①一般…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。
②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。
③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
①一般…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。
②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。
③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。
④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。
⑤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①から④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①から④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。
①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。
②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、為替のヘッジを行な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＞

資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

●資産配分の異なる3つのファンドから、皆様のライフサイクルやリスク許容度に応じてご選択いただけます。
インデックスコレクション(バランス株式30)(以下「バランス株式30」という場合があります。)
インデックスコレクション(バランス株式50)(以下「バランス株式50」という場合があります。)
インデックスコレクション(バランス株式70)(以下「バランス株式70」という場合があります。)

国内外の株式・公社債へ分散投資します。

●日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンド(以下これらを「マザーファンド」という場合があります。)への投資を通じて、国内外の株式・公社債へ分散投資します。
●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。
●基本配分比率は以下の通りとします。

基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設けます。

<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。
国内債券	日本債券マザーファンド	「NOMURA-BPI総合」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。

ポートフォリオ構築プロセス

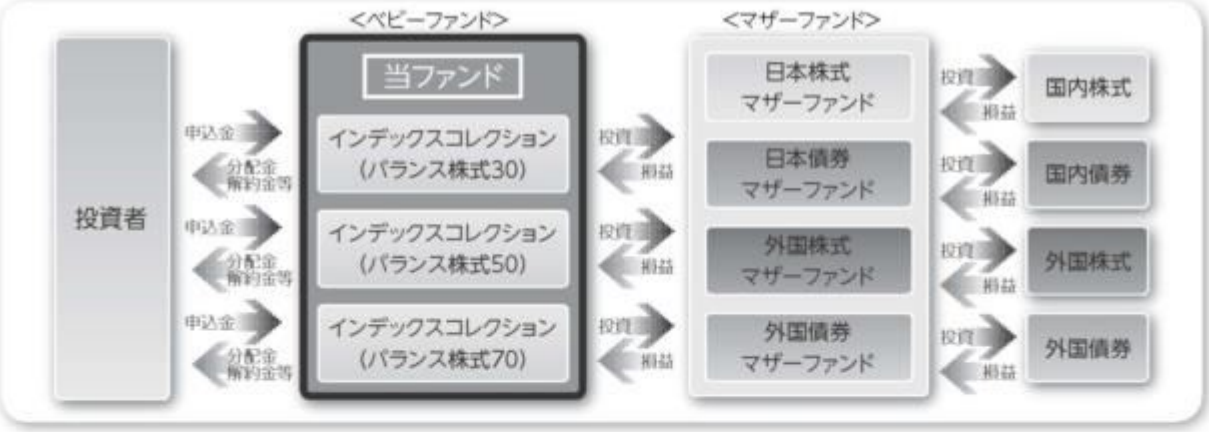
ファンドマネジャーは各ファンドの基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。

ポートフォリオ構築	ファンドマネジャー	●基本配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分
↓		
リバランス実施	ファンドマネジャー	●資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

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。



分配方針

●年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。
●分配対象額は、経費控除後の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。
●分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
●収益分配金は、自動的にファンドの受益権に再投資されます。
※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。

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、取得時において以下のとおりとします。

バランス株式30	信託財産の純資産総額の40%以下
バランス株式50	信託財産の純資産総額の60%以下
バランス株式70	信託財産の純資産総額の80%以下

●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、取得時において以下のとおりとします。

バランス株式30	信託財産の純資産総額の30%以下
バランス株式50	信託財産の純資産総額の40%以下
バランス株式70	信託財産の純資産総額の45%以下

◆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JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「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。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

日本債券マザーファンド「NOMURA-BPI総合」

「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通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債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

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】

2010年10月20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

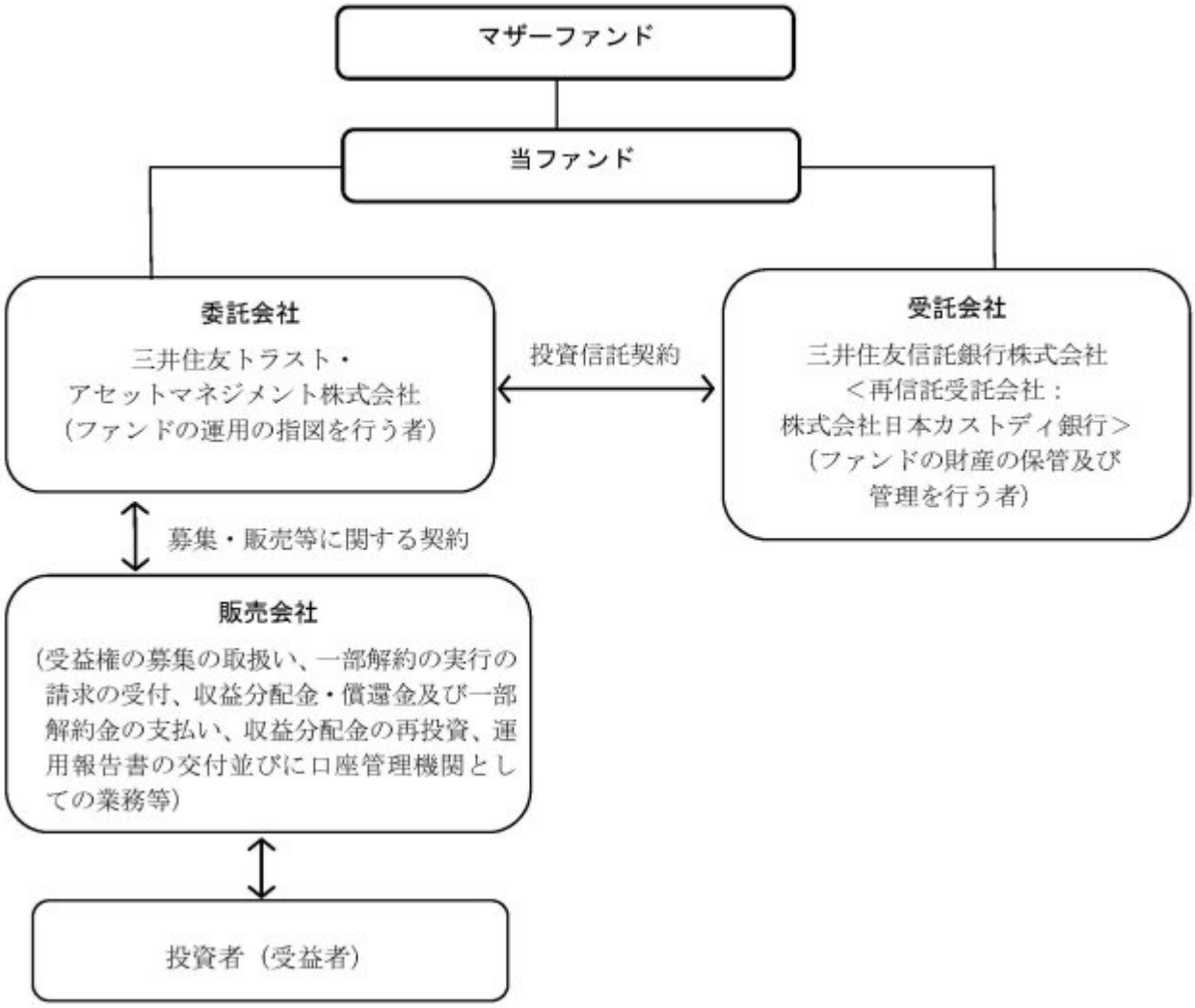
2012年４月１日　当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継

ファンドの名称を中央三井インデックスコレクション（バランス株式３０）からインデックスコレクション（バランス株式３０）、中央三井インデックスコレクション（バランス株式５０）からインデックスコレクション（バランス株式５０）、中央三井インデックスコレクション（バランス株式７０）からインデックスコレクション（バランス株式７０）に変更

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、中央三井日本債券マザーファンドの名称を日本債券マザーファンド、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】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2022年 2月28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

ハ．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】

①　運用方針

当ファンドは、日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンドを主要投資対象とし、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。なお、国内外の株式・公社債等に直接投資することもあります。

②　投資態度

Ａ．主として、マザーファンド受益証券に投資し、実質的に国内外の株式・公社債へ分散投資を行うことにより、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

Ｂ．各資産への基本配分比率は以下のとおりです。資産配分の異なる３つのファンドから、皆様のライフサイクルやリスク許容度に応じてご選択いただけます。

	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券
バランス株式３０	２０％	６０％	１０％	１０％
バランス株式５０	３０％	４０％	２０％	１０％
バランス株式７０	４０％	２５％	３０％	５％

Ｃ．上記Ｂ．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．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。

Ｇ．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。

Ｈ．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」という場合があります。）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、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】

①　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、投資信託約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。）

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

② 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」、「日本債券マザーファンド」、「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書
２．国債証券
３．地方債証券
４．特別の法律により法人の発行する債券
５．社債券（新株引受権証券と社債券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書
９．資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
10．コマーシャル・ペーパー
11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
12．外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記１．から11．までの証券又は証書の性質を有するもの
13．投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。）
14．投資証券又は外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）
15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
16．オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
17．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
18．外国法人が発行する譲渡性預金証書
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。

③ 運用指図できる金融商品

A．委託会社は、信託金を、上記②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②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している株式を主要投資対象とします。

（２）投資態度

① 株式への投資は、原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、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。

② 株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった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。

⑦ 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

３．投資制限

① 株式への投資割合には制限を設けません。

② 外貨建資産への投資は、行いません。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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。

⑥　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。

⑦　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。

⑧　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。

⑨　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。

「日本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

わが国の公社債を主要投資対象とします。

（２）投資態度

①　わが国の公社債に投資を行い、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

②　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。

③　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。

④　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。

⑤　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。

⑥　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

①　株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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。）の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、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。

②　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。

③　外貨建資産への投資は、行いません。

④　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。

⑤　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー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。

⑥　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。

「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

①　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。

②　株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

③　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。

④　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。

⑤　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。

⑥　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。

⑦　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。

⑧　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

①　外貨建資産への投資には、制限を設けません。

②　株式への投資割合には制限を設けません。

③　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。

④　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。

⑤　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。

⑥　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。

⑦　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。

⑧　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。

⑨　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

①　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。

②　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。

③　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。

④　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。

⑤　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。

⑥　信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利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。

⑦　信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

３．投資制限

①　株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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。）の新株予約権に限ります。）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。

② 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。

③ 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

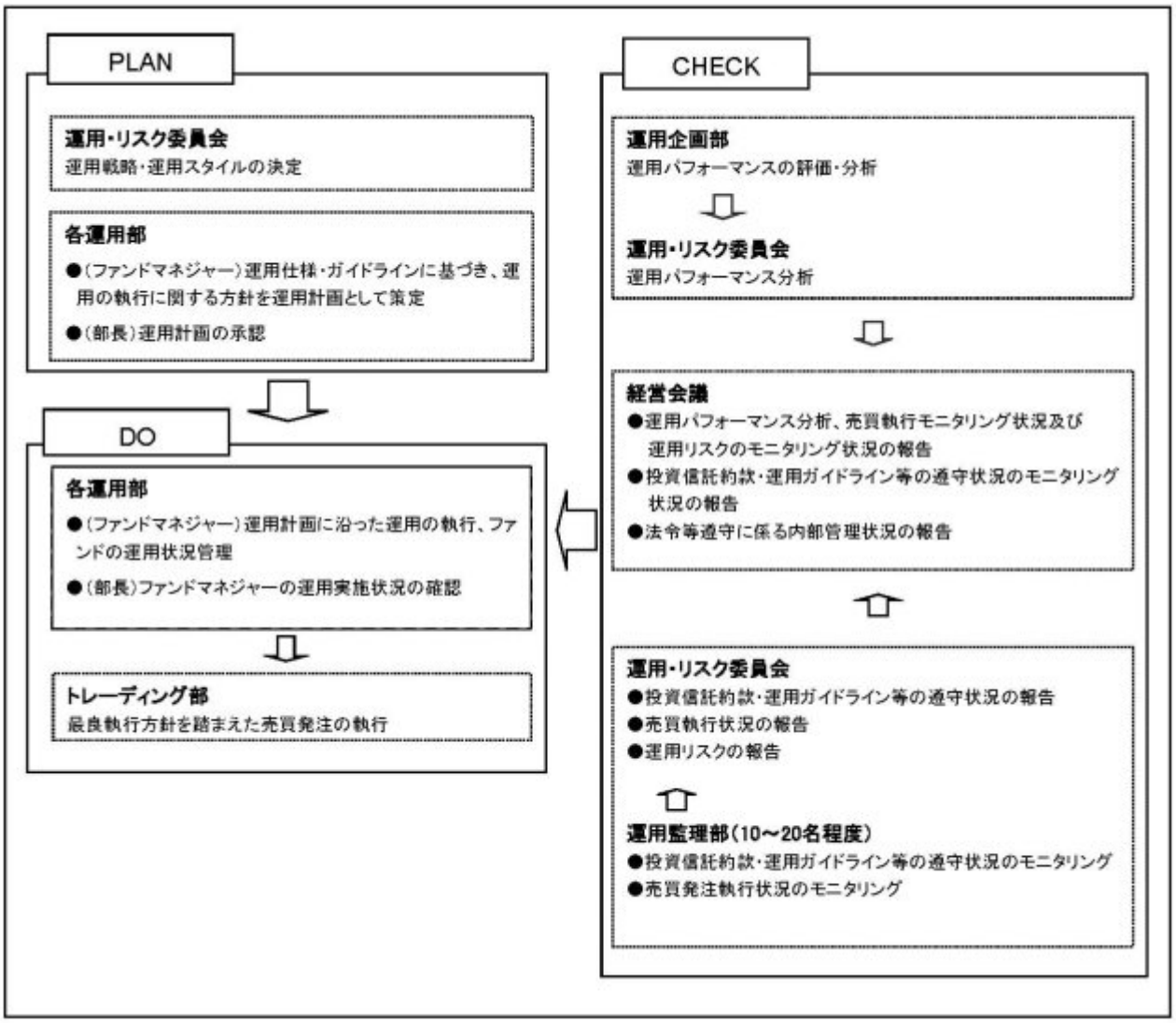
④ 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー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。

⑥ 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回の毎決算時（決算日は７月25日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

・分配対象額は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）及び売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額。）等の全額とします。なお、前期から繰り越された分配準備積立金及び収益調整金は、全額分配に使用することがあります。
・分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
・収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

※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＞

①　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、取得時において以下のとおりとします。

○バランス株式３０……信託財産の純資産総額の40%以下
○バランス株式５０……信託財産の純資産総額の60%以下
○バランス株式７０……信託財産の純資産総額の80%以下

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、取得時において以下のとおりとします。

○バランス株式３０……信託財産の純資産総額の30%以下
○バランス株式５０……信託財産の純資産総額の40%以下
○バランス株式７０……信託財産の純資産総額の45%以下

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（マザーファンド及び上場投資信託を除きます。）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号ロ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。）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ます。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、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、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、信託財産の効率的な運用に資するため、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、信託財産の効率的な運用に資するため、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たときは、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たときは、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たときは、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るものとします。

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。

O．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たときは、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。

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

U．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。

V．利害関係人等との取引等

イ．受託会社は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託会

社が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）及び受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第２条第１項にて準用する信託業法第29条第２項第１号に規定する利害関係人をいいます。以下イ．及び下記ロ．において同じ。）、信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、前記（２）に掲げる資産への投資等並びに上記Ｉ．からＯ．まで及びＱ．からＴ．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

ロ．受託会社は、受託会社が当ファンド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Ｉ．からＯ．まで及びＱ．からＴ．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、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。

ニ．上記イ．からハ．までの場合、委託会社及び受託会社は、受益者に対して信託法第31条第３項及び同法第32条第３項の通知は行いません。

Ｗ．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10％、合計で20％以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

Ｘ．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

＜関連法令に基づく投資制限＞

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

３【投資リスク】

（１）ファンドのリスク

●当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様の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。

①　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。

② 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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 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＞

① 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。

② 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が小さかった場合も同様です。

③ 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。

④ ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止、取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

⑤ 確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

（２）リスクの管理体制

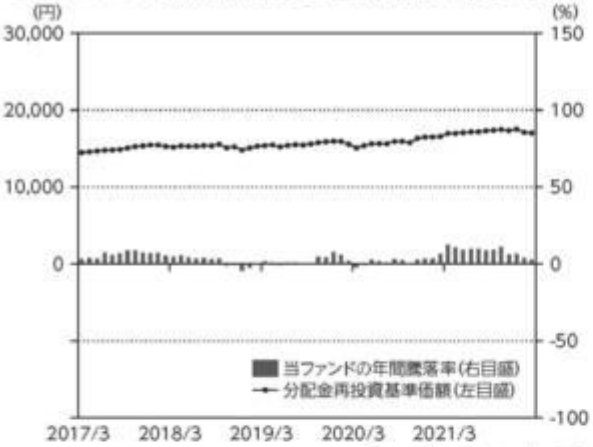
委託会社におけるリスク管理体制

・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（流動性リスク管理等を含む）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。

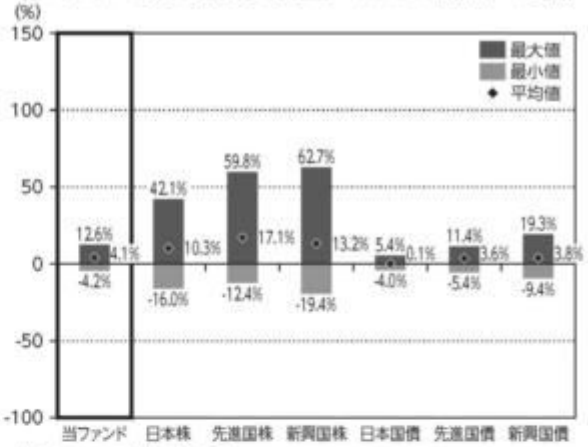
〔参考情報〕

インデックスコレクション（バランス株式30）

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

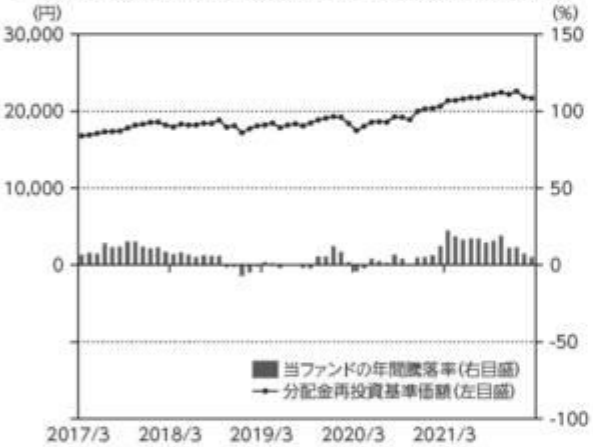


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

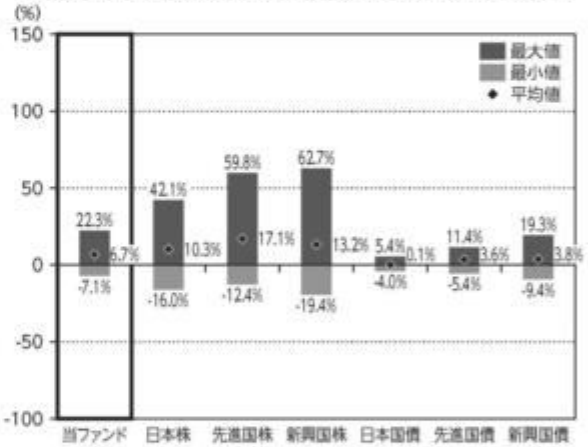


インデックスコレクション（バランス株式50）

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



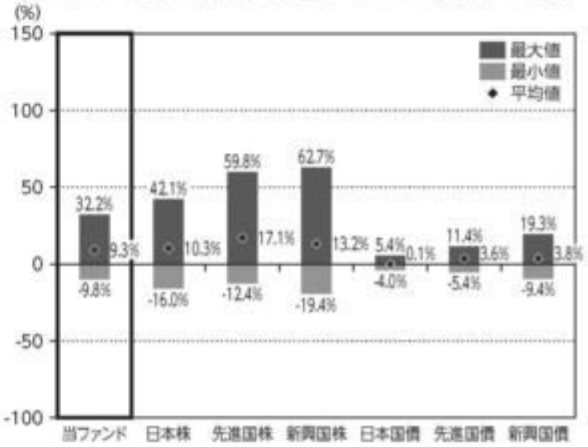
当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



インデックスコレクション（バランス株式70）

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



〔参考情報〕

＊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。

＊2017年3月～2022年2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JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「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。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、JPXは責任を負いません。
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付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性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。
新興国債 JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（※）の控除はありません。ただし、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

①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年率0.154%（税抜　0.14%）（※）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。

委託会社	年率　0.099%　（税抜　0.09%）	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　0.033%　（税抜　0.03%）	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　0.022%　（税抜　0.02%）	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。

②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。

③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】

①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を含みます。）。

②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。

③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を含みます。）。

④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。

⑤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。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が

適用されます。

※上記は、2022年 2月28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、2022年2月28日現在の状況について記載してあります。

【インデックスコレクション（バランス株式３０）】

（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	131,494,062,982	99.57
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	573,430,495	0.43
合計(純資産総額)		132,067,493,477	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】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	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	日本債券マザーファンド	58,590,989,447	1.3811	80,920,015,526	1.3599	79,677,886,548	60.33
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	12,069,755,335	2.1565	26,028,427,380	2.1354	25,773,755,542	19.52
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	3,255,649,792	4.1876	13,633,359,069	4.2873	13,957,947,353	10.57
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	4,649,662,770	2.6733	12,429,943,484	2.5990	12,084,473,539	9.15

(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	99.57
合計	99.57

(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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	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2期計算期間末 (2012年 7月25日)	1,826,441,025	1,826,441,025	10,014	10,014
第3期計算期間末 (2013年 7月25日)	3,055,855,651	3,055,855,651	12,198	12,198
第4期計算期間末 (2014年 7月25日)	4,778,573,004	4,778,573,004	12,984	12,984
第5期計算期間末 (2015年 7月27日)	7,218,074,538	7,218,074,538	14,344	14,344
第6期計算期間末 (2016年 7月25日)	26,094,390,333	26,094,390,333	14,066	14,066
第7期計算期間末 (2017年 7月25日)	36,940,752,492	36,940,752,492	14,836	14,836
第8期計算期間末 (2018年 7月25日)	47,046,612,483	47,046,612,483	15,400	15,400
第9期計算期間末 (2019年 7月25日)	58,853,542,284	58,853,542,284	15,526	15,526
第10期計算期間末 (2020年 7月27日)	112,284,528,451	112,284,528,451	15,765	15,765
第11期計算期間末 (2021年 7月26日)	129,179,991,406	129,179,991,406	17,227	17,227
2021年 2月末日	122,154,326,593	—	16,561	—
3月末日	126,644,328,887	—	16,972	—
4月末日	127,216,930,459	—	16,975	—
5月末日	127,911,508,317	—	17,072	—
6月末日	129,029,622,587	—	17,160	—
7月末日	129,625,418,907	—	17,171	—
8月末日	131,390,182,213	—	17,313	—
9月末日	132,397,636,915	—	17,372	—
10月末日	133,866,825,909	—	17,476	—
11月末日	133,511,442,738	—	17,347	—
12月末日	134,780,631,015	—	17,526	—
2022年 1月末日	133,116,864,656	—	17,118	—
2月末日	132,067,493,477	—	17,010	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	0
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	0
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	0
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	0
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	△2.0
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	21.8
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	6.4
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	10.5
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	△1.9
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	5.5
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	3.8
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0.8
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	1.5
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	9.3
第12期中間計算期間	2021年 7月27日～2022年 1月26日	△0.8

(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2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	297,421,058	85,659,240	1,823,954,652
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	946,841,759	265,501,127	2,505,295,284
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	1,384,516,621	209,546,149	3,680,265,756
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	1,662,961,851	310,939,646	5,032,287,961
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	14,070,621,585	551,965,479	18,550,944,067
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	7,358,731,907	1,010,990,195	24,898,685,779
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	7,713,381,660	2,062,382,166	30,549,685,273
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	8,500,605,703	1,144,421,624	37,905,869,352

第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	40,477,320,641	7,158,886,380	71,224,303,613
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	9,629,005,674	5,864,610,694	74,988,698,593
第12期中間計算期間	2021年 7月27日～2022年 1月26日	4,568,746,049	2,301,891,661	77,255,552,981

(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。

【インデックスコレクション（バランス株式５０）】

（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	19,896,835,239	99.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	81,622,845	0.41
合計(純資産総額)		19,978,458,084	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】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	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	日本債券マザーファンド	5,927,991,081	1.3809	8,185,962,884	1.3599	8,061,475,071	40.35
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,751,454,609	2.1591	5,940,665,647	2.1354	5,875,456,172	29.41
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	944,884,047	4.1907	3,959,725,576	4.2873	4,051,001,374	20.28
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	734,475,807	2.6731	1,963,327,280	2.5990	1,908,902,622	9.55

(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	99.59
合計	99.59

(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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	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2期計算期間末 (2012年 7月25日)	2,308,448,560	2,308,448,560	9,855	9,855
第3期計算期間末 (2013年 7月25日)	3,298,797,421	3,298,797,421	13,348	13,348
第4期計算期間末 (2014年 7月25日)	4,273,661,874	4,273,661,874	14,552	14,552
第5期計算期間末 (2015年 7月27日)	5,112,201,159	5,112,201,159	16,776	16,776
第6期計算期間末 (2016年 7月25日)	5,810,707,419	5,810,707,419	15,725	15,725
第7期計算期間末 (2017年 7月25日)	6,724,648,904	6,724,648,904	17,405	17,405
第8期計算期間末 (2018年 7月25日)	8,658,183,416	8,658,183,416	18,451	18,451
第9期計算期間末 (2019年 7月25日)	11,669,771,032	11,669,771,032	18,409	18,409
第10期計算期間末 (2020年 7月27日)	13,923,564,557	13,923,564,557	18,866	18,866
第11期計算期間末 (2021年 7月26日)	18,266,192,032	18,266,192,032	21,871	21,871
2021年 2月末日	16,303,610,361	—	20,648	—
3月末日	17,226,847,239	—	21,374	—
4月末日	17,348,022,596	—	21,413	—
5月末日	17,752,789,162	—	21,595	—
6月末日	18,156,665,608	—	21,781	—
7月末日	18,430,947,208	—	21,760	—
8月末日	19,117,948,935	—	22,065	—
9月末日	19,507,820,623	—	22,200	—
10月末日	19,884,403,544	—	22,460	—
11月末日	19,835,829,121	—	22,195	—
12月末日	20,412,555,230	—	22,599	—
2022年 1月末日	20,047,320,835	—	21,838	—
2月末日	19,978,458,084	—	21,697	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	0
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	0
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	0

第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	0
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	△5.0
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	35.4
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	9.0
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	15.3
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	△6.3
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	10.7
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	6.0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	△0.2
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	2.5
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	15.9
第12期中間計算期間	2021年 7月27日～2022年 1月26日	△0.6

(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2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	190,420,353	137,880,635	2,342,407,409
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	416,815,707	287,930,717	2,471,292,399
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	658,340,834	192,744,346	2,936,888,887
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	449,877,581	339,477,441	3,047,289,027
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	961,565,392	313,575,798	3,695,278,621
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	603,139,592	434,776,876	3,863,641,337
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	1,120,338,164	291,368,383	4,692,611,118
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	2,005,968,696	359,477,733	6,339,102,081
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	1,649,045,263	607,727,034	7,380,420,310
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	1,599,018,504	627,657,001	8,351,781,813
第12期中間計算期間	2021年 7月27日～2022年 1月26日	1,060,823,851	299,151,295	9,113,454,369

(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。

【インデックスコレクション（バランス株式７０）】

（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	13,147,772,081	99.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	50,209,452	0.38
合計(純資産総額)		13,197,981,533	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】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	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	日本株式マザーファンド	2,445,425,989	2.1623	5,287,744,617	2.1354	5,221,962,656	39.57
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	928,836,836	4.1952	3,896,656,295	4.2873	3,982,202,166	30.17
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	2,452,628,063	1.3813	3,387,815,144	1.3599	3,335,328,902	25.27
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	234,043,231	2.6729	625,574,153	2.5990	608,278,357	4.61

(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	99.62
合計	99.62

(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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	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2期計算期間末　(2012年 7月25日)	1,392,591,169	1,392,591,169	9,716	9,716
第3期計算期間末　(2013年 7月25日)	2,374,954,327	2,374,954,327	14,377	14,377
第4期計算期間末　(2014年 7月25日)	3,063,861,342	3,063,861,342	15,968	15,968
第5期計算期間末　(2015年 7月27日)	3,890,683,336	3,890,683,336	19,106	19,106
第6期計算期間末　(2016年 7月25日)	3,517,186,547	3,517,186,547	17,198	17,198
第7期計算期間末　(2017年 7月25日)	4,084,827,402	4,084,827,402	19,885	19,885
第8期計算期間末　(2018年 7月25日)	5,289,106,724	5,289,106,724	21,519	21,519
第9期計算期間末　(2019年 7月25日)	6,627,304,937	6,627,304,937	21,241	21,241
第10期計算期間末　(2020年 7月27日)	7,965,836,155	7,965,836,155	21,868	21,868
第11期計算期間末　(2021年 7月26日)	11,461,085,557	11,461,085,557	26,791	26,791
2021年 2月末日	9,770,587,890	—	24,856	—
3月末日	10,424,065,754	—	26,002	—
4月末日	10,605,902,068	—	26,091	—
5月末日	10,932,568,614	—	26,365	—
6月末日	11,331,530,146	—	26,691	—
7月末日	11,638,918,204	—	26,612	—
8月末日	12,319,876,051	—	27,138	—
9月末日	12,631,009,958	—	27,386	—
10月末日	13,006,962,186	—	27,841	—
11月末日	13,002,192,883	—	27,404	—
12月末日	13,603,828,025	—	28,113	—
2022年 1月末日	13,222,135,353	—	26,887	—
2月末日	13,197,981,533	—	26,727	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	0
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	0
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	0
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	0
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	0

第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	△7.9
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	48.0
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	11.1
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	19.7
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	△10.0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	15.6
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	8.2
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	△1.3
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	3.0
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	22.5
第12期中間計算期間	2021年 7月27日～2022年 1月26日	△0.4

(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2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	201,368,030	156,966,363	1,433,291,853
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	664,273,333	445,609,632	1,651,955,554
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	635,433,541	368,605,971	1,918,783,124
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	672,066,846	554,506,519	2,036,343,451
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	442,910,032	434,101,250	2,045,152,233
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	508,202,695	499,147,088	2,054,207,840
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	778,728,051	375,069,629	2,457,866,262
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	1,031,236,687	369,101,257	3,120,001,692
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	1,230,292,042	707,559,121	3,642,734,613
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	1,243,904,534	608,757,486	4,277,881,661
第12期中間計算期間	2021年 7月27日～2022年 1月26日	970,053,710	357,607,318	4,890,328,053

(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	283,671,795,850	99.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	2,114,351,259	0.74
合計(純資産総額)		285,786,147,109	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	日本	1,966,640,000	0.69

(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	5,573,600	2,278.08	12,697,106,688	2,138.50	11,919,143,600	4.17
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	689,300	12,831.14	8,844,504,802	11,810.00	8,140,633,000	2.85
日本	株式	キーエンス	電気機器	99,700	60,035.22	5,985,511,434	53,780.00	5,361,866,000	1.88
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	6,806,200	685.78	4,667,555,836	712.80	4,851,459,360	1.70
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	811,200	5,952.80	4,828,911,360	4,819.00	3,909,172,800	1.37
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	69,800	58,426.38	4,078,161,324	55,770.00	3,892,746,000	1.36
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,129,600	3,265.72	3,688,957,312	3,293.00	3,719,772,800	1.30
日本	株式	任天堂	その他製品	62,100	53,907.01	3,347,625,321	58,020.00	3,603,042,000	1.26
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	647,500	5,352.64	3,465,834,400	5,125.00	3,318,437,500	1.16
日本	株式	信越化学工業	化学	185,000	18,736.47	3,466,246,950	17,670.00	3,268,950,000	1.14
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	214,700	14,796.76	3,176,864,372	14,855.00	3,189,368,500	1.12
日本	株式	三菱商事	卸売業	812,100	3,867.73	3,140,983,533	3,871.00	3,143,639,100	1.10
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	751,200	4,168.83	3,131,625,096	4,121.00	3,095,695,200	1.08

日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	866,400	3,384.71	2,932,512,744	3,525.00	3,054,060,000	1.07
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	864,900	3,339.81	2,888,601,669	3,501.00	3,028,014,900	1.06
日本	株式	日立製作所	電気機器	529,200	6,288.81	3,328,038,252	5,650.00	2,989,980,000	1.05
日本	株式	ダイキン工業	機械	140,200	24,823.74	3,480,288,348	21,205.00	2,972,941,000	1.04
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	787,200	3,577.97	2,816,577,984	3,756.00	2,956,723,200	1.03
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	758,000	3,682.63	2,791,433,540	3,743.00	2,837,194,000	0.99
日本	株式	日本電産	電気機器	285,200	11,029.90	3,145,727,480	9,883.00	2,818,631,600	0.99
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	124,300	18,882.97	2,347,153,171	21,130.00	2,626,459,000	0.92
日本	株式	村田製作所	電気機器	323,300	8,584.29	2,775,300,957	7,787.00	2,517,537,100	0.88
日本	株式	第一三共	医薬品	864,700	2,599.03	2,247,381,241	2,793.50	2,415,539,450	0.85
日本	株式	三井物産	卸売業	841,600	2,848.74	2,397,499,584	2,865.50	2,411,604,800	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,635,500	1,444.96	2,363,232,080	1,450.50	2,372,292,750	0.83
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	424,000	5,261.20	2,230,748,800	5,591.00	2,370,584,000	0.83
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	357,400	6,789.01	2,426,392,174	6,574.00	2,349,547,600	0.82
日本	株式	ＳＭＣ	機械	32,200	65,467.49	2,108,053,178	68,050.00	2,191,210,000	0.77
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,387,900	1,585.35	2,200,307,265	1,525.00	2,116,547,500	0.74
日本	株式	ファナック	電気機器	96,600	23,137.73	2,235,104,718	21,155.00	2,043,573,000	0.72

(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	0.28
		建設業	2.30
		食料品	3.41
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.22
		化学	6.57
		医薬品	5.01
		石油・石炭製品	0.44
		ゴム製品	0.67
		ガラス・土石製品	0.77
		鉄鋼	0.86
		非鉄金属	0.82
		金属製品	0.60
		機械	5.19
		電気機器	17.52
		輸送用機器	8.44
		精密機器	2.62

		その他製品	2.37
		電気・ガス業	1.17
		陸運業	3.06
		海運業	0.64
		空運業	0.43
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	8.01
		卸売業	5.68
		小売業	4.34
		銀行業	5.39
		証券、商品先物取引業	0.78
		保険業	2.17
		その他金融業	1.13
		不動産業	1.96
		サービス業	5.69
		小計	99.26
合計			99.26

(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	104	円	1,966,037,450	1,966,640,000	0.69

(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。

日本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	日本	319,589,025,250	83.42
地方債証券	日本	20,128,099,436	5.25
特殊債券	日本	24,310,136,978	6.35
社債券	日本	16,574,410,000	4.33

	フランス	901,593,000	0.24
	スペイン	200,210,000	0.05
	オーストラリア	200,090,000	0.05
	小計	17,876,303,000	4.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,185,813,262	0.31
合計(純資産総額)		383,089,377,926	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	日本	602,000,000	0.16

(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	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(%)
日本	国債証券	第３６３回利付国債（１０年）	4,780,000,000	99.90	4,775,506,800	99.54	4,758,059,800	0.100	2031/6/20	1.24
日本	国債証券	第１４５回利付国債（５年）	4,240,000,000	100.60	4,265,440,000	100.39	4,256,578,400	0.100	2025/9/20	1.11
日本	国債証券	第１４１回利付国債（５年）	4,230,000,000	100.45	4,249,077,300	100.31	4,243,493,700	0.100	2024/9/20	1.11
日本	国債証券	第３４３回利付国債（１０年）	3,595,000,000	100.66	3,618,727,000	100.45	3,611,249,400	0.100	2026/6/20	0.94
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	3,560,000,000	100.33	3,571,854,800	100.26	3,569,327,200	0.100	2023/12/20	0.93
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	3,450,000,000	100.73	3,475,461,000	100.42	3,464,559,000	0.100	2028/3/20	0.90
日本	国債証券	第３３８回利付国債（１０年）	3,410,000,000	101.48	3,460,536,200	101.26	3,453,204,700	0.400	2025/3/20	0.90
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	3,425,000,000	100.69	3,448,838,000	100.45	3,440,549,500	0.100	2027/3/20	0.90
日本	国債証券	第３４７回利付国債（１０年）	3,415,000,000	100.70	3,439,007,450	100.45	3,430,367,500	0.100	2027/6/20	0.90
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	3,410,000,000	100.73	3,435,097,600	100.44	3,425,106,300	0.100	2027/9/20	0.89
日本	国債証券	第１４９回利付国債（５年）	3,330,000,000	100.20	3,336,959,700	100.02	3,330,732,600	0.005	2026/9/20	0.87
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	3,320,000,000	100.30	3,329,960,000	99.91	3,317,178,000	0.100	2030/9/20	0.87

日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	3,240,000,000	101.70	3,295,144,800	101.45	3,287,239,200	0.400	2025/9/20	0.86
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	3,240,000,000	100.67	3,261,708,000	100.45	3,254,742,000	0.100	2026/9/20	0.85
日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	3,190,000,000	100.64	3,210,543,600	100.42	3,203,557,500	0.100	2026/3/20	0.84
日本	国債証券	第３３０回利付国債（１０年）	3,130,000,000	101.44	3,175,291,100	101.32	3,171,409,900	0.800	2023/9/20	0.83
日本	国債証券	第３２９回利付国債（１０年）	3,125,000,000	101.20	3,162,706,500	101.12	3,160,062,500	0.800	2023/6/20	0.82
日本	国債証券	第１４８回利付国債（５年）	3,120,000,000	100.24	3,127,488,000	100.04	3,121,341,600	0.005	2026/6/20	0.81
日本	国債証券	第３３４回利付国債（１０年）	3,010,000,000	101.61	3,058,461,000	101.45	3,053,705,200	0.600	2024/6/20	0.80
日本	国債証券	第３６１回利付国債（１０年）	2,950,000,000	100.22	2,956,490,000	99.82	2,944,837,500	0.100	2030/12/20	0.77
日本	国債証券	第３５６回利付国債（１０年）	2,930,000,000	100.57	2,946,715,800	100.22	2,936,592,500	0.100	2029/9/20	0.77
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	2,880,000,000	100.40	2,891,660,700	100.29	2,888,611,200	0.100	2024/6/20	0.75
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	2,870,000,000	100.69	2,889,803,000	100.40	2,881,680,900	0.100	2028/12/20	0.75
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	2,810,000,000	100.73	2,830,569,200	100.39	2,821,015,200	0.100	2028/9/20	0.74
日本	国債証券	第３３９回利付国債（１０年）	2,775,000,000	101.60	2,819,427,750	101.35	2,812,601,250	0.400	2025/6/20	0.73
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	2,780,000,000	100.66	2,798,349,800	100.38	2,790,730,800	0.100	2029/3/20	0.73
日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	2,735,000,000	100.73	2,755,184,300	100.43	2,746,869,900	0.100	2027/12/20	0.72
日本	国債証券	第３３３回利付国債（１０年）	2,680,000,000	101.44	2,718,618,800	101.30	2,714,920,400	0.600	2024/3/20	0.71
日本	国債証券	第１３６回利付国債（５年）	2,640,000,000	100.25	2,646,600,000	100.20	2,645,491,200	0.100	2023/6/20	0.69
日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	2,580,000,000	100.66	2,597,079,600	100.45	2,591,764,800	0.100	2026/12/20	0.68

(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	83.42
地方債証券	5.25
特殊債券	6.35
社債券	4.67
合計	99.69

(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	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（%）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	4	円	602,121,320	602,000,000	0.16

(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	206,462,583,548	66.24
	イギリス	13,207,506,935	4.24
	カナダ	11,262,181,334	3.61
	スイス	10,079,081,268	3.23
	フランス	9,471,535,247	3.04
	ドイツ	7,604,020,417	2.44
	オーストラリア	5,918,607,744	1.90
	オランダ	5,594,569,787	1.80
	アイルランド	5,328,154,483	1.71
	スウェーデン	2,915,892,432	0.94
	デンマーク	2,290,142,058	0.73
	スペイン	2,107,023,906	0.68
	香港	1,893,607,294	0.61
	イタリア	1,671,003,193	0.54
	フィンランド	1,053,980,746	0.34
	ジャージー	994,382,840	0.32
	シンガポール	923,376,074	0.30
	ベルギー	782,783,582	0.25
	イスラエル	670,599,643	0.22
	バミューダ	661,007,267	0.21
	ノルウェー	645,247,460	0.21
	ケイマン	587,283,787	0.19
	キュラソー	317,628,063	0.10
	ルクセンブルク	270,647,924	0.09

	ニュージーランド	230,267,277	0.07
	オーストリア	198,228,132	0.06
	ポルトガル	138,500,439	0.04
	パナマ	104,348,456	0.03
	リベリア	102,795,009	0.03
	マン島	69,034,933	0.02
	ロシア	5,511,072	0.00
	小計	293,561,532,350	94.19
投資信託受益証券	オーストラリア	85,065,351	0.03
	香港	44,109,696	0.01
	小計	129,175,047	0.04
投資証券	アメリカ	5,806,485,759	1.86
	オーストラリア	381,447,568	0.12
	イギリス	180,717,006	0.06
	フランス	141,840,087	0.05
	シンガポール	117,625,745	0.04
	香港	101,241,987	0.03
	カナダ	44,882,827	0.01
	小計	6,774,240,979	2.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	11,206,960,449	3.60
合計(純資産総額)		311,671,908,825	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	7,667,551,350	2.46
	買建	カナダ	508,812,920	0.16
	買建	ドイツ	1,745,743,847	0.56
	買建	イギリス	161,281,043	0.05
	買建	オーストラリア	389,251,170	0.12

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

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	—	995,433,695	0.32
	売建	—	1,234,972,721	△0.40

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	798,812	19,919.66	15,912,067,039	19,048.41	15,216,104,480	4.88
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	345,008	35,351.36	12,196,504,426	34,354.17	11,852,463,656	3.80
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	22,027	364,304.88	8,024,543,691	355,405.22	7,828,510,858	2.51
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	14,563	331,150.12	4,822,539,241	310,735.90	4,525,246,977	1.45
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	13,900	330,509.97	4,594,088,667	310,874.56	4,321,156,447	1.39
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	40,697	106,689.62	4,341,947,710	93,580.47	3,808,444,734	1.22
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	120,952	28,100.60	3,398,824,316	27,913.41	3,376,183,190	1.08
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	115,331	27,395.74	3,159,579,186	24,320.96	2,804,961,099	0.90
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	45,683	55,830.29	2,550,495,298	54,972.91	2,511,327,562	0.81
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	144,686	17,628.30	2,550,569,371	17,097.93	2,473,831,606	0.79
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	127,558	19,831.84	2,529,710,675	19,181.29	2,446,728,265	0.79

アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	64,242	36,397.09	2,338,222,145	36,888.18	2,369,770,588	0.76
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	117,178	18,664.79	2,187,102,938	18,284.63	2,142,556,608	0.69
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	81,833	26,390.46	2,159,610,882	25,336.64	2,073,373,957	0.67
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	136,031	14,870.82	2,022,893,331	14,795.90	2,012,702,433	0.65
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	366,345	5,578.75	2,043,748,634	5,202.06	1,905,749,037	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	51,131	41,559.86	2,124,997,636	36,588.90	1,870,827,429	0.60
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	205,529	9,406.92	1,933,395,991	8,994.41	1,848,612,504	0.59
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	42,363	44,163.20	1,870,886,065	42,648.34	1,806,712,030	0.58
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	20,078	72,973.62	1,465,164,503	76,194.19	1,529,827,027	0.49
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	88,209	16,410.41	1,447,545,944	17,278.19	1,524,091,994	0.49
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	92,886	15,700.93	1,458,396,955	16,220.90	1,506,695,353	0.48
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	272,114	6,124.14	1,666,466,953	5,514.04	1,500,449,113	0.48
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	33,666	43,107.91	1,451,271,066	43,626.08	1,468,715,744	0.47
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	84,795	16,252.10	1,378,097,456	17,279.34	1,465,202,229	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	199,430	7,043.92	1,404,770,561	7,262.31	1,448,323,979	0.46
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	19,933	68,192.98	1,359,290,830	67,944.55	1,354,338,825	0.43
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	202,087	6,372.58	1,287,816,080	6,475.42	1,308,598,606	0.42
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	66,328	19,931.21	1,321,997,927	19,456.30	1,290,498,063	0.41
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	21,257	60,059.42	1,276,683,166	59,795.96	1,271,082,924	0.41

(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	4.11
		素材	4.15
		資本財	5.89
		商業・専門サービス	1.11

		運輸	1.91
		自動車・自動車部品	2.15
		耐久消費財・アパレル	1.72
		消費者サービス	1.77
		メディア・娯楽	6.17
		小売	5.01
		食品・生活必需品小売り	1.42
		食品・飲料・タバコ	3.90
		家庭用品・パーソナル用品	1.69
		ヘルスケア機器・サービス	4.68
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.73
		銀行	6.25
		各種金融	4.66
		保険	2.99
		不動産	0.45
		ソフトウェア・サービス	10.90
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.37
		電気通信サービス	1.52
		公益事業	2.80
		半導体・半導体製造装置	4.86
		小計	94.19
投資信託受益証券	—	—	0.04
投資証券	—	—	2.17
合計			96.40

(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	303	アメリカドル	67,974,179	7,854,416,383	66,357,000	7,667,551,350	2.46
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	22	カナダドル	5,679,505.5	514,108,838	5,621,000	508,812,920	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	42	スイスフラン	5,054,181	631,065,039	4,994,640	623,630,750	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	219	ユーロ	8,919,547	1,153,654,208	8,675,685	1,122,113,097	0.36

	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	27	オーストラリアドル	4,751,907	394,170,686	4,692,600	389,251,170	0.12
	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	14	イギリスポンド	1,043,412.5	161,290,704	1,043,350	161,281,043	0.05

(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	6,873,500.00	794,441,192	793,864,505	0.25
	ユーロ	買建	1,200,000.00	158,461,200	155,214,480	0.05
	イギリスポンド	買建	300,000.00	46,892,880	46,354,710	0.01
	アメリカドル	売建	8,280,000.00	956,775,402	956,710,542	△0.31
	カナダドル	売建	600,000.00	54,308,700	54,309,000	△0.02
	ユーロ	売建	855,000.00	110,605,764	110,586,223	△0.04
	イギリスポンド	売建	152,000.00	23,506,496	23,495,506	△0.01
	スウェーデンクローナ	売建	4,000,000.00	48,474,700	48,397,500	△0.02
	オーストラリアドル	売建	500,000.00	41,470,000	41,473,950	△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	69,742,790,800	47.20
	フランス	14,183,731,645	9.60
	イタリア	12,446,014,354	8.42
	ドイツ	10,443,792,274	7.07
	イギリス	8,282,698,171	5.61
	スペイン	8,251,698,522	5.58
	ベルギー	3,178,062,911	2.15
	カナダ	2,941,696,230	1.99
	オランダ	2,635,810,807	1.78
	オーストラリア	2,277,259,612	1.54
	オーストリア	2,011,922,724	1.36
	中国	1,340,407,925	0.91

	アイルランド	1,126,059,146	0.76
	メキシコ	1,058,333,847	0.72
	フィンランド	845,106,201	0.57
	マレーシア	746,248,741	0.51
	ポーランド	653,835,372	0.44
	シンガポール	649,788,209	0.44
	イスラエル	624,165,230	0.42
	デンマーク	621,272,332	0.42
	スウェーデン	406,767,389	0.28
	ノルウェー	355,461,948	0.24
	小計	144,822,924,390	98.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	2,939,528,952	1.99
合計(純資産総額)		147,762,453,342	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	711,011,656	0.48
	買建	ドイツ	791,920,365	0.54

(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	—	1,453,375,826	0.98

(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 0.25% 06/15/24	10,610,000	11,242.20	1,192,797,692	11,191.19	1,187,386,118	0.250	2024/6/15	0.80
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	9,130,000	10,403.11	949,804,028	10,361.58	946,012,724	0.625	2030/8/15	0.64
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	7,400,000	10,437.41	772,368,698	10,400.40	769,629,806	0.625	2030/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/25	7,000,000	10,981.76	768,723,461	10,923.53	764,647,609	0.250	2025/9/30	0.52
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	6,500,000	11,681.60	759,304,550	11,650.46	757,280,171	2.000	2023/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 0.125% 06/30/23	6,630,000	11,396.34	755,577,634	11,370.39	753,856,912	0.125	2023/6/30	0.51
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	6,500,000	11,450.95	744,312,388	11,430.42	742,977,472	0.250	2023/4/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	6,550,000	10,889.68	713,274,355	10,842.74	710,199,642	1.250	2031/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/30/23	6,000,000	11,886.30	713,178,214	11,828.07	709,684,627	2.875	2023/11/30	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.625% 06/30/23	6,000,000	11,795.80	707,748,261	11,750.44	705,026,518	2.625	2023/6/30	0.48
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	11,704.40	708,116,355	11,636.69	704,020,194	2.000	2025/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.625% 04/30/23	5,800,000	11,636.47	674,915,362	11,606.45	673,174,443	1.625	2023/4/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.25% 05/31/28	6,000,000	11,122.59	667,355,417	11,086.93	665,215,935	1.250	2028/5/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	5,750,000	11,517.08	662,232,397	11,453.89	658,598,891	1.625	2026/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	6,160,000	10,603.51	653,176,707	10,561.99	650,618,719	0.875	2030/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	5,390,000	12,116.50	653,079,392	12,065.04	650,305,924	2.625	2029/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	5,500,000	11,792.41	648,583,056	11,722.00	644,710,325	2.250	2025/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	5,460,000	11,818.14	645,270,831	11,748.63	641,475,552	2.375	2024/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/51	5,870,000	10,985.37	644,841,491	10,808.43	634,455,352	2.000	2051/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	5,260,000	11,814.08	621,420,860	11,763.53	618,761,766	2.250	2027/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	5,400,000	11,506.25	621,337,626	11,440.80	617,803,422	1.625	2026/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.375% 08/15/24	5,500,000	11,246.71	618,569,389	11,192.55	615,590,366	0.375	2024/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	5,600,000	10,814.75	605,626,438	10,770.52	603,149,337	1.125	2031/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	5,300,000	11,433.13	605,955,938	11,374.45	602,846,016	1.500	2026/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 07/31/25	5,000,000	12,039.76	601,988,421	11,962.13	598,106,663	2.875	2025/7/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.25% 01/31/24	5,090,000	11,766.91	598,936,067	11,707.78	595,926,400	2.250	2024/1/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/31/25	5,000,000	11,990.56	599,528,466	11,912.93	595,646,708	2.750	2025/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.5% 05/31/27	5,500,000	10,797.60	593,868,325	10,756.53	591,609,231	0.500	2027/5/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	5,230,000	11,315.32	591,791,444	11,256.19	588,698,997	0.750	2024/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/28	5,300,000	11,139.29	590,382,415	11,107.24	588,683,919	1.250	2028/3/31	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.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	98.01
合計	98.01

(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	19	アメリカドル	2,231,217.31	257,817,160	2,231,312.5	257,828,159	0.17
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	14	アメリカドル	1,767,211.04	204,201,235	1,766,406.32	204,108,250	0.14
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	14	アメリカドル	2,159,320.52	249,509,486	2,155,562.5	249,075,247	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	8	ユーロ	891,717.1	115,334,690	894,040	115,635,134	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	12	ユーロ	1,569,366.3	202,981,837	1,573,440	203,508,729	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	22	ユーロ	3,653,768.4	472,578,405	3,655,300	472,776,502	0.32

(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	6,500,000.00	750,605,189	750,726,600	0.51
	カナダドル	買建	660,000.00	60,049,792	59,718,450	0.04
	ユーロ	買建	4,230,000.00	557,157,332	547,131,042	0.37
	イギリスポンド	買建	620,000.00	96,935,856	95,799,734	0.06

(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≫

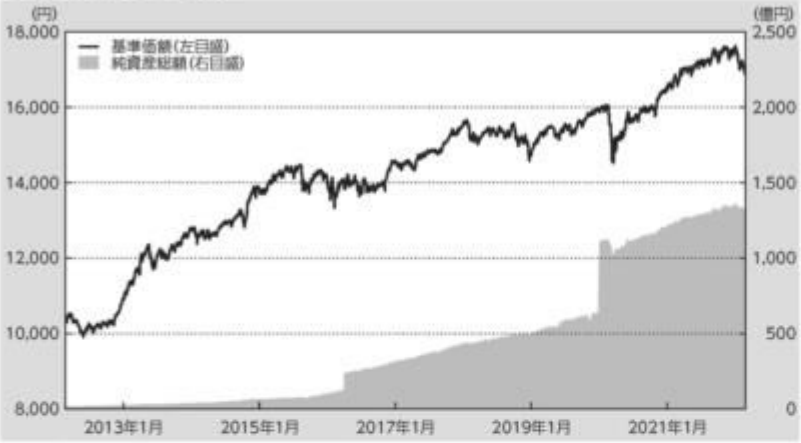
交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2010年10月20日
作成基準日：2022年 2 月28日

インデックスコレクション（バランス株式30）

基準価額・純資産の推移



※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。

基準価額	17,010円
純資産総額	1,320.67億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2017年７月	0円
2018年７月	0円
2019年７月	0円
2020年７月	0円
2021年７月	0円
設定来分配金合計額	0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。

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
日本債券マザーファンド	60.3%	第363回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2031/06/20	0.7%
		第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2025/09/20	0.7%
		第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2024/09/20	0.7%
日本株式マザーファンド	19.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.8%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.6%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	0.4%
外国株式マザーファンド	10.6%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.4%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.3%
外国債券マザーファンド	9.2%	T 0.25% 06/15/24	アメリカ	国債	-	0.250%	2024/06/15	0.1%
		T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.1%
		T 0.625% 05/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/05/15	0.0%

※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）

※2022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。

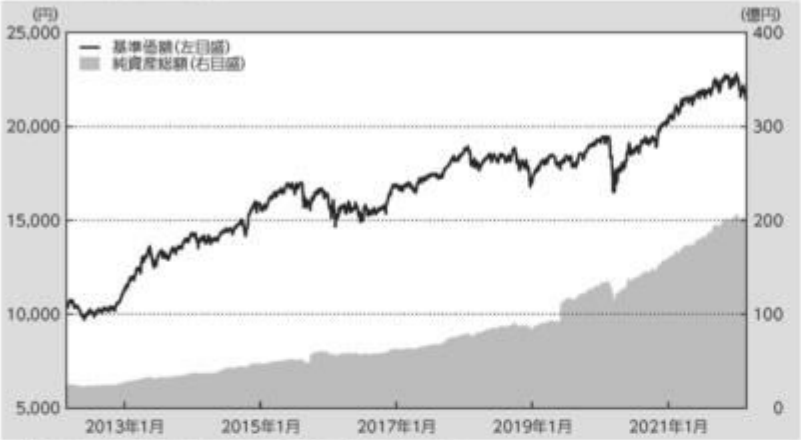
記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

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。

当初設定日：2010年10月20日
作成基準日：2022年 2 月28日

インデックスコレクション（バランス株式50）

基準価額・純資産の推移



※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。

基準価額	21,697円
純資産総額	199.78億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2017年７月	0円
2018年７月	0円
2019年７月	0円
2020年７月	0円
2021年７月	0円
設定来分配金合計額	0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。

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
日本債券マザーファンド	40.4%	第363回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2031/06/20	0.5%
		第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2025/09/20	0.4%
		第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2024/09/20	0.4%
日本株式マザーファンド	29.4%	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%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	0.6%
外国株式マザーファンド	20.3%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	1.0%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.8%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.5%
外国債券マザーファンド	9.6%	T 0.25% 06/15/24	アメリカ	国債	-	0.250%	2024/06/15	0.1%
		T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.1%
		T 0.625% 05/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/05/15	0.0%

※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）

※2022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。

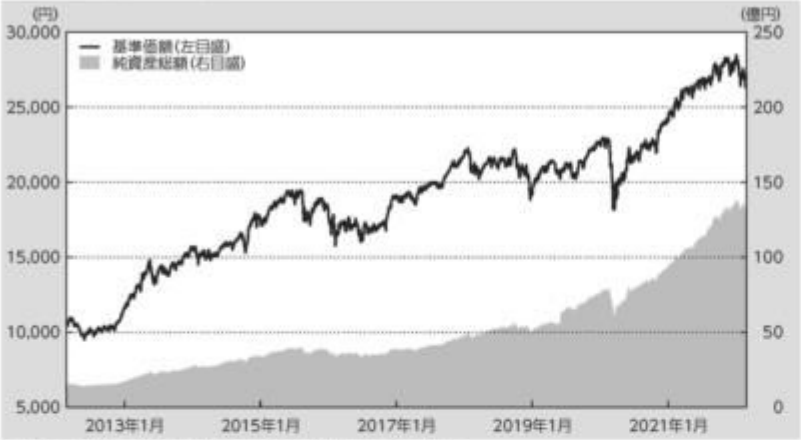
運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページ等でご確認いただけます。

運用実績

当初設定日：2010年10月20日
作成基準日：2022年 2 月28日

インデックスコレクション（バランス株式70）

基準価額・純資産の推移



※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。

基準価額	26,727円
純資産総額	131.98億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2017年 7 月	0円
2018年 7 月	0円
2019年 7 月	0円
2020年 7 月	0円
2021年 7 月	0円
設定来分配金合計額	0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。

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
日本株式マザーファンド	39.6%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.7%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	1.1%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	0.7%
外国株式マザーファンド	30.2%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	-	-	1.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.1%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.8%
日本債券マザーファンド	25.3%	第363回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2031/06/20	0.3%
		第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2025/09/20	0.3%
		第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2024/09/20	0.3%
外国債券マザーファンド	4.6%	T 0.25% 06/15/24	アメリカ	国債	-	0.250%	2024/06/15	0.0%
		T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.0%
		T 0.625% 05/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/05/15	0.0%

※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）

※2022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＞

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に

規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。
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＞
当ファンドは、「分配金再投資コース」（※）専用ファンドです。
※「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＞
1円以上1円単位とします。

＜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＞
収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。
ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日

＜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付けを中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

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

託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

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

＜一部解約の受付＞

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

＜一部解約単位＞

1口以上1口単位とします。

＜解約価額＞

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（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。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに拠ることとなります。

＜受付不可日＞

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日

＜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付けを中止すること、及びすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止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1万口当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＞

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

計算日の基準価額で評価します。

B．国内上場株式

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。

C．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す。）

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。

D．公社債等

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

イ．日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

ロ．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。）

ハ．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。（2010年10月20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７月26日から翌年７月25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2010年10月20日から2011年７月25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）

①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30億口を下回ることとなった場合

・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

②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。

③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。

④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）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。

①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れ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します。

②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、知れ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。

③上記①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。

④上記①から③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①から③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いて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続に従います。

(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。

①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れ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します。

②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、知れ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。

③上記①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。

④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。

⑤上記①から④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。

⑥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＞

①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。受託会社が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。

②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＞

①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。

②上記①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。

③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。

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

①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。

②収益分配金は、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。販売会社は、毎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ます。）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。

(2)償還金に対する請求権

①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。

②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、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。

③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。

④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【財務諸表】

【インデックスコレクション（バランス株式３０）】

(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11期計算期間(2020年7月28日から2021年7月26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）【貸借対照表】

（単位：円）

	第10期 （2020年 7月27日現在）	第11期 （2021年 7月26日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	635,727,697	681,829,425
親投資信託受益証券	111,665,613,936	128,612,884,880
未収入金	110,390,988	9,433,221
流動資産合計	112,411,732,621	129,304,147,526
資産合計	112,411,732,621	129,304,147,526
負債の部		
流動負債		
未払解約金	41,763,279	27,065,897
未払受託者報酬	12,056,062	13,716,279
未払委託者報酬	72,336,325	82,297,612
未払利息	640	1,223
その他未払費用	1,047,864	1,075,109
流動負債合計	127,204,170	124,156,120
負債合計	127,204,170	124,156,120
純資産の部		
元本等		
元本	71,224,303,613	74,988,698,593
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	41,060,224,838	54,191,292,813
（分配準備積立金）	5,062,621,653	14,242,034,535
元本等合計	112,284,528,451	129,179,991,406
純資産合計	112,284,528,451	129,179,991,406
負債純資産合計	112,411,732,621	129,304,147,526

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 自　2019年 7月26日 至　2020年 7月27日	第11期 自　2020年 7月28日 至　2021年 7月26日
営業収益		
受取利息	1,981	2,612
有価証券売買等損益	476,009,399	10,929,273,762
営業収益合計	476,011,380	10,929,276,374
営業費用		
支払利息	202,865	263,234
受託者報酬	19,325,422	26,708,609
委託者報酬	120,876,131	160,251,545
その他費用	1,972,325	2,148,391
営業費用合計	142,376,743	189,371,779
営業利益又は営業損失（△）	333,634,637	10,739,904,595
経常利益又は経常損失（△）	333,634,637	10,739,904,595
当期純利益又は当期純損失（△）	333,634,637	10,739,904,595
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（△）	△69,465,747	452,184,234
期首剰余金又は期首欠損金（△）	20,947,672,932	41,060,224,838
剰余金増加額又は欠損金減少額	23,740,842,748	6,243,617,917
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	23,740,842,748	6,243,617,917
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,031,391,226	3,400,270,303
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,031,391,226	3,400,270,303
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	41,060,224,838	54,191,292,813

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月26日から翌年7月25日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第11期計算期間は2020年 7月28日から2021年 7月26日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第10期 (2020年 7月27日現在)		第11期 (2021年 7月26日現在)	
１. 計算期間の末日における受益権の総数		71,224,303,613口		74,988,698,593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	1.5765円	1口当たり純資産額	1.7227円
	(1万口当たり純資産額)	(15,765円)	(1万口当たり純資産額)	(17,227円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第10期
自 2019年 7月26日
至 2020年 7月27日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,110,754,872円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	35,997,603,185円
分配準備積立金額	D	3,951,866,781円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	41,060,224,838円
当ファンドの期末残存口数	F	71,224,303,613口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,764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

第11期
自 2020年 7月28日
至 2021年 7月26日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,480,069,222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	8,087,265,659円
収益調整金額	C	39,949,258,278円
分配準備積立金額	D	4,674,699,654円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	54,191,292,813円
当ファンドの期末残存口数	F	74,988,698,593口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	7,226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11期 自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26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

	第11期 (2021年 7月26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10期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27日	第11期 自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	37,905,869,352円	71,224,303,613円
期中追加設定元本額	40,477,320,641円	9,629,005,674円
期中一部解約元本額	7,158,886,380円	5,864,610,694円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第10期 (2020年 7月27日現在)	第11期 (2021年 7月26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	518,597,203	10,165,602,532
合計	518,597,203	10,165,602,532

（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	11,797,110,415	25,440,468,609	
	日本債券マザーファンド	55,511,403,944	76,783,373,935	
	外国株式マザーファンド	3,415,764,981	14,304,199,010	
	外国債券マザーファンド	4,517,867,332	12,084,843,326	
合計		75,242,146,672	128,612,884,880	

(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。

【インデックスコレクション（バランス株式５０）】

(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11期計算期間(2020年7月28日から2021年7月26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）【貸借対照表】

（単位：円）

	第10期 （2020年 7月27日現在）	第11期 （2021年 7月26日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	79,638,793	98,735,496
親投資信託受益証券	13,848,096,851	18,191,206,271
未収入金	7,596,906	-
流動資産合計	13,935,332,550	18,289,941,767
資産合計	13,935,332,550	18,289,941,767
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,353,173	10,134,007
未払受託者報酬	1,436,534	1,878,027
未払委託者報酬	8,619,127	11,268,076
未払利息	80	177
その他未払費用	359,079	469,448
流動負債合計	11,767,993	23,749,735
負債合計	11,767,993	23,749,735
純資産の部		
元本等		
元本	7,380,420,310	8,351,781,813
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,543,144,247	9,914,410,219
（分配準備積立金）	1,964,640,384	4,072,034,139
元本等合計	13,923,564,557	18,266,192,032
純資産合計	13,923,564,557	18,266,192,032
負債純資産合計	13,935,332,550	18,289,941,767

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 自　2019年 7月26日 至　2020年 7月27日	第11期 自　2020年 7月28日 至　2021年 7月26日
営業収益		
受取利息	270	315
有価証券売買等損益	338,258,885	2,384,116,113
営業収益合計	338,259,155	2,384,116,428
営業費用		
支払利息	29,961	33,333
受託者報酬	2,799,239	3,541,482
委託者報酬	18,093,790	21,248,719
その他費用	699,844	885,250
営業費用合計	21,622,834	25,708,784
営業利益又は営業損失（△）	316,636,321	2,358,407,644
経常利益又は経常損失（△）	316,636,321	2,358,407,644
当期純利益又は当期純損失（△）	316,636,321	2,358,407,644
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（△）	△3,268,237	100,461,959
期首剰余金又は期首欠損金（△）	5,330,668,951	6,543,144,247
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,405,146,161	1,676,067,116
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,405,146,161	1,676,067,116
剰余金減少額又は欠損金増加額	512,575,423	562,746,829
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	512,575,423	562,746,829
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,543,144,247	9,914,410,219

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月26日から翌年7月25日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第11期計算期間は2020年 7月28日から2021年 7月26日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第10期 (2020年 7月27日現在)	第11期 (2021年 7月26日現在)
１. 計算期間の末日における受益権の総数	7,380,420,310口	8,351,781,813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 1.8866円 (1万口当たり純資産額) (18,866円)	1口当たり純資産額 2.1871円 (1万口当たり純資産額) (21,871円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第10期
自 2019年 7月26日
至 2020年 7月27日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	200,782,479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	42,105,581円
収益調整金額	C	4,578,503,863円
分配準備積立金額	D	1,721,752,324円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,543,144,247円
当ファンドの期末残存口数	F	7,380,420,310口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,865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

第11期
自 2020年 7月28日
至 2021年 7月26日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	231,837,880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	2,026,107,805円
収益調整金額	C	5,842,376,080円
分配準備積立金額	D	1,814,088,454円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,914,410,219円
当ファンドの期末残存口数	F	8,351,781,813口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	11,871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11期 自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26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

	第11期 (2021年 7月26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10期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27日	第11期 自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	6,339,102,081円	7,380,420,310円
期中追加設定元本額	1,649,045,263円	1,599,018,504円
期中一部解約元本額	607,727,034円	627,657,001円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第10期 (2020年 7月27日現在)	第11期 (2021年 7月26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	345,251,931	2,231,045,564
合計	345,251,931	2,231,045,564

（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	2,452,491,023	5,288,796,891	
	日本債券マザーファンド	5,217,625,878	7,217,020,114	
	外国株式マザーファンド	925,518,625	3,875,794,345	
	外国債券マザーファンド	676,509,373	1,809,594,921	
合計		9,272,144,899	18,191,206,271	

(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。

【インデックスコレクション（バランス株式７０）】

(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11期計算期間(2020年7月28日から2021年7月26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）【貸借対照表】

（単位：円）

	第10期 （2020年 7月27日現在）	第11期 （2021年 7月26日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	39,629,773	64,491,151
親投資信託受益証券	7,927,234,485	11,419,045,759
未収入金	9,106,729	-
流動資産合計	7,975,970,987	11,483,536,910
資産合計	7,975,970,987	11,483,536,910
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,263,269	14,132,271
未払受託者報酬	809,883	1,147,461
未払委託者報酬	4,859,231	6,884,699
未払利息	39	115
その他未払費用	202,410	286,807
流動負債合計	10,134,832	22,451,353
負債合計	10,134,832	22,451,353
純資産の部		
元本等		
元本	3,642,734,613	4,277,881,661
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,323,101,542	7,183,203,896
（分配準備積立金）	955,934,005	2,581,982,802
元本等合計	7,965,836,155	11,461,085,557
純資産合計	7,965,836,155	11,461,085,557
負債純資産合計	7,975,970,987	11,483,536,910

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 自　2019年 7月26日 至　2020年 7月27日	第11期 自　2020年 7月28日 至　2021年 7月26日
営業収益		
受取利息	155	211
有価証券売買等損益	220,698,990	1,930,580,299
営業収益合計	220,699,145	1,930,580,510
営業費用		
支払利息	17,595	18,545
受託者報酬	1,587,978	2,112,043
委託者報酬	10,445,426	12,672,141
その他費用	396,956	527,888
営業費用合計	12,447,955	15,330,617
営業利益又は営業損失（△）	208,251,190	1,915,249,893
経常利益又は経常損失（△）	208,251,190	1,915,249,893
当期純利益又は当期純損失（△）	208,251,190	1,915,249,893
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（△）	△16,083,589	151,130,794
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,507,303,245	4,323,101,542
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,390,615,450	1,833,564,448
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,390,615,450	1,833,564,448
剰余金減少額又は欠損金増加額	799,151,932	737,581,193
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	799,151,932	737,581,193
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,323,101,542	7,183,203,896

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月26日から翌年7月25日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第11期計算期間は2020年 7月28日から2021年 7月26日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第10期 (2020年 7月27日現在)		第11期 (2021年 7月26日現在)	
１. 計算期間の末日における受益権の総数		3,642,734,613口		4,277,881,661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	2.1868円	1口当たり純資産額	2.6791円
	(1万口当たり純資産額)	(21,868円)	(1万口当たり純資産額)	(26,791円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第10期
自 2019年 7月26日
至 2020年 7月27日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	127,774,497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	9,267,378円
収益調整金額	C	3,367,167,537円
分配準備積立金額	D	818,892,130円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,323,101,542円
当ファンドの期末残存口数	F	3,642,734,613口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	11,867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

第11期
自 2020年 7月28日
至 2021年 7月26日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	154,103,316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	1,610,015,783円
収益調整金額	C	4,601,221,094円
分配準備積立金額	D	817,863,703円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,183,203,896円
当ファンドの期末残存口数	F	4,277,881,661口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	16,791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11期 自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26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

	第11期 (2021年 7月26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10期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27日	第11期 自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,120,001,692円	3,642,734,613円
期中追加設定元本額	1,230,292,042円	1,243,904,534円
期中一部解約元本額	707,559,121円	608,757,486円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第10期 (2020年 7月27日現在)	第11期 (2021年 7月26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	251,862,104	1,877,289,629
合計	251,862,104	1,877,289,629

（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	2,094,428,936	4,516,636,000	
	日本債券マザーファンド	2,029,858,795	2,807,700,685	
	外国株式マザーファンド	855,125,978	3,581,011,058	
	外国債券マザーファンド	192,043,821	513,698,016	
合計		5,171,457,530	11,419,045,759	

(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

	2021年 7月26日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,569,964,624
株式	285,529,593,070
派生商品評価勘定	8,289,600
未収入金	614,785,668
未収配当金	355,846,225
前払金	18,039,800
差入委託証拠金	116,510,000
流動資産合計	288,213,028,987
資産合計	288,213,028,987
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	26,340,400
未払解約金	265,374,591
未払利息	2,818
流動負債合計	291,717,809
負債合計	291,717,809
純資産の部	

	2021年 7月26日現在
項目	金額（円）
元本等	
元本	133,516,172,873
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	154,405,138,305
元本等合計	287,921,311,178
純資産合計	287,921,311,178
負債純資産合計	288,213,028,987

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月26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 7月26日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		133,516,172,873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	2.1565円
	(1万口当たり純資産額)	(21,565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 7月26日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月26日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2021年 7月26日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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。

（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 7月26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	141,188,957,091円
期中追加設定元本額	7,488,473,911円
期中一部解約元本額	15,161,258,129円
期末元本額	133,516,172,873円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	608,769,800円
ＤＣ日本株式インデックスファンド	310,777,930円
ＤＣ日本株式インデックスファンドＬ	53,666,588,994円
ＤＣ日本株式インデックスファンドＡ	683,845,666円
ＤＣバランスファンド３０	2,246,388,327円
ＤＣバランスファンド５０	3,454,194,474円
ＤＣバランスファンド７０	2,005,957,721円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	562,618,035円
日本株式インデックスｅ	1,496,303,317円
インデックスコレクション（国内株式）	19,137,333,031円

区分	2021年 7月26日現在
インデックスコレクション（バランス株式３０）	11,797,110,415円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	2,452,491,023円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	2,094,428,936円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,495,384,363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）	2,771,609,513円
日本株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	1,098,947,508円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	55,303,682円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	655,094,151円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	74,942,273円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	140,588,631円
ＶＡバランス株式３０（適格機関投資家専用）	719,719円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	222,648,862円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	836,279,953円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	477,986,707円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	8,309,259,783円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	757,116,991円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	84,709,104円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	1,315,778,094円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	31,151,710円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	164,102,041円
バランスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	2,132,523,943円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	60,522,719円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	63,211,619円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	26,502,259円
バランスファンドＶＡ２（適格機関投資家専用）	679,553,887円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	293,512,492円
バランスファンドＶＡ３（適格機関投資家専用）	4,973,038,527円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	91,887,183円
国内バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	39,202,435円
国内バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	8,477,312円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	134,816,334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）	4,493,409円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月26日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	10,167,797,481
合計	10,167,797,481

(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 7月26日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,368,369,800	－	2,350,330,000	△18,039,800
合計		2,368,369,800	－	2,350,330,000	△18,039,800

(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	
		単価(円)	金額(円)	備考
極洋	4,800	2,963.00	14,222,400	
日本水産	136,300	555.00	75,646,500	
マルハニチロ	23,000	2,412.00	55,476,000	
雪国まいたけ	12,100	1,687.00	20,412,700	
カネコ種苗	4,400	1,431.00	6,296,400	
サカタのタネ	17,500	3,710.00	64,925,000	
ホクト	12,300	1,932.00	23,763,600	
ホクリヨウ	2,300	830.00	1,909,000	
住石ホールディングス	25,700	128.00	3,289,600	
日鉄鉱業	3,400	5,850.00	19,890,000	
三井松島ホールディングス	6,100	1,013.00	6,179,300	
ＩＮＰＥＸ	539,700	766.00	413,410,200	
石油資源開発	19,200	1,828.00	35,097,600	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	7,100	1,317.00	9,350,700	
ヒノキヤグループ	3,600	2,400.00	8,640,000	
ショーボンドホールディングス	20,900	4,710.00	98,439,000	
ミライト・ホールディングス	50,900	2,103.00	107,042,700	
タマホーム	8,900	2,663.00	23,700,700	
サンヨーホームズ	1,700	728.00	1,237,600	

日本アクア	5,800	528.00	3,062,400	
ファーストコーポレーション	4,500	776.00	3,492,000	
ベステラ	2,800	1,422.00	3,981,600	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	27,500	220.00	6,050,000	
キャンディル	2,500	572.00	1,430,000	
スペースバリューホールディングス	17,900	798.00	14,284,200	
ダイセキ環境ソリューション	2,800	1,338.00	3,746,400	
第一カッター興業	3,600	1,336.00	4,809,600	
安藤・間	94,100	859.00	80,831,900	
東急建設	43,000	807.00	34,701,000	
コムシスホールディングス	52,000	3,085.00	160,420,000	
ビーアールホールディングス	19,600	473.00	9,270,800	
高松コンストラクショングループ	9,100	2,030.00	18,473,000	
東建コーポレーション	4,500	10,140.00	45,630,000	
ソネック	1,500	1,084.00	1,626,000	
ヤマウラ	6,400	902.00	5,772,800	
オリエンタル白石	49,300	280.00	13,804,000	
大成建設	105,500	3,790.00	399,845,000	
大林組	338,900	910.00	308,399,000	
清水建設	317,500	891.00	282,892,500	
飛島建設	9,700	1,131.00	10,970,700	
長谷工コーポレーション	111,000	1,492.00	165,612,000	
松井建設	13,300	779.00	10,360,700	
錢高組	1,500	4,065.00	6,097,500	
鹿島建設	248,300	1,455.00	361,276,500	
不動テトラ	8,300	1,865.00	15,479,500	
大末建設	4,300	990.00	4,257,000	
鉄建建設	6,800	1,910.00	12,988,000	
西松建設	24,200	3,545.00	85,789,000	
三井住友建設	81,900	489.00	40,049,100	
大豊建設	7,400	4,220.00	31,228,000	
前田建設工業	84,900	944.00	80,145,600	
佐田建設	7,800	481.00	3,751,800	
ナカノフドー建設	8,100	414.00	3,353,400	
奥村組	18,600	3,015.00	56,079,000	
東鉄工業	14,500	2,349.00	34,060,500	
イチケン	2,400	1,887.00	4,528,800	
富士ピー・エス	4,400	557.00	2,450,800	
淺沼組	4,100	4,745.00	19,454,500	
戸田建設	140,700	783.00	110,168,100	
熊谷組	15,700	2,897.00	45,482,900	
北野建設	2,100	2,316.00	4,863,600	

植木組	3,000	1,447.00	4,341,000	
矢作建設工業	15,000	731.00	10,965,000	
ピーエス三菱	11,200	617.00	6,910,400	
日本ハウスホールディングス	23,100	390.00	9,009,000	
大東建託	37,000	13,060.00	483,220,000	
新日本建設	14,400	867.00	12,484,800	
ＮＩＰＰＯ	28,000	3,130.00	87,640,000	
東亜道路工業	2,100	4,625.00	9,712,500	
前田道路	20,900	2,137.00	44,663,300	
日本道路	3,300	8,220.00	27,126,000	
東亜建設工業	9,100	2,494.00	22,695,400	
日本国土開発	33,000	584.00	19,272,000	
若築建設	6,100	1,713.00	10,449,300	
東洋建設	38,000	591.00	22,458,000	
五洋建設	144,000	761.00	109,584,000	
世紀東急工業	16,300	900.00	14,670,000	
福田組	3,900	4,865.00	18,973,500	
住友林業	86,700	2,106.00	182,590,200	
日本基礎技術	10,400	586.00	6,094,400	
巴コーポレーション	15,000	384.00	5,760,000	
大和ハウス工業	313,000	3,393.00	1,062,009,000	
ライト工業	19,400	1,941.00	37,655,400	
積水ハウス	367,600	2,249.00	826,732,400	
日特建設	8,400	771.00	6,476,400	
北陸電気工事	5,900	1,315.00	7,758,500	
ユアテック	19,400	739.00	14,336,600	
日本リーテック	7,100	1,783.00	12,659,300	
四電工	1,800	3,015.00	5,427,000	
中電工	15,600	2,309.00	36,020,400	
関電工	55,100	895.00	49,314,500	
きんでん	68,800	1,824.00	125,491,200	
東京エネシス	11,300	997.00	11,266,100	
トーエネック	3,400	3,735.00	12,699,000	
住友電設	9,600	2,189.00	21,014,400	
日本電設工業	18,600	1,932.00	35,935,200	
協和エクシオ	51,400	2,738.00	140,733,200	
新日本空調	9,000	2,140.00	19,260,000	
九電工	23,800	3,755.00	89,369,000	
三機工業	24,000	1,505.00	36,120,000	
日揮ホールディングス	113,100	999.00	112,986,900	
中外炉工業	3,700	1,954.00	7,229,800	
ヤマト	10,800	814.00	8,791,200	

太平電業	7,500	2,696.00	20,220,000	
高砂熱学工業	30,600	1,986.00	60,771,600	
三晃金属工業	1,300	2,432.00	3,161,600	
朝日工業社	2,500	3,235.00	8,087,500	
明星工業	21,900	758.00	16,600,200	
大氣社	16,500	3,515.00	57,997,500	
ダイダン	7,500	2,690.00	20,175,000	
日比谷総合設備	10,900	1,886.00	20,557,400	
フィル・カンパニー	1,900	2,745.00	5,215,500	
テスホールディングス	6,200	2,412.00	14,954,400	
東洋エンジニアリング	14,200	791.00	11,232,200	
レイズネクスト	18,200	1,148.00	20,893,600	
ニップン	31,700	1,601.00	50,751,700	
日清製粉グループ本社	122,500	1,719.00	210,577,500	
日東富士製粉	800	6,850.00	5,480,000	
昭和産業	9,100	3,040.00	27,664,000	
鳥越製粉	9,600	796.00	7,641,600	
中部飼料	13,200	1,140.00	15,048,000	
フィード・ワン	14,600	764.00	11,154,400	
東洋精糖	1,800	1,190.00	2,142,000	
日本甜菜製糖	5,700	1,647.00	9,387,900	
DM三井製糖ホールディングス	8,600	1,892.00	16,271,200	
塩水港精糖	12,900	223.00	2,876,700	
日新製糖	5,100	1,694.00	8,639,400	
森永製菓	25,500	3,600.00	91,800,000	
中村屋	2,600	3,770.00	9,802,000	
江崎グリコ	29,900	4,220.00	126,178,000	
名糖産業	4,800	1,603.00	7,694,400	
井村屋グループ	6,100	2,300.00	14,030,000	
不二家	6,900	2,208.00	15,235,200	
山崎製パン	81,300	1,557.00	126,584,100	
第一屋製パン	2,100	878.00	1,843,800	
モロゾフ	1,700	5,230.00	8,891,000	
亀田製菓	6,200	4,690.00	29,078,000	
寿スピリッツ	10,400	6,830.00	71,032,000	
カルビー	49,400	2,580.00	127,452,000	
森永乳業	20,100	6,160.00	123,816,000	
六甲バター	7,200	1,568.00	11,289,600	
ヤクルト本社	74,600	6,410.00	478,186,000	
明治ホールディングス	71,700	6,930.00	496,881,000	
雪印メグミルク	26,100	2,118.00	55,279,800	
プリマハム	15,300	3,060.00	46,818,000	

日本ハム	41,500	4,460.00	185,090,000	
林兼産業	3,600	590.00	2,124,000	
丸大食品	10,700	1,742.00	18,639,400	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	9,700	3,520.00	34,144,000	
柿安本店	3,800	2,553.00	9,701,400	
伊藤ハム米久ホールディングス	69,800	748.00	52,210,400	
サッポロホールディングス	37,000	2,327.00	86,099,000	
アサヒグループホールディングス	237,000	5,032.00	1,192,584,000	
キリンホールディングス	460,000	2,084.50	958,870,000	
宝ホールディングス	80,400	1,353.00	108,781,200	
オエノンホールディングス	30,800	379.00	11,673,200	
養命酒製造	3,300	1,824.00	6,019,200	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	83,100	1,876.00	155,895,600	
サントリー食品インターナショナル	72,600	4,005.00	290,763,000	
ダイドーグループホールディングス	6,100	5,060.00	30,866,000	
伊藤園	32,900	6,590.00	216,811,000	
キーコーヒー	10,700	2,117.00	22,651,900	
ユニカフェ	3,300	991.00	3,270,300	
ジャパンフーズ	1,500	1,234.00	1,851,000	
日清オイリオグループ	13,600	3,100.00	42,160,000	
不二製油グループ本社	26,400	2,563.00	67,663,200	
かどや製油	1,200	4,045.00	4,854,000	
Ｊ－オイルミルズ	10,100	1,890.00	19,089,000	
キッコーマン	78,100	7,130.00	556,853,000	
味の素	258,000	2,881.00	743,298,000	
ブルドックソース	4,900	2,422.00	11,867,800	
キユーピー	60,400	2,512.00	151,724,800	
ハウス食品グループ本社	40,600	3,445.00	139,867,000	
カゴメ	44,300	2,920.00	129,356,000	
焼津水産化学工業	5,300	965.00	5,114,500	
アリアケジャパン	9,900	6,680.00	66,132,000	
ピエトロ	1,400	1,734.00	2,427,600	
エバラ食品工業	2,400	2,678.00	6,427,200	
やまみ	1,200	1,850.00	2,220,000	
ニチレイ	51,700	3,015.00	155,875,500	
東洋水産	55,800	4,285.00	239,103,000	
イートアンドホールディングス	3,700	1,983.00	7,337,100	
大冷	1,200	2,002.00	2,402,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,100	800.00	4,880,000	
日清食品ホールディングス	42,600	7,970.00	339,522,000	
永谷園ホールディングス	5,300	2,168.00	11,490,400	
一正蒲鉾	4,200	924.00	3,880,800	

フジッコ	11,700	1,940.00	22,698,000	
ロック・フィールド	11,700	1,467.00	17,163,900	
日本たばこ産業	581,600	2,172.00	1,263,235,200	
ケンコーマヨネーズ	6,600	1,481.00	9,774,600	
わらべや日洋ホールディングス	7,100	2,439.00	17,316,900	
なとり	6,100	1,934.00	11,797,400	
イフジ産業	1,700	962.00	1,635,400	
ピックルスコーポレーション	2,600	3,585.00	9,321,000	
ファーマフーズ	10,200	3,110.00	31,722,000	
北の達人コーポレーション	37,900	550.00	20,845,000	
ユーグレナ	55,200	1,032.00	56,966,400	
紀文食品	6,300	1,314.00	8,278,200	
ミヨシ油脂	3,800	1,284.00	4,879,200	
理研ビタミン	10,200	1,633.00	16,656,600	
片倉工業	14,400	1,509.00	21,729,600	
グンゼ	7,800	4,700.00	36,660,000	
東洋紡	42,100	1,355.00	57,045,500	
ユニチカ	31,900	340.00	10,846,000	
富士紡ホールディングス	5,200	3,935.00	20,462,000	
倉敷紡績	9,200	1,975.00	18,170,000	
シキボウ	5,900	930.00	5,487,000	
日本毛織	35,100	975.00	34,222,500	
トーア紡コーポレーション	4,200	427.00	1,793,400	
帝国繊維	12,100	1,990.00	24,079,000	
帝人	99,800	1,660.00	165,668,000	
東レ	766,800	716.30	549,258,840	
サカイオーベックス	2,900	3,035.00	8,801,500	
住江織物	2,300	2,065.00	4,749,500	
日本フエルト	6,700	445.00	2,981,500	
イチカワ	1,600	1,297.00	2,075,200	
日東製網	1,100	1,505.00	1,655,500	
アツギ	8,300	624.00	5,179,200	
ダイニック	4,000	742.00	2,968,000	
セーレン	26,200	2,198.00	57,587,600	
ソトー	4,400	804.00	3,537,600	
東海染工	1,500	1,139.00	1,708,500	
小松マテーレ	17,500	955.00	16,712,500	
ワコールホールディングス	26,500	2,494.00	66,091,000	
ホギメディカル	14,300	3,530.00	50,479,000	
ＴＳＩホールディングス	32,500	358.00	11,635,000	
マツオカコーポレーション	3,500	1,581.00	5,533,500	
ワールド	13,900	1,396.00	19,404,400	

三陽商会	5,500	937.00	5,153,500	
ナイガイ	4,300	332.00	1,427,600	
オンワードホールディングス	64,000	314.00	20,096,000	
ルックホールディングス	3,700	1,432.00	5,298,400	
ゴールドウイン	17,500	7,070.00	123,725,000	
デサント	18,100	3,135.00	56,743,500	
キング	5,900	448.00	2,643,200	
ヤマトインターナショナル	9,700	339.00	3,288,300	
特種東海製紙	6,500	4,460.00	28,990,000	
王子ホールディングス	476,500	633.00	301,624,500	
日本製紙	46,800	1,259.00	58,921,200	
三菱製紙	15,000	358.00	5,370,000	
北越コーポレーション	75,700	626.00	47,388,200	
中越パルプ工業	4,000	1,265.00	5,060,000	
巴川製紙所	3,500	959.00	3,356,500	
大王製紙	51,000	1,850.00	94,350,000	
阿波製紙	2,700	400.00	1,080,000	
レンゴー	109,100	922.00	100,590,200	
トーモク	6,500	1,958.00	12,727,000	
ザ・パック	8,000	2,802.00	22,416,000	
クラレ	166,700	1,021.00	170,200,700	
旭化成	701,600	1,189.50	834,553,200	
共和レザー	5,800	715.00	4,147,000	
昭和電工	80,400	3,055.00	245,622,000	
住友化学	833,200	565.00	470,758,000	
住友精化	5,200	3,740.00	19,448,000	
日産化学	58,000	5,410.00	313,780,000	
ラサ工業	3,500	1,815.00	6,352,500	
クレハ	9,100	7,250.00	65,975,000	
多木化学	4,100	5,660.00	23,206,000	
テイカ	7,800	1,238.00	9,656,400	
石原産業	19,000	1,141.00	21,679,000	
片倉コープアグリ	2,700	1,215.00	3,280,500	
日本曹達	14,800	3,390.00	50,172,000	
東ソー	163,600	1,893.00	309,694,800	
トクヤマ	31,400	2,269.00	71,246,600	
セントラル硝子	20,200	2,208.00	44,601,600	
東亜合成	64,600	1,137.00	73,450,200	
大阪ソーダ	10,800	2,450.00	26,460,000	
関東電化工業	25,100	1,034.00	25,953,400	
デンカ	38,600	3,760.00	145,136,000	
信越化学工業	195,700	17,735.00	3,470,739,500	

日本カーバイド工業	3,900	1,301.00	5,073,900	
堺化学工業	7,400	1,911.00	14,141,400	
第一稀元素化学工業	10,600	1,872.00	19,843,200	
エア・ウォーター	107,900	1,634.00	176,308,600	
日本酸素ホールディングス	87,200	2,411.00	210,239,200	
日本化学工業	3,000	3,090.00	9,270,000	
東邦アセチレン	1,600	1,158.00	1,852,800	
日本パーカライジング	53,400	1,145.00	61,143,000	
高圧ガス工業	16,800	668.00	11,222,400	
チタン工業	1,300	1,854.00	2,410,200	
四国化成工業	14,100	1,360.00	19,176,000	
戸田工業	2,300	2,651.00	6,097,300	
ステラ　ケミファ	5,800	2,851.00	16,535,800	
保土谷化学工業	3,100	3,985.00	12,353,500	
日本触媒	19,200	5,260.00	100,992,000	
大日精化工業	8,700	2,331.00	20,279,700	
カネカ	27,400	4,425.00	121,245,000	
三菱瓦斯化学	106,000	2,307.00	244,542,000	
三井化学	91,400	3,525.00	322,185,000	
ＪＳＲ	106,200	3,570.00	379,134,000	
東京応化工業	18,200	7,130.00	129,766,000	
大阪有機化学工業	9,800	3,730.00	36,554,000	
三菱ケミカルホールディングス	707,600	919.40	650,567,440	
ＫＨネオケム	17,500	2,539.00	44,432,500	
ダイセル	142,300	893.00	127,073,900	
住友ベークライト	16,600	4,760.00	79,016,000	
積水化学工業	221,500	1,907.00	422,400,500	
日本ゼオン	95,500	1,468.00	140,194,000	
アイカ工業	29,500	4,015.00	118,442,500	
宇部興産	53,500	2,208.00	118,128,000	
積水樹脂	16,000	2,164.00	34,624,000	
タキロンシーアイ	22,900	602.00	13,785,800	
旭有機材	6,000	1,358.00	8,148,000	
ニチバン	5,600	1,782.00	9,979,200	
リケンテクノス	25,800	612.00	15,789,600	
大倉工業	5,000	2,542.00	12,710,000	
積水化成品工業	14,200	617.00	8,761,400	
群栄化学工業	2,400	2,474.00	5,937,600	
タイガースポリマー	5,600	456.00	2,553,600	
ミライアル	3,400	1,255.00	4,267,000	
ダイキアクシス	4,000	824.00	3,296,000	
ダイキョーニシカワ	22,300	713.00	15,899,900	

竹本容器	3,800	1,036.00	3,936,800	
森六ホールディングス	5,700	2,259.00	12,876,300	
恵和	2,100	3,440.00	7,224,000	
日本化薬	65,500	1,129.00	73,949,500	
カーリットホールディングス	10,500	740.00	7,770,000	
日本精化	7,700	1,629.00	12,543,300	
扶桑化学工業	8,300	3,915.00	32,494,500	
トリケミカル研究所	9,800	3,005.00	29,449,000	
ＡＤＥＫＡ	48,700	2,230.00	108,601,000	
日油	39,900	5,610.00	223,839,000	
新日本理化	17,500	265.00	4,637,500	
ハリマ化成グループ	7,900	897.00	7,086,300	
花王	258,800	6,798.00	1,759,322,400	
第一工業製薬	3,600	3,275.00	11,790,000	
石原ケミカル	2,700	2,148.00	5,799,600	
日華化学	3,600	1,390.00	5,004,000	
ニイタカ	2,200	2,041.00	4,490,200	
三洋化成工業	6,300	5,750.00	36,225,000	
有機合成薬品工業	8,100	367.00	2,972,700	
大日本塗料	12,000	858.00	10,296,000	
日本ペイントホールディングス	436,700	1,402.00	612,253,400	
関西ペイント	118,900	2,754.00	327,450,600	
神東塗料	8,300	197.00	1,635,100	
中国塗料	25,500	886.00	22,593,000	
日本特殊塗料	7,900	1,088.00	8,595,200	
藤倉化成	14,300	507.00	7,250,100	
太陽ホールディングス	7,800	5,050.00	39,390,000	
ＤＩＣ	44,700	2,851.00	127,439,700	
サカタインクス	23,100	1,047.00	24,185,700	
東洋インキＳＣホールディングス	22,400	2,009.00	45,001,600	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	7,400	828.00	6,127,200	
富士フイルムホールディングス	189,900	8,059.00	1,530,404,100	
資生堂	214,700	7,630.00	1,638,161,000	
ライオン	140,500	1,946.00	273,413,000	
高砂香料工業	6,800	2,758.00	18,754,400	
マンダム	22,700	1,929.00	43,788,300	
ミルボン	14,400	6,210.00	89,424,000	
ファンケル	39,400	3,520.00	138,688,000	
コーセー	20,300	18,300.00	371,490,000	
コタ	6,800	1,457.00	9,907,600	
シーボン	1,400	1,957.00	2,739,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	46,100	2,898.00	133,597,800	

ノエビアホールディングス	9,200	5,550.00	51,060,000	
アジュバンコスメジャパン	2,400	1,069.00	2,565,600	
新日本製薬	2,900	2,090.00	6,061,000	
エステー	6,900	1,737.00	11,985,300	
アグロ　カネショウ	4,000	1,379.00	5,516,000	
コニシ	17,800	1,665.00	29,637,000	
長谷川香料	18,600	2,578.00	47,950,800	
星光ＰＭＣ	6,200	951.00	5,896,200	
小林製薬	30,300	9,450.00	286,335,000	
荒川化学工業	9,000	1,194.00	10,746,000	
メック	7,400	3,310.00	24,494,000	
日本高純度化学	3,000	3,005.00	9,015,000	
タカラバイオ	28,300	2,824.00	79,919,200	
ＪＣＵ	12,200	3,875.00	47,275,000	
新田ゼラチン	6,800	629.00	4,277,200	
ＯＡＴアグリオ	2,000	1,371.00	2,742,000	
デクセリアルズ	30,200	2,398.00	72,419,600	
アース製薬	8,100	6,750.00	54,675,000	
北興化学工業	10,100	1,028.00	10,382,800	
大成ラミック	3,300	2,816.00	9,292,800	
クミアイ化学工業	44,700	853.00	38,129,100	
日本農薬	19,300	516.00	9,958,800	
アキレス	7,500	1,399.00	10,492,500	
有沢製作所	15,000	890.00	13,350,000	
日東電工	65,300	8,310.00	542,643,000	
レック	12,800	1,140.00	14,592,000	
三光合成	11,300	517.00	5,842,100	
きもと	16,500	309.00	5,098,500	
藤森工業	9,700	4,210.00	40,837,000	
前澤化成工業	6,900	1,241.00	8,562,900	
未来工業	3,900	1,629.00	6,353,100	
ウェーブロックホールディングス	3,700	698.00	2,582,600	
ＪＳＰ	6,300	1,642.00	10,344,600	
エフピコ	19,900	4,160.00	82,784,000	
天馬	8,100	2,644.00	21,416,400	
信越ポリマー	16,600	1,074.00	17,828,400	
東リ	26,900	240.00	6,456,000	
ニフコ	39,700	3,750.00	148,875,000	
バルカー	8,800	2,226.00	19,588,800	
ユニ・チャーム	229,100	4,450.00	1,019,495,000	
ショーエイコーポレーション	2,400	899.00	2,157,600	
協和キリン	108,700	3,735.00	405,994,500	

武田薬品工業	899,200	3,700.00	3,327,040,000	
アステラス製薬	937,000	1,921.50	1,800,445,500	
大日本住友製薬	80,100	2,282.00	182,788,200	
塩野義製薬	135,900	5,970.00	811,323,000	
わかもと製薬	12,900	314.00	4,050,600	
日本新薬	30,600	8,690.00	265,914,000	
ビオフェルミン製薬	1,800	3,155.00	5,679,000	
中外製薬	338,000	4,176.00	1,411,488,000	
科研製薬	18,500	4,895.00	90,557,500	
エーザイ	119,400	9,456.00	1,129,046,400	
ロート製薬	51,500	3,025.00	155,787,500	
小野薬品工業	248,200	2,539.50	630,303,900	
久光製薬	31,400	5,140.00	161,396,000	
持田製薬	15,000	3,670.00	55,050,000	
参天製薬	188,100	1,536.00	288,921,600	
扶桑薬品工業	3,500	2,305.00	8,067,500	
日本ケミファ	1,300	2,215.00	2,879,500	
ツムラ	36,100	3,495.00	126,169,500	
日医工	30,600	866.00	26,499,600	
キッセイ薬品工業	19,100	2,270.00	43,357,000	
生化学工業	19,100	1,096.00	20,933,600	
栄研化学	19,000	2,187.00	41,553,000	
日水製薬	4,000	1,001.00	4,004,000	
鳥居薬品	6,800	2,557.00	17,387,600	
ＪＣＲファーマ	30,500	3,315.00	101,107,500	
東和薬品	15,600	2,739.00	42,728,400	
富士製薬工業	6,600	1,138.00	7,510,800	
ゼリア新薬工業	19,600	2,103.00	41,218,800	
第一三共	849,300	2,256.50	1,916,445,450	
キョーリン製薬ホールディングス	23,800	1,820.00	43,316,000	
大幸薬品	13,300	999.00	13,286,700	
ダイト	6,900	3,295.00	22,735,500	
大塚ホールディングス	224,600	4,506.00	1,012,047,600	
大正製薬ホールディングス	25,700	6,330.00	162,681,000	
ペプチドリーム	56,700	4,740.00	268,758,000	
あすか製薬ホールディングス	12,300	987.00	12,140,100	
サワイグループホールディングス	23,700	4,720.00	111,864,000	
日本コークス工業	91,300	101.00	9,221,300	
ニチレキ	12,800	1,380.00	17,664,000	
ユシロ化学工業	6,100	1,175.00	7,167,500	
ビーピー・カストロール	3,900	1,349.00	5,261,100	
富士石油	26,200	248.00	6,497,600	

ＭＯＲＥＳＣＯ	3,900	1,146.00	4,469,400	
出光興産	119,900	2,570.00	308,143,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,625,800	454.70	739,251,260	
コスモエネルギーホールディングス	34,100	2,476.00	84,431,600	
横浜ゴム	62,600	2,192.00	137,219,200	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	56,900	2,092.00	119,034,800	
ブリヂストン	287,400	4,772.00	1,371,472,800	
住友ゴム工業	97,100	1,509.00	146,523,900	
藤倉コンポジット	9,400	498.00	4,681,200	
オカモト	6,400	4,220.00	27,008,000	
フコク	4,700	979.00	4,601,300	
ニッタ	11,200	2,605.00	29,176,000	
住友理工	20,900	800.00	16,720,000	
三ツ星ベルト	13,100	1,844.00	24,156,400	
バンドー化学	19,000	920.00	17,480,000	
日東紡績	16,100	3,355.00	54,015,500	
ＡＧＣ	99,200	4,700.00	466,240,000	
日本板硝子	54,900	628.00	34,477,200	
石塚硝子	1,800	1,915.00	3,447,000	
日本山村硝子	4,600	959.00	4,411,400	
日本電気硝子	40,100	2,526.00	101,292,600	
オハラ	4,300	1,372.00	5,899,600	
住友大阪セメント	19,500	3,080.00	60,060,000	
太平洋セメント	61,400	2,540.00	155,956,000	
日本ヒューム	9,900	729.00	7,217,100	
日本コンクリート工業	23,500	315.00	7,402,500	
三谷セキサン	5,000	4,595.00	22,975,000	
アジアパイルホールディングス	16,800	473.00	7,946,400	
東海カーボン	105,700	1,429.00	151,045,300	
日本カーボン	6,000	4,090.00	24,540,000	
東洋炭素	6,400	2,937.00	18,796,800	
ノリタケカンパニーリミテド	6,000	4,335.00	26,010,000	
ＴＯＴＯ	77,200	5,730.00	442,356,000	
日本碍子	119,000	1,802.00	214,438,000	
日本特殊陶業	82,300	1,620.00	133,326,000	
ＭＡＲＵＷＡ	3,700	10,780.00	39,886,000	
品川リフラクトリーズ	2,500	4,135.00	10,337,500	
黒崎播磨	1,800	4,825.00	8,685,000	
ヨータイ	7,800	1,287.00	10,038,600	
イソライト工業	4,900	684.00	3,351,600	
東京窯業	14,000	318.00	4,452,000	
ニッカトー	5,000	670.00	3,350,000	

フジミインコーポレーテッド	8,700	4,855.00	42,238,500	
クニミネ工業	3,500	1,133.00	3,965,500	
エーアンドエーマテリアル	2,100	1,023.00	2,148,300	
ニチアス	27,300	2,822.00	77,040,600	
ニチハ	15,100	2,941.00	44,409,100	
日本製鉄	510,200	1,812.00	924,482,400	
神戸製鋼所	195,700	704.00	137,772,800	
中山製鋼所	14,900	395.00	5,885,500	
合同製鐵	5,800	1,631.00	9,459,800	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	309,300	1,290.00	398,997,000	
東京製鐵	41,700	1,169.00	48,747,300	
共英製鋼	12,100	1,420.00	17,182,000	
大和工業	22,700	3,730.00	84,671,000	
東京鐵鋼	4,100	1,602.00	6,568,200	
大阪製鐵	5,700	1,150.00	6,555,000	
淀川製鋼所	14,000	2,372.00	33,208,000	
丸一鋼管	34,700	2,657.00	92,197,900	
モリ工業	3,200	2,301.00	7,363,200	
大同特殊鋼	17,500	5,410.00	94,675,000	
日本高周波鋼業	4,100	388.00	1,590,800	
日本冶金工業	8,300	2,331.00	19,347,300	
山陽特殊製鋼	12,800	1,713.00	21,926,400	
愛知製鋼	6,000	3,120.00	18,720,000	
日立金属	100,800	2,132.00	214,905,600	
日本金属	2,700	967.00	2,610,900	
大平洋金属	7,300	1,657.00	12,096,100	
新日本電工	69,100	302.00	20,868,200	
栗本鐵工所	4,900	1,667.00	8,168,300	
虹技	1,500	1,130.00	1,695,000	
三菱製鋼	8,000	1,048.00	8,384,000	
日亜鋼業	15,800	297.00	4,692,600	
日本精線	1,500	4,755.00	7,132,500	
エンビプロ・ホールディングス	4,600	1,272.00	5,851,200	
シンニッタン	13,100	255.00	3,340,500	
新家工業	2,700	1,486.00	4,012,200	
大紀アルミニウム工業所	16,200	1,195.00	19,359,000	
日本軽金属ホールディングス	29,200	1,870.00	54,604,000	
三井金属鉱業	28,900	3,045.00	88,000,500	
東邦亜鉛	6,000	1,857.00	11,142,000	
三菱マテリアル	70,600	2,251.00	158,920,600	
住友金属鉱山	136,600	4,280.00	584,648,000	
ＤＯＷＡホールディングス	27,100	4,215.00	114,226,500	

古河機械金属	17,700	1,272.00	22,514,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,200	754.00	8,444,800	
東邦チタニウム	19,200	1,036.00	19,891,200	
ＵＡＣＪ	16,200	2,836.00	45,943,200	
ＣＫサンエツ	2,300	2,903.00	6,676,900	
古河電気工業	33,200	2,734.00	90,768,800	
住友電気工業	373,000	1,569.00	585,237,000	
フジクラ	129,200	551.00	71,189,200	
昭和電線ホールディングス	10,400	1,742.00	18,116,800	
東京特殊電線	1,400	2,608.00	3,651,200	
タツタ電線	19,000	575.00	10,925,000	
カナレ電気	1,800	1,689.00	3,040,200	
平河ヒューテック	6,000	1,202.00	7,212,000	
リョービ	13,200	1,436.00	18,955,200	
アーレスティ	13,300	475.00	6,317,500	
アサヒホールディングス	40,200	2,160.00	86,832,000	
稲葉製作所	6,000	1,499.00	8,994,000	
宮地エンジニアリンググループ	3,500	2,563.00	8,970,500	
トーカロ	27,600	1,405.00	38,778,000	
アルファＣｏ	3,800	1,144.00	4,347,200	
ＳＵＭＣＯ	136,300	2,635.00	359,150,500	
川田テクノロジーズ	2,200	3,730.00	8,206,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	3,500	5,860.00	20,510,000	
ジェイテックコーポレーション	1,200	3,440.00	4,128,000	
信和	5,700	702.00	4,001,400	
東洋製罐グループホールディングス	68,100	1,462.00	99,562,200	
ホッカンホールディングス	5,400	1,402.00	7,570,800	
コロナ	5,900	904.00	5,333,600	
横河ブリッジホールディングス	18,300	2,048.00	37,478,400	
駒井ハルテック	2,200	1,714.00	3,770,800	
高田機工	1,000	2,812.00	2,812,000	
三和ホールディングス	100,800	1,343.00	135,374,400	
文化シヤッター	31,500	1,211.00	38,146,500	
三協立山	13,800	819.00	11,302,200	
アルインコ	7,100	1,000.00	7,100,000	
東洋シヤッター	2,400	655.00	1,572,000	
ＬＩＸＩＬ	147,200	2,963.00	436,153,600	
日本フイルコン	7,400	502.00	3,714,800	
ノーリツ	22,200	1,917.00	42,557,400	
長府製作所	10,900	2,063.00	22,486,700	
リンナイ	20,800	10,430.00	216,944,000	
ダイニチ工業	5,100	759.00	3,870,900	

日東精工	13,400	594.00	7,959,600	
三洋工業	1,300	1,883.00	2,447,900	
岡部	21,700	658.00	14,278,600	
ジーテクト	13,300	1,561.00	20,761,300	
東プレ	19,900	1,601.00	31,859,900	
高周波熱錬	20,600	573.00	11,803,800	
東京製綱	7,600	1,118.00	8,496,800	
サンコール	9,100	452.00	4,113,200	
モリテック　スチール	8,300	475.00	3,942,500	
パイオラックス	15,800	1,541.00	24,347,800	
エイチワン	10,500	744.00	7,812,000	
日本発條	106,500	853.00	90,844,500	
中央発條	5,100	1,398.00	7,129,800	
アドバネクス	1,500	1,264.00	1,896,000	
立川ブラインド工業	4,700	1,299.00	6,105,300	
三益半導体工業	8,300	2,416.00	20,052,800	
日本ドライケミカル	2,700	1,862.00	5,027,400	
日本製鋼所	32,500	2,723.00	88,497,500	
三浦工業	46,300	4,960.00	229,648,000	
タクマ	36,300	1,731.00	62,835,300	
ツガミ	22,200	1,678.00	37,251,600	
オークマ	12,500	5,320.00	66,500,000	
芝浦機械	11,100	2,531.00	28,094,100	
アマダ	156,800	1,135.00	177,968,000	
アイダエンジニアリング	28,100	988.00	27,762,800	
滝澤鉄工所	3,100	1,117.00	3,462,700	
ＦＵＪＩ	42,700	2,596.00	110,849,200	
牧野フライス製作所	12,600	4,095.00	51,597,000	
オーエスジー	52,800	2,088.00	110,246,400	
ダイジェット工業	1,300	1,285.00	1,670,500	
旭ダイヤモンド工業	28,300	533.00	15,083,900	
ＤＭＧ森精機	67,700	1,751.00	118,542,700	
ソディック	25,700	1,030.00	26,471,000	
ディスコ	14,500	31,050.00	450,225,000	
日東工器	5,200	1,906.00	9,911,200	
日進工具	8,400	1,510.00	12,684,000	
パンチ工業	9,000	607.00	5,463,000	
冨士ダイス	5,500	690.00	3,795,000	
豊和工業	6,100	810.00	4,941,000	
ＯＫＫ	4,100	409.00	1,676,900	
東洋機械金属	7,800	514.00	4,009,200	
津田駒工業	2,100	866.00	1,818,600	

エンシュウ	2,700	842.00	2,273,400	
島精機製作所	15,700	1,865.00	29,280,500	
オプトラン	13,400	2,258.00	30,257,200	
ＮＣホールディングス	3,300	1,200.00	3,960,000	
イワキポンプ	6,900	927.00	6,396,300	
フリュー	10,500	1,407.00	14,773,500	
ヤマシンフィルタ	21,600	703.00	15,184,800	
日阪製作所	13,200	832.00	10,982,400	
やまびこ	20,800	1,256.00	26,124,800	
平田機工	5,100	6,240.00	31,824,000	
ペガサスミシン製造	11,000	474.00	5,214,000	
マルマエ	4,400	2,198.00	9,671,200	
タツモ	4,600	1,727.00	7,944,200	
ナブテスコ	63,000	4,295.00	270,585,000	
三井海洋開発	11,400	1,885.00	21,489,000	
レオン自動機	10,500	1,480.00	15,540,000	
ＳＭＣ	31,600	65,790.00	2,078,964,000	
ホソカワミクロン	3,800	6,300.00	23,940,000	
ユニオンツール	4,000	4,095.00	16,380,000	
オイレス工業	15,000	1,621.00	24,315,000	
日精エー・エス・ビー機械	3,600	4,820.00	17,352,000	
サトーホールディングス	14,100	2,786.00	39,282,600	
技研製作所	9,400	4,615.00	43,381,000	
日本エアーテック	3,500	1,281.00	4,483,500	
カワタ	3,000	883.00	2,649,000	
日精樹脂工業	8,300	1,391.00	11,545,300	
オカダアイヨン	3,400	1,313.00	4,464,200	
ワイエイシイホールディングス	4,300	1,145.00	4,923,500	
小松製作所	489,700	2,757.50	1,350,347,750	
住友重機械工業	61,900	3,055.00	189,104,500	
日立建機	50,600	3,190.00	161,414,000	
日工	16,300	693.00	11,295,900	
巴工業	4,300	2,291.00	9,851,300	
井関農機	10,900	1,486.00	16,197,400	
ＴＯＷＡ	10,100	2,057.00	20,775,700	
丸山製作所	2,300	1,819.00	4,183,700	
北川鉄工所	5,000	1,682.00	8,410,000	
ローツェ	4,700	8,490.00	39,903,000	
タカキタ	3,900	583.00	2,273,700	
クボタ	567,800	2,285.50	1,297,706,900	
荏原実業	5,500	2,873.00	15,801,500	
三菱化工機	3,500	2,522.00	8,827,000	

月島機械	20,000	1,165.00	23,300,000	
帝国電機製作所	7,600	1,234.00	9,378,400	
新東工業	25,800	807.00	20,820,600	
澁谷工業	9,500	3,110.00	29,545,000	
アイチ　コーポレーション	18,600	850.00	15,810,000	
小森コーポレーション	27,600	845.00	23,322,000	
鶴見製作所	8,400	1,767.00	14,842,800	
住友精密工業	1,600	2,792.00	4,467,200	
日本ギア工業	4,500	322.00	1,449,000	
酒井重工業	2,000	2,608.00	5,216,000	
荏原製作所	44,900	5,360.00	240,664,000	
石井鐵工所	1,600	3,015.00	4,824,000	
西島製作所	10,900	868.00	9,461,200	
北越工業	11,200	1,122.00	12,566,400	
ダイキン工業	137,700	22,645.00	3,118,216,500	
オルガノ	3,500	5,990.00	20,965,000	
トーヨーカネツ	4,100	2,412.00	9,889,200	
栗田工業	58,500	5,600.00	327,600,000	
椿本チエイン	15,500	3,440.00	53,320,000	
大同工業	5,300	1,125.00	5,962,500	
木村化工機	9,200	883.00	8,123,600	
アネスト岩田	18,300	1,058.00	19,361,400	
ダイフク	59,500	9,980.00	593,810,000	
サムコ	2,700	3,080.00	8,316,000	
加藤製作所	6,100	972.00	5,929,200	
油研工業	1,900	1,792.00	3,404,800	
タダノ	52,300	1,119.00	58,523,700	
フジテック	37,200	2,463.00	91,623,600	
ＣＫＤ	25,100	2,210.00	55,471,000	
キトー	9,100	1,689.00	15,369,900	
平和	30,200	1,997.00	60,309,400	
理想科学工業	8,000	1,800.00	14,400,000	
ＳＡＮＫＹＯ	25,700	2,811.00	72,242,700	
日本金銭機械	12,000	569.00	6,828,000	
マースグループホールディングス	6,900	1,632.00	11,260,800	
フクシマガリレイ	7,400	4,615.00	34,151,000	
オーイズミ	4,700	377.00	1,771,900	
ダイコク電機	5,000	910.00	4,550,000	
竹内製作所	18,100	2,754.00	49,847,400	
アマノ	28,300	2,825.00	79,947,500	
ＪＵＫＩ	15,000	825.00	12,375,000	
蛇の目ミシン工業	9,900	775.00	7,672,500	

マックス	14,500	1,866.00	27,057,000	
グローリー	27,800	2,411.00	67,025,800	
新晃工業	10,100	2,067.00	20,876,700	
大和冷機工業	17,400	1,091.00	18,983,400	
セガサミーホールディングス	98,300	1,459.00	143,419,700	
日本ピストンリング	4,000	1,319.00	5,276,000	
リケン	5,000	2,615.00	13,075,000	
ＴＰＲ	14,600	1,522.00	22,221,200	
ツバキ・ナカシマ	20,900	1,635.00	34,171,500	
ホシザキ	34,000	9,320.00	316,880,000	
大豊工業	8,900	972.00	8,650,800	
日本精工	222,000	932.00	206,904,000	
ＮＴＮ	250,100	291.00	72,779,100	
ジェイテクト	103,700	1,124.00	116,558,800	
不二越	10,000	4,490.00	44,900,000	
日本トムソン	29,700	662.00	19,661,400	
ＴＨＫ	67,400	3,265.00	220,061,000	
ユーシン精機	7,200	876.00	6,307,200	
前澤給装工業	7,600	992.00	7,539,200	
イーグル工業	13,400	1,262.00	16,910,800	
前澤工業	6,600	673.00	4,441,800	
日本ピラー工業	10,900	2,345.00	25,560,500	
キッツ	33,400	794.00	26,519,600	
マキタ	140,900	5,760.00	811,584,000	
日立造船	85,900	791.00	67,946,900	
三菱重工業	169,800	3,134.00	532,153,200	
ＩＨＩ	72,700	2,498.00	181,604,600	
スター精密	16,700	1,692.00	28,256,400	
日清紡ホールディングス	66,100	942.00	62,266,200	
イビデン	52,100	5,790.00	301,659,000	
コニカミノルタ	220,400	599.00	132,019,600	
ブラザー工業	132,300	2,318.00	306,671,400	
ミネベアミツミ	186,500	3,065.00	571,622,500	
日立製作所	519,600	6,497.00	3,375,841,200	
東芝	213,900	4,800.00	1,026,720,000	
三菱電機	1,080,700	1,502.50	1,623,751,750	
富士電機	65,100	5,140.00	334,614,000	
東洋電機製造	4,300	1,146.00	4,927,800	
安川電機	116,300	5,320.00	618,716,000	
シンフォニアテクノロジー	14,100	1,292.00	18,217,200	
明電舎	18,400	2,347.00	43,184,800	
オリジン	3,000	1,329.00	3,987,000	

山洋電気	5,300	7,630.00	40,439,000	
デンヨー	9,200	2,056.00	18,915,200	
東芝テック	11,600	4,520.00	52,432,000	
芝浦メカトロニクス	2,000	7,470.00	14,940,000	
マブチモーター	30,100	4,145.00	124,764,500	
日本電産	260,200	12,580.00	3,273,316,000	
トレックス・セミコンダクター	6,100	2,962.00	18,068,200	
東光高岳	6,000	1,349.00	8,094,000	
ダイヘン	11,800	4,895.00	57,761,000	
ヤーマン	18,100	1,347.00	24,380,700	
ＪＶＣケンウッド	96,300	239.00	23,015,700	
ミマキエンジニアリング	10,600	781.00	8,278,600	
Ｉ－ＰＥＸ	5,300	2,552.00	13,525,600	
日新電機	25,400	1,346.00	34,188,400	
大崎電気工業	21,600	624.00	13,478,400	
オムロン	90,000	9,270.00	834,300,000	
日東工業	15,900	1,841.00	29,271,900	
ＩＤＥＣ	14,500	2,204.00	31,958,000	
正興電機製作所	3,800	1,825.00	6,935,000	
不二電機工業	2,300	1,290.00	2,967,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	39,100	2,825.00	110,457,500	
サクサホールディングス	2,600	1,332.00	3,463,200	
メルコホールディングス	3,900	5,700.00	22,230,000	
テクノメディカ	2,800	1,610.00	4,508,000	
日本電気	137,300	5,670.00	778,491,000	
富士通	97,200	20,230.00	1,966,356,000	
沖電気工業	44,000	1,010.00	44,440,000	
岩崎通信機	4,700	950.00	4,465,000	
電気興業	5,200	2,278.00	11,845,600	
サンケン電気	12,600	5,230.00	65,898,000	
ナカヨ	2,100	1,427.00	2,996,700	
アイホン	6,200	2,000.00	12,400,000	
ルネサスエレクトロニクス	518,300	1,147.00	594,490,100	
セイコーエプソン	134,100	1,893.00	253,851,300	
ワコム	79,200	660.00	52,272,000	
アルバック	19,900	5,410.00	107,659,000	
アクセル	5,300	868.00	4,600,400	
ＥＩＺＯ	9,200	4,765.00	43,838,000	
日本信号	25,300	916.00	23,174,800	
京三製作所	23,400	423.00	9,898,200	
能美防災	14,600	2,144.00	31,302,400	
ホーチキ	8,400	1,161.00	9,752,400	

星和電機	6,600	525.00	3,465,000	
エレコム	25,100	1,984.00	49,798,400	
パナソニック	1,152,600	1,320.50	1,522,008,300	
シャープ	143,800	1,733.00	249,205,400	
アンリツ	65,000	2,048.00	133,120,000	
富士通ゼネラル	33,000	2,883.00	95,139,000	
ソニーグループ	677,000	10,975.00	7,430,075,000	
ＴＤＫ	52,200	13,180.00	687,996,000	
帝国通信工業	5,400	1,139.00	6,150,600	
タムラ製作所	39,000	940.00	36,660,000	
アルプスアルパイン	88,900	1,148.00	102,057,200	
池上通信機	3,400	822.00	2,794,800	
鈴木	5,500	935.00	5,142,500	
日本トリム	2,500	3,675.00	9,187,500	
ローランド　ディー．ジー．	6,600	2,782.00	18,361,200	
フォスター電機	11,000	927.00	10,197,000	
ＳＭＫ	2,800	2,459.00	6,885,200	
ヨコオ	8,800	2,640.00	23,232,000	
ホシデン	28,900	1,021.00	29,506,900	
ヒロセ電機	16,700	16,620.00	277,554,000	
日本航空電子工業	24,800	1,793.00	44,466,400	
ＴＯＡ	12,800	845.00	10,816,000	
マクセルホールディングス	22,000	1,276.00	28,072,000	
古野電気	14,500	1,105.00	16,022,500	
ユニデンホールディングス	2,800	2,716.00	7,604,800	
スミダコーポレーション	9,700	1,339.00	12,988,300	
アイコム	4,500	2,407.00	10,831,500	
リオン	4,800	2,747.00	13,185,600	
本多通信工業	9,700	503.00	4,879,100	
横河電機	108,200	1,670.00	180,694,000	
新電元工業	4,200	4,435.00	18,627,000	
アズビル	73,100	4,505.00	329,315,500	
東亜ディーケーケー	6,200	821.00	5,090,200	
日本光電工業	44,900	3,310.00	148,619,000	
チノー	3,500	1,532.00	5,362,000	
共和電業	11,500	380.00	4,370,000	
日本電子材料	4,500	1,772.00	7,974,000	
堀場製作所	21,400	7,060.00	151,084,000	
アドバンテスト	80,400	9,270.00	745,308,000	
小野測器	5,700	604.00	3,442,800	
エスペック	9,900	2,224.00	22,017,600	
キーエンス	106,100	57,530.00	6,103,933,000	

日置電機	5,300	7,030.00	37,259,000	
シスメックス	84,400	13,300.00	1,122,520,000	
日本マイクロニクス	19,300	1,393.00	26,884,900	
メガチップス	11,000	3,295.00	36,245,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	5,100	3,855.00	19,660,500	
澤藤電機	1,500	2,136.00	3,204,000	
原田工業	5,100	919.00	4,686,900	
コーセル	13,800	1,015.00	14,007,000	
イリソ電子工業	9,200	5,260.00	48,392,000	
オプテックスグループ	18,100	1,762.00	31,892,200	
千代田インテグレ	4,900	1,803.00	8,834,700	
アイ・オー・データ機器	4,600	1,005.00	4,623,000	
レーザーテック	47,500	21,720.00	1,031,700,000	
スタンレー電気	75,900	3,135.00	237,946,500	
岩崎電気	4,300	2,100.00	9,030,000	
ウシオ電機	55,700	1,990.00	110,843,000	
岡谷電機産業	9,500	377.00	3,581,500	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	11,900	350.00	4,165,000	
エノモト	3,400	1,710.00	5,814,000	
日本セラミック	11,200	2,877.00	32,222,400	
遠藤照明	6,300	750.00	4,725,000	
古河電池	8,100	1,560.00	12,636,000	
双信電機	6,500	576.00	3,744,000	
山一電機	7,500	1,640.00	12,300,000	
図研	7,200	3,575.00	25,740,000	
日本電子	19,800	7,090.00	140,382,000	
カシオ計算機	87,000	1,792.00	155,904,000	
ファナック	94,800	25,355.00	2,403,654,000	
日本シイエムケイ	24,900	431.00	10,731,900	
エンプラス	5,100	3,435.00	17,518,500	
大真空	3,800	3,565.00	13,547,000	
ローム	45,000	10,250.00	461,250,000	
浜松ホトニクス	77,600	6,300.00	488,880,000	
三井ハイテック	10,700	6,420.00	68,694,000	
新光電気工業	36,500	3,835.00	139,977,500	
京セラ	164,800	6,795.00	1,119,816,000	
太陽誘電	48,200	5,380.00	259,316,000	
村田製作所	317,500	9,022.00	2,864,485,000	
双葉電子工業	19,400	797.00	15,461,800	
北陸電気工業	4,700	1,095.00	5,146,500	
ニチコン	34,600	1,164.00	40,274,400	
日本ケミコン	10,900	2,568.00	27,991,200	

ＫＯＡ	15,400	1,663.00	25,610,200	
市光工業	17,100	706.00	12,072,600	
小糸製作所	64,800	6,790.00	439,992,000	
ミツバ	19,900	814.00	16,198,600	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	18,800	9,550.00	179,540,000	
キヤノン電子	10,300	1,630.00	16,789,000	
キヤノン	537,100	2,620.50	1,407,470,550	
リコー	275,000	1,205.00	331,375,000	
象印マホービン	29,700	1,564.00	46,450,800	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,800	1,582.00	2,847,600	
東京エレクトロン	63,300	45,370.00	2,871,921,000	
トヨタ紡織	31,500	2,269.00	71,473,500	
芦森工業	2,100	1,181.00	2,480,100	
ユニプレス	17,800	954.00	16,981,200	
豊田自動織機	87,500	9,300.00	813,750,000	
モリタホールディングス	17,400	1,647.00	28,657,800	
三櫻工業	15,000	1,180.00	17,700,000	
デンソー	238,000	7,330.00	1,744,540,000	
東海理化電機製作所	28,500	1,776.00	50,616,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	41,800	505.00	21,109,000	
川崎重工業	84,100	2,280.00	191,748,000	
名村造船所	32,500	201.00	6,532,500	
日本車輌製造	3,900	2,119.00	8,264,100	
三菱ロジスネクスト	14,300	986.00	14,099,800	
近畿車輛	1,900	1,198.00	2,276,200	
日産自動車	1,274,600	559.80	713,521,080	
いすゞ自動車	286,900	1,401.00	401,946,900	
トヨタ自動車	1,094,900	9,829.00	10,761,772,100	
日野自動車	135,000	909.00	122,715,000	
三菱自動車工業	400,000	278.00	111,200,000	
エフテック	7,600	785.00	5,966,000	
レシップホールディングス	4,300	574.00	2,468,200	
ＧＭＢ	2,000	1,221.00	2,442,000	
ファルテック	2,000	728.00	1,456,000	
武蔵精密工業	24,100	2,327.00	56,080,700	
日産車体	15,800	738.00	11,660,400	
新明和工業	30,500	951.00	29,005,500	
極東開発工業	18,600	1,568.00	29,164,800	
トピー工業	8,900	1,284.00	11,427,600	
ティラド	3,400	2,769.00	9,414,600	
曙ブレーキ工業	59,300	168.00	9,962,400	
タチエス	16,600	1,462.00	24,269,200	

ＮＯＫ	52,300	1,447.00	75,678,100	
フタバ産業	27,200	583.00	15,857,600	
ＫＹＢ	12,100	3,645.00	44,104,500	
大同メタル工業	22,400	609.00	13,641,600	
プレス工業	53,700	363.00	19,493,100	
ミクニ	13,900	317.00	4,406,300	
太平洋工業	22,700	1,215.00	27,580,500	
河西工業	14,700	403.00	5,924,100	
アイシン	79,100	4,725.00	373,747,500	
マツダ	339,200	1,008.00	341,913,600	
今仙電機製作所	9,500	702.00	6,669,000	
本田技研工業	850,900	3,440.00	2,927,096,000	
スズキ	214,200	4,479.00	959,401,800	
ＳＵＢＡＲＵ	309,700	2,084.00	645,414,800	
安永	5,300	1,142.00	6,052,600	
ヤマハ発動機	152,700	2,733.00	417,329,100	
ＴＢＫ	13,000	412.00	5,356,000	
エクセディ	14,700	1,710.00	25,137,000	
豊田合成	34,900	2,649.00	92,450,100	
愛三工業	17,000	969.00	16,473,000	
盟和産業	1,700	1,000.00	1,700,000	
日本プラスト	9,200	701.00	6,449,200	
ヨロズ	9,300	1,223.00	11,373,900	
エフ・シー・シー	17,700	1,571.00	27,806,700	
シマノ	40,400	28,395.00	1,147,158,000	
テイ・エス　テック	50,200	1,680.00	84,336,000	
ジャムコ	6,300	1,024.00	6,451,200	
テルモ	331,300	4,246.00	1,406,699,800	
クリエートメディック	3,600	979.00	3,524,400	
日機装	34,900	1,134.00	39,576,600	
日本エム・ディ・エム	6,200	2,389.00	14,811,800	
島津製作所	139,100	4,455.00	619,690,500	
ＪＭＳ	9,200	820.00	7,544,000	
長野計器	7,900	1,037.00	8,192,300	
ブイ・テクノロジー	5,100	4,930.00	25,143,000	
東京計器	6,900	1,059.00	7,307,100	
愛知時計電機	1,400	4,495.00	6,293,000	
インターアクション	5,400	2,298.00	12,409,200	
オーバル	9,800	285.00	2,793,000	
東京精密	18,200	4,695.00	85,449,000	
マニー	43,100	2,423.00	104,431,300	
ニコン	165,100	1,029.00	169,887,900	

トプコン	54,500	1,566.00	85,347,000	
オリンパス	598,000	2,240.00	1,339,520,000	
理研計器	9,500	2,599.00	24,690,500	
タムロン	8,700	2,592.00	22,550,400	
ＨＯＹＡ	210,900	15,120.00	3,188,808,000	
シード	4,200	746.00	3,133,200	
ノーリツ鋼機	9,700	2,441.00	23,677,700	
エー・アンド・デイ	9,100	975.00	8,872,500	
朝日インテック	114,500	2,953.00	338,118,500	
シチズン時計	137,200	419.00	57,486,800	
リズム	3,400	891.00	3,029,400	
大研医器	8,600	536.00	4,609,600	
メニコン	16,600	7,900.00	131,140,000	
シンシア	1,200	573.00	687,600	
松風	5,000	1,995.00	9,975,000	
セイコーホールディングス	15,300	2,284.00	34,945,200	
ニプロ	80,600	1,347.00	108,568,200	
中本パックス	2,700	1,770.00	4,779,000	
スノーピーク	6,400	3,925.00	25,120,000	
パラマウントベッドホールディングス	20,700	2,014.00	41,689,800	
トランザクション	5,900	1,296.00	7,646,400	
粧美堂	3,100	417.00	1,292,700	
ニホンフラッシュ	9,200	1,270.00	11,684,000	
前田工繊	11,900	3,670.00	43,673,000	
永大産業	14,100	297.00	4,187,700	
アートネイチャー	10,400	692.00	7,196,800	
バンダイナムコホールディングス	89,400	7,231.00	646,451,400	
アイフィスジャパン	2,700	670.00	1,809,000	
共立印刷	18,100	142.00	2,570,200	
ＳＨＯＥＩ	10,100	4,360.00	44,036,000	
フランスベッドホールディングス	13,900	928.00	12,899,200	
パイロットコーポレーション	18,200	3,870.00	70,434,000	
萩原工業	6,000	1,469.00	8,814,000	
トッパン・フォームズ	19,300	1,089.00	21,017,700	
フジシールインターナショナル	22,200	2,312.00	51,326,400	
タカラトミー	48,500	989.00	47,966,500	
廣済堂	7,500	835.00	6,262,500	
エステールホールディングス	2,900	640.00	1,856,000	
タカノ	3,700	673.00	2,490,100	
プロネクサス	8,700	1,017.00	8,847,900	
ホクシン	6,700	158.00	1,058,600	
ウッドワン	3,600	1,205.00	4,338,000	

大建工業	7,300	2,203.00	16,081,900	
凸版印刷	164,300	1,873.00	307,733,900	
大日本印刷	127,700	2,539.00	324,230,300	
共同印刷	3,300	2,670.00	8,811,000	
ＮＩＳＳＨＡ	22,200	1,586.00	35,209,200	
光村印刷	900	1,571.00	1,413,900	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	5,300	1,789.00	9,481,700	
アシックス	95,600	2,479.00	236,992,400	
ツツミ	2,700	2,385.00	6,439,500	
ローランド	8,400	5,460.00	45,864,000	
小松ウオール工業	3,300	1,951.00	6,438,300	
ヤマハ	64,300	6,130.00	394,159,000	
河合楽器製作所	3,000	4,220.00	12,660,000	
クリナップ	10,100	540.00	5,454,000	
ピジョン	69,400	3,200.00	222,080,000	
オリバー	2,300	3,780.00	8,694,000	
兼松サステック	700	1,800.00	1,260,000	
キングジム	8,700	890.00	7,743,000	
リンテック	23,100	2,413.00	55,740,300	
イトーキ	21,500	355.00	7,632,500	
任天堂	61,900	60,120.00	3,721,428,000	
三菱鉛筆	17,800	1,434.00	25,525,200	
タカラスタンダード	22,300	1,648.00	36,750,400	
コクヨ	51,800	1,783.00	92,359,400	
ナカバヤシ	10,600	590.00	6,254,000	
グローブライド	5,200	5,560.00	28,912,000	
オカムラ	37,100	1,533.00	56,874,300	
美津濃	10,700	2,633.00	28,173,100	
東京電力ホールディングス	916,700	312.00	286,010,400	
中部電力	330,600	1,327.00	438,706,200	
関西電力	409,500	1,047.50	428,951,250	
中国電力	155,900	1,012.00	157,770,800	
北陸電力	98,800	584.00	57,699,200	
東北電力	253,100	854.00	216,147,400	
四国電力	89,800	764.00	68,607,200	
九州電力	238,700	838.00	200,030,600	
北海道電力	101,100	504.00	50,954,400	
沖縄電力	21,000	1,416.00	29,736,000	
電源開発	86,000	1,626.00	139,836,000	
エフオン	6,500	1,151.00	7,481,500	
イーレックス	15,900	3,115.00	49,528,500	
レノバ	18,400	5,020.00	92,368,000	

東京瓦斯	207,800	2,040.50	424,015,900	
大阪瓦斯	195,700	2,035.00	398,249,500	
東邦瓦斯	53,200	5,440.00	289,408,000	
北海道瓦斯	5,800	1,586.00	9,198,800	
広島ガス	22,300	374.00	8,340,200	
西部ガスホールディングス	12,200	2,426.00	29,597,200	
静岡ガス	30,700	1,099.00	33,739,300	
メタウォーター	12,200	2,039.00	24,875,800	
ＳＢＳホールディングス	8,000	3,375.00	27,000,000	
東武鉄道	112,600	2,840.00	319,784,000	
相鉄ホールディングス	37,000	2,205.00	81,585,000	
東急	272,600	1,503.00	409,717,800	
京浜急行電鉄	138,800	1,330.00	184,604,000	
小田急電鉄	173,100	2,726.00	471,870,600	
京王電鉄	60,400	6,330.00	382,332,000	
京成電鉄	81,000	3,375.00	273,375,000	
富士急行	14,700	5,000.00	73,500,000	
新京成電鉄	2,800	2,120.00	5,936,000	
東日本旅客鉄道	190,200	7,515.00	1,429,353,000	
西日本旅客鉄道	96,300	6,099.00	587,333,700	
東海旅客鉄道	89,900	16,155.00	1,452,334,500	
西武ホールディングス	130,200	1,249.00	162,619,800	
鴻池運輸	17,200	1,263.00	21,723,600	
西日本鉄道	30,000	2,683.00	80,490,000	
ハマキョウレックス	8,300	3,215.00	26,684,500	
サカイ引越センター	5,000	5,820.00	29,100,000	
近鉄グループホールディングス	102,400	3,780.00	387,072,000	
阪急阪神ホールディングス	136,500	3,370.00	460,005,000	
南海電気鉄道	48,500	2,351.00	114,023,500	
京阪ホールディングス	45,600	3,165.00	144,324,000	
神戸電鉄	2,400	3,485.00	8,364,000	
名古屋鉄道	84,200	1,932.00	162,674,400	
山陽電気鉄道	7,300	1,940.00	14,162,000	
アルプス物流	7,100	945.00	6,709,500	
日本通運	35,400	8,200.00	290,280,000	
ヤマトホールディングス	143,400	3,285.00	471,069,000	
山九	26,300	4,970.00	130,711,000	
丸運	5,800	274.00	1,589,200	
丸全昭和運輸	8,300	3,425.00	28,427,500	
センコーグループホールディングス	56,500	1,110.00	62,715,000	
トナミホールディングス	2,500	4,905.00	12,262,500	
ニッコンホールディングス	34,300	2,410.00	82,663,000	

日本石油輸送	1,100	2,595.00	2,854,500	
福山通運	13,100	4,155.00	54,430,500	
セイノーホールディングス	76,700	1,416.00	108,607,200	
エスライン	2,800	903.00	2,528,400	
神奈川中央交通	2,500	3,390.00	8,475,000	
日立物流	22,500	4,395.00	98,887,500	
丸和運輸機関	21,600	1,549.00	33,458,400	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	10,300	1,649.00	16,984,700	
九州旅客鉄道	79,200	2,503.00	198,237,600	
ＳＧホールディングス	193,400	3,025.00	585,035,000	
日本郵船	85,800	5,520.00	473,616,000	
商船三井	60,900	5,000.00	304,500,000	
川崎汽船	31,500	3,580.00	112,770,000	
ＮＳユナイテッド海運	5,300	2,336.00	12,380,800	
飯野海運	49,900	442.00	22,055,800	
共栄タンカー	3,000	853.00	2,559,000	
乾汽船	7,000	1,229.00	8,603,000	
日本航空	249,400	2,298.00	573,121,200	
ＡＮＡホールディングス	276,200	2,574.00	710,938,800	
パスコ	2,000	1,532.00	3,064,000	
トランコム	3,100	8,580.00	26,598,000	
日新	8,200	1,509.00	12,373,800	
三菱倉庫	35,400	3,290.00	116,466,000	
三井倉庫ホールディングス	10,900	2,599.00	28,329,100	
住友倉庫	36,200	1,608.00	58,209,600	
澁澤倉庫	5,600	2,089.00	11,698,400	
東陽倉庫	17,200	315.00	5,418,000	
日本トランスシティ	22,500	573.00	12,892,500	
ケイヒン	2,000	1,372.00	2,744,000	
中央倉庫	6,200	999.00	6,193,800	
川西倉庫	1,900	1,124.00	2,135,600	
安田倉庫	8,400	961.00	8,072,400	
ファイズホールディングス	1,800	825.00	1,485,000	
東洋埠頭	3,100	1,425.00	4,417,500	
宇徳	7,300	515.00	3,759,500	
上組	56,300	2,340.00	131,742,000	
サンリツ	2,600	775.00	2,015,000	
キムラユニティー	2,700	1,303.00	3,518,100	
キユーソー流通システム	2,600	1,725.00	4,485,000	
近鉄エクスプレス	19,300	2,644.00	51,029,200	
東海運	5,800	306.00	1,774,800	
エーアイテイー	6,400	1,113.00	7,123,200	

内外トランスライン	3,600	1,928.00	6,940,800	
日本コンセプト	3,300	2,081.00	6,867,300	
ＮＥＣネッツエスアイ	35,200	1,823.00	64,169,600	
クロスキャット	3,000	999.00	2,997,000	
システナ	37,900	2,200.00	83,380,000	
デジタルアーツ	6,200	7,890.00	48,918,000	
日鉄ソリューションズ	15,400	3,570.00	54,978,000	
キューブシステム	5,600	1,016.00	5,689,600	
WOW　WORLD	1,800	2,042.00	3,675,600	
コア	4,700	1,455.00	6,838,500	
ラクーンホールディングス	7,600	2,457.00	18,673,200	
ソリトンシステムズ	5,500	1,581.00	8,695,500	
ソフトクリエイトホールディングス	4,200	2,930.00	12,306,000	
ＴＩＳ	106,100	2,886.00	306,204,600	
ＪＮＳホールディングス	5,200	603.00	3,135,600	
グリー	65,400	616.00	40,286,400	
GMOペパボ	1,000	4,505.00	4,505,000	
コーエーテクモホールディングス	28,200	5,030.00	141,846,000	
三菱総合研究所	4,600	4,090.00	18,814,000	
電算	1,300	2,307.00	2,999,100	
ＡＧＳ	5,700	887.00	5,055,900	
ファインデックス	9,200	1,110.00	10,212,000	
ブレインパッド	2,800	4,440.00	12,432,000	
ＫＬａｂ	19,400	664.00	12,881,600	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	14,300	1,056.00	15,100,800	
イーブックイニシアティブジャパン	1,800	3,365.00	6,057,000	
ネクソン	268,700	2,312.00	621,234,400	
アイスタイル	32,900	478.00	15,726,200	
エムアップホールディングス	2,800	3,390.00	9,492,000	
エイチーム	7,500	1,513.00	11,347,500	
エニグモ	10,200	1,450.00	14,790,000	
テクノスジャパン	8,600	608.00	5,228,800	
コロプラ	35,100	809.00	28,395,900	
ブロードリーフ	53,000	510.00	27,030,000	
クロス・マーケティンググループ	5,100	612.00	3,121,200	
デジタルハーツホールディングス	5,000	1,553.00	7,765,000	
システム情報	8,200	924.00	7,576,800	
メディアドゥ	4,200	4,670.00	19,614,000	
じげん	26,800	444.00	11,899,200	
ブイキューブ	5,900	2,499.00	14,744,100	
エンカレッジ・テクノロジ	2,200	638.00	1,403,600	
サイバーリンクス	3,700	1,509.00	5,583,300	

フィックスターズ	11,600	803.00	9,314,800	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,400	1,898.00	8,351,200	
オプティム	7,500	2,111.00	15,832,500	
セレス	3,600	3,360.00	12,096,000	
ＳＨＩＦＴ	5,300	20,240.00	107,272,000	
ティーガイア	11,400	2,012.00	22,936,800	
セック	1,600	2,660.00	4,256,000	
日本アジアグループ	10,200	967.00	9,863,400	
テクマトリックス	16,600	1,848.00	30,676,800	
プロシップ	3,300	1,392.00	4,593,600	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25,700	2,084.00	53,558,800	
GMOペイメントゲートウェイ	20,500	14,420.00	295,610,000	
ザッパラス	4,600	530.00	2,438,000	
システムリサーチ	3,200	2,200.00	7,040,000	
インターネットイニシアティブ	28,300	3,585.00	101,455,500	
さくらインターネット	11,800	609.00	7,186,200	
ヴィンクス	3,200	963.00	3,081,600	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,400	4,470.00	10,728,000	
ＳＲＡホールディングス	5,700	2,677.00	15,258,900	
システムインテグレータ	3,400	637.00	2,165,800	
朝日ネット	8,900	691.00	6,149,900	
ｅＢＡＳＥ	13,000	828.00	10,764,000	
アバント	11,500	1,651.00	18,986,500	
アドソル日進	3,900	2,115.00	8,248,500	
ＯＤＫソリューションズ	2,500	765.00	1,912,500	
フリービット	6,600	772.00	5,095,200	
コムチュア	9,800	2,335.00	22,883,000	
サイバーコム	2,100	1,368.00	2,872,800	
アステリア	7,900	824.00	6,509,600	
アイル	6,100	1,435.00	8,753,500	
マークラインズ	4,500	2,941.00	13,234,500	
メディカル・データ・ビジョン	12,200	2,085.00	25,437,000	
ｇｕｍｉ	15,000	797.00	11,955,000	
ショーケース	2,600	710.00	1,846,000	
モバイルファクトリー	2,600	1,124.00	2,922,400	
テラスカイ	3,500	2,104.00	7,364,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,800	1,897.00	9,105,600	
ＰＣＩホールディングス	5,000	1,109.00	5,545,000	
パイプドＨＤ	2,300	2,300.00	5,290,000	
アイビーシー	2,000	960.00	1,920,000	
ネオジャパン	2,200	1,418.00	3,119,600	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	2,300	3,255.00	7,486,500	

ラクス	32,000	3,320.00	106,240,000	
ランドコンピュータ	1,800	1,100.00	1,980,000	
ダブルスタンダード	1,400	5,260.00	7,364,000	
オープンドア	6,400	2,134.00	13,657,600	
マイネット	3,500	682.00	2,387,000	
アカツキ	4,300	3,405.00	14,641,500	
ベネフィットジャパン	900	2,027.00	1,824,300	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	2,800	3,420.00	9,576,000	
カナミックネットワーク	11,700	626.00	7,324,200	
ノムラシステムコーポレーション	5,500	304.00	1,672,000	
チェンジ	19,600	2,697.00	52,861,200	
シンクロ・フード	7,000	361.00	2,527,000	
オークネット	5,800	1,691.00	9,807,800	
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	1,040.00	2,392,000	
セグエグループ	3,000	1,074.00	3,222,000	
エイトレッド	2,100	2,319.00	4,869,900	
マクロミル	22,000	797.00	17,534,000	
ビーグリー	2,200	1,576.00	3,467,200	
オロ	3,400	3,820.00	12,988,000	
ユーザーローカル	3,300	1,916.00	6,322,800	
テモナ	2,500	1,066.00	2,665,000	
ニーズウェル	2,500	630.00	1,575,000	
サインポスト	2,500	707.00	1,767,500	
電算システムホールディングス	4,000	3,030.00	12,120,000	
ソルクシーズ	4,300	959.00	4,123,700	
フェイス	3,600	693.00	2,494,800	
プロトコーポレーション	12,800	1,395.00	17,856,000	
ハイマックス	3,200	1,100.00	3,520,000	
野村総合研究所	184,300	3,580.00	659,794,000	
サイバネットシステム	7,900	694.00	5,482,600	
ＣＥホールディングス	6,000	594.00	3,564,000	
日本システム技術	2,000	1,608.00	3,216,000	
インテージホールディングス	13,400	1,560.00	20,904,000	
東邦システムサイエンス	3,000	944.00	2,832,000	
ソースネクスト	51,100	304.00	15,534,400	
インフォコム	9,800	2,921.00	28,625,800	
ＨＥＲＯＺ	3,100	2,094.00	6,491,400	
ラクスル	11,600	5,560.00	64,496,000	
ＩＰＳ	2,600	2,803.00	7,287,800	
ＦＩＧ	12,400	277.00	3,434,800	
システムサポート	3,300	1,307.00	4,313,100	
イーソル	6,000	1,084.00	6,504,000	

アルテリア・ネットワークス	11,900	1,808.00	21,515,200	
ＥｄｕＬａｂ	1,100	5,000.00	5,500,000	
東海ソフト	1,800	1,373.00	2,471,400	
ウイングアーク１ｓｔ	5,700	2,048.00	11,673,600	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,500	2,115.00	5,287,500	
サーバーワークス	1,100	4,130.00	4,543,000	
東名	1,200	1,171.00	1,405,200	
ヴィッツ	1,100	1,803.00	1,983,300	
トビラシステムズ	1,600	1,293.00	2,068,800	
Ｓａｎｓａｎ	9,400	8,970.00	84,318,000	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	2,100	1,547.00	3,248,700	
ギフティ	6,500	3,545.00	23,042,500	
ベース	1,200	4,925.00	5,910,000	
フォーカスシステムズ	7,400	1,009.00	7,466,600	
クレスコ	7,100	1,992.00	14,143,200	
フジ・メディア・ホールディングス	110,200	1,228.00	135,325,600	
オービック	33,400	19,520.00	651,968,000	
ジャストシステム	15,100	6,380.00	96,338,000	
ＴＤＣソフト	9,500	1,116.00	10,602,000	
Ｚホールディングス	1,457,300	581.10	846,837,030	
トレンドマイクロ	56,700	5,900.00	334,530,000	
ＩＤホールディングス	6,300	960.00	6,048,000	
日本オラクル	21,500	8,250.00	177,375,000	
アルファシステムズ	2,900	3,845.00	11,150,500	
フューチャー	12,900	1,894.00	24,432,600	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	7,100	1,418.00	10,067,800	
ＳＢテクノロジー	3,900	3,050.00	11,895,000	
トーセ	3,200	799.00	2,556,800	
オービックビジネスコンサルタント	10,200	6,030.00	61,506,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	48,400	3,420.00	165,528,000	
アイティフォー	14,200	759.00	10,777,800	
東計電算	1,600	4,430.00	7,088,000	
エックスネット	1,900	1,041.00	1,977,900	
大塚商会	57,400	5,900.00	338,660,000	
サイボウズ	12,500	2,486.00	31,075,000	
電通国際情報サービス	13,200	4,675.00	61,710,000	
ＡＣＣＥＳＳ	13,500	874.00	11,799,000	
デジタルガレージ	17,600	4,780.00	84,128,000	
ＥＭシステムズ	17,800	851.00	15,147,800	
ウェザーニューズ	3,200	5,640.00	18,048,000	
ＣＩＪ	7,100	851.00	6,042,100	
ビジネスエンジニアリング	1,100	3,215.00	3,536,500	

日本エンタープライズ	12,000	206.00	2,472,000	
WOWOW	5,200	2,466.00	12,823,200	
スカラ	9,800	748.00	7,330,400	
インテリジェント　ウェイブ	6,600	586.00	3,867,600	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	9,600	445.00	4,272,000	
ネットワンシステムズ	43,400	3,785.00	164,269,000	
システムソフト	22,900	274.00	6,274,600	
アルゴグラフィックス	8,300	3,395.00	28,178,500	
マーベラス	17,000	761.00	12,937,000	
エイベックス	18,400	1,679.00	30,893,600	
日本ユニシス	36,900	3,420.00	126,198,000	
兼松エレクトロニクス	5,800	3,665.00	21,257,000	
都築電気	4,900	1,606.00	7,869,400	
ＴＢＳホールディングス	70,500	1,692.00	119,286,000	
日本テレビホールディングス	88,700	1,254.00	111,229,800	
朝日放送グループホールディングス	10,900	709.00	7,728,100	
テレビ朝日ホールディングス	32,900	1,723.00	56,686,700	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	70,400	422.00	29,708,800	
テレビ東京ホールディングス	7,700	2,098.00	16,154,600	
日本ＢＳ放送	3,800	1,106.00	4,202,800	
ビジョン	13,400	1,102.00	14,766,800	
スマートバリュー	3,100	683.00	2,117,300	
ワイヤレスゲート	4,900	422.00	2,067,800	
コネクシオ	6,200	1,578.00	9,783,600	
クロップス	2,200	889.00	1,955,800	
日本電信電話	1,240,500	2,825.50	3,505,032,750	
ＫＤＤＩ	850,500	3,469.00	2,950,384,500	
ソフトバンク	963,900	1,467.50	1,414,523,250	
光通信	12,500	20,220.00	252,750,000	
エムティーアイ	10,600	715.00	7,579,000	
GMOインターネット	37,600	2,936.00	110,393,600	
ファイバーゲート	3,600	1,413.00	5,086,800	
アイドママーケティングコミュニケーション	3,300	380.00	1,254,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	27,500	4,395.00	120,862,500	
学研ホールディングス	15,200	1,303.00	19,805,600	
ゼンリン	19,500	1,115.00	21,742,500	
昭文社ホールディングス	4,800	494.00	2,371,200	
インプレスホールディングス	8,800	261.00	2,296,800	
アイネット	5,600	1,425.00	7,980,000	
松竹	7,000	12,050.00	84,350,000	
東宝	62,600	4,900.00	306,740,000	
東映	3,500	19,910.00	69,685,000	

エヌ・ティ・ティ・データ	282,500	1,744.00	492,680,000	
ピー・シー・エー	1,600	3,995.00	6,392,000	
ビジネスブレイン太田昭和	3,800	1,744.00	6,627,200	
ＤＴＳ	22,100	2,741.00	60,576,100	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	45,300	5,750.00	260,475,000	
シーイーシー	11,500	1,637.00	18,825,500	
カプコン	91,000	3,065.00	278,915,000	
アイ・エス・ビー	5,100	1,476.00	7,527,600	
ジャステック	7,000	1,204.00	8,428,000	
ＳＣＳＫ	24,500	6,830.00	167,335,000	
日本システムウエア	3,600	2,415.00	8,694,000	
アイネス	10,600	1,382.00	14,649,200	
ＴＫＣ	18,000	3,245.00	58,410,000	
富士ソフト	11,400	5,520.00	62,928,000	
ＮＳＤ	34,200	1,880.00	64,296,000	
コナミホールディングス	38,600	6,200.00	239,320,000	
福井コンピュータホールディングス	4,900	4,060.00	19,894,000	
ＪＢＣＣホールディングス	7,300	1,466.00	10,701,800	
ミロク情報サービス	10,700	1,637.00	17,515,900	
ソフトバンクグループ	841,500	7,106.00	5,979,699,000	
ホウスイ	900	981.00	882,900	
高千穂交易	4,100	1,159.00	4,751,900	
オルバヘルスケアホールディングス	1,700	1,649.00	2,803,300	
伊藤忠食品	2,600	5,290.00	13,754,000	
エレマテック	8,500	1,260.00	10,710,000	
ＪＡＬＵＸ	3,000	1,724.00	5,172,000	
あらた	8,500	4,275.00	36,337,500	
トーメンデバイス	1,400	4,215.00	5,901,000	
東京エレクトロン　デバイス	3,500	5,320.00	18,620,000	
フィールズ	9,300	522.00	4,854,600	
双日	587,900	338.00	198,710,200	
アルフレッサ　ホールディングス	110,400	1,718.00	189,667,200	
横浜冷凍	29,900	897.00	26,820,300	
ラサ商事	5,700	899.00	5,124,300	
アルコニックス	11,300	1,463.00	16,531,900	
神戸物産	73,400	3,970.00	291,398,000	
ハイパー	2,200	549.00	1,207,800	
あい　ホールディングス	15,200	2,092.00	31,798,400	
ディーブイエックス	3,300	1,012.00	3,339,600	
ダイワボウホールディングス	48,500	2,220.00	107,670,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	25,400	2,727.00	69,265,800	
ラクト・ジャパン	4,700	2,676.00	12,577,200	

グリムス	3,200	2,077.00	6,646,400	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,500	762.00	14,097,000	
八洲電機	8,200	963.00	7,896,600	
メディアスホールディングス	6,100	996.00	6,075,600	
レスターホールディングス	11,100	1,919.00	21,300,900	
ジューテックホールディングス	2,500	1,049.00	2,622,500	
大光	4,100	674.00	2,763,400	
ＯＣＨＩホールディングス	3,100	1,294.00	4,011,400	
ＴＯＫＡＩホールディングス	51,600	910.00	46,956,000	
黒谷	2,900	826.00	2,395,400	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,900	730.00	1,387,000	
三洋貿易	10,700	1,219.00	13,043,300	
ビューティガレージ	1,700	4,265.00	7,250,500	
ウイン・パートナーズ	7,700	998.00	7,684,600	
ミタチ産業	2,900	822.00	2,383,800	
シップヘルスケアホールディングス	37,500	2,803.00	105,112,500	
明治電機工業	3,700	1,427.00	5,279,900	
デリカフーズホールディングス	4,200	656.00	2,755,200	
スターティアホールディングス	2,100	2,046.00	4,296,600	
コメダホールディングス	23,200	2,025.00	46,980,000	
ピーバンドットコム	1,500	768.00	1,152,000	
アセンテック	2,700	1,185.00	3,199,500	
富士興産	3,300	1,049.00	3,461,700	
協栄産業	1,200	1,418.00	1,701,600	
小野建	9,600	1,335.00	12,816,000	
南陽	2,200	1,974.00	4,342,800	
佐鳥電機	6,700	860.00	5,762,000	
エコートレーディング	2,300	669.00	1,538,700	
伯東	6,500	1,540.00	10,010,000	
コンドーテック	8,300	1,008.00	8,366,400	
中山福	6,200	447.00	2,771,400	
ナガイレーベン	14,100	2,605.00	36,730,500	
三菱食品	11,700	2,848.00	33,321,600	
松田産業	7,800	2,143.00	16,715,400	
第一興商	20,200	4,135.00	83,527,000	
メディパルホールディングス	106,700	2,152.00	229,618,400	
ＳＰＫ	4,600	1,397.00	6,426,200	
萩原電気ホールディングス	3,900	2,283.00	8,903,700	
アズワン	7,600	15,520.00	117,952,000	
スズデン	3,700	1,482.00	5,483,400	
尾家産業	3,100	1,201.00	3,723,100	
シモジマ	6,500	1,091.00	7,091,500	

ドウシシャ	10,000	1,712.00	17,120,000	
小津産業	2,300	1,909.00	4,390,700	
高速	5,600	1,477.00	8,271,200	
たけびし	3,700	1,546.00	5,720,200	
リックス	2,400	1,535.00	3,684,000	
丸文	9,500	683.00	6,488,500	
ハピネット	8,900	1,466.00	13,047,400	
橋本総業ホールディングス	2,200	2,928.00	6,441,600	
日本ライフライン	34,400	1,395.00	47,988,000	
タカショー	6,900	886.00	6,113,400	
マルカ	3,500	2,573.00	9,005,500	
ＩＤＯＭ	35,900	946.00	33,961,400	
進和	6,300	2,258.00	14,225,400	
エスケイジャパン	2,600	480.00	1,248,000	
ダイトロン	4,500	1,980.00	8,910,000	
シークス	13,500	1,427.00	19,264,500	
田中商事	3,300	661.00	2,181,300	
オーハシテクニカ	5,500	1,563.00	8,596,500	
白銅	3,800	2,210.00	8,398,000	
ダイコー通産	1,300	1,240.00	1,612,000	
伊藤忠商事	744,500	3,273.00	2,436,748,500	
丸紅	1,049,700	955.60	1,003,093,320	
高島	1,700	1,777.00	3,020,900	
長瀬産業	58,500	1,719.00	100,561,500	
蝶理	6,800	1,876.00	12,756,800	
豊田通商	106,900	5,250.00	561,225,000	
三共生興	16,200	558.00	9,039,600	
兼松	42,500	1,508.00	64,090,000	
ツカモトコーポレーション	1,800	1,449.00	2,608,200	
三井物産	849,100	2,554.00	2,168,601,400	
日本紙パルプ商事	5,600	3,655.00	20,468,000	
カメイ	13,900	1,163.00	16,165,700	
東都水産	1,200	5,170.00	6,204,000	
ＯＵＧホールディングス	1,700	2,911.00	4,948,700	
スターゼン	7,900	2,225.00	17,577,500	
山善	41,600	1,044.00	43,430,400	
椿本興業	2,000	3,600.00	7,200,000	
住友商事	671,700	1,486.00	998,146,200	
内田洋行	4,600	4,885.00	22,471,000	
三菱商事	648,100	3,104.00	2,011,702,400	
第一実業	4,800	4,560.00	21,888,000	
キヤノンマーケティングジャパン	26,400	2,573.00	67,927,200	

西華産業	5,600	1,664.00	9,318,400	
佐藤商事	8,800	1,146.00	10,084,800	
菱洋エレクトロ	8,100	2,484.00	20,120,400	
東京産業	9,700	672.00	6,518,400	
ユアサ商事	10,900	3,150.00	34,335,000	
神鋼商事	2,400	2,340.00	5,616,000	
トルク	6,500	235.00	1,527,500	
阪和興業	21,300	3,130.00	66,669,000	
正栄食品工業	6,900	3,950.00	27,255,000	
カナデン	8,700	1,066.00	9,274,200	
菱電商事	7,700	1,651.00	12,712,700	
フルサト工業	5,400	1,995.00	10,773,000	
岩谷産業	25,500	6,390.00	162,945,000	
ナイス	4,200	2,031.00	8,530,200	
ニチモウ	1,700	2,087.00	3,547,900	
極東貿易	3,100	2,689.00	8,335,900	
アステナホールディングス	15,600	567.00	8,845,200	
三愛石油	26,200	1,364.00	35,736,800	
稲畑産業	25,600	1,707.00	43,699,200	
ＧＳＩクレオス	5,200	973.00	5,059,600	
明和産業	9,900	477.00	4,722,300	
クワザワホールディングス	3,800	613.00	2,329,400	
ヤマエ久野	7,800	1,104.00	8,611,200	
ワキタ	21,000	1,036.00	21,756,000	
東邦ホールディングス	34,200	1,916.00	65,527,200	
サンゲツ	28,600	1,631.00	46,646,600	
ミツウロコグループホールディングス	15,700	1,285.00	20,174,500	
シナネンホールディングス	3,900	3,280.00	12,792,000	
伊藤忠エネクス	23,600	1,020.00	24,072,000	
サンリオ	29,900	1,907.00	57,019,300	
サンワテクノス	7,000	1,317.00	9,219,000	
リョーサン	11,800	2,156.00	25,440,800	
新光商事	14,400	784.00	11,289,600	
トーホー	4,800	1,576.00	7,564,800	
三信電気	5,700	2,129.00	12,135,300	
東陽テクニカ	10,500	1,189.00	12,484,500	
モスフードサービス	15,000	3,140.00	47,100,000	
加賀電子	9,600	2,922.00	28,051,200	
ソーダニッカ	10,200	536.00	5,467,200	
立花エレテック	7,900	1,451.00	11,462,900	
フォーバル	3,800	952.00	3,617,600	
ＰＡＬＴＡＣ	17,100	5,150.00	88,065,000	

三谷産業	14,100	388.00	5,470,800	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,400	2,693.00	6,463,200	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,759.00	1,759,000	
コーア商事ホールディングス	8,000	653.00	5,224,000	
国際紙パルプ商事	22,800	262.00	5,973,600	
ヤマタネ	4,600	1,566.00	7,203,600	
丸紅建材リース	1,000	1,916.00	1,916,000	
日鉄物産	7,600	4,600.00	34,960,000	
泉州電業	3,000	3,865.00	11,595,000	
トラスコ中山	24,400	2,911.00	71,028,400	
オートバックスセブン	38,600	1,571.00	60,640,600	
モリト	7,800	677.00	5,280,600	
加藤産業	15,400	3,375.00	51,975,000	
北恵	2,700	990.00	2,673,000	
イノテック	6,000	1,336.00	8,016,000	
イエローハット	20,100	2,115.00	42,511,500	
ＪＫホールディングス	9,600	809.00	7,766,400	
日伝	8,800	2,239.00	19,703,200	
北沢産業	7,300	250.00	1,825,000	
杉本商事	5,400	2,325.00	12,555,000	
因幡電機産業	28,400	2,694.00	76,509,600	
東テク	3,500	2,654.00	9,289,000	
ミスミグループ本社	133,500	3,920.00	523,320,000	
アルテック	7,900	320.00	2,528,000	
タキヒヨー	3,500	1,903.00	6,660,500	
蔵王産業	2,100	1,573.00	3,303,300	
スズケン	45,100	3,315.00	149,506,500	
ジェコス	7,400	900.00	6,660,000	
グローセル	11,600	451.00	5,231,600	
ローソン	26,900	5,620.00	151,178,000	
サンエー	8,100	4,145.00	33,574,500	
カワチ薬品	7,500	2,246.00	16,845,000	
エービーシー・マート	16,700	6,020.00	100,534,000	
ハードオフコーポレーション	5,000	766.00	3,830,000	
アスクル	17,300	1,690.00	29,237,000	
ゲオホールディングス	14,400	1,216.00	17,510,400	
アダストリア	14,900	1,913.00	28,503,700	
くら寿司	12,600	3,960.00	49,896,000	
キャンドゥ	5,200	1,885.00	9,802,000	
アイケイ	3,400	645.00	2,193,000	
パルグループホールディングス	9,500	1,799.00	17,090,500	
エディオン	45,300	1,115.00	50,509,500	

サーラコーポレーション	22,000	607.00	13,354,000	
ワッツ	5,400	942.00	5,086,800	
ハローズ	4,400	2,883.00	12,685,200	
フジオフードグループ本社	9,000	1,301.00	11,709,000	
あみやき亭	2,400	2,899.00	6,957,600	
大黒天物産	3,400	6,340.00	21,556,000	
ハニーズホールディングス	8,600	1,184.00	10,182,400	
ファーマライズホールディングス	2,900	748.00	2,169,200	
アルペン	8,200	3,140.00	25,748,000	
ハブ	3,800	695.00	2,641,000	
クオールホールディングス	14,500	1,525.00	22,112,500	
ジンズホールディングス	7,300	7,220.00	52,706,000	
ビックカメラ	63,300	1,130.00	71,529,000	
ＤＣＭホールディングス	65,900	1,107.00	72,951,300	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	151,500	2,613.00	395,869,500	
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	601.00	1,682,800	
アークランドサービスホールディングス	9,000	2,188.00	19,692,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	127,400	933.00	118,864,200	
ドトール・日レスホールディングス	17,000	1,664.00	28,288,000	
マツモトキヨシホールディングス	44,000	5,030.00	221,320,000	
ブロンコビリー	5,700	2,376.00	13,543,200	
ＺＯＺＯ	62,800	3,470.00	217,916,000	
トレジャー・ファクトリー	3,400	1,002.00	3,406,800	
物語コーポレーション	5,700	7,040.00	40,128,000	
ココカラファイン	9,500	8,520.00	80,940,000	
三越伊勢丹ホールディングス	186,600	773.00	144,241,800	
Ｈａｍｅｅ	2,900	1,547.00	4,486,300	
マーケットエンタープライズ	900	1,101.00	990,900	
ウエルシアホールディングス	56,300	3,690.00	207,747,000	
クリエイトＳＤホールディングス	15,800	3,690.00	58,302,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	12,400	395.00	4,898,000	
ミサワ	2,500	673.00	1,682,500	
ティーライフ	1,600	1,449.00	2,318,400	
チムニー	3,200	1,419.00	4,540,800	
シュッピン	7,500	1,097.00	8,227,500	
オイシックス・ラ・大地	14,100	4,265.00	60,136,500	
ネクステージ	18,900	2,243.00	42,392,700	
ジョイフル本田	31,300	1,403.00	43,913,900	
鳥貴族ホールディングス	4,000	1,754.00	7,016,000	
ホットランド	8,100	1,305.00	10,570,500	
すかいらーくホールディングス	135,800	1,458.00	197,996,400	

ＳＦＰホールディングス	5,200	1,432.00	7,446,400	
綿半ホールディングス	8,200	1,269.00	10,405,800	
ヨシックスホールディングス	2,200	2,265.00	4,983,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	31,200	1,070.00	33,384,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,700	1,643.00	9,365,100	
ＢＥＥＮＯＳ	5,400	3,360.00	18,144,000	
あさひ	8,100	1,354.00	10,967,400	
日本調剤	6,600	1,705.00	11,253,000	
コスモス薬品	10,800	18,440.00	199,152,000	
トーエル	5,500	826.00	4,543,000	
オンリー	2,300	476.00	1,094,800	
セブン＆アイ・ホールディングス	416,400	5,010.00	2,086,164,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	57,200	895.00	51,194,000	
ツルハホールディングス	23,200	13,010.00	301,832,000	
サンマルクホールディングス	8,600	1,576.00	13,553,600	
フェリシモ	2,500	1,515.00	3,787,500	
トリドールホールディングス	26,500	1,887.00	50,005,500	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	10,000	688.00	6,880,000	
ウイルプラスホールディングス	1,900	1,133.00	2,152,700	
ＪＭホールディングス	7,300	2,112.00	15,417,600	
サツドラホールディングス	1,700	2,028.00	3,447,600	
アレンザホールディングス	8,300	1,301.00	10,798,300	
串カツ田中ホールディングス	3,000	1,799.00	5,397,000	
バロックジャパンリミテッド	7,700	840.00	6,468,000	
クスリのアオキホールディングス	10,600	7,480.00	79,288,000	
力の源ホールディングス	4,800	608.00	2,918,400	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	62,400	4,290.00	267,696,000	
メディカルシステムネットワーク	9,600	749.00	7,190,400	
はるやまホールディングス	5,400	633.00	3,418,200	
ノジマ	19,000	2,866.00	54,454,000	
カッパ・クリエイト	14,900	1,411.00	21,023,900	
ライトオン	8,000	745.00	5,960,000	
良品計画	122,600	2,179.00	267,145,400	
三城ホールディングス	14,100	273.00	3,849,300	
アドヴァングループ	11,100	915.00	10,156,500	
アルビス	3,500	2,378.00	8,323,000	
コナカ	12,500	349.00	4,362,500	
ハウス　オブ　ローゼ	1,500	1,643.00	2,464,500	
Ｇ－７ホールディングス	5,200	3,655.00	19,006,000	
イオン北海道	14,100	1,020.00	14,382,000	

コジマ	18,700	687.00	12,846,900	
ヒマラヤ	4,000	1,133.00	4,532,000	
コーナン商事	15,200	4,560.00	69,312,000	
エコス	4,000	1,917.00	7,668,000	
ワタミ	14,000	921.00	12,894,000	
マルシェ	2,800	492.00	1,377,600	
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	212,900	2,396.00	510,108,400	
西松屋チェーン	23,500	1,389.00	32,641,500	
ゼンショーホールディングス	57,200	2,734.00	156,384,800	
幸楽苑ホールディングス	6,800	1,441.00	9,798,800	
ハークスレイ	2,500	1,001.00	2,502,500	
サイゼリヤ	15,900	2,552.00	40,576,800	
ＶＴホールディングス	40,600	492.00	19,975,200	
魚力	3,400	2,116.00	7,194,400	
フジ・コーポレーション	5,800	1,240.00	7,192,000	
ユナイテッドアローズ	12,300	1,983.00	24,390,900	
ハイデイ日高	15,500	1,768.00	27,404,000	
京都きもの友禅	7,700	258.00	1,986,600	
コロワイド	35,400	1,960.00	69,384,000	
ピーシーデポコーポレーション	12,900	481.00	6,204,900	
壱番屋	7,500	4,850.00	36,375,000	
ＰＬＡＮＴ	3,100	743.00	2,303,300	
スギホールディングス	21,300	8,240.00	175,512,000	
薬王堂ホールディングス	4,700	2,301.00	10,814,700	
スクロール	15,500	859.00	13,314,500	
ヨンドシーホールディングス	9,900	1,821.00	18,027,900	
木曽路	14,000	2,349.00	32,886,000	
ＳＲＳホールディングス	14,100	807.00	11,378,700	
リテールパートナーズ	13,100	1,170.00	15,327,000	
ケーヨー	19,800	837.00	16,572,600	
上新電機	12,300	2,747.00	33,788,100	
日本瓦斯	51,900	1,953.00	101,360,700	
ロイヤルホールディングス	18,600	1,929.00	35,879,400	
いなげや	11,900	1,497.00	17,814,300	
チヨダ	10,600	880.00	9,328,000	
ライフコーポレーション	10,000	3,680.00	36,800,000	
リンガーハット	13,100	2,233.00	29,252,300	
ＭｒＭａｘＨＤ	15,000	674.00	10,110,000	
ＡＯＫＩホールディングス	21,000	667.00	14,007,000	
オークワ	16,800	1,111.00	18,664,800	
コメリ	16,500	2,708.00	44,682,000	
青山商事	24,000	712.00	17,088,000	

しまむら	12,400	10,520.00	130,448,000	
はせがわ	6,500	277.00	1,800,500	
高島屋	77,600	1,169.00	90,714,400	
松屋	23,400	943.00	22,066,200	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	50,500	871.00	43,985,500	
近鉄百貨店	4,100	3,140.00	12,874,000	
丸井グループ	90,100	1,974.00	177,857,400	
アクシアル　リテイリング	8,900	3,850.00	34,265,000	
イオン	409,600	2,986.50	1,223,270,400	
イズミ	21,700	3,870.00	83,979,000	
平和堂	19,700	2,129.00	41,941,300	
フジ	12,900	1,972.00	25,438,800	
ヤオコー	12,100	6,660.00	80,586,000	
ゼビオホールディングス	13,100	1,030.00	13,493,000	
ケーズホールディングス	90,800	1,274.00	115,679,200	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	5,800	773.00	4,483,400	
日産東京販売ホールディングス	16,600	252.00	4,183,200	
シルバーライフ	2,300	1,955.00	4,496,500	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	4,700	4,260.00	20,022,000	
ナルミヤ・インターナショナル	2,300	1,158.00	2,663,400	
ブックオフグループホールディングス	6,200	970.00	6,014,000	
ギフト	1,400	2,415.00	3,381,000	
アインホールディングス	15,500	6,650.00	103,075,000	
元気寿司	3,100	2,504.00	7,762,400	
ヤマダホールディングス	357,200	510.00	182,172,000	
アークランドサカモト	16,800	1,492.00	25,065,600	
ニトリホールディングス	42,300	20,320.00	859,536,000	
グルメ杵屋	7,800	944.00	7,363,200	
愛眼	8,500	228.00	1,938,000	
ケーユーホールディングス	5,800	1,027.00	5,956,600	
吉野家ホールディングス	35,100	2,045.00	71,779,500	
松屋フーズホールディングス	5,200	3,615.00	18,798,000	
サガミホールディングス	15,300	1,027.00	15,713,100	
関西スーパーマーケット	8,300	1,088.00	9,030,400	
王将フードサービス	7,100	5,800.00	41,180,000	
プレナス	12,000	2,154.00	25,848,000	
ミニストップ	8,000	1,422.00	11,376,000	
アークス	20,400	2,269.00	46,287,600	
バローホールディングス	21,800	2,334.00	50,881,200	
ベルク	5,300	5,040.00	26,712,000	
大庄	5,900	1,006.00	5,935,400	
ファーストリテイリング	14,200	75,810.00	1,076,502,000	

サンドラッグ	40,100	3,660.00	146,766,000	
サックスバー　ホールディングス	9,400	617.00	5,799,800	
ヤマザワ	2,600	1,712.00	4,451,200	
やまや	2,200	2,327.00	5,119,400	
ベルーナ	23,100	918.00	21,205,800	
島根銀行	3,700	614.00	2,271,800	
じもとホールディングス	7,200	647.00	4,658,400	
めぶきフィナンシャルグループ	553,900	234.00	129,612,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,400	1,551.00	20,783,400	
九州フィナンシャルグループ	217,700	384.00	83,596,800	
ゆうちょ銀行	302,000	933.00	281,766,000	
富山第一銀行	25,400	273.00	6,934,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	649,400	392.00	254,564,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	69,600	624.00	43,430,400	
三十三フィナンシャルグループ	9,200	1,420.00	13,064,000	
第四北越フィナンシャルグループ	17,300	2,426.00	41,969,800	
ひろぎんホールディングス	157,200	587.00	92,276,400	
新生銀行	86,900	1,447.00	125,744,300	
あおぞら銀行	63,500	2,464.00	156,464,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	7,291,600	580.00	4,229,128,000	
りそなホールディングス	1,230,100	411.30	505,940,130	
三井住友トラスト・ホールディングス	201,500	3,512.00	707,668,000	
三井住友フィナンシャルグループ	737,700	3,693.00	2,724,326,100	
千葉銀行	355,700	633.00	225,158,100	
群馬銀行	219,400	347.00	76,131,800	
武蔵野銀行	15,900	1,646.00	26,171,400	
千葉興業銀行	27,100	255.00	6,910,500	
筑波銀行	44,300	169.00	7,486,700	
七十七銀行	33,400	1,142.00	38,142,800	
青森銀行	8,300	2,027.00	16,824,100	
秋田銀行	6,400	1,417.00	9,068,800	
山形銀行	12,000	848.00	10,176,000	
岩手銀行	7,000	1,677.00	11,739,000	
東邦銀行	95,300	209.00	19,917,700	
東北銀行	5,100	998.00	5,089,800	
みちのく銀行	6,800	924.00	6,283,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	96,200	1,846.00	177,585,200	
静岡銀行	259,600	822.00	213,391,200	
十六銀行	13,400	1,929.00	25,848,600	
スルガ銀行	93,500	327.00	30,574,500	
八十二銀行	240,100	353.00	84,755,300	
山梨中央銀行	12,400	819.00	10,155,600	

大垣共立銀行	21,100	1,859.00	39,224,900	
福井銀行	9,100	1,401.00	12,749,100	
北國銀行	9,900	2,070.00	20,493,000	
清水銀行	4,400	1,559.00	6,859,600	
富山銀行	2,100	2,153.00	4,521,300	
滋賀銀行	21,400	1,872.00	40,060,800	
南都銀行	15,500	1,885.00	29,217,500	
百五銀行	95,900	308.00	29,537,200	
京都銀行	38,200	4,825.00	184,315,000	
紀陽銀行	37,700	1,503.00	56,663,100	
ほくほくフィナンシャルグループ	71,000	795.00	56,445,000	
山陰合同銀行	67,200	548.00	36,825,600	
中国銀行	91,700	851.00	78,036,700	
鳥取銀行	3,400	1,133.00	3,852,200	
伊予銀行	141,200	536.00	75,683,200	
百十四銀行	11,300	1,511.00	17,074,300	
四国銀行	15,100	714.00	10,781,400	
阿波銀行	16,300	1,997.00	32,551,100	
大分銀行	6,100	1,685.00	10,278,500	
宮崎銀行	6,700	1,990.00	13,333,000	
佐賀銀行	6,000	1,371.00	8,226,000	
沖縄銀行	9,800	2,469.00	24,196,200	
琉球銀行	23,100	721.00	16,655,100	
セブン銀行	356,100	235.00	83,683,500	
みずほフィナンシャルグループ	1,448,400	1,570.50	2,274,712,200	
高知銀行	3,900	805.00	3,139,500	
山口フィナンシャルグループ	133,000	620.00	82,460,000	
長野銀行	3,500	1,091.00	3,818,500	
名古屋銀行	8,600	2,437.00	20,958,200	
北洋銀行	160,700	237.00	38,085,900	
愛知銀行	3,600	2,821.00	10,155,600	
中京銀行	3,800	1,430.00	5,434,000	
大光銀行	3,700	1,265.00	4,680,500	
愛媛銀行	14,900	749.00	11,160,100	
トマト銀行	4,100	1,043.00	4,276,300	
京葉銀行	45,400	415.00	18,841,000	
栃木銀行	51,500	171.00	8,806,500	
北日本銀行	3,300	1,559.00	5,144,700	
東和銀行	18,700	499.00	9,331,300	
福島銀行	12,200	235.00	2,867,000	
大東銀行	5,100	613.00	3,126,300	
トモニホールディングス	82,400	297.00	24,472,800	

フィデアホールディングス	103,500	120.00	12,420,000	
池田泉州ホールディングス	122,600	159.00	19,493,400	
ＦＰＧ	36,100	754.00	27,219,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	7,300	1,534.00	11,198,200	
マーキュリアホールディングス	4,300	741.00	3,186,300	
ＳＢＩホールディングス	131,400	2,596.00	341,114,400	
ジャフコ　グループ	15,300	6,460.00	98,838,000	
大和証券グループ本社	798,600	572.70	457,358,220	
野村ホールディングス	1,627,800	549.60	894,638,880	
岡三証券グループ	91,200	414.00	37,756,800	
丸三証券	31,900	599.00	19,108,100	
東洋証券	36,200	157.00	5,683,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	114,100	393.00	44,841,300	
光世証券	2,800	584.00	1,635,200	
水戸証券	29,000	300.00	8,700,000	
いちよし証券	21,600	602.00	13,003,200	
松井証券	52,400	810.00	42,444,000	
マネックスグループ	95,900	683.00	65,499,700	
極東証券	14,500	790.00	11,455,000	
岩井コスモホールディングス	11,000	1,410.00	15,510,000	
藍澤證券	19,300	1,040.00	20,072,000	
マネーパートナーズグループ	12,100	221.00	2,674,100	
スパークス・グループ	49,900	258.00	12,874,200	
かんぽ生命保険	132,100	1,962.00	259,180,200	
ＳＯＭＰＯホールディングス	187,900	4,511.00	847,616,900	
アニコム　ホールディングス	30,000	855.00	25,650,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	258,900	3,372.00	873,010,800	
第一生命ホールディングス	524,600	1,973.50	1,035,298,100	
東京海上ホールディングス	351,100	5,252.00	1,843,977,200	
Ｔ＆Ｄホールディングス	318,600	1,396.00	444,765,600	
アドバンスクリエイト	5,100	1,004.00	5,120,400	
全国保証	27,800	5,120.00	142,336,000	
あんしん保証	4,100	349.00	1,430,900	
イントラスト	3,300	667.00	2,201,100	
日本モーゲージサービス	5,600	1,015.00	5,684,000	
Ｃａｓａ	3,200	979.00	3,132,800	
アルヒ	15,900	1,411.00	22,434,900	
プレミアグループ	5,000	3,610.00	18,050,000	
クレディセゾン	62,400	1,328.00	82,867,200	
芙蓉総合リース	11,200	7,140.00	79,968,000	
みずほリース	16,500	3,625.00	59,812,500	
東京センチュリー	24,800	5,960.00	147,808,000	

日本証券金融	45,400	825.00	37,455,000	
アイフル	179,500	353.00	63,363,500	
リコーリース	8,500	3,460.00	29,410,000	
イオンフィナンシャルサービス	65,400	1,379.00	90,186,600	
アコム	214,700	470.00	100,909,000	
ジャックス	11,900	2,583.00	30,737,700	
オリエントコーポレーション	290,000	142.00	41,180,000	
オリックス	647,200	1,913.50	1,238,417,200	
三菱ＨＣキャピタル	369,000	605.00	223,245,000	
九州リースサービス	5,500	653.00	3,591,500	
日本取引所グループ	288,000	2,581.00	743,328,000	
イー・ギャランティ	12,600	2,427.00	30,580,200	
アサックス	5,800	689.00	3,996,200	
ＮＥＣキャピタルソリューション	4,400	2,170.00	9,548,000	
いちご	121,700	332.00	40,404,400	
日本駐車場開発	122,900	162.00	19,909,800	
スター・マイカ・ホールディングス	6,300	1,282.00	8,076,600	
ＳＲＥホールディングス	1,700	6,750.00	11,475,000	
ＡＤワークスグループ	21,600	157.00	3,391,200	
ヒューリック	226,900	1,259.00	285,667,100	
三栄建築設計	4,800	1,997.00	9,585,600	
野村不動産ホールディングス	61,500	2,748.00	169,002,000	
三重交通グループホールディングス	23,700	486.00	11,518,200	
サムティ	15,600	2,237.00	34,897,200	
ディア・ライフ	15,800	471.00	7,441,800	
日本商業開発	7,300	1,751.00	12,782,300	
プレサンスコーポレーション	18,200	1,562.00	28,428,400	
ハウスコム	2,600	1,217.00	3,164,200	
日本管理センター	6,500	1,304.00	8,476,000	
サンセイランディック	4,300	874.00	3,758,200	
フージャースホールディングス	17,400	728.00	12,667,200	
オープンハウス	34,000	5,590.00	190,060,000	
東急不動産ホールディングス	291,500	621.00	181,021,500	
飯田グループホールディングス	89,300	2,626.00	234,501,800	
イーグランド	2,700	1,021.00	2,756,700	
ムゲンエステート	8,500	503.00	4,275,500	
ハウスドゥ	5,200	990.00	5,148,000	
シーアールイー	3,400	1,567.00	5,327,800	
グッドコムアセット	5,800	1,420.00	8,236,000	
ジェイ・エス・ビー	2,200	4,310.00	9,482,000	
テンポイノベーション	4,100	884.00	3,624,400	
フェイスネットワーク	1,600	1,352.00	2,163,200	

パーク２４	57,700	2,025.00	116,842,500	
パラカ	3,300	1,654.00	5,458,200	
三井不動産	486,200	2,573.00	1,250,992,600	
三菱地所	700,800	1,718.50	1,204,324,800	
平和不動産	18,500	3,895.00	72,057,500	
東京建物	105,900	1,661.00	175,899,900	
ダイビル	27,700	1,416.00	39,223,200	
京阪神ビルディング	19,100	1,414.00	27,007,400	
住友不動産	239,900	3,642.00	873,715,800	
テーオーシー	22,400	657.00	14,716,800	
東京楽天地	2,000	4,050.00	8,100,000	
スターツコーポレーション	13,000	2,877.00	37,401,000	
フジ住宅	13,900	640.00	8,896,000	
空港施設	12,300	575.00	7,072,500	
明和地所	6,600	616.00	4,065,600	
ゴールドクレスト	10,200	1,665.00	16,983,000	
エスリード	4,800	1,613.00	7,742,400	
日神グループホールディングス	17,900	485.00	8,681,500	
日本エスコン	19,300	768.00	14,822,400	
タカラレーベン	44,700	346.00	15,466,200	
ＡＶＡＮＴＩＡ	6,600	916.00	6,045,600	
イオンモール	54,000	1,680.00	90,720,000	
毎日コムネット	4,900	774.00	3,792,600	
ファースト住建	5,400	1,152.00	6,220,800	
カチタス	26,700	3,320.00	88,644,000	
トーセイ	15,600	1,130.00	17,628,000	
穴吹興産	2,800	1,996.00	5,588,800	
サンフロンティア不動産	14,000	1,069.00	14,966,000	
エフ・ジェー・ネクスト	11,400	1,045.00	11,913,000	
インテリックス	2,400	701.00	1,682,400	
ランドビジネス	4,500	325.00	1,462,500	
サンネクスタグループ	4,300	978.00	4,205,400	
グランディハウス	9,500	441.00	4,189,500	
日本空港ビルデング	37,200	4,685.00	174,282,000	
明豊ファシリティワークス	4,900	985.00	4,826,500	
日本工営	6,100	3,005.00	18,330,500	
ＬＩＦＵＬＬ	32,100	341.00	10,946,100	
ミクシィ	26,300	2,821.00	74,192,300	
ジェイエイシーリクルートメント	7,200	1,814.00	13,060,800	
日本Ｍ＆Ａセンター	169,400	3,115.00	527,681,000	
メンバーズ	3,100	3,335.00	10,338,500	
中広	1,900	370.00	703,000	

ＵＴグループ	15,000	3,350.00	50,250,000	
アイティメディア	3,500	2,122.00	7,427,000	
タケエイ	11,600	1,874.00	21,738,400	
Ｅ・Ｊホールディングス	5,500	1,330.00	7,315,000	
夢真ビーネックスグループ	27,600	1,305.00	36,018,000	
コシダカホールディングス	28,000	556.00	15,568,000	
アルトナー	2,700	839.00	2,265,300	
パソナグループ	11,300	2,227.00	25,165,100	
ＣＤＳ	2,700	1,558.00	4,206,600	
リンクアンドモチベーション	19,000	867.00	16,473,000	
ＧＣＡ	13,700	1,111.00	15,220,700	
エス・エム・エス	35,100	3,085.00	108,283,500	
サニーサイドアップグループ	3,800	740.00	2,812,000	
パーソルホールディングス	103,300	2,242.00	231,598,600	
リニカル	6,000	950.00	5,700,000	
クックパッド	33,200	246.00	8,167,200	
アイ・ケイ・ケイ	5,300	664.00	3,519,200	
学情	3,800	1,208.00	4,590,400	
スタジオアリス	5,300	2,402.00	12,730,600	
シミックホールディングス	5,800	1,512.00	8,769,600	
エプコ	2,700	917.00	2,475,900	
ＮＪＳ	2,600	1,925.00	5,005,000	
綜合警備保障	41,100	5,150.00	211,665,000	
カカクコム	76,400	3,105.00	237,222,000	
アイロムグループ	3,700	1,926.00	7,126,200	
セントケア・ホールディング	7,700	972.00	7,484,400	
サイネックス	2,000	699.00	1,398,000	
ルネサンス	6,600	1,251.00	8,256,600	
ディップ	16,200	3,380.00	54,756,000	
デジタルホールディングス	7,300	2,249.00	16,417,700	
新日本科学	12,800	1,093.00	13,990,400	
キャリアデザインセンター	2,800	1,035.00	2,898,000	
ベネフィット・ワン	37,600	3,515.00	132,164,000	
エムスリー	182,200	7,560.00	1,377,432,000	
ツカダ・グローバルホールディング	8,200	337.00	2,763,400	
アウトソーシング	59,200	2,114.00	125,148,800	
ウェルネット	10,800	516.00	5,572,800	
ワールドホールディングス	3,600	3,150.00	11,340,000	
ディー・エヌ・エー	43,800	2,135.00	93,513,000	
博報堂ＤＹホールディングス	143,800	1,729.00	248,630,200	
ぐるなび	18,300	502.00	9,186,600	
タカミヤ	12,900	501.00	6,462,900	

ジャパンベストレスキューシステム	7,000	1,034.00	7,238,000	
ファンコミュニケーションズ	28,900	405.00	11,704,500	
ライク	2,800	2,200.00	6,160,000	
ビジネス・ブレークスルー	4,800	421.00	2,020,800	
エスプール	26,700	968.00	25,845,600	
ＷＤＢホールディングス	4,800	2,950.00	14,160,000	
手間いらず	1,300	5,970.00	7,761,000	
ティア	6,400	477.00	3,052,800	
ＣＤＧ	1,100	1,585.00	1,743,500	
アドウェイズ	17,000	806.00	13,702,000	
バリューコマース	7,000	3,450.00	24,150,000	
インフォマート	104,700	928.00	97,161,600	
ＪＰホールディングス	30,200	273.00	8,244,600	
エコナックホールディングス	20,800	88.00	1,830,400	
レッグス	2,600	2,366.00	6,151,600	
プレステージ・インターナショナル	39,000	715.00	27,885,000	
アミューズ	5,700	2,309.00	13,161,300	
ドリームインキュベータ	3,400	925.00	3,145,000	
クイック	6,600	1,184.00	7,814,400	
ＴＡＣ	6,400	232.00	1,484,800	
電通グループ	116,200	3,850.00	447,370,000	
イオンファンタジー	4,100	1,953.00	8,007,300	
シーティーエス	11,900	816.00	9,710,400	
ネクシィーズグループ	3,800	890.00	3,382,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	29,000	2,882.00	83,578,000	
アルプス技研	9,200	2,001.00	18,409,200	
ダイオーズ	2,200	1,055.00	2,321,000	
日本空調サービス	11,100	742.00	8,236,200	
オリエンタルランド	109,800	15,420.00	1,693,116,000	
ダスキン	24,000	2,557.00	61,368,000	
明光ネットワークジャパン	12,500	581.00	7,262,500	
ファルコホールディングス	5,000	1,732.00	8,660,000	
ラウンドワン	35,400	1,111.00	39,329,400	
リゾートトラスト	47,400	1,804.00	85,509,600	
ビー・エム・エル	13,300	3,820.00	50,806,000	
りらいあコミュニケーションズ	15,800	1,413.00	22,325,400	
リソー教育	52,900	358.00	18,938,200	
早稲田アカデミー	4,600	921.00	4,236,600	
ユー・エス・エス	115,700	1,945.00	225,036,500	
東京個別指導学院	9,400	622.00	5,846,800	
サイバーエージェント	254,600	2,228.00	567,248,800	
楽天グループ	482,600	1,313.00	633,653,800	

クリーク・アンド・リバー社	5,500	1,670.00	9,185,000	
モーニングスター	15,500	470.00	7,285,000	
テー・オー・ダブリュー	18,700	324.00	6,058,800	
山田コンサルティンググループ	6,200	1,231.00	7,632,200	
セントラルスポーツ	3,900	2,411.00	9,402,900	
フルキャストホールディングス	8,900	2,258.00	20,096,200	
エン・ジャパン	18,400	3,770.00	69,368,000	
リソルホールディングス	1,200	3,980.00	4,776,000	
テクノプロ・ホールディングス	61,900	2,708.00	167,625,200	
アトラグループ	2,400	325.00	780,000	
インターワークス	3,400	418.00	1,421,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	4,200	14,490.00	60,858,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	6,700	2,962.00	19,845,400	
ファーストロジック	2,200	782.00	1,720,400	
三機サービス	2,200	1,121.00	2,466,200	
Ｇｕｎｏｓｙ	6,600	731.00	4,824,600	
デザインワン・ジャパン	3,300	244.00	805,200	
イー・ガーディアン	4,300	2,884.00	12,401,200	
リブセンス	6,500	217.00	1,410,500	
ジャパンマテリアル	31,900	1,326.00	42,299,400	
ベクトル	13,000	1,033.00	13,429,000	
ウチヤマホールディングス	5,600	361.00	2,021,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	7,800	1,160.00	9,048,000	
キャリアリンク	3,500	1,978.00	6,923,000	
ＩＢＪ	8,600	1,075.00	9,245,000	
アサンテ	3,800	1,750.00	6,650,000	
バリューＨＲ	4,200	1,629.00	6,841,800	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	8,500	5,450.00	46,325,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,100	1,444.00	5,920,400	
ＥＲＩホールディングス	3,100	912.00	2,827,200	
アビスト	1,700	2,932.00	4,984,400	
シグマクシス	5,700	2,488.00	14,181,600	
ウィルグループ	7,800	981.00	7,651,800	
エスクロー・エージェント・ジャパン	16,100	226.00	3,638,600	
メドピア	8,000	4,360.00	34,880,000	
レアジョブ	2,000	1,652.00	3,304,000	
リクルートホールディングス	739,800	5,697.00	4,214,640,600	
エラン	14,400	1,219.00	17,553,600	
土木管理総合試験所	5,500	388.00	2,134,000	
ネットマーケティング	5,500	392.00	2,156,000	
日本郵政	781,600	926.70	724,308,720	
ベルシステム２４ホールディングス	17,400	1,735.00	30,189,000	

鎌倉新書	10,600	977.00	10,356,200	
ＳＭＮ	2,400	785.00	1,884,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	2,100	884.00	1,856,400	
エアトリ	6,500	2,531.00	16,451,500	
アトラエ	7,300	2,171.00	15,848,300	
ストライク	3,900	3,820.00	14,898,000	
ソラスト	25,500	1,339.00	34,144,500	
セラク	3,300	1,903.00	6,279,900	
インソース	10,100	2,500.00	25,250,000	
ベイカレント・コンサルティング	6,800	42,400.00	288,320,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,400	2,857.00	6,856,800	
アイモバイル	3,000	1,647.00	4,941,000	
キャリアインデックス	4,400	969.00	4,263,600	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,400	1,131.00	4,976,400	
船場	2,300	861.00	1,980,300	
グレイステクノロジー	10,600	1,428.00	15,136,800	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	29,900	2,554.00	76,364,600	
フルテック	1,600	1,319.00	2,110,400	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	3,400	552.00	1,876,800	
ソウルドアウト	2,600	1,845.00	4,797,000	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	2,000	600.00	1,200,000	
ウェルビー	4,000	1,314.00	5,256,000	
エル・ティー・エス	1,000	4,040.00	4,040,000	
ミダック	4,500	5,020.00	22,590,000	
日総工産	8,300	830.00	6,889,000	
キュービーネットホールディングス	4,800	1,665.00	7,992,000	
ＲＰＡホールディングス	12,700	677.00	8,597,900	
スプリックス	3,100	1,126.00	3,490,600	
マネジメントソリューションズ	5,100	2,689.00	13,713,900	
プロレド・パートナーズ	1,900	2,874.00	5,460,600	
テノ．ホールディングス	1,300	1,156.00	1,502,800	
フロンティア・マネジメント	2,500	1,078.00	2,695,000	
ピアラ	900	1,023.00	920,700	
コプロ・ホールディングス	1,500	1,340.00	2,010,000	
ギークス	1,900	1,586.00	3,013,400	
カーブスホールディングス	28,600	871.00	24,910,600	
フォーラムエンジニアリング	7,400	911.00	6,741,400	
ダイレクトマーケティングミックス	5,600	3,810.00	21,336,000	
ポピンズホールディングス	2,800	4,180.00	11,704,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	4,200	5,200.00	21,840,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	5,400	1,123.00	6,064,200	
リログループ	56,500	2,443.00	138,029,500	

東祥	6,500	1,762.00	11,453,000	
エイチ・アイ・エス	16,500	2,418.00	39,897,000	
ラックランド	3,000	2,691.00	8,073,000	
共立メンテナンス	17,200	3,615.00	62,178,000	
イチネンホールディングス	10,900	1,256.00	13,690,400	
建設技術研究所	6,700	2,317.00	15,523,900	
スペース	6,900	911.00	6,285,900	
長大	4,200	1,940.00	8,148,000	
燦ホールディングス	4,600	1,265.00	5,819,000	
スバル興業	600	8,110.00	4,866,000	
東京テアトル	4,000	1,246.00	4,984,000	
タナベ経営	2,100	1,456.00	3,057,600	
ナガワ	3,300	8,800.00	29,040,000	
東京都競馬	6,800	4,505.00	30,634,000	
カナモト	18,300	2,581.00	47,232,300	
西尾レントオール	9,600	3,045.00	29,232,000	
トランス・コスモス	9,900	3,120.00	30,888,000	
乃村工藝社	44,500	850.00	37,825,000	
藤田観光	4,100	2,266.00	9,290,600	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	5,500	1,294.00	7,117,000	
日本管財	11,100	2,587.00	28,715,700	
トーカイ	10,100	2,436.00	24,603,600	
セコム	101,800	8,368.00	851,862,400	
セントラル警備保障	5,000	3,075.00	15,375,000	
丹青社	19,700	867.00	17,079,900	
メイテック	12,500	6,390.00	79,875,000	
応用地質	11,800	1,311.00	15,469,800	
船井総研ホールディングス	21,200	2,561.00	54,293,200	
進学会ホールディングス	4,500	427.00	1,921,500	
オオバ	7,500	819.00	6,142,500	
いであ	2,600	1,850.00	4,810,000	
学究社	3,100	1,347.00	4,175,700	
ベネッセホールディングス	37,900	2,600.00	98,540,000	
イオンディライト	12,800	3,705.00	47,424,000	
ナック	5,100	935.00	4,768,500	
ダイセキ	17,400	5,130.00	89,262,000	
ステップ	3,900	1,815.00	7,078,500	
合　計	113,308,700		285,529,593,070	

(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。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2021年 7月26日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,053,112,246
国債証券	320,246,032,250
地方債証券	21,380,284,912
特殊債券	23,832,302,703
社債券	17,488,316,000
派生商品評価勘定	29,010
未収利息	682,123,114
前払費用	9,464,970
流動資産合計	384,691,665,205
資産合計	384,691,665,205
負債の部	
流動負債	
未払解約金	782,206,823
未払利息	1,890
流動負債合計	782,208,713
負債合計	782,208,713
純資産の部	
元本等	
元本	277,547,967,709
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	106,361,488,783
元本等合計	383,909,456,492
純資産合計	383,909,456,492
負債純資産合計	384,691,665,205

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月26日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

	2021年 7月26日現在
	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。 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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 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	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 7月26日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		277,547,967,709口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。	
	有価証券	101,542,000円
3. 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	1.3832円
	(1万口当たり純資産額)	(13,832円)

（注）担保資産の有価証券は、「国債証券」であります。上記金額には、約定未受渡債券を含んでおります。

（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 7月26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 7月26日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券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、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月26日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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 7月26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	265,539,402,653円
期中追加設定元本額	24,714,995,306円
期中一部解約元本額	12,706,430,250円
期末元本額	277,547,967,709円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	867,501,448円
ＤＣ日本債券インデックスファンド	2,101,614,727円
ＤＣ日本債券インデックスファンドＬ	42,807,172,566円
ＤＣバランスファンド３０	10,392,815,912円
ＤＣバランスファンド５０	7,204,001,400円
ＤＣバランスファンド７０	1,947,503,048円
日本債券インデックスｅ	1,205,361,860円
インデックスコレクション（国内債券）	36,556,001,149円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	55,511,403,944円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	5,217,625,878円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	2,029,858,795円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	48,266,493,571円
日本債券パッシブファンド私募Ａ（適格機関投資家専用）	3,880,011,293円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	195,794,006円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	987,544,932円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	138,828,650円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	85,303,785円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	535,531,349円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	3,420,434,983円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	1,068,983,463円

区分	2021年 7月26日現在
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	12,035,877,776円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	154,662,755円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	338,388,795円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	3,151,801,621円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	198,955,265円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	368,548,560円
バランスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	3,135,014,291円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	386,622,990円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	908,737,264円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	84,649,276円
バランスファンドＶＡ２（適格機関投資家専用）	3,475,940,026円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	1,546,467,870円
バランスファンドＶＡ３（適格機関投資家専用）	26,034,139,871円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	472,490,638円
国内バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	144,422,430円
国内バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	39,681,846円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	645,916,192円
私募日本債券インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	5,863,484円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月26日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	672,606,900
地方債証券	8,986,964
特殊債券	△17,472,335
社債券	49,117,000
合計	713,238,529

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本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 7月26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	457,200,000	－	457,230,000	30,000
合計		457,200,000	－	457,230,000	30,000

(注)1.時価の算定方法

債券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.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.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第４１５回利付国債（２年）	1,340,000,000	1,343,256,200	
	第４１６回利付国債（２年）	2,990,000,000	2,997,893,600	
	第４１７回利付国債（２年）	610,000,000	611,762,900	
	第４１８回利付国債（２年）	700,000,000	702,170,000	
	第４１９回利付国債（２年）	300,000,000	300,990,000	
	第４２０回利付国債（２年）	1,010,000,000	1,013,545,100	
	第４２３回利付国債（２年）	160,000,000	160,403,200	
	第４２４回利付国債（２年）	20,000,000	20,051,200	
	第４２５回利付国債（２年）	2,330,000,000	2,336,034,700	
	第１３３回利付国債（５年）	1,670,000,000	1,674,509,000	
	第１３４回利付国債（５年）	3,620,000,000	3,632,163,200	
	第１３５回利付国債（５年）	3,140,000,000	3,152,434,400	
	第１３６回利付国債（５年）	2,730,000,000	2,742,203,100	
	第１３７回利付国債（５年）	2,580,000,000	2,593,054,800	
	第１３８回利付国債（５年）	4,250,000,000	4,275,075,000	
	第１３９回利付国債（５年）	2,580,000,000	2,597,131,200	
	第１４０回利付国債（５年）	2,650,000,000	2,668,894,500	
	第１４１回利付国債（５年）	6,460,000,000	6,510,065,000	
	第１４２回利付国債（５年）	1,390,000,000	1,401,870,600	
	第１４３回利付国債（５年）	2,200,000,000	2,220,152,000	
	第１４４回利付国債（５年）	1,710,000,000	1,726,758,000	
	第１４５回利付国債（５年）	5,480,000,000	5,537,211,200	
	第１４６回利付国債（５年）	920,000,000	929,972,800	
	第１４７回利付国債（５年）	1,710,000,000	1,721,593,800	
	第１回利付国債（４０年）	230,000,000	334,325,700	
	第２回利付国債（４０年）	350,000,000	493,916,500	

第３回利付国債（４０年）	380,000,000	538,498,000	
第４回利付国債（４０年）	665,000,000	944,685,700	
第５回利付国債（４０年）	455,000,000	623,932,400	
第６回利付国債（４０年）	430,000,000	580,216,200	
第７回利付国債（４０年）	1,440,000,000	1,869,854,400	
第８回利付国債（４０年）	960,000,000	1,166,832,000	
第９回利付国債（４０年）	1,130,000,000	1,029,723,800	
第１０回利付国債（４０年）	970,000,000	1,032,700,800	
第１１回利付国債（４０年）	1,120,000,000	1,156,030,400	
第１２回利付国債（４０年）	640,000,000	595,648,000	
第１３回利付国債（４０年）	1,220,000,000	1,130,305,600	
第１４回利付国債（４０年）	380,000,000	376,492,600	
第３２５回利付国債（１０年）	2,245,000,000	2,269,178,650	
第３２６回利付国債（１０年）	1,260,000,000	1,274,754,600	
第３２７回利付国債（１０年）	1,740,000,000	1,762,811,400	
第３２８回利付国債（１０年）	2,010,000,000	2,034,361,200	
第３２９回利付国債（１０年）	2,425,000,000	2,467,922,500	
第３３０回利付国債（１０年）	2,230,000,000	2,274,711,500	
第３３１回利付国債（１０年）	130,000,000	132,046,200	
第３３２回利付国債（１０年）	2,270,000,000	2,310,156,300	
第３３３回利付国債（１０年）	2,290,000,000	2,334,998,500	
第３３４回利付国債（１０年）	3,140,000,000	3,208,075,200	
第３３５回利付国債（１０年）	1,275,000,000	1,301,022,750	
第３３６回利付国債（１０年）	1,060,000,000	1,083,542,600	
第３３７回利付国債（１０年）	1,870,000,000	1,898,741,900	
第３３８回利付国債（１０年）	3,410,000,000	3,478,745,600	
第３３９回利付国債（１０年）	2,775,000,000	2,834,829,000	
第３４０回利付国債（１０年）	3,580,000,000	3,662,232,600	
第３４１回利付国債（１０年）	2,050,000,000	2,090,385,000	
第３４２回利付国債（１０年）	3,190,000,000	3,225,791,800	
第３４３回利付国債（１０年）	4,035,000,000	4,081,725,300	
第３４４回利付国債（１０年）	3,880,000,000	3,927,258,400	
第３４５回利付国債（１０年）	2,580,000,000	2,612,972,400	
第３４６回利付国債（１０年）	3,425,000,000	3,471,751,250	
第３４７回利付国債（１０年）	3,415,000,000	3,463,732,050	
第３４８回利付国債（１０年）	3,490,000,000	3,541,931,200	
第３４９回利付国債（１０年）	2,355,000,000	2,390,725,350	
第３５０回利付国債（１０年）	3,150,000,000	3,198,573,000	代用有価証券 100,000,000円
第３５１回利付国債（１０年）	1,370,000,000	1,391,933,700	
第３５２回利付国債（１０年）	2,080,000,000	2,114,528,000	
第３５３回利付国債（１０年）	3,160,000,000	3,213,088,000	
第３５４回利付国債（１０年）	3,070,000,000	3,120,900,600	

第３５５回利付国債（１０年）	2,490,000,000	2,530,636,800	
第３５６回利付国債（１０年）	2,990,000,000	3,036,644,000	
第３５７回利付国債（１０年）	2,460,000,000	2,497,441,200	
第３５８回利付国債（１０年）	3,040,000,000	3,083,593,600	
第３５９回利付国債（１０年）	2,460,000,000	2,492,964,000	
第３６０回利付国債（１０年）	3,770,000,000	3,816,710,300	
第３６１回利付国債（１０年）	3,260,000,000	3,296,838,000	
第３６２回利付国債（１０年）	1,390,000,000	1,404,080,700	
第１回利付国債（３０年）	50,000,000	61,788,500	
第２回利付国債（３０年）	100,000,000	121,243,000	
第３回利付国債（３０年）	140,000,000	169,124,200	
第４回利付国債（３０年）	190,000,000	241,904,200	
第５回利付国債（３０年）	180,000,000	218,754,000	
第６回利付国債（３０年）	20,000,000	24,888,200	
第７回利付国債（３０年）	790,000,000	981,701,400	
第９回利付国債（３０年）	180,000,000	207,192,600	
第１０回利付国債（３０年）	170,000,000	190,117,800	
第１１回利付国債（３０年）	460,000,000	547,505,800	
第１２回利付国債（３０年）	370,000,000	459,384,600	
第１３回利付国債（３０年）	330,000,000	406,794,300	
第１４回利付国債（３０年）	350,000,000	450,250,500	
第１５回利付国債（３０年）	370,000,000	482,158,100	
第１６回利付国債（３０年）	150,000,000	196,090,500	
第１７回利付国債（３０年）	420,000,000	545,206,200	
第１８回利付国債（３０年）	340,000,000	438,045,800	
第１９回利付国債（３０年）	280,000,000	361,712,400	
第２０回利付国債（３０年）	400,000,000	529,516,000	
第２１回利付国債（３０年）	780,000,000	1,013,524,200	
第２２回利付国債（３０年）	380,000,000	506,167,600	
第２３回利付国債（３０年）	170,000,000	227,225,400	
第２４回利付国債（３０年）	75,000,000	100,513,500	
第２５回利付国債（３０年）	185,000,000	243,040,050	
第２６回利付国債（３０年）	1,470,000,000	1,959,157,200	
第２７回利付国債（３０年）	890,000,000	1,206,484,000	
第２８回利付国債（３０年）	1,050,000,000	1,430,992,500	
第２９回利付国債（３０年）	480,000,000	649,180,800	
第３０回利付国債（３０年）	555,000,000	744,144,000	
第３１回利付国債（３０年）	670,000,000	889,887,300	
第３２回利付国債（３０年）	955,000,000	1,291,140,900	
第３３回利付国債（３０年）	1,150,000,000	1,495,920,000	
第３４回利付国債（３０年）	1,220,000,000	1,637,898,800	
第３５回利付国債（３０年）	1,350,000,000	1,767,609,000	

第３６回利付国債（３０年）	1,310,000,000	1,721,222,100	
第３７回利付国債（３０年）	1,365,000,000	1,771,183,050	
第３８回利付国債（３０年）	925,000,000	1,184,157,250	
第３９回利付国債（３０年）	890,000,000	1,159,963,700	
第４０回利付国債（３０年）	715,000,000	917,745,400	
第４１回利付国債（３０年）	585,000,000	739,820,250	
第４２回利付国債（３０年）	880,000,000	1,114,080,000	
第４３回利付国債（３０年）	865,000,000	1,096,283,700	
第４４回利付国債（３０年）	780,000,000	989,609,400	
第４５回利付国債（３０年）	740,000,000	907,373,200	
第４６回利付国債（３０年）	1,190,000,000	1,460,165,700	
第４７回利付国債（３０年）	975,000,000	1,219,569,000	
第４８回利付国債（３０年）	810,000,000	976,552,200	
第４９回利付国債（３０年）	1,150,000,000	1,387,141,500	
第５０回利付国債（３０年）	1,030,000,000	1,098,999,700	
第５１回利付国債（３０年）	935,000,000	887,689,000	
第５２回利付国債（３０年）	1,190,000,000	1,183,383,600	
第５３回利付国債（３０年）	960,000,000	976,128,000	
第５４回利付国債（３０年）	875,000,000	930,440,000	
第５５回利付国債（３０年）	930,000,000	988,301,700	
第５６回利付国債（３０年）	820,000,000	869,847,800	
第５７回利付国債（３０年）	720,000,000	763,250,400	
第５８回利付国債（３０年）	1,410,000,000	1,491,921,000	
第５９回利付国債（３０年）	520,000,000	537,014,400	
第６０回利付国債（３０年）	1,530,000,000	1,654,542,000	
第６１回利付国債（３０年）	760,000,000	782,480,800	
第６２回利付国債（３０年）	360,000,000	351,878,400	
第６３回利付国債（３０年）	880,000,000	835,938,400	
第６４回利付国債（３０年）	1,140,000,000	1,079,887,800	
第６５回利付国債（３０年）	840,000,000	794,413,200	
第６６回利付国債（３０年）	720,000,000	679,809,600	
第６７回利付国債（３０年）	950,000,000	944,186,000	
第６８回利付国債（３０年）	1,130,000,000	1,121,649,300	
第６９回利付国債（３０年）	800,000,000	813,888,000	
第７０回利付国債（３０年）	1,030,000,000	1,046,696,300	
第５８回利付国債（２０年）	250,000,000	255,862,500	
第５９回利付国債（２０年）	440,000,000	451,321,200	
第６０回利付国債（２０年）	570,000,000	582,272,100	
第６１回利付国債（２０年）	390,000,000	397,304,700	
第６２回利付国債（２０年）	250,000,000	254,425,000	
第６３回利付国債（２０年）	570,000,000	590,936,100	
第６４回利付国債（２０年）	410,000,000	427,949,800	
第６５回利付国債（２０年）	370,000,000	388,081,900	

第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	345,331,800	
第６７回利付国債（２０年）	310,000,000	326,755,500	
第６８回利付国債（２０年）	230,000,000	244,262,300	
第６９回利付国債（２０年）	530,000,000	561,460,800	
第７０回利付国債（２０年）	490,000,000	526,220,800	
第７１回利付国債（２０年）	400,000,000	427,240,000	
第７２回利付国債（２０年）	710,000,000	760,324,800	
第７３回利付国債（２０年）	540,000,000	579,576,600	
第７４回利付国債（２０年）	310,000,000	333,777,000	
第７５回利付国債（２０年）	360,000,000	389,628,000	
第７６回利付国債（２０年）	340,000,000	365,486,400	
第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	312,802,700	
第７８回利付国債（２０年）	20,000,000	21,603,600	
第７９回利付国債（２０年）	100,000,000	108,410,000	
第８０回利付国債（２０年）	250,000,000	272,005,000	
第８１回利付国債（２０年）	180,000,000	196,122,600	
第８２回利付国債（２０年）	485,000,000	530,463,900	
第８３回利付国債（２０年）	70,000,000	76,941,900	
第８４回利付国債（２０年）	190,000,000	208,000,600	
第８５回利付国債（２０年）	360,000,000	397,620,000	
第８６回利付国債（２０年）	240,000,000	267,324,000	
第８７回利付国債（２０年）	170,000,000	188,560,600	
第８８回利付国債（２０年）	340,000,000	380,823,800	
第８９回利付国債（２０年）	320,000,000	356,844,800	
第９０回利付国債（２０年）	420,000,000	470,866,200	
第９１回利付国債（２０年）	310,000,000	349,149,900	
第９２回利付国債（２０年）	790,000,000	886,040,300	
第９３回利付国債（２０年）	260,000,000	291,665,400	
第９４回利付国債（２０年）	445,000,000	501,733,050	
第９５回利付国債（２０年）	1,100,000,000	1,259,632,000	
第９６回利付国債（２０年）	200,000,000	226,644,000	
第９７回利付国債（２０年）	210,000,000	240,485,700	
第９８回利付国債（２０年）	370,000,000	421,418,900	
第９９回利付国債（２０年）	660,000,000	754,980,600	
第１００回利付国債（２０年）	760,000,000	878,719,600	
第１０１回利付国債（２０年）	360,000,000	421,063,200	
第１０２回利付国債（２０年）	1,070,000,000	1,258,437,700	
第１０３回利付国債（２０年）	1,335,000,000	1,560,815,250	
第１０４回利付国債（２０年）	260,000,000	300,359,800	
第１０５回利付国債（２０年）	730,000,000	847,186,900	
第１０６回利付国債（２０年）	270,000,000	315,292,500	
第１０７回利付国債（２０年）	270,000,000	314,868,600	

	第１０８回利付国債（２０年）	725,000,000	834,649,000	
	第１０９回利付国債（２０年）	290,000,000	335,077,600	
	第１１０回利付国債（２０年）	515,000,000	602,998,050	
	第１１１回利付国債（２０年）	450,000,000	532,611,000	
	第１１２回利付国債（２０年）	550,000,000	646,591,000	
	第１１３回利付国債（２０年）	905,000,000	1,067,728,050	
	第１１４回利付国債（２０年）	610,000,000	722,453,500	
	第１１５回利付国債（２０年）	370,000,000	441,339,700	
	第１１６回利付国債（２０年）	260,000,000	311,207,000	
	第１１７回利付国債（２０年）	240,000,000	285,180,000	
	第１１８回利付国債（２０年）	450,000,000	532,453,500	
	第１１９回利付国債（２０年）	320,000,000	372,915,200	
	第１２０回利付国債（２０年）	1,330,000,000	1,526,148,400	
	第１２１回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,201,182,600	
	第１２２回利付国債（２０年）	490,000,000	572,540,500	
	第１２３回利付国債（２０年）	900,000,000	1,079,685,000	
	第１２４回利付国債（２０年）	820,000,000	975,988,600	
	第１２５回利付国債（２０年）	500,000,000	606,400,000	
	第１２６回利付国債（２０年）	450,000,000	537,075,000	
	第１２７回利付国債（２０年）	400,000,000	473,540,000	
	第１２８回利付国債（２０年）	810,000,000	961,380,900	
	第１２９回利付国債（２０年）	260,000,000	306,022,600	
	第１３０回利付国債（２０年）	890,000,000	1,050,475,900	
	第１３１回利付国債（２０年）	1,030,000,000	1,205,285,400	
	第１３２回利付国債（２０年）	600,000,000	703,878,000	
	第１３３回利付国債（２０年）	620,000,000	733,770,000	
	第１３４回利付国債（２０年）	1,060,000,000	1,257,774,800	
	第１３５回利付国債（２０年）	155,000,000	182,276,900	
	第１３６回利付国債（２０年）	450,000,000	524,421,000	
	第１３７回利付国債（２０年）	210,000,000	247,558,500	
	第１３８回利付国債（２０年）	260,000,000	300,864,200	
	第１３９回利付国債（２０年）	800,000,000	934,408,000	
	第１４０回利付国債（２０年）	1,205,000,000	1,423,888,250	
	第１４１回利付国債（２０年）	1,040,000,000	1,232,410,400	
	第１４２回利付国債（２０年）	540,000,000	646,018,200	
	第１４３回利付国債（２０年）	830,000,000	976,138,100	
	第１４４回利付国債（２０年）	1,080,000,000	1,257,681,600	
	第１４５回利付国債（２０年）	1,150,000,000	1,368,764,500	
	第１４６回利付国債（２０年）	1,300,000,000	1,551,550,000	
	第１４７回利付国債（２０年）	1,190,000,000	1,408,626,800	
	第１４８回利付国債（２０年）	1,470,000,000	1,724,853,900	
	第１４９回利付国債（２０年）	2,090,000,000	2,456,335,200	
	第１５０回利付国債（２０年）	1,790,000,000	2,083,918,000	

	第１５１回利付国債（２０年）	1,680,000,000	1,914,225,600	
	第１５２回利付国債（２０年）	1,700,000,000	1,938,697,000	
	第１５３回利付国債（２０年）	2,130,000,000	2,460,128,700	
	第１５４回利付国債（２０年）	1,530,000,000	1,747,749,600	
	第１５５回利付国債（２０年）	1,050,000,000	1,170,844,500	
	第１５６回利付国債（２０年）	1,390,000,000	1,430,574,100	
	第１５７回利付国債（２０年）	1,700,000,000	1,698,759,000	
	第１５８回利付国債（２０年）	1,900,000,000	1,980,902,000	
	第１５９回利付国債（２０年）	1,780,000,000	1,880,748,000	
	第１６０回利付国債（２０年）	400,000,000	428,716,000	
	第１６１回利付国債（２０年）	1,065,000,000	1,124,565,450	
	第１６２回利付国債（２０年）	1,050,000,000	1,107,907,500	
	第１６３回利付国債（２０年）	1,845,000,000	1,945,183,500	
	第１６４回利付国債（２０年）	270,000,000	280,114,200	
	第１６５回利付国債（２０年）	1,660,000,000	1,720,307,800	
	第１６６回利付国債（２０年）	1,320,000,000	1,410,723,600	
	第１６７回利付国債（２０年）	1,650,000,000	1,705,968,000	
	第１６８回利付国債（２０年）	1,930,000,000	1,959,046,500	
	第１６９回利付国債（２０年）	820,000,000	816,531,400	
	第１７０回利付国債（２０年）	2,270,000,000	2,256,402,700	
	第１７１回利付国債（２０年）	730,000,000	724,313,300	
	第１７２回利付国債（２０年）	290,000,000	292,537,500	
	第１７３回利付国債（２０年）	2,210,000,000	2,225,624,700	
	第１７４回利付国債（２０年）	1,290,000,000	1,296,914,400	
	第１７５回利付国債（２０年）	440,000,000	449,944,000	
	第１７６回利付国債（２０年）	1,870,000,000	1,909,270,000	
国債証券合計		298,150,000,000	320,246,032,250	
地方債証券	第１回東京都公募公債（東京グリーンボンド（３０年））	100,000,000	108,613,000	
	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	105,967,000	
	第７回東京都公募公債（３０年）	200,000,000	271,204,000	
	第１１回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	224,690,000	
	第１６回東京都公募公債（２０年）	150,000,000	171,682,500	
	第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	115,046,000	
	第１８回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	233,060,000	
	第２０回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	116,470,000	
	第２１回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	117,808,000	
	第７１４回東京都公募公債	100,000,000	101,031,000	
	第７２９回東京都公募公債	150,000,000	152,719,500	
	第７４０回東京都公募公債	100,000,000	101,558,000	
	第７８６回東京都公募公債	200,000,000	201,568,000	
	第８００回東京都公募公債	300,000,000	300,501,000	

平成２７年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	100,963,000	
第３回神奈川県公募公債（３０年）	100,000,000	135,065,000	
第１１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	116,142,000	
第１５回神奈川県公募公債（２０年）	300,000,000	351,828,000	
第１６回神奈川県公募公債（２０年）	600,000,000	714,360,000	
第２１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	117,599,000	
第１９６回神奈川県公募公債	100,000,000	101,112,000	
第２４３回神奈川県公募公債	100,000,000	100,125,000	
第２回大阪府公募公債（２０年）	300,000,000	353,532,000	
第３７６回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,759,000	
第４０３回大阪府公募公債（１０年）	300,000,000	305,985,000	
第４１７回大阪府公募公債（１０年）	108,000,000	109,251,720	
第４２３回大阪府公募公債（１０年）	300,000,000	302,460,000	
平成２５年度第２回京都府公募公債（１５年）	100,000,000	106,805,000	
平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	102,136,000	
平成２７年度第１３回京都府公募公債	105,860,000	106,375,538	
令和元年度第３回京都府公募公債	100,000,000	100,014,000	
第３回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	113,940,000	
第４回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	108,124,000	
第８回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	108,001,000	
第１１回兵庫県公募公債（１５年）	200,000,000	211,504,000	
平成２６年度第２回兵庫県公募公債	100,000,000	101,760,000	
平成２８年度第３０回兵庫県公募公債	100,000,000	101,042,000	
第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	104,505,000	
第１５回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	117,311,000	
平成２４年度第１０回静岡県公募公債	100,000,000	101,115,000	
平成２５年度第１回静岡県公募公債	100,000,000	100,999,000	
平成２７年度第６回静岡県公募公債	100,000,000	101,908,000	
平成２２年度第１４回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	118,803,000	
平成２４年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,142,000	
平成２５年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,545,000	
平成２５年度第２１回愛知県公募公債（１０年）	400,000,000	407,460,000	
平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	203,378,000	
平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,078,000	
平成２９年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,438,000	
平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	201,952,000	
	100,000,000	100,255,000	

	令和元年度第１６回愛知県公募公債（１０年）			
	令和２年度第７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,671,000	
	令和３年度第６回愛知県公募公債（３０年）	200,000,000	200,384,000	
	平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	116,329,000	
	平成２７年度第２回広島県公募公債	162,000,000	165,863,700	
	平成２９年度第７回広島県公募公債	131,440,000	132,835,892	
	第５回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	115,300,000	
	第７回埼玉県公募公債（１５年）	400,000,000	404,888,000	
	第８回埼玉県公募公債（１５年）	100,000,000	101,396,000	
	第９回埼玉県公募公債（３０年）	100,000,000	105,030,000	
	第１８回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	201,462,000	
	平成２４年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	100,996,000	
	平成２９年度第５回埼玉県公募公債	100,000,000	101,137,000	
	平成１９年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	135,930,000	
	平成２０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	200,000,000	263,516,000	
	平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	107,847,000	
	平成２５年度第１回福岡県公募公債	100,000,000	101,571,000	
	平成２６年度第８回福岡県公募公債	100,000,000	101,489,000	
	平成２９年度第８回福岡県公募公債	200,000,000	202,496,000	
	令和３年度第２回福岡県公募公債	100,000,000	100,732,000	
	令和３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	200,000,000	200,836,000	
	第６回千葉県公募公債（２０年）	200,000,000	234,052,000	
	第８回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	118,414,000	
	第９回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	116,199,000	
	平成２４年度第８回千葉県公募公債	100,000,000	101,254,000	
	平成２６年度第９回千葉県公募公債	100,000,000	101,685,000	
	平成２８年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	100,362,000	
	平成２９年度第５回千葉県公募公債	120,000,000	121,342,800	
	令和元年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	100,170,000	
	平成２４年度第２回新潟県公募公債	200,000,000	202,500,000	
	平成２７年度第３回新潟県公募公債	200,000,000	201,072,000	
	令和３年度第１回長野県公募公債（１０年）	200,000,000	202,220,000	
	平成２４年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	139,630,000	140,964,862	
	第１１６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,060,000	
	第１１７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,006,000	
	第１１８回共同発行市場公募地方債	550,000,000	556,897,000	
	第１２０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,122,000	
	第１２５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,394,000	
	第１３０回共同発行市場公募地方債	350,000,000	356,608,000	

第１３３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,879,000	
第１３４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,892,000	
第１３７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,726,000	
第１３９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,502,000	
第１４０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,667,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,503,000	
第１５３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,049,000	
第１６１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,609,000	
第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,199,000	
第１７５回共同発行市場公募地方債	150,000,000	151,635,000	
第１８１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,942,000	
第１９４回共同発行市場公募地方債	160,000,000	160,747,200	
第２０９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,496,000	
平成２４年度第２回熊本県公募公債（１０年）	100,000,000	100,994,000	
第７回大阪市公募公債（３０年）	100,000,000	108,410,000	
第１０回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	118,269,000	
平成２４年度第８回大阪市公募公債	300,000,000	303,918,000	
令和３年度第２回大阪市公募公債	100,000,000	100,828,000	
第３回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	133,976,000	
第１３回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	108,500,000	
第２５回名古屋市公募公債（５年）	100,000,000	100,035,000	
第４８２回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	101,047,000	
第４８８回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	101,869,000	
第４９５回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	100,487,000	
第２回京都市公募公債（２０年）	100,000,000	108,779,000	
第６回京都市公募公債（２０年）	100,000,000	114,344,000	
平成２７年度第５回京都市公募公債	200,000,000	201,834,000	
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	115,945,000	
平成２４年度第１２回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	117,619,000	
平成２６年度第３回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	116,203,000	
令和２年度第９回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	99,490,000	
第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	108,447,000	
第５回横浜市公募公債（３０年）	100,000,000	135,365,000	
第７回横浜市公募公債（３０年）	100,000,000	135,396,000	
平成２５年度第６回横浜市公募公債	100,000,000	101,718,000	
第２５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	117,264,000	
第２６回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	118,464,000	
第５５回横浜市公募公債（５年）	100,000,000	100,024,000	
令和３年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	100,828,000	
平成２４年度第７回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	100,858,000	

	第８回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	117,363,000	
	第１１回川崎市公募公債（２０年）	150,000,000	174,348,000	
	第８８回川崎市公募公債	100,000,000	102,019,000	
	平成２５年度第６回福岡市公募公債（２０年）	400,000,000	465,124,000	
	平成２９年度第１２回福岡市公募公債	130,000,000	131,383,200	
	平成３０年度第９回福岡市公募公債（１０年）	100,000,000	101,729,000	
	平成２７年度第２回広島市公募公債	100,000,000	102,027,000	
	平成２６年度第１回千葉市公募公債	200,000,000	203,704,000	
	平成２７年度第１回三重県公募公債	100,000,000	102,027,000	
	平成２４年度第１回福井県公募公債	100,000,000	100,994,000	
	平成２４年度第１回山梨県公募公債（１０年）	100,000,000	100,999,000	
	平成２７年度第１回山梨県公募公債（１０年）	100,000,000	102,088,000	
地方債証券合計		20,056,930,000	21,380,284,912	
特殊債券	第２回政府保証新関西国際空港債券	200,000,000	203,444,000	
	第１２９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	95,535,000	
	第１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	152,654,000	
	第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	166,843,500	
	第２１回道路債券	100,000,000	129,869,000	
	第２２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	293,952,000	
	第２７回道路債券	100,000,000	106,355,000	
	第２７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,058,000	
	第２８回道路債券	300,000,000	395,250,000	
	第３３回道路債券	100,000,000	133,746,000	
	第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,060,000	
	第３８回道路債券	100,000,000	107,059,000	
	第３９回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,246,000	
	第４２回道路債券	100,000,000	108,029,000	
	第４３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,292,000	
	第４９回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,885,000	
	第８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,795,000	
	第９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,834,000	
	第９９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,386,000	
	第１０１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	133,915,000	

第１０２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,083,000	
第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	700,000,000	708,148,000	
第１０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	132,347,000	
第１１１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,480,000	
第１２３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	130,972,000	
第１２３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,772,000	
第１２８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,220,000	
第１７５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,038,000	
第１７７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	404,416,000	
第１７８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,268,000	
第１８２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,578,000	
第１８３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,977,000	
第１８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	209,000,000	211,344,980	
第１８９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,954,000	
第１９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,145,000	
第１９５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,865,000	
第１９７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	116,000,000	118,020,720	
第２００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,734,000	
第２３５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,239,000	
第２６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,399,000	
第２７１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,092,000	
第２７３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,047,000	
第２８８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,974,000	
第３００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	301,650,000	
第３３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	243,000,000	245,879,550	
第３６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,406,000	
	100,000,000	117,029,000	

第２回地方公営企業等金融機構債券（２０年）			
第４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	117,071,000	
第５回公営企業債券（２０年）	100,000,000	104,499,000	
第５回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	236,174,000	
第７回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	118,439,000	
第９回公営企業債券（２０年）	100,000,000	107,305,000	
第１１回公営企業債券（２０年）	100,000,000	107,645,000	
第１２回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	118,759,000	
第１５回公営企業債券（２０年）	100,000,000	108,863,000	
第１５回地方公共団体金融機構債券（２０年）	300,000,000	356,700,000	
第１７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	111,035,000	
第１７回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	117,464,000	
第２２回公営企業債券（２０年）	200,000,000	226,554,000	
第２３回地方公共団体金融機構債券（２０年）	300,000,000	349,503,000	
第２４回公営企業債券（２０年）	100,000,000	114,910,000	
第４０回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,951,000	
第４１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,990,000	
第４３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,042,000	
第４３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,011,000	
第４４回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,263,000	
第４６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,234,000	
第４９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,695,000	
第５０回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	102,839,210	
第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,704,000	
第５６回政府保証地方公共団体金融機構債券	193,000,000	196,558,920	
第５８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,687,000	
第５９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,801,000	
第６０回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,846,000	
第６２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,772,000	
第７３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,839,000	
第７７回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,172,000	
第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	421,000,000	427,803,360	
第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,092,000	
第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,376,000	
第９６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,843,000	
第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,358,000	
第１０７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,704,000	
第１１０回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	151,201,500	

第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,295,000	
第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,399,000	
Ｆ１９０回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,505,000	
第２１回首都高速道路株式会社社債	300,000,000	300,294,000	
第８５回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,990,000	
第８７回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,950,000	
第１５９回都市再生債券	100,000,000	85,137,000	
第１６１回都市再生債券	100,000,000	93,240,000	
第１６９回都市再生債券	100,000,000	99,202,000	
第１８回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	101,131,000	
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,835,000	58,011,484	
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	23,548,000	24,105,852	
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,017,000	12,332,926	
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	10,200,000	10,234,782	
第５回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	224,385,000	224,665,481	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	10,637,000	10,762,091	
第６回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,033,000	
第７回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	42,660,000	43,163,388	
第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	82,484,000	82,559,060	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	11,251,000	11,465,444	
第８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,164,000	25,790,583	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	11,309,000	11,525,454	
第９回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	92,636,000	92,786,996	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	11,700,000	11,977,992	
第１２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	14,211,000	14,871,243	
第１７回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	32,112,000	32,372,107	
第１８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	10,618,000	10,693,069	
第１８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,584,000	
第２０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,820,000	21,022,995	
第２３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,882,000	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,692,000	18,821,280	
第２５回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,650,000	10,739,992	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,615,000	20,980,988	
第２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,150,000	38,273,812	
第２８回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,072,000	12,348,328	
第２９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,334,000	32,688,057	

第３１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,327,000	11,510,270	
第３２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,255,000	36,938,406	
第３４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,657,000	14,102,764	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,026,000	27,826,218	
第３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,237,000	25,759,568	
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,499,000	11,706,326	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,499,000	24,836,328	
第３７回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,169,000	12,480,161	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,001,000	35,641,518	
第３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,134,000	53,672,803	
第４０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,712,000	27,721,980	
第４１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,568,000	12,964,771	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,408,000	11,667,532	
第４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,608,000	32,223,490	
第４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,103,000	31,901,353	
第４３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,703,000	
第４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,814,000	91,942,102	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,140,000	103,760,477	
第４７回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,881,000	12,204,757	
第４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,532,000	24,816,611	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,016,000	26,177,492	
第５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	34,557,000	35,441,313	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,125,000	28,596,260	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,328,000	12,718,427	
第５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,413,000	33,126,265	
第５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,121,000	34,982,068	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,110,000	39,227,125	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,134,000	37,097,639	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,144,000	45,155,804	
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,689,000	46,146,943	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,022,000	39,986,216	
第７１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,845,000	38,453,652	
第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,740,000	39,417,165	
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,315,000	45,784,821	
第８５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,151,000	
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,519,000	
第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,802,000	70,356,101	
第１０９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,652,000	153,157,904	
第１１１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,617,000	77,598,371	
第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,155,000	80,002,750	

	第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,944,000	79,625,286	
	第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,303,000	80,345,834	
	第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,606,000	80,985,571	
	第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,434,000	81,726,574	
	第１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,226,000	81,569,785	
	第１２１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,330,000	82,570,282	
	第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,230,000	84,480,114	
	第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,138,000	85,225,904	
	第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,351,000	84,532,917	
	第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,600,000	86,856,608	
	第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,625,000	87,696,551	
	第１３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,382,000	88,792,345	
	第１３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,563,000	89,091,849	
	第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,708,000	88,766,635	
	第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,740,000	90,525,225	
	第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,535,000	91,210,391	
	第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,633,000	91,677,900	
	第１５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	281,232,000	282,306,306	
	第１５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	281,421,000	284,010,073	
	第１５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,058,000	94,982,590	
	第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,578,000	190,848,172	
	第１５７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,491,000	
	第１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,939,000	98,106,145	
	第１６１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,411,000	98,468,883	
	第１６３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,952,000	99,002,045	
	第１６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,206,000	99,086,907	
	第１６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,686,000	100,273,857	

	第１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,441,000	100,944,547	
	第１６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,684,000	202,519,512	
	第６０回日本学生支援債券	100,000,000	99,988,000	
	第６２回日本学生支援債券	100,000,000	99,986,000	
	い第８１７号商工債	200,000,000	200,518,000	
	い第８２９号商工債	100,000,000	100,174,000	
	い第８３２号商工債	100,000,000	99,968,000	
	い第８３５号商工債	200,000,000	199,760,000	
	い第８４５号商工債	200,000,000	200,254,000	
	第３３９回信金中金債（５年）	100,000,000	100,120,000	
	第３４２回信金中金債（５年）	100,000,000	100,137,000	
	第２３６号商工債（３年）	400,000,000	399,948,000	
	第４８回東日本高速道路株式会社社債	300,000,000	300,294,000	
	第６７回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	202,026,000	
	第７４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,043,000	
	第４５回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,018,000	
	第８３回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,035,000	
	第８８回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,000,000	
	第１８回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	202,882,000	
	第２９回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,180,000	
	第５４回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,154,000	
	第６６回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	107,796,000	
特殊債券合計		22,607,411,000	23,832,302,703	
社債券	第２４回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	100,356,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	99,926,000	
	第２回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	100,626,000	
	第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,265,000	
	第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,986,000	
	第１回バンコ・サンタンデール・エセ・アー非上位円貨社債	100,000,000	100,279,000	
	第１２回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	200,000,000	199,858,000	
	第２０回株式会社大林組無担保社債	100,000,000	101,531,000	
	第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,714,000	
	第５回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,236,000	
	第２４回大和ハウス工業株式会社無担保社債	200,000,000	200,390,000	
	第３回高砂熱学工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,755,000	
	第９回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,869,000	

第１３回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,820,000	
第１９回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,977,000	
第２回株式会社伊藤園無担保社債	100,000,000	99,814,000	
第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,230,000	
第１０回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,712,000	
第２５回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,244,000	
第９回株式会社セブン＆アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	101,030,000	
第１４回株式会社セブン＆アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	100,399,000	
第３０回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	101,092,000	
第１１回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,953,000	
第２２回レンゴー株式会社無担保社債	100,000,000	100,794,000	
第２２回三菱瓦斯化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,232,000	
第２２回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	101,116,000	
第３２回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,386,000	
第３５回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,452,000	
第４０回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,195,000	
第４２回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,777,000	
第７回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,867,000	
第６回株式会社電通無担保社債	100,000,000	101,770,000	
第１回株式会社ツムラ無担保社債	100,000,000	100,119,000	
第１３回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	99,068,000	
第１４回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,932,000	
第１４回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	101,438,000	
第９回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	101,147,000	
第１４回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	101,673,000	
第１１回日本電気硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,240,000	
第９回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	100,807,000	
第３１回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,050,000	
第３４回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,342,000	
第１０回株式会社荏原製作所無担保社債	100,000,000	100,048,000	
第１６回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	101,719,000	
第２０回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	100,422,000	
第８回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	99,768,000	
第１６回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,448,000	

	第２０回パナソニック株式会社無担保社債	300,000,000	299,985,000	
	第２３回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,032,000	
	第１９回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,691,000	
	第１回株式会社東海理化電機製作所無担保社債	100,000,000	99,911,000	
	第１回明治安田生命２０１７基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,111,000	
	第３０回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,207,000	
	第１２回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,932,000	
	第１回明治安田生命２０１８基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,137,000	
	第１回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,164,000	
	第６回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	98,188,000	
	第６９回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	118,179,000	
	第８７回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	100,491,000	
	第２２回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	100,025,000	
	第９回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	108,412,000	
	第５７回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	102,694,000	
	第１回三井住友ＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	101,316,000	
	第２５回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	108,226,000	
	第２３回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,531,000	
	第４回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,403,000	
	第１６回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,399,000	
	第１８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,415,000	
	第３４回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	99,993,000	
	第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,244,000	
	第６４回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,870,000	
	第６５回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,400,000	
	第９４回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,402,000	
	第７回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,990,000	
	第１６回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	100,026,000	
	第３０回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,361,000	
	第５０回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,127,000	
	第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,233,000	
	第８７回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,970,000	

第２１回三井住友ファイナンス＆リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,504,000	
第６９回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,542,000	
第８２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,160,000	
第４７回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	117,159,000	
第７８回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,907,000	
第８３回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	113,746,000	
第１３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,963,000	
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,184,000	
第１３回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,886,000	
第３回東急株式会社無担保社債	100,000,000	100,982,000	
第４５回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,607,000	
第４６回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,834,000	
第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,306,000	
第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	96,713,000	
第４２回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,948,000	
第２１回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,318,000	
第４９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,452,000	
第６７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,287,000	
第１２９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,238,000	
第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,684,000	
第１６５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,453,000	
第１１回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,771,000	
第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,962,000	
第５１回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,090,000	
第５１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,099,000	
第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	125,339,000	
第８３回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	199,874,000	
第８回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	114,205,000	
第１０回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	118,158,000	
第１３回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	115,432,000	
第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,493,000	
第４５回西日本鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	208,030,000	
第５８回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,980,000	
第４回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	100,306,000	
第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	200,000,000	202,216,000	

	第１１回ソフトバンク株式会社無担保社債	200,000,000	200,194,000	
	第３２回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	100,121,000	
	第５００回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,329,000	
	第５３５回中部電力株式会社社債	200,000,000	200,900,000	
	第５０９回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,878,000	
	第５１０回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,988,000	
	第５３６回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,280,000	
	第３７７回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,217,000	
	第３９３回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,715,000	
	第４２５回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,134,000	
	第４２６回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,659,000	
	第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,670,000	
	第３２１回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,455,000	
	第５０８回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,099,000	
	第５２１回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,595,000	
	第５３５回東北電力株式会社社債	200,000,000	200,068,000	
	第２５３回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,822,000	
	第３７１回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,941,000	
	第４２６回九州電力株式会社社債	200,000,000	205,174,000	
	第４３１回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,525,000	
	第４６８回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,747,000	
	第４８２回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,322,000	
	第３２３回北海道電力株式会社社債	100,000,000	108,939,000	
	第３５７回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,806,000	
	第１３回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	107,568,000	
	第３８回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,198,000	
	第５６回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,875,000	
	第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,340,000	
	第３１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	103,120,000	
	第３８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	303,855,000	
	第３９回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	103,802,000	
	第４１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,585,000	
	第４２回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,155,000	
	第４４回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,493,000	
	第３８回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	126,342,000	
	第４１回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	100,777,000	
	第４２回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	101,102,000	
	第７回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,761,000	

社債券合計	17,100,000,000	17,488,316,000	
合計		382,946,935,865	

(注)備考欄の代用有価証券の数値は額面を表示しております。代用有価証券の担保差入額面には、約定未受渡券面額を含んでおります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2021年 7月26日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	10,432,085,594
コール・ローン	1,590,815,051
株式	278,121,997,577
投資信託受益証券	168,107,142
投資証券	6,430,352,155
派生商品評価勘定	383,139,490
未収入金	758,604
未収配当金	217,320,886
差入委託証拠金	2,507,525,177
流動資産合計	299,852,101,676
資産合計	299,852,101,676
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	16,485,826
前受金	366,021,096
未払解約金	491,418,158
未払利息	2,855
流動負債合計	873,927,935
負債合計	873,927,935
純資産の部	
元本等	
元本	71,393,866,315
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	227,584,307,426
元本等合計	298,978,173,741
純資産合計	298,978,173,741
負債純資産合計	299,852,101,676

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月26日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(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。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2 .デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)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、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。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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。
3 .外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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。 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。
4 .収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金

	2021年 7月26日現在
	株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 7月26日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		71,393,866,315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	4.1877円
	(1万口当たり純資産額)	(41,877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 7月26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。

	2021年 7月26日現在
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 7月26日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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 7月26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	76,769,062,125円
期中追加設定元本額	14,071,570,259円
期中一部解約元本額	19,446,766,069円
期末元本額	71,393,866,315円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,546,356,335円
ＤＣ外国株式インデックスファンド	4,615,650,603円
ＤＣ外国株式インデックスファンドＬ	24,411,737,412円
ＤＣバランスファンド３０	643,471,544円
ＤＣバランスファンド５０	1,307,649,069円
ＤＣバランスファンド７０	807,993,968円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	302,166,230円
外国株式インデックスｅ	4,820,893,383円
インデックスコレクション（外国株式）	12,034,777,410円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	3,415,764,981円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	925,518,625円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	855,125,978円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,458,197,267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）	1,575,703,302円
私募外国株式パッシブファンド２（適格機関投資家専用）	121,347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）	513,012,406円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	30,825,029円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	352,702,530円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	40,097,490円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	75,212,725円
ＶＡバランス株式３０（適格機関投資家専用）	193,855円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	596,051,782円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	318,642,630円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	225,813,329円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	4,373,981,561円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	484,943,811円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	135,986,800円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	703,961,860円

区分	2021年 7月26日現在
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	16,664,285円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	88,073,103円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	97,145,871円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	304,430,306円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	14,179,855円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	73,675,142円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	216,392,877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）	10,751,614円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月26日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	30,375,516,897
投資信託受益証券	8,806,577
投資証券	1,096,911,623
合計	31,481,235,097

(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 7月26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	14,009,613,272	－	14,375,634,368	366,021,096
合計		14,009,613,272	－	14,375,634,368	366,021,096

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2021年 7月26日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,414,481,151	－	1,415,113,719	632,568
	アメリカドル	909,733,238	－	910,761,308	1,028,070
	ユーロ	209,297,000	－	208,097,560	△1,199,440
	イギリスポンド	295,450,913	－	296,254,851	803,938
合計		1,414,481,151	－	1,415,113,719	632,568

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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 単価	評価額 金額	備考
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	34,920	20.21	705,733.20	
	CHENIERE ENERGY INC	11,266	83.89	945,104.74	
	CHEVRON CORP	90,349	98.86	8,931,902.14	
	CONOCOPHILLIPS	63,467	55.34	3,512,263.78	
	DEVON ENERGY CORPORATION	27,923	25.62	715,387.26	
	EOG RESOURCES INC	27,260	72.51	1,976,622.60	
	EXXON MOBIL	198,480	57.04	11,321,299.20	
	HALLIBURTON CO	41,018	20.11	824,871.98	
	HESS CORP	12,829	74.37	954,092.73	
	KINDER MORGAN INC	95,062	17.37	1,651,226.94	
	MARATHON PETROLEUM CORP	30,365	53.43	1,622,401.95	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	43,347	26.58	1,152,163.26	
	ONEOK INC	20,659	52.95	1,093,894.05	
	PHILLIPS 66	20,389	72.17	1,471,474.13	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	9,578	141.95	1,359,597.10	
	SCHLUMBERGER	64,999	28.41	1,846,621.59	
	VALERO ENERGY CORP	19,008	63.71	1,210,999.68	
	WILLIAMS COS	56,474	25.15	1,420,321.10	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	10,347	290.29	3,003,630.63	
	ALBEMARLE CORP	5,325	190.35	1,013,613.75	

AMCOR PLC	72,748	11.30	822,052.40	
AVERY DENNISON CORP	4,144	202.25	838,124.00	
BALL CORP	15,147	80.00	1,211,760.00	
CELANESE CORP-SERIES A	5,419	152.81	828,077.39	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	47.31	491,030.49	
CORTEVA INC	34,769	42.13	1,464,817.97	
CROWN HOLDINGS INC	6,218	97.29	604,949.22	
DOW INC	34,681	60.11	2,084,674.91	
DUPONT DE NEMOURS INC	25,064	74.22	1,860,250.08	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,266	110.05	689,573.30	
ECOLAB INC	12,020	217.89	2,619,037.80	
FMC CORP	5,984	106.35	636,398.40	
FREEPORT-MCMORAN INC	67,926	35.19	2,390,315.94	
INT'L PAPER CO	17,345	58.08	1,007,397.60	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,577	148.33	1,717,216.41	
LINDE PLC	24,622	298.81	7,357,299.82	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,432	96.59	1,200,806.88	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,894	356.23	1,030,929.62	
MOSAIC CO/THE	16,566	29.85	494,495.10	
NEWMONT CORPORATION	37,562	60.11	2,257,851.82	
NUCOR CORP	14,049	94.33	1,325,242.17	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,374	133.63	584,497.62	
PPG INDUSTRIES INC	11,026	162.92	1,796,355.92	
RPM INTERNATIONAL INC	5,987	88.17	527,873.79	
SEALED AIR CORP	7,368	54.94	404,797.92	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	11,916	285.97	3,407,618.52	
STEEL DYNAMICS INC	9,667	59.08	571,126.36	
VULCAN MATERIALS CO	6,162	178.14	1,097,698.68	
WESTROCK CO	12,132	48.17	584,398.44	
3 M COMPANY	27,047	200.49	5,422,653.03	
ALLEGION PLC	4,638	139.18	645,516.84	
AMETEK INC	10,723	137.83	1,477,951.09	
BOEING CO	25,870	221.52	5,730,722.40	
CARRIER GLOBAL CORP	38,424	51.90	1,994,205.60	
CATERPILLAR	25,479	209.53	5,338,614.87	
CUMMINS INC	6,913	237.44	1,641,422.72	
DEERE&CO	13,959	354.70	4,951,257.30	
DOVER CORP	6,691	164.29	1,099,264.39	
EATON CORP	18,650	156.73	2,923,014.50	
EMERSON ELECTRIC CO	27,979	98.48	2,755,371.92	
FASTENAL CO	26,712	54.64	1,459,543.68	
FORTIVE CORP	14,104	69.31	977,548.24	

FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,412	98.17	629,466.04	
GENERAC HOLDINGS INC	2,918	449.64	1,312,049.52	
GENERAL DYNAMICS CORP	11,401	191.86	2,187,395.86	
GENERAL ELECTRIC CO	410,769	12.71	5,220,873.99	
GRAINGER (WW) INC	2,116	458.66	970,524.56	
HEICO CORP	2,252	135.99	306,249.48	
HEICO CORP-CLASS A	3,318	124.13	411,863.34	
HONEYWELL INTL INC	32,494	229.32	7,451,524.08	
HOWMET AEROSPACE INC	18,227	32.38	590,190.26	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	203.75	406,073.75	
IDEX CORP	3,505	227.80	798,439.00	
ILLINOIS TOOL WORKS	14,823	226.39	3,355,778.97	
INGERSOLL-RAND INC	16,458	48.61	800,023.38	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,600	62.59	600,864.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	33,831	70.92	2,399,294.52	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	9,818	227.25	2,231,140.50	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,584	320.61	507,846.24	
LOCKHEED MARTIN CORP	11,802	380.77	4,493,847.54	
MASCO CORP	12,110	59.78	723,935.80	
NORDSON CORP	2,536	224.99	570,574.64	
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,408	361.31	2,676,584.48	
OTIS WORLDWIDE CORP	19,169	88.52	1,696,839.88	
OWENS CORNING	4,965	94.18	467,603.70	
PACCAR INC	16,159	87.58	1,415,205.22	
PARKER HANNIFIN CORP	6,017	306.68	1,845,293.56	
PENTAIR PLC	7,637	68.46	522,829.02	
PLUG POWER INC	23,605	26.81	632,850.05	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	71,218	85.81	6,111,216.58	
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,418	299.25	1,621,336.50	
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,901	496.63	2,433,983.63	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,602	54.88	417,197.76	
SMITH (A.O.) CORP	6,846	69.63	476,686.98	
SNAP-ON INC	2,372	224.59	532,727.48	
STANLEY BLACK&DECKER	7,473	204.19	1,525,911.87	
SUNRUN INC	7,884	50.62	399,088.08	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,150	445.66	958,169.00	
TEXTRON	10,911	68.03	742,275.33	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	11,217	201.45	2,259,664.65	
TRANSDIGM GROUP INC	2,411	647.64	1,561,460.04	
UNITED RENTALS INC	3,357	324.06	1,087,869.42	
WABTEC CORP	8,356	81.81	683,604.36	
XYLEM INC	8,363	123.26	1,030,823.38	

BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	6,342	89.69	568,813.98	
CINTAS CORP	4,399	395.34	1,739,100.66	
CLARIVATE PLC	15,370	25.14	386,401.80	
COPART INC	9,881	146.64	1,448,949.84	
COSTAR GROUP INC	18,390	89.97	1,654,548.30	
EQUIFAX INC	5,655	253.07	1,431,110.85	
IHS MARKIT LTD	17,667	115.44	2,039,478.48	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,004	133.90	803,935.60	
LEIDOS HOLDINGS	6,238	106.42	663,847.96	
REPUBLIC SERVICES INC	10,373	116.18	1,205,135.14	
ROBERT HALF INTL INC	5,212	92.87	484,038.44	
ROLLINS INC	10,710	37.90	405,909.00	
TRANSUNION	8,818	115.74	1,020,595.32	
VERISK ANALYTICS INC	7,189	188.39	1,354,335.71	
WASTE CONNECTIONS INC	12,201	124.76	1,522,196.76	
WASTE MANAGEMENT INC	19,771	146.39	2,894,276.69	
AMERCO	564	583.65	329,178.60	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,274	92.88	582,729.12	
CSX CORP	107,460	32.81	3,525,762.60	
DELTA AIR LINES INC	7,841	40.41	316,854.81	
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,850	130.36	1,023,326.00	
FEDEX CORP	11,683	297.07	3,470,668.81	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,907	167.25	653,445.75	
KANSAS CITY SOUTHERN	4,469	271.40	1,212,886.60	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,000	48.37	338,590.00	
LYFT INC-A	11,829	54.90	649,412.10	
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,893	265.32	3,155,450.76	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,619	261.08	1,205,928.52	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,754	50.70	342,427.80	
UBER TECHNOLOGIES INC	56,121	47.46	2,663,502.66	
UNION PACIFIC CORP	31,614	220.15	6,959,822.10	
UNITED PARCEL SERVICE B	33,541	211.64	7,098,617.24	
XPO LOGISTICS INC	4,206	143.62	604,065.72	
APTIV PLC	12,607	157.39	1,984,215.73	
AUTOLIV INC	3,858	93.75	361,687.50	
BORGWARNER INC	11,533	47.00	542,051.00	
FORD MOTOR COMPANY	182,713	13.82	2,525,093.66	
GENERAL MOTORS CO	60,338	54.94	3,314,969.72	
LEAR CORP	2,989	167.04	499,282.56	
TESLA INC	35,900	643.38	23,097,342.00	
DR HORTON INC	16,141	93.55	1,509,990.55	
GARMIN LTD	6,654	154.13	1,025,581.02	

HASBRO INC	6,002	92.41	554,644.82	
LENNAR CORP-CL A	12,818	102.86	1,318,459.48	
LULULEMON ATHLETICA INC	5,782	402.79	2,328,931.78	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,830	191.84	542,907.20	
NEWELL BRANDS INC	17,598	27.33	480,953.34	
NIKE B	59,408	166.36	9,883,114.88	
NVR INC	164	5,130.03	841,324.92	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	11,302	121.55	1,373,758.10	
PULTE GROUP INC	12,386	54.07	669,711.02	
VF CORP	16,318	83.08	1,355,699.44	
WHIRLPOOL CORP	3,060	219.52	671,731.20	
AIRBNB INC-CLASS A	2,569	138.73	356,397.37	
ARAMARK	11,643	34.75	404,594.25	
BOOKING HOLDINGS INC	1,920	2,202.57	4,228,934.40	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	9,663	90.31	872,665.53	
CARNIVAL CORPORATION	36,154	21.96	793,941.84	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,310	1,830.92	2,398,505.20	
DARDEN RESTAURANTS INC	6,041	144.52	873,045.32	
DOMINO'S PIZZA INC	1,797	525.45	944,233.65	
DRAFTKINGS INC - CL A	8,917	49.33	439,875.61	
EXPEDIA GROUP INC	6,324	161.55	1,021,642.20	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	12,946	125.26	1,621,615.96	
LAS VEGAS SANDS CORP	15,969	45.77	730,901.13	
MARRIOTT INTL A	12,879	139.18	1,792,499.22	
MCDONALD'S CORP	34,962	242.96	8,494,367.52	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	10,511	14.48	152,199.28	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	18,299	38.76	709,269.24	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,621	77.72	825,464.12	
STARBUCKS CORP	55,049	125.97	6,934,522.53	
VAIL RESORTS INC	1,853	312.56	579,173.68	
WYNN RESORTS LTD	5,210	103.57	539,599.70	
YUM BRANDS INC	14,073	122.79	1,728,023.67	
ACTIVISION BLIZZARD INC	36,195	91.50	3,311,842.50	
ALPHABET INC-CL A	14,062	2,660.30	37,409,138.60	
ALPHABET INC-CL C	13,785	2,756.32	37,995,871.20	
ALTICE USA INC- A	12,390	34.47	427,083.30	
CABLE ONE INC	247	1,938.89	478,905.83	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	6,332	726.81	4,602,160.92	
COMCAST CORP-CL A	214,339	58.36	12,508,824.04	
DISCOVERY INC - A	7,886	28.47	224,514.42	
DISCOVERY INC-C	14,119	26.83	378,812.77	
DISH NETWORK CORPORATION-A	12,603	41.68	525,293.04	

ELECTRONIC ARTS INC	13,548	144.99	1,964,324.52	
FACEBOOK INC-A	112,478	369.79	41,593,239.62	
FOX CORP - CLASS A	15,560	36.19	563,116.40	
FOX CORP- CLASS B	6,975	34.01	237,219.75	
IAC/INTERACTIVECORP	3,853	140.80	542,502.40	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	17,946	35.29	633,314.34	
LIBERTY BROADBAND-A	1,450	171.18	248,211.00	
LIBERTY BROADBAND-C	7,402	177.10	1,310,894.20	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,885	47.85	472,997.25	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,928	45.73	362,547.44	
LIBERTY SIRIUSXM-A	3,171	46.41	147,166.11	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	7,518	77.71	584,223.78	
MATCH GROUP INC	11,789	165.86	1,955,323.54	
NETFLIX INC	20,738	515.41	10,688,572.58	
NEWS CORP-CLASS A	17,936	24.75	443,916.00	
OMNICOM GROUP	9,954	72.30	719,674.20	
PINTEREST INC- CLASS A	23,843	76.91	1,833,765.13	
ROKU INC	5,086	473.65	2,408,983.90	
SEA LTD-ADR	617	297.67	183,662.39	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,096	6.43	302,827.28	
SNAP INC - A	43,288	77.97	3,375,165.36	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	5,342	173.29	925,715.18	
THE WALT DISNEY CO	85,011	176.14	14,973,837.54	
TWITTER INC	37,195	71.69	2,666,509.55	
VIACOMCBS INC-CLASS B	26,308	40.99	1,078,364.92	
ZILLOW GROUP INC-A	3,140	113.28	355,699.20	
ZILLOW GROUP INC-C	7,537	111.64	841,430.68	
ADVANCE AUTO PARTS	3,129	214.95	672,578.55	
AMAZON.COM	20,037	3,656.64	73,268,095.68	
AUTOZONE INC	1,082	1,632.13	1,765,964.66	
BEST BUY COMPANY INC	10,832	113.28	1,227,048.96	
BURLINGTON STORES INC	3,076	329.97	1,014,987.72	
CARMAX INC	7,628	134.84	1,028,559.52	
CARVANA CO	3,266	338.92	1,106,912.72	
CHEWY INC - CLASS A	3,947	86.74	342,362.78	
DOLLAR GENERAL CORP	11,647	228.90	2,665,998.30	
DOLLAR TREE INC	10,956	100.15	1,097,243.40	
EBAY	32,206	73.54	2,368,429.24	
ETSY INC	5,869	208.86	1,225,799.34	
GENUINE PARTS CO	6,685	129.09	862,966.65	
HOME DEPOT	50,551	332.84	16,825,394.84	
L BRANDS INC	10,967	77.85	853,780.95	

LKQ CORP	13,325	50.76	676,377.00	
LOWES COMPANIES	34,371	200.84	6,903,071.64	
MERCADOLIBRE INC	2,098	1,613.81	3,385,773.38	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,383	620.92	2,100,572.36	
POOL CORP	1,855	462.37	857,696.35	
ROSS STORES INC	16,636	121.68	2,024,268.48	
TARGET (DAYTON HUDSON)	23,475	261.03	6,127,679.25	
TJX COMPANIES INC	56,174	68.18	3,829,943.32	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,411	187.70	1,015,644.70	
ULTA BEAUTY INC	2,478	341.58	846,435.24	
WAYFAIR INC- CLASS A	3,215	285.51	917,914.65	
COSTCO WHOLESALE CORP	20,701	423.43	8,765,424.43	
KROGER CO	33,615	39.89	1,340,902.35	
SYSCO CORP	23,775	72.87	1,732,484.25	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	34,374	46.53	1,599,422.22	
WALMART INC	72,724	142.43	10,358,079.32	
ALTRIA GROUP INC	87,106	47.49	4,136,663.94	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	25,951	58.01	1,505,417.51	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	418	701.00	293,018.00	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14,377	72.02	1,035,431.54	
BUNGE LIMITED	6,422	74.94	481,264.68	
CAMPBELL SOUP CO (US)	9,742	44.57	434,200.94	
COCA-COLA CO	191,622	57.01	10,924,370.22	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	9,216	61.34	565,309.44	
CONAGRA BRANDS INC	22,663	34.25	776,207.75	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,917	224.58	1,777,999.86	
GENERAL MILLS INC	28,545	59.40	1,695,573.00	
HERSHEY FOODS CORPORATION	6,862	179.26	1,230,082.12	
HORMEL FOODS CORP	13,714	47.34	649,220.76	
JM SMUCKER CO	5,275	130.50	688,387.50	
KELLOGG CO	11,938	63.43	757,227.34	
KEURIG DR PEPPER INC	32,694	36.07	1,179,272.58	
KRAFT HEINZ CO/THE	32,632	39.22	1,279,827.04	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	6,735	75.50	508,492.50	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,562	85.72	991,094.64	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	8,727	49.70	433,731.90	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	67,011	64.89	4,348,343.79	
MONSTER BEVERAGE CORP	18,482	96.29	1,779,631.78	
PEPSICO INC	64,857	157.18	10,194,223.26	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	73,051	98.40	7,188,218.40	
TYSON FOODS INC	13,674	71.32	975,229.68	
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,548	86.48	998,671.04	

CLOROX COMPANY	5,866	184.77	1,083,860.82	
COLGATE-PALMOLIVE CO	38,122	83.28	3,174,800.16	
ESTEE LAUDER CO-CL A	10,607	333.55	3,537,964.85	
KIMBERLY-CLARK CORP	15,902	135.66	2,157,265.32	
PROCTER & GAMBLE CO	115,113	139.79	16,091,646.27	
ABBOTT LABORATORIES	83,187	120.80	10,048,989.60	
ABIOMED INC	2,088	328.52	685,949.76	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,499	638.28	2,233,341.72	
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,105	121.31	861,907.55	
ANTHEM INC	11,435	382.29	4,371,486.15	
BAXTER INTERNATIONAL	23,872	81.14	1,936,974.08	
BECTON DICKINSON & CO	13,583	251.08	3,410,419.64	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	66,997	44.12	2,955,907.64	
CARDINAL HEALTH	13,608	59.20	805,593.60	
CENTENE CORP	27,073	73.46	1,988,782.58	
CERNER CORP	14,251	78.41	1,117,420.91	
CIGNA CORP	16,426	232.88	3,825,286.88	
CVS HEALTH CORP	61,357	83.27	5,109,197.39	
DANAHER CORP	29,992	291.27	8,735,769.84	
DAVITA INC	3,582	120.61	432,025.02	
DENTSPLY SIRONA INC	10,094	63.59	641,877.46	
DEXCOM INC	4,480	460.72	2,064,025.60	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	29,151	109.40	3,189,119.40	
HCA HEALTHCARE INC	12,661	248.46	3,145,752.06	
HENRY SCHEIN INC	6,547	77.36	506,475.92	
HOLOGIC INC	11,926	72.30	862,249.80	
HUMANA INC	6,010	471.22	2,832,032.20	
IDEXX LABORATORIES INC	3,985	693.74	2,764,553.90	
INSULET CORP	3,056	276.55	845,136.80	
INTUITIVE SURGICAL INC	5,509	976.46	5,379,318.14	
LABORATORY CRP OF AMER	4,533	283.77	1,286,329.41	
MASIMO CORP	2,735	274.54	750,866.90	
MCKESSON CORP	7,488	202.63	1,517,293.44	
MEDTRONIC PLC	63,131	128.54	8,114,858.74	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,739	261.20	715,426.80	
NOVOCURE LTD	4,504	189.37	852,922.48	
OAK STREET HEALTH INC	4,376	60.49	264,704.24	
QUEST DIAGNOSTICS	6,246	139.43	870,879.78	
RESMED INC	6,751	259.83	1,754,112.33	
STERIS PLC	3,951	212.47	839,468.97	
STRYKER CORP	15,846	262.67	4,162,268.82	
TELADOC HEALTH INC	6,270	151.59	950,469.30	

TELEFLEX INC	2,162	397.91	860,281.42	
THE COOPER COS INC	2,279	410.07	934,549.53	
UNITEDHEALTH GROUP INC	44,358	417.70	18,528,336.60	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	152.67	595,107.66	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,333	333.06	2,109,268.98	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,434	381.07	1,308,594.38	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,671	159.97	1,547,069.87	
10X GENOMICS INC-CLASS A	3,216	183.47	590,039.52	
ABBVIE INC	82,852	118.19	9,792,277.88	
AGILENT TECHNOLOGIES	14,398	152.31	2,192,959.38	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,417	182.41	988,114.97	
AMGEN	26,982	247.72	6,683,981.04	
ASTRAZENECA PLC-SPONS ADR	21,691	58.23	1,263,066.93	
AVANTOR INC	24,065	37.18	894,736.70	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,027	682.92	701,358.84	
BIO-TECHNE CORP	1,796	474.40	852,022.40	
BIOGEN INC	7,191	325.40	2,339,951.40	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,381	77.04	645,672.24	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	104,670	68.34	7,153,147.80	
CATALENT INC	8,308	116.26	965,888.08	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,324	396.32	921,047.68	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,778	36.50	758,397.00	
EXACT SCIENCES CORP	7,383	117.95	870,824.85	
GILEAD SCIENCES INC	58,731	69.02	4,053,613.62	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	10,243	101.05	1,035,055.15	
ILLUMINA INC	6,830	495.51	3,384,333.30	
INCYTE CORP	8,608	79.30	682,614.40	
IQVIA HOLDINGS INC	8,951	249.08	2,229,515.08	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,663	173.93	463,175.59	
JOHNSON & JOHNSON	122,897	171.79	21,112,475.63	
LILLY (ELI) & CO	38,063	244.15	9,293,081.45	
MERCK & CO	118,737	77.54	9,206,866.98	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,109	1,477.14	1,638,148.26	
MODERNA INC	14,757	348.83	5,147,684.31	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,708	98.52	463,832.16	
NOVAVAX INC	3,227	203.24	655,855.48	
PERKINELMER INC	5,174	164.34	850,295.16	
PFIZER	260,869	41.68	10,873,019.92	
PPD INC	6,368	46.16	293,946.88	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,904	586.35	2,875,460.40	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	8,453	40.33	340,909.49	
SEAGEN INC	6,223	145.60	906,068.80	

TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56,857	8.81	500,910.17	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	18,401	532.26	9,794,116.26	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,167	200.50	2,439,483.50	
VIATRIS INC	57,073	13.92	794,456.16	
WATERS CORP	2,876	384.70	1,106,397.20	
ZOETIS INC	22,261	203.59	4,532,116.99	
BANK OF AMERICA CORP	363,211	37.70	13,693,054.70	
CITIGROUP	97,674	66.71	6,515,832.54	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,818	43.63	864,659.34	
FIFTH THIRD BANCORP	33,182	35.78	1,187,251.96	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,108	196.93	1,596,708.44	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	69,030	13.82	953,994.60	
JPMORGAN CHASE & CO	142,670	150.64	21,491,808.80	
KEY CORP	44,974	19.10	859,003.40	
M & T BANK CORP	5,956	129.33	770,289.48	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	19,846	183.02	3,632,214.92	
REGIONS FINL CORP	46,064	19.10	879,822.40	
SVB FINANCIAL GROUP	2,412	570.87	1,376,938.44	
TRUIST FINANCIAL CORP	63,156	54.46	3,439,475.76	
US BANCORP	66,613	55.72	3,711,676.36	
WELLS FARGO & CO	193,181	44.59	8,613,940.79	
ALLY FINANCIAL INC	18,129	51.79	938,900.91	
AMERICAN EXPRESS	32,082	173.18	5,555,960.76	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,496	248.89	1,367,899.44	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	8,001	59.44	475,579.44	
BANK NEW YORK CO	38,892	49.97	1,943,433.24	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	64,092	278.49	17,848,981.08	
BLACKROCK INC	7,152	868.95	6,214,730.40	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	21,406	160.08	3,426,672.48	
CARLYLE GROUP INC/THE	7,865	46.82	368,239.30	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,962	120.20	596,432.40	
CME GROUP INC	16,814	211.90	3,562,886.60	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,285	123.01	1,757,197.85	
EQUITABLE HOLDINGS INC	18,461	29.41	542,938.01	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,750	345.23	604,152.50	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	29.30	432,116.40	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,286	124.62	284,881.32	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,151	374.05	6,041,281.55	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	26,274	121.36	3,188,612.64	
INVESCO LTD	19,405	24.82	481,632.10	
KKR & CO INC	24,952	61.42	1,532,551.84	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,762	475.19	837,284.78	

MOODY'S CORP	7,905	381.86	3,018,603.30	
MORGAN STANLEY	65,965	94.55	6,236,990.75	
MSCI INC	3,869	578.95	2,239,957.55	
NASDAQ INC	5,320	187.76	998,883.20	
NORTHERN TRUST CORP	9,186	111.49	1,024,147.14	
PRICE T ROWE GROUP INC	10,575	207.35	2,192,726.25	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,700	128.50	732,450.00	
S&P GLOBAL INC	11,274	418.50	4,718,169.00	
SCHWAB (CHARLES) CORP	67,355	67.91	4,574,078.05	
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	60.80	382,371.20	
STATE STREET CORP	17,185	85.35	1,466,739.75	
SYNCHRONY FINANCIAL	27,139	46.51	1,262,234.89	
THE BLACKSTONE GROUP INC	31,520	111.30	3,508,176.00	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,522	87.82	397,122.04	
VOYA FINANCIAL INC	6,370	62.77	399,844.90	
AFLAC	31,141	53.37	1,661,995.17	
ALLEGHANY CORP	647	655.68	424,224.96	
ALLSTATE CORP	14,193	129.74	1,841,399.82	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,803	125.91	478,835.73	
AMERICAN INT'L GROUP	40,246	47.31	1,904,038.26	
AON PLC	10,695	232.48	2,486,373.60	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	18,793	38.53	724,094.29	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,948	143.05	1,280,011.40	
ASSURANT INC	2,684	155.02	416,073.68	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	6,517	65.22	425,038.74	
BROWN & BROWN INC	11,065	54.35	601,382.75	
CHUBB LTD	21,140	166.90	3,528,266.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,076	115.24	815,438.24	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,444	183.68	265,233.92	
EVEREST RE GROUP LTD	1,834	242.79	445,276.86	
FNF GROUP	12,836	44.74	574,282.64	
GLOBE LIFE INC	4,559	93.36	425,628.24	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	16,673	61.40	1,023,722.20	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,416	60.28	507,316.48	
LOEWS CORP	10,482	53.57	561,520.74	
MARKEL CORP	639	1,229.33	785,541.87	
MARSH & MCLENNAN COS	23,740	147.41	3,499,513.40	
METLIFE INC	35,762	57.63	2,060,964.06	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,725	62.19	791,367.75	
PROGRESSIVE CORP	27,400	94.73	2,595,602.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,486	99.50	1,839,357.00	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,361	107.21	360,332.81	

RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,776	149.32	414,512.32	
TRAVELERS COS INC/THE	11,830	147.87	1,749,302.10	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,009	226.41	1,360,497.69	
WR BERKLEY CORP	6,553	74.81	490,229.93	
CBRE GROUP INC-A	16,391	87.73	1,437,982.43	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	64,300	4.72	303,496.00	
WEYERHAEUSER CO	36,674	34.58	1,268,186.92	
ACCENTURE PLC-CL A	29,730	318.65	9,473,464.50	
ADOBE INC	22,518	625.87	14,093,340.66	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	7,539	119.54	901,212.06	
ANSYS INC	4,002	365.40	1,462,330.80	
AUTODESK INC	10,262	312.65	3,208,414.30	
AUTOMATIC DATA PROCESS	20,090	206.08	4,140,147.20	
AVALARA INC	4,011	166.42	667,510.62	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,879	60.94	480,146.26	
BLACK KNIGHT INC	8,009	80.00	640,720.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	5,360	172.49	924,546.40	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	13,022	145.67	1,896,914.74	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,963	100.35	698,737.05	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,676	125.90	714,608.40	
CITRIX SYSTEMS INC	5,416	114.93	622,460.88	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	9,908	117.24	1,161,613.92	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	24,980	69.29	1,730,864.20	
COUPA SOFTWARE INC	3,189	225.33	718,577.37	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	8,169	268.96	2,197,134.24	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,100	146.31	307,251.00	
DATADOG INC - CLASS A	8,853	111.23	984,719.19	
DOCUSIGN INC	8,685	308.50	2,679,322.50	
DROPBOX INC-CLASS A	16,505	30.91	510,169.55	
DYNATRACE INC	8,780	63.48	557,354.40	
EPAM SYSTEMS INC	2,602	557.36	1,450,250.72	
FAIR ISAAC CORP	1,345	552.88	743,623.60	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	29,079	148.83	4,327,827.57	
FISERV INC	28,111	111.79	3,142,528.69	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,879	257.08	997,213.32	
FORTINET INC	6,422	275.71	1,770,609.62	
GARTNER INC	4,134	260.61	1,077,361.74	
GLOBAL PAYMENTS INC	14,011	193.03	2,704,543.33	
GODADDY INC - CLASS A	8,747	86.13	753,379.11	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3,640	114.89	418,199.60	
HUBSPOT INC	2,023	580.34	1,174,027.82	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	41,787	141.34	5,906,174.58	

INTUIT INC	12,789	528.43	6,758,091.27	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,514	176.27	619,412.78	
MASTERCARD INC-CLASS A	41,447	393.26	16,299,447.22	
MICROSOFT CORP	335,078	289.67	97,062,044.26	
MONGODB INC	2,666	361.54	963,865.64	
NORTONLIFELOCK INC	25,891	25.78	667,469.98	
OKTA INC	5,585	257.91	1,440,427.35	
ORACLE CORP	89,401	87.69	7,839,573.69	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	24,206	21.81	527,932.86	
PALO ALTO NETWORKS INC	4,439	401.62	1,782,791.18	
PAYCHEX INC	15,091	112.25	1,693,964.75	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,306	395.90	912,945.40	
PAYPAL HOLDINGS INC	52,256	308.53	16,122,543.68	
PTC INC	5,381	152.69	821,624.89	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,503	276.55	968,754.65	
SALESFORCE.COM INC	44,494	248.25	11,045,635.50	
SERVICENOW INC	9,145	586.18	5,360,616.10	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,141	264.92	302,273.72	
SPLUNK INC	7,452	141.75	1,056,321.00	
SQUARE INC - A	17,982	264.00	4,747,248.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,662	75.70	807,113.40	
SYNOPSYS INC	7,085	285.07	2,019,720.95	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	19,540	81.15	1,585,671.00	
TWILIO INC - A	7,460	409.84	3,057,406.40	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,028	497.85	1,009,639.80	
UNITY SOFTWARE INC	2,516	105.50	265,438.00	
VERISIGN INC	4,769	222.54	1,061,293.26	
VISA INC-CLASS A SHARES	79,470	249.02	19,789,619.40	
VMWARE INC-CLASS A	3,884	158.34	614,992.56	
WESTERN UNION CO	20,387	23.22	473,386.14	
WIX.COM LTD	2,353	302.51	711,806.03	
WORKDAY INC-CLASS A	8,412	240.40	2,022,244.80	
ZENDESK INC	5,395	146.90	792,525.50	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	9,544	359.23	3,428,491.12	
ZSCALER INC	3,401	238.72	811,886.72	
AMPHENOL CORPORATION	27,943	71.00	1,983,953.00	
APPLE INC	785,112	148.56	116,636,238.72	
ARISTA NETWORKS INC	2,873	380.98	1,094,555.54	
ARROW ELECTRONICS INC	3,851	113.86	438,474.86	
CDW CORP/DE	6,651	180.95	1,203,498.45	
CISCO SYSTEMS	198,333	55.23	10,953,931.59	
COGNEX CORP	8,069	86.06	694,418.14	

CORNING	35,643	41.22	1,469,204.46	
DELL TECHNOLOGIES -C	12,252	96.55	1,182,930.60	
F5 NETWORKS INC	2,841	192.18	545,983.38	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	59,737	14.10	842,291.70	
HP INC	58,057	28.20	1,637,207.40	
IPG PHOTONICS CORP	1,782	215.46	383,949.72	
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	27.57	449,611.56	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	8,628	159.70	1,377,891.60	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,906	221.70	1,752,760.20	
NETAPP INC	10,843	77.72	842,717.96	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,880	85.48	844,542.40	
TE CONNECTIVITY LTD	15,454	138.35	2,138,060.90	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	11,609	83.45	968,771.05	
WESTERN DIGITAL CORP	15,203	63.75	969,191.25	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,482	548.61	1,361,650.02	
AT&T INC	334,473	28.15	9,415,414.95	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,831	26.05	203,997.55	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,877	26.02	491,179.54	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	42,975	12.63	542,774.25	
T-MOBILE US INC	29,005	144.00	4,176,720.00	
VERIZON COMMUNICATIONS	194,251	55.88	10,854,745.88	
AES CORP	30,838	23.90	737,028.20	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	12,663	58.61	742,178.43	
AMEREN CORPORATION	11,479	83.39	957,233.81	
AMERICAN ELECTRIC POWER	23,193	85.98	1,994,134.14	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,442	167.27	1,412,093.34	
ATMOS ENERGY CORP	6,189	99.45	615,496.05	
CENTERPOINT ENERGY INC	27,008	25.18	680,061.44	
CMS ENERGY CORP	13,272	62.08	823,925.76	
CONSOLIDATED EDISON INC	15,585	74.18	1,156,095.30	
DOMINION ENERGY INC	38,186	75.32	2,876,169.52	
DTE ENERGY COMPANY	9,012	116.36	1,048,636.32	
DUKE ENERGY CORP	35,874	104.47	3,747,756.78	
EDISON INTL	17,598	56.23	989,535.54	
ENTERGY CORP	9,296	102.74	955,071.04	
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,385	48.65	553,880.25	
EVERGY INC	10,471	65.08	681,452.68	
EVERSOURCE ENERGY	15,980	86.22	1,377,795.60	
EXELON CORP	45,584	46.52	2,120,567.68	
FIRSTENERGY CORP	25,172	38.47	968,366.84	
NEXTERA ENERGY INC	90,964	77.20	7,022,420.80	
NISOURCE INC	20,005	25.21	504,326.05	

	NRG ENERGY INC	12,298	41.00	504,218.00	
	PG&E CORP	68,966	9.22	635,866.52	
	PINNACLE WEST CAPITAL	6,029	84.55	509,751.95	
	PPL CORPORATION	35,742	28.26	1,010,068.92	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	23,582	61.22	1,443,690.04	
	SEMPRA ENERGY	14,758	130.72	1,929,165.76	
	SOUTHERN CO	49,296	63.86	3,148,042.56	
	UGI CORP	9,579	46.15	442,070.85	
	VISTRA CORP	23,603	19.10	450,817.30	
	WEC ENERGY GROUP INC	14,672	94.03	1,379,608.16	
	XCEL ENERGY INC	24,521	68.27	1,674,048.67	
	ADVANCED MICRO DEVICES	56,366	92.15	5,194,126.90	
	ANALOG DEVICES	17,289	163.55	2,827,615.95	
	APPLIED MATERIALS	42,826	138.43	5,928,403.18	
	BROADCOM INC	18,983	483.15	9,171,636.45	
	ENPHASE ENERGY INC	5,566	178.18	991,749.88	
	INTEL CORP	189,887	53.00	10,064,011.00	
	KLA CORP	7,254	320.76	2,326,793.04	
	LAM RESEARCH CORP	6,748	640.27	4,320,541.96	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	37,654	58.92	2,218,573.68	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	12,436	99.28	1,234,646.08	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,161	139.22	1,693,054.42	
	MICRON TECHNOLOGY	52,179	75.94	3,962,473.26	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,981	414.26	820,649.06	
	NVIDIA CORP	115,752	195.58	22,638,776.16	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	13,089	196.35	2,570,025.15	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	19,043	36.35	692,213.05	
	QORVO INC	5,297	193.09	1,022,797.73	
	QUALCOMM	53,058	144.88	7,687,043.04	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,742	192.66	1,491,573.72	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	2,629	248.63	653,648.27	
	TERADYNE INC	7,707	128.80	992,661.60	
	TEXAS INSTRUMENTS	43,073	186.85	8,048,190.05	
	XILINX INC	11,425	137.86	1,575,050.50	
アメリカドル 小計		15,016,486		1,828,602,437.59 (202,133,713,451)	
カナダドル	CAMECO CORP	19,186	21.48	412,115.28	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	54,987	40.95	2,251,717.65	
	CENOVUS ENERGY INC	65,155	10.12	659,368.60	
	ENBRIDGE	94,735	48.80	4,623,068.00	
	IMPERIAL OIL	11,645	34.06	396,628.70	
	INTER PIPELINE LTD	18,856	20.22	381,268.32	

KEYERA CORP	10,963	32.30	354,104.90	
PARKLAND CORP	8,544	39.80	340,051.20	
PEMBINA PIPELINE CORP	25,294	39.40	996,583.60	
SUNCOR ENERGY	70,924	26.14	1,853,953.36	
TC ENERGY CORP	43,831	61.02	2,674,567.62	
AGNICO EAGLE MINES	11,143	75.36	839,736.48	
B2GOLD CORP	46,547	4.95	230,407.65	
BARRICK GOLD CORP	82,748	25.93	2,145,655.64	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	69.25	505,663.50	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	26,720	24.55	655,976.00	
FRANCO-NEVADA CORP	9,313	184.85	1,721,508.05	
IVANHOE MINES LTD-CL A	26,291	9.20	241,877.20	
KINROSS GOLD CORP	56,706	7.70	436,636.20	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	11,734	50.12	588,108.08	
LUNDIN MINING CORP	30,173	11.32	341,558.36	
NUTRIEN LTD	26,457	74.28	1,965,225.96	
PAN AMERICAN SILVER CORP	9,343	33.77	315,513.11	
TECK RESOURCES LTD-CL B	20,669	26.40	545,661.60	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,500	90.00	405,000.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	20,697	54.94	1,137,093.18	
YAMANA GOLD INC	42,412	5.12	217,149.44	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	10,643	19.84	211,157.12	
CAE INC	11,940	39.00	465,660.00	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,269	103.95	443,762.55	
WSP GLOBAL INC	5,400	146.93	793,422.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	6,920	41.07	284,204.40	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,665	76.11	431,163.15	
THOMSON REUTERS CORP	7,995	131.36	1,050,223.20	
AIR CANADA	6,737	25.11	169,166.07	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	33,237	132.99	4,420,188.63	
CP RAILWAY LIMITED	31,390	92.81	2,913,305.90	
MAGNA INTERNATIONAL INC	13,183	101.73	1,341,106.59	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	43.32	433,200.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	13,329	82.80	1,103,641.20	
QUEBECOR INC -CL B	5,999	33.32	199,886.68	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	21,310	36.50	777,815.00	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,586	195.50	505,563.00	
DOLLARAMA INC	13,514	58.96	796,785.44	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	39,890	49.15	1,960,593.50	
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	40.33	295,618.90	
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	80.25	727,707.00	
METRO INC	11,419	61.98	707,749.62	

	WESTON (GEORGE) LTD	3,705	124.58	461,568.90	
	SAPUTO INC	11,041	36.09	398,469.69	
	BAUSCH HEALTH COS INC	14,544	35.96	523,002.24	
	CANOPY GROWTH CORP	9,718	24.70	240,034.60	
	BANK MONTREAL	30,030	124.47	3,737,834.10	
	BANK NOVA SCOTIA	56,675	77.92	4,416,116.00	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	20,799	143.12	2,976,752.88	
	NATIONAL BANK OF CANADA	16,160	94.02	1,519,363.20	
	ROYAL BANK OF CANADA	66,677	125.32	8,355,961.64	
	TORONTO-DOMINION BANK	84,951	82.68	7,023,748.68	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	59,948	64.39	3,860,051.72	
	IGM FINANCIAL INC	3,890	43.74	170,148.60	
	ONEX CORP	3,361	93.99	315,900.39	
	TMX GROUP LTD	2,508	134.67	337,752.36	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,198	526.61	630,878.78	
	GREAT-WEST LIFECO INC	12,491	37.24	465,164.84	
	IA FINANCIAL CORP INC	5,415	65.91	356,902.65	
	INTACT FINANCIAL CORP	6,593	168.60	1,111,579.80	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	90,426	23.97	2,167,511.22	
	POWER CORP OF CANADA	25,684	39.28	1,008,867.52	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	27,175	63.98	1,738,656.50	
	FIRSTSERVICE CORP	2,028	229.21	464,837.88	
	BLACKBERRY LIMITED	25,075	12.83	321,712.25	
	CGI INC - CL A	11,043	115.85	1,279,331.55	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	932	1,928.54	1,797,399.28	
	LIGHTSPEED POS INC-SUB VOTE	4,310	108.03	465,609.30	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,153	103.11	221,995.83	
	OPEN TEXT CORP	12,469	64.54	804,749.26	
	SHOPIFY INC - CLASS A	5,243	2,068.45	10,844,883.35	
	BCE INC	3,102	61.99	192,292.98	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	16,322	64.49	1,052,605.78	
	TELUS CORP	23,120	27.66	639,499.20	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,057	19.39	524,635.23	
	ALTAGAS INCOME LTD	14,516	26.41	383,367.56	
	ATCO LTD -CLASS I	4,372	43.79	191,449.88	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,264	53.12	332,743.68	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	35.31	211,083.18	
	EMERA INC	11,366	58.10	660,364.60	
	FORTIS INC	22,342	56.06	1,252,492.52	
	HYDRO ONE LTD	14,776	30.37	448,747.12	
	NORTHLAND POWER INC	9,907	43.37	429,666.59	
		1,904,063		111,603,850.96	

カナダドル 小計				(9,806,630,383)	
ユーロ	ENI	116,874	9.66	1,130,054.70	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	23,722	8.34	198,031.25	
	NESTE OIL OYJ	19,525	55.72	1,087,933.00	
	OMV AG	5,822	45.85	266,938.70	
	REPSOL SA	68,089	9.18	625,329.37	
	TENARIS SA	19,529	8.53	166,738.60	
	TOTALENERGIES SE	117,879	35.63	4,200,618.16	
	VOPAK	3,661	38.25	140,033.25	
	AIR LIQUIDE	22,094	150.56	3,326,472.64	
	AKZO NOBEL	9,224	102.70	947,304.80	
	ARCELORMITTAL	35,308	27.16	959,141.82	
	ARKEMA	2,799	102.75	287,597.25	
	BASF SE	42,880	67.02	2,873,817.60	
	COVESTRO AG	8,282	56.20	465,448.40	
	CRH PLC	36,478	41.45	1,512,013.10	
	EVONIK INDUSTRIES AG	9,603	29.23	280,695.69	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	3,246	41.04	133,215.84	
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,738	74.34	500,902.92	
	KONINKLIJKE DSM NV	7,981	170.35	1,359,563.35	
	LANXESS	3,921	59.80	234,475.80	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,335	47.07	533,538.45	
	SOLVAY SA	3,676	110.80	407,300.80	
	STORA ENSO OYJ R	26,361	16.60	437,592.60	
	SYMRISE AG	5,851	122.85	718,795.35	
	UMICORE	9,946	53.88	535,890.48	
	UPM KYMMENE OYJ	24,581	34.39	845,340.59	
	VOESTALPINE AG	5,948	35.86	213,295.28	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	10,716	22.02	235,966.32	
	AIRBUS SE	27,407	111.50	3,055,880.50	
	ALSTOM	12,580	36.98	465,208.40	
	BOUYGUES ORD	11,344	32.40	367,545.60	
	BRENNTAG SE	6,989	84.16	588,194.24	
	CNH INDUSTRIAL NV	46,753	13.72	641,684.92	
	DASSAULT AVIATION SA	121	1,013.00	122,573.00	
	EIFFAGE	3,659	85.92	314,381.28	
	FERROVIAL SA	21,875	24.60	538,125.00	
	GEA GROUP AG	7,649	35.84	274,140.16	
	KINGSPAN GROUP PLC	7,694	89.20	686,304.80	
	KION GROUP AG	3,430	89.96	308,562.80	
	KNORR-BREMSE AG	3,221	96.18	309,795.78	
	KONE OYJ-B	15,737	71.86	1,130,860.82	

LEGRAND SA	13,075	93.72	1,225,389.00	
MTU AERO ENGINES AG	2,396	207.50	497,170.00	
PRYSMIAN SPA	11,275	29.73	335,205.75	
RATIONAL AG	268	899.80	241,146.40	
SAFRAN SA	15,920	116.40	1,853,088.00	
SAINT-GOBAIN	23,479	59.03	1,385,965.37	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	25,140	140.18	3,524,125.20	
SIEMENS	35,805	134.56	4,817,920.80	
SIEMENS ENERGY AG	18,121	22.73	411,890.33	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	12,322	22.92	282,420.24	
THALES SA	4,746	89.48	424,672.08	
VINCI S.A.	24,815	90.15	2,237,072.25	
WARTSILA OYJ	18,738	12.72	238,441.05	
BUREAU VERITAS SA	12,892	27.41	353,369.72	
RANDSTAD NV	5,866	65.82	386,100.12	
TELEPERFORMANCE	2,688	360.60	969,292.80	
WOLTERS KLUWER	12,334	94.74	1,168,523.16	
ADP	1,532	105.40	161,472.80	
AENA SME SA	3,518	135.05	475,105.90	
ATLANTIA SPA	26,089	15.17	395,900.57	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	18,089	9.84	178,158.56	
DEUTSCHE POST AG-REG	46,149	59.37	2,739,866.13	
GETLINK	18,993	13.26	251,942.14	
INPOST SA	7,867	17.60	138,459.20	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	15,333	85.55	1,311,738.15	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,582	73.35	189,389.70	
CONTINENTAL AG	4,993	118.00	589,174.00	
DAIMLER AG	39,953	75.27	3,007,262.31	
FAURECIA	5,347	39.57	211,580.79	
FERRARI NV	5,821	179.20	1,043,123.20	
MICHELIN	8,304	138.00	1,145,952.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	6,979	92.50	645,557.50	
RENAULT SA	8,441	31.21	263,485.81	
STELLANTIS NV	95,050	15.75	1,497,227.60	
VALEO SA	10,032	24.16	242,373.12	
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,638	208.60	1,801,886.80	
VOLKSWAGEN STAMM	1,657	279.20	462,634.40	
ADIDAS AG	8,871	317.80	2,819,203.80	
ESSILORLUXOTTICA	13,235	155.12	2,053,013.20	
HERMES INTERNATIONAL	1,465	1,288.00	1,886,920.00	
KERING	3,523	747.60	2,633,794.80	
LVMH	13,006	674.00	8,766,044.00	

MONCLER SPA	9,963	59.60	593,794.80	
PUMA SE	4,644	105.85	491,567.40	
SEB SA	1,310	141.10	184,841.00	
ACCOR	7,911	29.89	236,459.79	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,577	151.00	1,144,127.00	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,332	49.56	264,253.92	
SODEXO	3,888	74.50	289,656.00	
BOLLORE	37,200	4.62	172,161.60	
PUBLICIS GROUPE	10,059	54.80	551,233.20	
SCOUT24 AG	4,128	71.96	297,050.88	
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,969	56.32	279,854.08	
VIVENDI	33,016	28.46	939,635.36	
DELIVERY HERO SE	7,305	129.40	945,267.00	
HELLOFRESH SE	7,756	84.26	653,520.56	
INDITEX	50,337	28.84	1,451,719.08	
JUST EAT TAKEAWAY	8,459	71.26	602,788.34	
PROSUS	22,719	79.97	1,816,838.43	
ZALANDO SE	9,081	100.85	915,818.85	
CARREFOUR	30,831	15.94	491,600.29	
COLRUYT SA	2,228	47.97	106,877.16	
JERONIMO MARTINS	13,062	16.68	217,874.16	
KESKO OYJ-B SHS	14,326	36.08	516,882.08	
KONINKLIJKE AHOLD NV	50,995	25.85	1,318,220.75	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	34,760	58.09	2,019,208.40	
DANONE (GROUPE)	30,378	58.19	1,767,695.82	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	26,648	11.49	306,318.76	
HEINEKEN HOLDING NV	5,127	84.15	431,437.05	
HEINEKEN NV	11,984	100.00	1,198,400.00	
JDE PEET'S BV	4,123	29.75	122,659.25	
KERRY GROUP PLC-A	7,323	124.40	910,981.20	
PERNOD-RICARD	9,706	186.35	1,808,713.10	
REMY COINTREAU	1,020	182.40	186,048.00	
BEIERSDORF AG	4,515	102.00	460,530.00	
HENKEL AG & CO KGAA	4,647	77.65	360,839.55	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	8,553	85.88	734,531.64	
LOREAL	11,771	387.05	4,555,965.55	
AMPLIFON SPA	6,606	41.37	273,290.22	
BIOMERIEUX	2,374	94.86	225,197.64	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,091	184.10	384,953.10	
DIASORIN SPA	1,418	172.35	244,392.30	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	9,705	69.38	673,332.90	
FRESENIUS SE&CO KGAA	20,026	45.77	916,690.15	

KONINKLIJKE PHILIPS	42,449	40.76	1,730,433.48	
ORPEA	2,344	107.65	252,331.60	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,216	499.40	607,270.40	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,190	54.80	668,012.00	
ARGENX SE	2,207	267.90	591,255.30	
BAYER	45,791	51.20	2,344,499.20	
EUROFINS SCIENTIFIC	6,490	102.90	667,821.00	
GRIFOLS SA	14,240	20.80	296,192.00	
IPSEN	1,866	86.92	162,192.72	
MERCK KGAA	5,937	173.95	1,032,741.15	
ORION OYJ-CLASS B	5,393	35.45	191,181.85	
QIAGEN N.V.	11,006	44.08	485,144.48	
RECORDATI SPA	5,195	51.24	266,191.80	
SANOFI	52,976	88.07	4,665,596.32	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,235	461.90	570,446.50	
UCB (GROUPE)	5,237	90.22	472,482.14	
ABN AMRO BANK NV-CVA	19,718	9.59	189,233.64	
BANCO BILBAO VIZCAYA	307,517	5.36	1,650,136.22	
BANCO SANTANDER SA	805,941	3.12	2,519,371.56	
BNP PARIBAS	52,430	50.57	2,651,385.10	
CAIXABANK	190,947	2.53	483,095.91	
COMMERZBANK AG	46,222	5.44	251,817.45	
CREDIT AGRICOLE SA	52,435	11.67	612,021.32	
ERSTE GROUP BANK AG	14,009	31.57	442,264.13	
FINECOBANK SPA	27,362	14.42	394,560.04	
ING GROEP NV-CVA	181,624	10.53	1,912,500.72	
INTESA SANPAOLO	768,339	2.28	1,755,654.61	
KBC GROEP NV	10,838	66.36	719,209.68	
MEDIOBANCA	29,447	9.92	292,114.24	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,866	18.81	147,959.46	
SOCIETE GENERALE	38,744	24.47	948,065.68	
UNICREDIT SPA	97,909	9.65	945,311.39	
AMUNDI SA	2,812	77.30	217,367.60	
DEUTSCHE BANK NAMEN	95,207	10.56	1,005,766.74	
DEUTSCHE BOERSE	8,787	147.75	1,298,279.25	
EURAZEO SA	2,340	77.25	180,765.00	
EXOR NV	4,845	67.56	327,328.20	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,582	97.40	543,686.80	
SOFINA	752	396.40	298,092.80	
WENDEL	1,047	112.10	117,368.70	
AEGON	79,881	3.56	284,775.76	
AGEAS	8,621	45.07	388,548.47	

ALLIANZ SE-REG	19,282	210.50	4,058,861.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	50,794	16.73	850,037.59	
AXA SA	89,924	21.77	1,957,645.48	
CNP ASSURANCES	8,406	14.78	124,282.71	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,976	142.45	423,931.20	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	6,508	229.60	1,494,236.80	
NN GROUP NV	13,557	41.31	560,039.67	
POSTE ITALIANE SPA	25,777	11.21	288,960.17	
SAMPO OYJ-A SHS	22,572	40.77	920,260.44	
SCOR SE	6,702	24.40	163,528.80	
AROUNDTOWN SA	52,418	6.58	345,015.27	
DEUTSCHE WOHNEN SE	16,289	51.12	832,693.68	
LEG IMMOBILIEN SE	3,774	133.15	502,508.10	
VONOVIA SE	24,902	57.62	1,434,853.24	
ADYEN NV	911	2,308.00	2,102,588.00	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	20,738	56.46	1,170,867.48	
ATOS SE	5,368	40.89	219,497.52	
BECHTLE AG	1,432	170.60	244,299.20	
CAPGEMINI SA	7,448	172.30	1,283,290.40	
DASSAULT SYSTEMES SA	30,430	44.45	1,352,765.65	
EDENRED	12,673	50.78	643,534.94	
NEMETSCHEK SE	3,320	73.00	242,360.00	
NEXI SPA	19,721	19.00	374,699.00	
SAP SE	48,874	117.80	5,757,357.20	
TEAMVIEWER AG	7,213	29.25	210,980.25	
WORLDLINE SA	10,832	84.37	913,895.84	
NOKIA OYJ	272,288	4.95	1,349,595.47	
CELLNEX TELECOM SA	22,819	55.54	1,267,367.26	
DEUTSCHE TELEKOM	155,446	17.88	2,779,996.26	
ELISA A	6,367	54.26	345,473.42	
ILIAD SA	637	118.30	75,357.10	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,877	10.03	149,290.69	
KPN (KON.)	173,861	2.70	469,946.28	
ORANGE	97,536	9.52	928,932.86	
PROXIMUS	7,531	16.97	127,801.07	
TELECOM ITALIA ORD	489,749	0.37	182,039.70	
TELECOM ITALIA RNC	345,204	0.39	137,839.95	
TELEFONICA	242,616	3.76	912,357.46	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	2.46	100,889.37	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,889	35.45	208,765.05	
E.ON SE	109,829	10.36	1,138,487.41	
EDP RENOVAVEIS SA	11,245	20.98	235,920.10	

	ELECTRICITE DE FRANCE	21,082	10.85	228,739.70	
	ELIA GROUP SA/NV	1,959	95.30	186,692.70	
	ENAGAS	11,944	18.89	225,681.88	
	ENDESA	17,138	21.35	365,896.30	
	ENEL	380,046	8.05	3,059,370.30	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	139,324	4.56	636,571.35	
	ENGIE	83,973	11.46	962,666.47	
	FORTUM OYJ	20,155	23.29	469,409.95	
	IBERDROLA SA	272,601	10.42	2,841,865.42	
	IBERDROLA SA-RTS	272,601	0.25	69,295.17	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	14,147	22.56	319,156.32	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,296	16.33	380,423.68	
	RWE STAMM	31,648	30.19	955,453.12	
	SNAM SPA	90,959	5.01	455,704.59	
	SUEZ	17,194	19.66	338,034.04	
	TERNA SPA	63,339	6.69	424,117.94	
	UNIPER SE	4,137	32.62	134,948.94	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,290	26.23	637,126.70	
	VERBUND AG	3,100	84.25	261,175.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	2,248	304.50	684,516.00	
	ASML HOLDING NV	19,578	638.80	12,506,426.40	
	INFINEON TECHNOLOGIES	60,801	32.06	1,949,584.06	
	STMICROELECTRONICS	31,427	33.22	1,044,004.94	
ユーロ 小計		9,189,341		224,353,970.98 (29,174,990,386)	
イギリスポンド	BP PLC	949,608	2.84	2,697,836.32	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	192,131	13.65	2,622,972.41	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	173,536	13.41	2,327,811.90	
	ANGLO AMERICAN PLC	59,983	29.64	1,777,896.12	
	ANTOFAGASTA PLC	17,358	14.37	249,434.46	
	BHP GROUP PLC	98,845	22.58	2,231,920.10	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,013	79.32	556,271.16	
	EVRAZ PLC	16,676	6.06	101,189.96	
	GLENCORE PLC	466,638	3.15	1,473,409.48	
	JOHNSON MATTHEY PLC	8,824	30.76	271,426.24	
	MONDI PLC	22,378	19.90	445,322.20	
	RIO TINTO PLC REG	52,576	59.26	3,115,653.76	
	ASHTEAD GROUP PLC	20,655	56.50	1,167,007.50	
	BAE SYSTEMS PLC	156,168	5.52	862,047.36	
	BUNZL PLC	15,472	26.67	412,638.24	
	DCC PLC	4,499	60.14	270,569.86	
	FERGUSON PLC	10,338	103.95	1,074,635.10	

MELROSE INDUSTRIES PLC	238,890	1.58	378,162.87	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	385,471	0.95	368,625.91	
SMITHS GROUP PLC	20,046	15.91	318,931.86	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,672	146.50	537,948.00	
EXPERIAN PLC	42,767	31.44	1,344,594.48	
INTERTEK GROUP PLC	7,435	55.92	415,765.20	
RELX PLC	90,321	20.66	1,866,031.86	
RENTOKIL INITIAL PLC	85,410	5.29	451,989.72	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	7.19	366,531.82	
BURBERRY GROUP PLC	18,587	21.05	391,256.35	
PERSIMMON PLC	14,327	28.93	414,480.11	
TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.66	276,054.80	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,550	49.35	323,242.50	
COMPASS GROUP PLC	83,254	14.85	1,236,321.90	
ENTAIN PLC	26,944	18.48	498,059.84	
INTERCONTINENTAL HOTELS	7,987	47.53	379,622.11	
WHITBREAD PLC	10,170	30.33	308,456.10	
AUTO TRADER GROUP PLC	43,890	6.60	289,761.78	
INFORMA PLC	69,112	4.99	345,490.88	
PEARSON	34,302	8.57	294,036.74	
WPP PLC	56,693	9.52	539,717.36	
JD SPORTS FASHION PLC	22,866	9.28	212,379.40	
KINGFISHER PLC	96,593	3.75	362,416.93	
NEXT PLC	6,143	80.92	497,091.56	
OCADO GROUP PLC	23,500	18.68	439,097.50	
MORRISON SUPERMARKETS	111,872	2.66	298,138.88	
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.79	228,912.23	
TESCO PLC	359,660	2.34	842,683.38	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	15,871	20.40	323,768.40	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	101,284	27.69	2,804,553.96	
COCA-COLA HBC AG-CDI	9,115	27.10	247,016.50	
DIAGEO	109,617	35.05	3,842,623.93	
IMPERIAL BRANDS PLC	45,617	15.69	715,730.73	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	33,311	62.64	2,086,601.04	
UNILEVER PLC	123,338	41.44	5,111,126.72	
SMITH & NEPHEW PLC	42,096	15.54	654,382.32	
ASTRAZENECA	61,548	84.80	5,219,270.40	
GLAXOSMITHKLINE	235,119	14.16	3,329,285.04	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	8,586	26.44	227,013.84	
BARCLAYS	811,088	1.67	1,355,490.26	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	955,091	4.01	3,835,645.45	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,308,712	0.45	1,518,202.50	

	NATWEST GROUP PLC	223,727	1.99	445,440.45	
	STANDARD CHARTERED PLC	124,429	4.31	537,159.99	
	3I GROUP PLC	45,010	12.95	583,104.55	
	ABRDN PLC	100,722	2.85	287,662.03	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,246	16.32	297,865.95	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	14,742	76.24	1,123,930.08	
	M&G PLC	118,170	2.25	266,000.67	
	SCHRODERS PLC	5,525	36.73	202,933.25	
	ST JAMES'S PLACE PLC	26,728	15.26	407,869.28	
	ADMIRAL GROUP PLC	9,872	33.50	330,712.00	
	AVIVA PIC	182,528	3.85	703,097.85	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	68,857	2.96	204,023.29	
	LEGAL & GENERAL GROUP	289,782	2.63	764,734.69	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	29,063	6.87	199,662.81	
	PRUDENTIAL	122,059	13.64	1,665,495.05	
	AVEVA GROUP PLC	4,523	39.98	180,829.54	
	SAGE GROUP PLC	48,541	7.04	342,116.96	
	HALMA PLC	17,484	28.56	499,343.04	
	BT GROUP PLC	413,941	1.84	764,755.99	
	VODAFONE GROUP PLC	1,254,547	1.18	1,490,903.65	
	NATIONAL GRID PLC	164,441	9.29	1,528,479.09	
	SEVERN TRENT PLC	11,927	27.40	326,799.80	
	SSE PLC	50,382	15.22	766,814.04	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	10.52	365,212.32	
イギリスポンド 小計		13,678,559		81,439,501.70 (12,373,103,493)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	8,748	19.04	166,605.66	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	310	968.50	300,235.00	
	GIVAUDAN-REG	429	4,489.00	1,925,781.00	
	HOLCIM LTD	24,228	53.30	1,291,352.40	
	SIKA AG-BR	6,585	320.20	2,108,517.00	
	ABB LTD	80,625	33.67	2,714,643.75	
	GEBERIT AG-REG	1,777	743.60	1,321,377.20	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	911	285.00	259,635.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,021	297.80	601,853.80	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,959	63.44	441,478.96	
	SGS SA	277	2,927.00	810,779.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,730	307.60	839,748.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	24,303	116.10	2,821,578.30	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,285	307.80	395,523.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	58.70	176,334.80	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	149	2,274.00	338,826.00	

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	100,500.00	502,500.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	55	9,750.00	536,250.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	135,176	115.62	15,629,049.12	
	ALCON INC	22,791	65.42	1,490,987.22	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,490	352.20	876,978.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	468	1,649.50	771,966.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,460	705.60	2,441,376.00	
	NOVARTIS	104,076	84.57	8,801,707.32	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,599	387.00	618,813.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	32,944	347.30	11,441,451.20	
	VIFOR PHARMA AG	2,126	126.50	268,939.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,566	80.10	125,436.60	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	113,012	9.26	1,046,491.12	
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,425	59.80	623,415.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,050	1,529.50	1,605,975.00	
	UBS GROUP AG	170,843	14.62	2,497,724.66	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	144.90	338,196.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,385	465.30	644,440.50	
	SWISS RE LTD	13,932	83.26	1,159,978.32	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,019	366.70	2,573,867.30	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,622	95.25	344,995.50	
	TEMENOS AG - REG	3,520	139.40	490,688.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,298	110.60	917,758.80	
	SWISSCOM	1,176	544.80	640,684.80	
スイスフラン 小計		807,713		72,903,937.93 (8,758,679,102)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	9,250	275.00	2,543,750.00	
	BOLIDEN AB	13,081	321.00	4,199,001.00	
	SCA SV CELLULOSA B	26,880	159.00	4,273,920.00	
	ALFA LAVAL AB	14,260	350.80	5,002,408.00	
	ASSA ABLOY AB-B	46,068	276.90	12,756,229.20	
	ATLAS COPCO A	31,072	586.20	18,214,406.40	
	ATLAS COPCO B	17,773	493.60	8,772,752.80	
	EPIROC AB-A	29,649	204.60	6,066,185.40	
	EPIROC AB-B	17,442	175.00	3,052,350.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,081	329.50	2,662,689.50	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	65,860	101.35	6,674,911.00	
	SANDVIK AB	51,973	226.90	11,792,673.70	
	SKANSKA B	14,869	258.80	3,848,097.20	
	SKF AB-B	18,340	229.90	4,216,366.00	
	VOLVO AB-A SHS	8,748	215.60	1,886,068.80	
	VOLVO B	65,760	209.00	13,743,840.00	

	SECURITAS B	15,577	143.55	2,236,078.35	
	ELECTROLUX AB-SER B	12,053	227.00	2,736,031.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	119.55	2,611,091.55	
	EVOLUTION AB	7,849	1,503.80	11,803,326.20	
	EMBRACER GROUP AB	11,439	223.30	2,554,328.70	
	HENNES & MAURITZ B	33,524	187.48	6,285,079.52	
	ICA GRUPPEN AB	4,719	422.70	1,994,721.30	
	SWEDISH MATCH AB	74,128	78.40	5,811,635.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	27,655	282.30	7,807,006.50	
	NORDEA BANK ABP	149,277	99.86	14,906,801.22	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	74,165	114.65	8,503,017.25	
	SVENSKA HANDELSBK A	70,420	96.22	6,775,812.40	
	SWEDBANK AB-A	40,897	164.20	6,715,287.40	
	EQT AB	12,798	430.20	5,505,699.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	5,765	344.00	1,983,160.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	329.50	2,843,914.50	
	INVESTOR AB-B SHS	84,132	216.20	18,189,338.40	
	KINNEVIK AB - B	10,757	377.30	4,058,616.10	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,093	608.00	2,488,544.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	5,413	594.80	3,219,652.40	
	SINCH AB	20,280	175.15	3,552,042.00	
	ERICSSON (LM) B	134,930	101.96	13,757,462.80	
	HEXAGON AB-B SHS	90,307	139.70	12,615,887.90	
	TELE2 AB-B SHS	24,520	127.65	3,129,978.00	
	TELIA CO AB	108,487	38.92	4,222,856.47	
スウェーデンクローナ 小計		1,492,763		266,013,017.76 (3,378,365,325)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	43,502	172.56	7,506,705.12	
	NORSK HYDRO	61,358	56.16	3,445,865.28	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,270	470.70	3,421,989.00	
	ADEVINTA ASA	16,857	179.15	3,019,931.55	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	4,706	412.60	1,941,695.60	
	SCHIBSTED ASA-CL A	4,047	472.80	1,913,421.60	
	MOWI ASA	23,314	226.80	5,287,615.20	
	ORKLA	39,803	81.38	3,239,168.14	
	DNB BANK ASA	41,479	175.00	7,258,825.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	201.80	2,250,675.40	
	TELENOR ASA	30,180	154.15	4,652,247.00	
ノルウェークローネ 小計		283,669		43,938,138.89 (547,469,210)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,314	552.00	2,933,328.00	
	NOVOZYMES A/S	9,034	477.70	4,315,541.80	

	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	428	3,285.00	1,405,980.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	48,316	234.00	11,305,944.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	152	16,820.00	2,556,640.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	301	17,380.00	5,231,380.00	
	DSV PANALPINA A S	9,482	1,534.50	14,550,129.00	
	PANDORA A/S	4,249	838.00	3,560,662.00	
	CARLSBERG AS-B	4,526	1,169.00	5,290,894.00	
	AMBU A/S-B	8,639	229.80	1,985,242.20	
	COLOPLAST-B	5,263	1,121.00	5,899,823.00	
	DEMANT A/S	4,463	367.70	1,641,045.10	
	GN STORE NORD A/S	6,740	581.60	3,919,984.00	
	GENMAB A/S	3,223	2,840.00	9,153,320.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	80,231	570.90	45,803,877.90	
	DANSKE BANK A/S	31,666	108.05	3,421,511.30	
	TRYG A/S	16,972	155.30	2,635,751.60	
	ORSTED A/S	8,594	944.40	8,116,173.60	
デンマーククローネ 小計		247,593		133,727,227.50 (2,338,889,208)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	12,821	28.77	368,860.17	
	OIL SEARCH LTD	110,184	3.99	439,634.16	
	SANTOS	83,906	6.59	552,940.54	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	4,845	33.37	161,677.65	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	48,027	22.34	1,072,923.18	
	BHP GROUP LTD	137,818	51.27	7,065,928.86	
	BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	22.67	488,515.83	
	EVOLUTION MINING LTD	88,310	4.25	375,317.50	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	78,225	25.25	1,975,181.25	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	20,170	46.49	937,703.30	
	NEWCREST MINING LIMITED	37,270	26.17	975,355.90	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	58,122	10.09	586,450.98	
	ORICA LTD	19,570	13.00	254,410.00	
	RIO TINTO LTD	17,196	127.10	2,185,611.60	
	SOUTH32 LTD	217,613	2.95	641,958.35	
	REECE LTD	12,870	23.12	297,554.40	
	BRAMBLES LTD	66,936	11.62	777,796.32	
	AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	3.91	365,991.64	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	39,948	4.55	181,763.40	
	TRANSURBAN GROUP	126,500	14.34	1,814,010.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	26,199	41.61	1,090,140.39	
	CROWN RESORTS LTD	18,801	10.02	188,386.02	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,685	119.00	319,515.00	
	TABCORP HOLDINGS LTD	98,817	4.95	489,144.15	

	REA GROUP LTD	3,000	162.55	487,650.00	
	SEEK LTD	17,113	30.60	523,657.80	
	WESFARMERS LTD	52,759	61.93	3,267,364.87	
	COLES GROUP LTD	60,959	17.61	1,073,487.99	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	58,785	6.44	378,575.40	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	58,785	39.52	2,323,183.20	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	11.95	412,036.00	
	COCHLEAR LIMITED	3,460	246.07	851,402.20	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,641	64.64	623,194.24	
	SONIC HEALTHCARE LTD	20,560	40.10	824,456.00	
	CSL LIMITED	21,276	293.48	6,244,080.48	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	132,501	27.69	3,668,952.69	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	83,045	99.12	8,231,420.40	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	153,560	26.04	3,998,702.40	
	WESTPAC BANKING	168,595	24.71	4,165,982.45	
	ASX LTD	8,713	77.67	676,738.71	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	15,958	157.70	2,516,576.60	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	6,690	53.92	360,724.80	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	114,505	4.91	562,219.55	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	129,252	3.32	429,116.64	
	QBE INSURANCE GROUP	66,253	10.63	704,269.39	
	SUNCORP GROUP LIMITED	57,398	11.40	654,337.20	
	AFTERPAY LTD	9,769	106.70	1,042,352.30	
	COMPUTERSHARE LIMITED	21,970	16.08	353,277.60	
	WISETECH GLOBAL LTD	6,445	30.55	196,894.75	
	XERO LTD	5,491	142.92	784,773.72	
	TELSTRA CORP	199,810	3.77	753,283.70	
	AGL ENERGY LTD	32,928	7.99	263,094.72	
	AUSNET SERVICES	80,543	1.84	148,601.83	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	87,883	4.53	398,109.99	
オーストラリアドル 小計		3,164,113		70,525,288.21 (5,730,884,919)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	64,661	7.15	462,326.15	
	A2 MILK CO LTD	40,302	7.14	287,756.28	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	24,554	32.65	801,688.10	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,000	13.02	286,440.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	104,543	4.83	504,942.69	
	MERCURY NZ LTD	19,343	6.82	131,919.26	
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	5.28	338,419.69	
ニュージーランドドル 小計		339,437		2,813,492.17 (216,638,897)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	121,448	57.35	6,965,042.80	

	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	62,000	133.50	8,277,000.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	102,000	31.90	3,253,800.00	
	MTR CORP	82,500	46.35	3,823,875.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	97,000	57.05	5,533,850.00	
	SANDS CHINA LTD	127,000	29.45	3,740,150.00	
	SJM HOLDINGS LTD	92,000	7.52	691,840.00	
	WYNN MACAU LTD	60,800	10.98	667,584.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	89,600	16.02	1,435,392.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	83,000	24.20	2,008,600.00	
	WH GROUP LTD	516,000	6.29	3,245,640.00	
	BANK EAST ASIA	46,964	13.04	612,410.56	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	161,500	25.20	4,069,800.00	
	HANG SENG BANK	33,600	149.90	5,036,640.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	55,900	521.00	29,123,900.00	
	AIA GROUP LTD	564,600	94.90	53,580,540.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	111,948	53.15	5,950,036.20	
	ESR CAYMAN LTD	92,400	28.10	2,596,440.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	115,000	18.88	2,171,200.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	79,761	36.05	2,875,384.05	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	76,250	37.70	2,874,625.00	
	SINO LAND CO	116,600	12.50	1,457,500.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	58,500	115.40	6,750,900.00	
	SWIRE PACIFIC A	20,000	50.00	1,000,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,000	23.00	1,587,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	81,000	45.00	3,645,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	46.60	1,491,200.00	
	CLP HOLDINGS	72,500	78.45	5,687,625.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	519,990	12.52	6,510,274.80	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	49.20	3,616,200.00	
香港ドル 小計		3,814,361		180,279,449.41 (2,565,376,565)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	80,200	5.30	425,060.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	3.97	296,956.00	
	SINGAPORE AIRLINES	54,650	4.91	268,331.50	
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	0.81	260,555.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	81,700	4.53	370,101.00	
	DBS GROUP	82,800	30.21	2,501,388.00	
	OCBC BANK	153,850	12.12	1,864,662.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	53,600	26.01	1,394,136.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	11.80	501,500.00	
	CAPITALAND LTD	118,900	4.00	475,600.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	6.84	150,480.00	

	UOL GROUP LIMITED	24,800	7.37	182,776.00	
	VENTURE CORP LTD	14,300	19.07	272,701.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	364,580	2.25	820,305.00	
シンガポールドル 小計		1,488,380		9,784,552.00 (794,309,931)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	28,484	22.42	638,611.28	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,248	411.00	512,928.00	
	BANK HAPOALIM BM	44,385	25.80	1,145,133.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,692	24.60	1,739,023.20	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,227	15.19	975,608.13	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,272	97.45	611,206.40	
	AZRIELI GROUP	1,471	249.70	367,308.70	
	NICE LTD	3,165	939.00	2,971,935.00	
イスラエルシェケル 小計		219,944		8,961,753.71 (302,946,707)	
合　計		51,646,422		278,121,997,577 (278,121,997,577)	

(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	608,053.95	
		LENDLEASE GROUP	36,448	434,460.16	
		SYDNEY AIRPORT	64,383	502,187.40	
	オーストラリアドル 小計		164,236	1,544,701.51 (125,522,444)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000	1,020,500.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	1,972,100.00	
	香港ドル 小計		315,000	2,992,600.00 (42,584,698)	
投資信託受益証券合計			479,236	168,107,142 (168,107,142)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	24,811	399,953.32	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6,274	1,235,601.56	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	20,560	5,864,945.60	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	71,103	596,554.17	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,501	1,474,426.80	
		BOSTON PROPERTIES	6,840	785,916.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,093	749,842.39	
		CROWN CASTLE INTL CORP	20,201	3,907,883.45	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	13,086	2,026,497.96	

	DUKE REALTY CORP	17,311	888,054.30	
	EQUINIX INC	4,103	3,419,768.44	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,979	739,869.60	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	16,454	1,395,628.28	
	ESSEX PROPERTY TRUST	3,024	1,003,695.84	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,989	1,026,574.49	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	24,947	904,827.69	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,496	512,786.88	
	INVITATION HOMES INC	27,833	1,127,793.16	
	IRON MOUNTAIN INC	13,240	574,880.80	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	27,097	569,037.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,299	994,092.40	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	12,315	460,950.45	
	PROLOGIS INC	34,369	4,395,451.41	
	PUBLIC STORAGE	7,348	2,305,802.40	
	REALTY INCOME CORP	17,346	1,222,546.08	
	REGENCY CENTERS CORP	7,026	457,041.30	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,181	1,746,204.24	
	SIMON PROPERTY GROUP	15,322	1,902,226.30	
	SUN COMMUNITIES INC	5,410	1,018,162.00	
	UDR INC	14,820	814,062.60	
	VENTAS INC	17,397	1,041,210.45	
	VEREIT INC	11,046	543,463.20	
	VICI PROPERTIES INC	24,821	793,279.16	
	VORNADO REALTY TRUST	7,639	336,268.78	
	WELLTOWER INC	19,456	1,707,458.56	
	WP CAREY INC	8,887	705,894.41	
アメリカドル 小計		569,624	49,648,651.47 (5,488,161,933)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,069	312,554.54	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	200,994.15	
カナダドル 小計		14,014	513,548.69 (45,125,523)	
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	—	
	COVIVIO(FP)	3,076	242,880.96	
	GECINA SA	1,966	262,559.30	
	KLEPIERRE	8,356	178,233.48	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,185	445,814.80	
ユーロ 小計		1,625,167	1,129,488.54 (146,878,689)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	39,175	197,520.35	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	222,353.44	
	SEGRO PLC	55,104	664,554.24	

	イギリスポンド 小計		126,411	1,084,428.03 (164,757,150)	
	オーストラリアドル	DEXUS	49,283	512,543.20	
		GOODMAN GROUP	76,627	1,726,406.31	
		GPT GROUP	85,529	406,262.75	
		MIRVAC GROUP	176,235	504,032.10	
		SCENTRE GROUP	234,255	599,692.80	
		STOCKLAND	121,481	532,086.78	
		VICINITY CENTERS	163,023	246,979.84	
	オーストラリアドル 小計		906,433	4,528,003.78 (367,945,587)	
	香港ドル	LINK REIT	91,900	6,920,070.00	
	香港ドル 小計		91,900	6,920,070.00 (98,472,596)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	135,809	416,933.63	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	196,300	412,230.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	132,200	282,908.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	168,542	353,938.20	
	シンガポールドル 小計		632,851	1,466,009.83 (119,010,677)	
投資証券合計			3,966,400	6,430,352,155 (6,430,352,155)	
合計				6,598,459,297 (6,598,459,297)	

(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　600銘柄	97.4%	—	—	71.0%
	投資証券　36銘柄	—	—	2.6%	1.9%
カナダドル	株式　89銘柄	99.5%	—	—	3.4%
	投資証券　2銘柄	—	—	0.5%	0.0%
ユーロ	株式　232銘柄	99.5%	—	—	10.2%
	投資証券　5銘柄	—	—	0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式　83銘柄	98.7%	—	—	4.3%

	投資証券　3銘柄	—	—	1.3%	0.1%
スイスフラン	株式　40銘柄	100.0%	—	—	3.1%
スウェーデンクローナ	株式　41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　54銘柄	92.1%	—	—	2.0%
	投資信託受益証券　3銘柄	—	2.0%	—	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　14銘柄	87.0%	—	—	0.3%
	投資証券　4銘柄	—	—	13.0%	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 7月26日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	123,542,246
コール・ローン	950,179,971
国債証券	146,695,295,351
派生商品評価勘定	13,136,669
未収入金	51,870
未収利息	909,143,590
前払費用	25,115,998
差入委託証拠金	341,991,481
流動資産合計	149,058,457,176
資産合計	149,058,457,176
負債の部	

	2021年 7月26日現在
項目	金額（円）
流動負債	
派生商品評価勘定	2,030,288
前受金	11,727,448
未払金	1,348,490
未払解約金	204,289,577
未払利息	1,705
流動負債合計	219,397,508
負債合計	219,397,508
純資産の部	
元本等	
元本	55,642,880,509
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	93,196,179,159
元本等合計	148,839,059,668
純資産合計	148,839,059,668
負債純資産合計	149,058,457,176

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月26日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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。 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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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。 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。

	2021年 7月26日現在
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 7月26日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		55,642,880,509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	2.6749円
	(1万口当たり純資産額)	(26,749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 7月26日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月26日現在
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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 7月26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2021年 7月26日現在
期首	2020年 7月28日
期首元本額	56,037,038,869円
期中追加設定元本額	5,948,810,393円
期中一部解約元本額	6,342,968,753円
期末元本額	55,642,880,509円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,075,068,624円
ＤＣ外国債券インデックスファンド	1,924,729,335円
ＤＣ外国債券インデックスファンドＬ	13,949,550,271円
ＤＣバランスファンド３０	872,169,228円
ＤＣバランスファンド５０	878,965,177円
ＤＣバランスファンド７０	203,271,052円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	456,211,210円
外国債券インデックスｅ	1,087,563,292円
インデックスコレクション（外国債券）	7,852,417,322円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	4,517,867,332円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	676,509,373円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	192,043,821円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	4,168,111,448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）	1,550,628,944円
外国債券インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	496,542,835円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	103,140,607円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	518,298,420円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	298,723,474円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	186,772,923円
ＶＡバランス株式３０（適格機関投資家専用）	141,857円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	462,545,850円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	1,549,963,183円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	604,535,440円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	6,434,246,115円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	360,215,104円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	246,253,410円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	1,638,868,967円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	103,461,184円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	192,961,445円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	100,524,132円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	52,500,204円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	88,033,026円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	249,656,793円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	71,576,904円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	1,455,413,603円
私募外国債券インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	23,398,604円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月26日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△1,284,255,716
合計	△1,284,255,716

(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 7月26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	1,104,163,821	―	1,115,891,269	11,727,448
合計		1,104,163,821	―	1,115,891,269	11,727,448

(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はありません。

通貨関連

（2021年 7月26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	864,376,655	―	863,755,588	△621,067
	アメリカドル	384,575,117	―	385,690,021	1,114,904
	カナダドル	49,396,162	―	49,192,024	△204,138
	ユーロ	350,917,059	―	349,880,499	△1,036,560
	イギリスポンド	79,488,317	―	78,993,044	△495,273
合計		864,376,655	―	863,755,588	△621,067

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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	4,980,468.75	
		T 0.125% 10/15/23	5,200,000.00	5,186,390.61	
		T 0.25% 03/15/24	4,500,000.00	4,493,320.33	
		T 0.25% 04/15/23	6,500,000.00	6,509,521.46	
		T 0.25% 05/15/24	5,070,000.00	5,057,126.96	
		T 0.25% 05/31/25	1,180,000.00	1,167,001.56	
		T 0.25% 06/30/25	4,310,000.00	4,259,323.83	
		T 0.25% 07/31/25	2,200,000.00	2,172,242.18	
		T 0.25% 09/30/25	7,000,000.00	6,899,648.42	
		T 0.375% 01/31/26	1,700,000.00	1,678,683.59	
		T 0.375% 07/31/27	4,000,000.00	3,880,937.52	
		T 0.375% 09/30/27	4,000,000.00	3,869,531.24	
		T 0.375% 11/30/25	3,770,000.00	3,729,354.68	
		T 0.5% 02/28/26	3,500,000.00	3,474,023.45	
		T 0.5% 03/15/23	3,980,000.00	4,002,620.68	
		T 0.5% 03/31/25	4,000,000.00	4,000,156.24	
		T 0.5% 05/31/27	5,500,000.00	5,386,132.84	
		T 0.5% 06/30/27	6,000,000.00	5,871,562.50	
		T 0.5% 08/31/27	1,100,000.00	1,073,574.21	
		T 0.5% 10/31/27	3,580,000.00	3,485,325.79	
		T 0.625% 03/31/27	3,400,000.00	3,362,414.05	
		T 0.625% 05/15/30	7,400,000.00	7,034,046.91	
		T 0.625% 08/15/30	9,130,000.00	8,649,248.43	
		T 0.625% 11/30/27	3,700,000.00	3,626,433.60	
		T 0.625% 12/31/27	3,000,000.00	2,937,187.50	
		T 0.75% 01/31/28	3,500,000.00	3,450,507.83	

		T 0.75% 03/31/26	2,750,000.00	2,759,130.85	
		T 0.75% 04/30/26	3,500,000.00	3,509,843.75	
		T 0.875% 11/15/30	6,160,000.00	5,953,543.78	
		T 1.125% 02/15/31	4,600,000.00	4,539,265.64	
		T 1.125% 05/15/40	3,920,000.00	3,480,531.26	
		T 1.125% 08/15/40	4,000,000.00	3,539,062.52	
		T 1.25% 03/31/28	5,300,000.00	5,387,367.21	
		T 1.25% 05/15/50	5,120,000.00	4,327,600.02	
		T 1.25% 07/31/23	3,950,000.00	4,033,166.02	
		T 1.375% 08/15/50	4,000,000.00	3,488,125.00	
		T 1.375% 08/31/23	3,450,000.00	3,533,689.44	
		T 1.375% 09/30/23	3,550,000.00	3,638,472.67	
		T 1.375% 10/15/22	2,250,000.00	2,284,848.63	
		T 1.375% 11/15/40	4,650,000.00	4,292,894.55	
		T 1.5% 01/15/23	2,000,000.00	2,040,117.18	
		T 1.5% 02/15/30	1,820,000.00	1,866,068.75	
		T 1.5% 02/28/23	1,760,000.00	1,797,950.00	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,089,921.88	
		T 1.5% 08/15/22	5,800,000.00	5,887,000.00	
		T 1.5% 08/15/26	5,300,000.00	5,502,476.58	
		T 1.5% 09/15/22	4,000,000.00	4,063,750.00	
		T 1.5% 09/30/24	3,000,000.00	3,104,062.50	
		T 1.625% 02/15/26	5,750,000.00	5,998,417.99	
		T 1.625% 04/30/23	5,800,000.00	5,948,058.57	
		T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	5,637,726.57	
		T 1.625% 05/15/31	4,200,000.00	4,331,578.14	
		T 1.625% 05/31/23	4,350,000.00	4,465,376.96	
		T 1.625% 08/15/22	1,400,000.00	1,422,859.38	
		T 1.625% 08/15/29	2,260,000.00	2,345,103.12	
		T 1.625% 08/31/22	500,000.00	508,457.03	
		T 1.625% 09/30/26	2,150,000.00	2,246,078.12	
		T 1.625% 11/15/22	4,000,000.00	4,078,671.88	
		T 1.625% 11/15/50	3,600,000.00	3,341,250.00	
		T 1.625% 11/30/26	3,030,000.00	3,165,166.42	
		T 1.75% 01/31/23	2,650,000.00	2,714,490.24	
		T 1.75% 05/15/23	1,750,000.00	1,799,423.83	
		T 1.75% 06/30/22	2,500,000.00	2,539,062.50	
		T 1.75% 06/30/24	2,000,000.00	2,081,171.88	
		T 1.75% 07/15/22	1,200,000.00	1,219,570.30	
		T 1.75% 09/30/22	1,050,000.00	1,070,487.30	
		T 1.75% 11/15/29	3,220,000.00	3,372,446.87	
		T 1.875% 02/15/41	4,750,000.00	4,775,605.48	

		T 1.875% 02/15/51	4,500,000.00	4,436,015.61	
		T 1.875% 06/30/26	3,980,000.00	4,204,341.41	
		T 1.875% 07/31/22	2,880,000.00	2,932,706.24	
		T 1.875% 07/31/26	1,800,000.00	1,902,375.00	
		T 1.875% 08/31/22	2,600,000.00	2,650,882.80	
		T 1.875% 09/30/22	1,500,000.00	1,531,464.84	
		T 1.875% 10/31/22	2,000,000.00	2,044,570.32	
		T 2.125% 02/29/24	1,400,000.00	1,466,226.56	
		T 2.125% 03/31/24	1,200,000.00	1,257,937.50	
		T 2.125% 05/15/25	7,250,000.00	7,685,000.00	
		T 2.125% 06/30/22	1,100,000.00	1,121,033.19	
		T 2.125% 07/31/24	1,500,000.00	1,578,632.82	
		T 2.125% 09/30/24	2,200,000.00	2,319,625.00	
		T 2.125% 11/30/23	2,700,000.00	2,817,808.58	
		T 2.125% 11/30/24	1,400,000.00	1,478,531.25	
		T 2.125% 12/31/22	3,800,000.00	3,908,062.50	
		T 2.25% 01/31/24	5,090,000.00	5,340,722.25	
		T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	4,206,210.95	
		T 2.25% 03/31/26	1,500,000.00	1,608,984.37	
		T 2.25% 04/30/24	2,600,000.00	2,737,210.94	
		T 2.25% 08/15/27	2,320,000.00	2,506,778.11	
		T 2.25% 08/15/46	2,880,000.00	3,067,875.01	
		T 2.25% 08/15/49	4,110,000.00	4,390,635.93	
		T 2.25% 10/31/24	2,500,000.00	2,648,046.87	
		T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	5,299,023.45	
		T 2.25% 11/15/25	5,500,000.00	5,882,851.59	
		T 2.25% 11/15/27	5,260,000.00	5,686,758.58	
		T 2.25% 12/31/23	3,500,000.00	3,667,617.20	
		T 2.25% 12/31/24	2,900,000.00	3,077,738.27	
		T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,168,945.30	
		T 2.375% 02/29/24	4,280,000.00	4,509,548.42	
		T 2.375% 04/30/26	1,820,000.00	1,964,107.03	
		T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,913,031.26	
		T 2.375% 05/15/29	3,890,000.00	4,253,471.87	
		T 2.375% 05/15/51	1,200,000.00	1,322,250.00	
		T 2.375% 08/15/24	6,700,000.00	7,106,187.50	
		T 2.375% 11/15/49	2,010,000.00	2,206,603.12	
		T 2.5% 01/31/25	4,000,000.00	4,283,437.52	
		T 2.5% 02/15/45	2,150,000.00	2,391,203.12	
		T 2.5% 02/15/46	2,250,000.00	2,507,871.10	
		T 2.5% 02/28/26	650,000.00	703,980.47	
		T 2.5% 05/15/24	3,700,000.00	3,925,035.14	
		T 2.5% 05/15/46	1,650,000.00	1,840,394.53	

		T 2.5% 08/15/23	3,450,000.00	3,611,718.75	
		T 2.625% 01/31/26	1,350,000.00	1,468,652.35	
		T 2.625% 02/15/29	5,390,000.00	5,987,532.05	
		T 2.625% 03/31/25	2,500,000.00	2,694,140.62	
		T 2.625% 06/30/23	6,000,000.00	6,280,429.68	
		T 2.75% 02/15/24	3,900,000.00	4,144,816.41	
		T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	5,200,482.81	
		T 2.75% 04/30/23	4,200,000.00	4,390,230.47	
		T 2.75% 06/30/25	2,000,000.00	2,170,937.50	
		T 2.75% 07/31/23	4,000,000.00	4,204,687.52	
		T 2.75% 08/15/42	1,450,000.00	1,676,222.66	
		T 2.75% 08/15/47	2,450,000.00	2,868,988.29	
		T 2.75% 08/31/25	5,000,000.00	5,440,039.05	
		T 2.75% 11/15/23	4,450,000.00	4,705,353.50	
		T 2.75% 11/15/42	1,040,000.00	1,201,606.25	
		T 2.75% 11/15/47	2,500,000.00	2,929,492.20	
		T 2.875% 04/30/25	2,300,000.00	2,502,867.19	
		T 2.875% 05/15/28	4,460,000.00	5,011,228.12	
		T 2.875% 05/15/43	1,050,000.00	1,238,425.78	
		T 2.875% 05/15/49	4,400,000.00	5,305,437.50	
		T 2.875% 07/31/25	5,000,000.00	5,458,593.75	
		T 2.875% 08/15/28	4,200,000.00	4,726,968.75	
		T 2.875% 08/15/45	1,480,000.00	1,758,309.38	
		T 2.875% 09/30/23	1,650,000.00	1,744,746.10	
		T 2.875% 11/30/23	6,000,000.00	6,367,031.28	
		T 2% 02/15/23	6,500,000.00	6,687,128.89	
		T 2% 02/15/25	6,050,000.00	6,373,296.87	
		T 2% 02/15/50	3,370,000.00	3,416,337.50	
		T 2% 04/30/24	3,000,000.00	3,138,046.89	
		T 2% 05/31/24	1,500,000.00	1,570,371.09	
		T 2% 06/30/24	1,000,000.00	1,047,812.50	
		T 2% 07/31/22	3,900,000.00	3,976,171.87	
		T 2% 08/15/25	3,750,000.00	3,964,892.58	
		T 2% 10/31/22	4,500,000.00	4,607,490.24	
		T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,873,390.62	
		T 2% 11/30/22	5,500,000.00	5,639,111.33	
		T 3.125% 02/15/42	1,000,000.00	1,223,125.00	
		T 3.125% 02/15/43	1,100,000.00	1,347,328.12	
		T 3.125% 05/15/48	1,400,000.00	1,756,343.75	
		T 3.125% 08/15/44	1,550,000.00	1,908,679.68	
		T 3.125% 11/15/28	3,960,000.00	4,534,200.00	
		T 3.125% 11/15/41	870,000.00	1,062,623.43	

		T 3.375% 05/15/44	1,700,000.00	2,174,007.82	
		T 3.375% 11/15/48	2,500,000.00	3,282,617.20	
		T 3.5% 02/15/39	900,000.00	1,151,507.81	
		T 3.625% 02/15/44	1,600,000.00	2,119,125.00	
		T 3.625% 08/15/43	1,600,000.00	2,110,875.00	
		T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,462,828.12	
		T 3.75% 11/15/43	900,000.00	1,210,781.25	
		T 3.875% 08/15/40	680,000.00	914,281.25	
		T 3% 02/15/47	2,400,000.00	2,931,000.00	
		T 3% 02/15/48	3,100,000.00	3,801,617.20	
		T 3% 02/15/49	1,940,000.00	2,389,231.25	
		T 3% 05/15/42	1,100,000.00	1,320,085.94	
		T 3% 05/15/45	2,100,000.00	2,543,789.07	
		T 3% 05/15/47	1,900,000.00	2,323,343.75	
		T 3% 08/15/48	2,710,000.00	3,328,853.91	
		T 3% 09/30/25	3,660,000.00	4,023,998.45	
		T 3% 10/31/25	1,000,000.00	1,100,898.44	
		T 3% 11/15/44	2,050,000.00	2,477,136.72	
		T 4.25% 05/15/39	850,000.00	1,188,937.50	
		T 4.25% 11/15/40	900,000.00	1,269,281.25	
		T 4.375% 02/15/38	500,000.00	702,695.31	
		T 4.375% 05/15/40	750,000.00	1,070,859.37	
		T 4.375% 05/15/41	550,000.00	789,894.53	
		T 4.375% 11/15/39	650,000.00	924,421.87	
		T 4.5% 02/15/36	600,000.00	838,875.00	
		T 4.5% 05/15/38	970,000.00	1,383,538.28	
		T 4.5% 08/15/39	750,000.00	1,080,468.75	
		T 4.625% 02/15/40	700,000.00	1,026,429.69	
		T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,124,062.50	
		T 5.0% 05/15/37	650,000.00	965,300.78	
		T 5.25% 11/15/28	900,000.00	1,167,398.44	
		T 5.375% 02/15/31	750,000.00	1,031,953.12	
		T 5.5% 08/15/28	250,000.00	326,601.56	
		T 6.0% 02/15/26	600,000.00	744,304.68	
		T 6.125% 11/15/27	1,050,000.00	1,386,451.17	
		T 6.25% 05/15/30	720,000.00	1,026,956.25	
		T 6.25% 08/15/23	1,350,000.00	1,517,431.64	
	アメリカドル 小計		574,150,000.00	604,415,537.68 (66,812,093,535)	
	カナダドル	CAN 0.25% 02/01/23	1,000,000.00	998,880.00	
		CAN 0.25% 03/01/26	890,000.00	868,097.10	
		CAN 0.25% 04/01/24	600,000.00	595,110.00	
		CAN 0.25% 05/01/23	300,000.00	299,268.00	

		CAN 0.25% 11/01/22	810,000.00	809,716.50	
		CAN 0.5% 09/01/25	1,330,000.00	1,317,976.80	
		CAN 0.5% 12/01/30	970,000.00	909,539.90	
		CAN 1.25% 03/01/25	450,000.00	459,360.00	
		CAN 1.25% 06/01/30	2,560,000.00	2,581,683.20	
		CAN 1.5% 06/01/23	2,010,000.00	2,051,104.50	
		CAN 1.5% 06/01/26	840,000.00	867,888.00	
		CAN 1.5% 06/01/31	700,000.00	715,540.00	
		CAN 1.5% 09/01/24	660,000.00	678,229.20	
		CAN 1.75% 03/01/23	700,000.00	715,799.00	
		CAN 1% 06/01/27	940,000.00	945,602.40	
		CAN 1% 09/01/22	2,680,000.00	2,702,726.40	
		CAN 2.25% 03/01/24	670,000.00	699,875.30	
		CAN 2.25% 06/01/25	1,530,000.00	1,621,845.90	
		CAN 2.25% 06/01/29	390,000.00	425,396.40	
		CAN 2.5% 06/01/24	1,780,000.00	1,877,526.20	
		CAN 2.75% 12/01/48	810,000.00	984,312.00	
		CAN 2.75% 12/01/64	290,000.00	368,897.40	
		CAN 2% 06/01/28	800,000.00	854,048.00	
		CAN 2% 09/01/23	1,180,000.00	1,218,149.40	
		CAN 2% 12/01/51	2,280,000.00	2,396,462.40	
		CAN 3.5% 12/01/45	690,000.00	933,721.80	
		CAN 4.0% 06/01/41	490,000.00	686,583.10	
		CAN 5.75% 06/01/29	960,000.00	1,298,630.40	
		CAN 5.75% 06/01/33	670,000.00	988,719.00	
		CAN 5% 06/01/37	490,000.00	730,178.40	
	カナダドル 小計		30,470,000.00	32,600,866.70 (2,864,638,156)	
	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	7,982,272.00	
		MBONO 10% 12/05/24	24,100,000.00	26,761,845.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	13,590,000.00	13,149,548.10	
		MBONO 6.75% 03/09/23	20,920,000.00	21,290,911.60	
		MBONO 7.5% 06/03/27	22,800,000.00	23,614,416.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	10,950,000.00	11,518,414.50	
		MBONO 7.75% 11/13/42	13,980,000.00	14,158,105.20	
		MBONO 7.75% 11/23/34	4,970,000.00	5,224,513.70	
		MBONO 8.5% 05/31/29	20,740,000.00	22,679,812.20	
		MBONO 8.5% 11/18/38	10,170,000.00	11,072,384.10	
		MBONO 8% 09/05/24	5,910,000.00	6,195,216.60	
		MBONO 8% 11/07/47	11,460,000.00	11,865,569.40	
		MBONO 8% 12/07/23	13,220,000.00	13,801,944.40	
	メキシコペソ 小計		179,210,000.00	189,314,952.80	

				(1,042,538,513)	
	ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	730,000.00	753,622.80	
		BGB 0.2% 10/22/23	640,000.00	653,452.80	
		BGB 0.4% 06/22/40	290,000.00	290,501.70	
		BGB 0.5% 10/22/24	490,000.00	509,482.40	
		BGB 0.65% 06/22/71	300,000.00	273,618.00	
		BGB 0.8% 06/22/25	1,100,000.00	1,164,559.00	
		BGB 0.8% 06/22/27	750,000.00	810,705.00	
		BGB 0.8% 06/22/28	980,000.00	1,066,396.80	
		BGB 0.9% 06/22/29	990,000.00	1,088,891.10	
		BGB 0% 10/22/27	600,000.00	619,578.00	
		BGB 0% 10/22/31	250,000.00	252,882.50	
		BGB 1.25% 04/22/33	330,000.00	380,955.30	
		BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	476,820.00	
		BGB 1.6% 06/22/47	690,000.00	856,628.10	
		BGB 1.7% 06/22/50	490,000.00	624,304.10	
		BGB 1.9% 06/22/38	510,000.00	647,113.50	
		BGB 1% 06/22/26	1,080,000.00	1,167,328.80	
		BGB 1% 06/22/31	1,140,000.00	1,274,394.60	
		BGB 2.15% 06/22/66	440,000.00	660,374.00	
		BGB 2.25% 06/22/23	970,000.00	1,025,726.50	
		BGB 2.25% 06/22/57	380,000.00	562,194.80	
		BGB 2.6% 06/22/24	1,000,000.00	1,097,760.00	
		BGB 3.75% 06/22/45	580,000.00	1,003,945.20	
		BGB 3% 06/22/34	680,000.00	940,120.40	
		BGB 4.25% 03/28/41	1,110,000.00	1,925,594.70	
		BGB 4.25% 09/28/22	890,000.00	942,421.00	
		BGB 4.5% 03/28/26	750,000.00	934,485.00	
		BGB 4% 03/28/32	620,000.00	897,127.60	
		BGB 5.5% 03/28/28	1,190,000.00	1,680,089.60	
		BGB 5% 03/28/35	1,270,000.00	2,129,269.30	
		BKO 0% 03/10/23	780,000.00	789,399.00	
		BKO 0% 06/16/23	620,000.00	628,655.20	
		BKO 0% 12/15/22	1,070,000.00	1,081,021.00	
		BTPS 0.05% 01/15/23	330,000.00	332,567.40	
		BTPS 0.25% 03/15/28	1,250,000.00	1,252,875.00	
		BTPS 0.3% 08/15/23	1,100,000.00	1,115,917.00	
		BTPS 0.35% 02/01/25	1,740,000.00	1,774,921.80	
		BTPS 0.5% 02/01/26	1,500,000.00	1,539,720.00	
		BTPS 0.6% 06/15/23	720,000.00	734,378.40	
		BTPS 0.6% 08/01/31	850,000.00	848,640.00	
		BTPS 0.65% 10/15/23	560,000.00	572,964.00	
		BTPS 0.85% 01/15/27	1,100,000.00	1,147,388.00	

		BTPS 0.9% 04/01/31	1,300,000.00	1,340,443.00	
		BTPS 0.9% 08/01/22	1,500,000.00	1,521,330.00	
		BTPS 0.95% 03/01/23	1,720,000.00	1,758,682.80	
		BTPS 0.95% 03/01/37	320,000.00	313,427.20	
		BTPS 0.95% 03/15/23	860,000.00	879,719.80	
		BTPS 0.95% 08/01/30	1,630,000.00	1,694,792.50	
		BTPS 0.95% 09/15/27	1,000,000.00	1,049,190.00	
		BTPS 0.95% 12/01/31	670,000.00	689,376.40	
		BTPS 0% 01/15/24	300,000.00	302,454.00	
		BTPS 0% 04/01/26	1,050,000.00	1,052,058.00	
		BTPS 0% 04/15/24	980,000.00	987,840.00	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,170,000.00	1,246,623.30	
		BTPS 1.35% 04/01/30	750,000.00	807,885.00	
		BTPS 1.45% 03/01/36	1,130,000.00	1,198,059.90	
		BTPS 1.45% 05/15/25	1,070,000.00	1,136,479.10	
		BTPS 1.45% 09/15/22	1,550,000.00	1,584,363.50	
		BTPS 1.45% 11/15/24	600,000.00	633,624.00	
		BTPS 1.5% 06/01/25	1,500,000.00	1,597,560.00	
		BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,457,109.00	
		BTPS 1.65% 03/01/32	1,340,000.00	1,474,495.80	
		BTPS 1.65% 12/01/30	1,330,000.00	1,465,114.70	
		BTPS 1.7% 09/01/51	750,000.00	764,985.00	
		BTPS 1.75% 07/01/24	990,000.00	1,048,914.90	
		BTPS 1.8% 03/01/41	650,000.00	703,982.50	
		BTPS 1.85% 05/15/24	750,000.00	795,450.00	
		BTPS 1.85% 07/01/25	820,000.00	884,632.40	
		BTPS 2.05% 08/01/27	1,040,000.00	1,160,099.20	
		BTPS 2.1% 07/15/26	1,470,000.00	1,625,496.60	
		BTPS 2.15% 03/01/72	370,000.00	383,493.90	
		BTPS 2.2% 06/01/27	1,700,000.00	1,909,746.00	
		BTPS 2.25% 09/01/36	990,000.00	1,158,646.50	
		BTPS 2.45% 09/01/33	990,000.00	1,175,872.50	
		BTPS 2.45% 09/01/50	720,000.00	863,460.00	
		BTPS 2.45% 10/01/23	870,000.00	924,174.90	
		BTPS 2.5% 11/15/25	660,000.00	734,771.40	
		BTPS 2.5% 12/01/24	1,300,000.00	1,419,483.00	
		BTPS 2.7% 03/01/47	1,240,000.00	1,549,962.80	
		BTPS 2.8% 03/01/67	600,000.00	746,856.00	
		BTPS 2.8% 12/01/28	1,260,000.00	1,490,189.40	
		BTPS 2.95% 09/01/38	1,100,000.00	1,402,599.00	
		BTPS 2% 02/01/28	930,000.00	1,039,591.20	
		BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,147,030.50	

		BTPS 3.1% 03/01/40	670,000.00	874,510.80	
		BTPS 3.25% 09/01/46	680,000.00	928,546.80	
		BTPS 3.35% 03/01/35	1,100,000.00	1,436,875.00	
		BTPS 3.45% 03/01/48	1,120,000.00	1,588,283.20	
		BTPS 3.5% 03/01/30	1,950,000.00	2,456,980.50	
		BTPS 3.75% 09/01/24	1,740,000.00	1,957,517.40	
		BTPS 3.85% 09/01/49	1,040,000.00	1,580,144.80	
		BTPS 3% 08/01/29	1,210,000.00	1,462,079.30	
		BTPS 4.5% 03/01/24	1,130,000.00	1,272,187.90	
		BTPS 4.5% 03/01/26	930,000.00	1,127,067.00	
		BTPS 4.5% 05/01/23	1,050,000.00	1,142,253.00	
		BTPS 4.75% 08/01/23	1,610,000.00	1,778,840.70	
		BTPS 4.75% 09/01/28	1,810,000.00	2,380,693.00	
		BTPS 4.75% 09/01/44	1,560,000.00	2,584,498.80	
		BTPS 4% 02/01/37	1,800,000.00	2,545,488.00	
		BTPS 5.0% 08/01/39	1,440,000.00	2,327,558.40	
		BTPS 5.25% 11/01/29	1,770,000.00	2,475,150.30	
		BTPS 5.5% 09/01/22	1,700,000.00	1,811,928.00	
		BTPS 5.5% 11/01/22	1,630,000.00	1,753,260.60	
		BTPS 5.75% 02/01/33	1,570,000.00	2,437,456.40	
		BTPS 5% 03/01/25	1,740,000.00	2,068,181.40	
		BTPS 5% 08/01/34	1,260,000.00	1,895,972.40	
		BTPS 5% 09/01/40	1,600,000.00	2,615,904.00	
		BTPS 6.5% 11/01/27	2,070,000.00	2,888,374.50	
		BTPS 6% 05/01/31	1,940,000.00	2,947,092.80	
		BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	483,945.00	
		BTPS 9% 11/01/23	1,800,000.00	2,183,148.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	1,920,000.00	2,024,582.40	
		DBR 0.25% 02/15/29	1,880,000.00	2,004,117.60	
		DBR 0.25% 08/15/28	1,300,000.00	1,382,706.00	
		DBR 0.5% 02/15/25	1,140,000.00	1,193,374.80	
		DBR 0.5% 02/15/26	2,300,000.00	2,435,263.00	
		DBR 0.5% 02/15/28	1,510,000.00	1,627,176.00	
		DBR 0.5% 08/15/27	900,000.00	965,934.00	
		DBR 0% 02/15/30	2,060,000.00	2,157,417.40	
		DBR 0% 02/15/31	1,240,000.00	1,296,246.40	
		DBR 0% 05/15/35	1,500,000.00	1,548,210.00	
		DBR 0% 05/15/36	510,000.00	522,678.60	
		DBR 0% 08/15/26	1,620,000.00	1,681,284.60	
		DBR 0% 08/15/29	2,430,000.00	2,543,675.40	
		DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,549,219.60	
		DBR 0% 08/15/31	670,000.00	699,004.30	
		DBR 0% 08/15/50	1,960,000.00	1,926,974.00	

		DBR 0% 11/15/27	1,580,000.00	1,646,423.20	
		DBR 1.25% 08/15/48	1,730,000.00	2,303,754.50	
		DBR 1.5% 02/15/23	950,000.00	983,620.50	
		DBR 1.5% 05/15/23	2,290,000.00	2,383,935.80	
		DBR 1.5% 05/15/24	1,020,000.00	1,086,626.40	
		DBR 1.5% 09/04/22	920,000.00	943,046.00	
		DBR 1.75% 02/15/24	1,250,000.00	1,332,412.50	
		DBR 1.75% 07/04/22	1,650,000.00	1,688,610.00	
		DBR 1% 08/15/24	1,610,000.00	1,699,677.00	
		DBR 1% 08/15/25	1,880,000.00	2,018,048.40	
		DBR 2.5% 07/04/44	1,740,000.00	2,787,184.20	
		DBR 2.5% 08/15/46	1,980,000.00	3,244,606.20	
		DBR 2% 08/15/23	1,890,000.00	1,999,185.30	
		DBR 3.25% 07/04/42	1,240,000.00	2,134,784.00	
		DBR 4.0% 01/04/37	1,670,000.00	2,795,997.50	
		DBR 4.25% 07/04/39	1,090,000.00	1,982,230.40	
		DBR 4.75% 07/04/28	700,000.00	970,998.00	
		DBR 4.75% 07/04/34	1,440,000.00	2,425,089.60	
		DBR 4.75% 07/04/40	1,310,000.00	2,562,988.80	
		DBR 5.5% 01/04/31	1,640,000.00	2,605,943.60	
		DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	2,129,235.00	
		DBR 6.25% 01/04/24	1,370,000.00	1,608,654.00	
		DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	974,767.80	
		DBR 6.5% 07/04/27	1,270,000.00	1,830,324.00	
		FRTR 0.25% 11/25/26	2,050,000.00	2,139,954.00	
		FRTR 0.5% 05/25/25	3,350,000.00	3,499,510.50	
		FRTR 0.5% 05/25/26	2,930,000.00	3,088,014.90	
		FRTR 0.5% 05/25/29	2,830,000.00	3,015,195.20	
		FRTR 0.5% 05/25/40	980,000.00	999,649.00	
		FRTR 0.5% 05/25/72	390,000.00	331,523.40	
		FRTR 0.5% 06/25/44	300,000.00	301,071.00	
		FRTR 0.75% 05/25/28	2,960,000.00	3,201,210.40	
		FRTR 0.75% 05/25/52	1,700,000.00	1,726,741.00	
		FRTR 0.75% 11/25/28	2,510,000.00	2,721,266.70	
		FRTR 0% 02/25/23	610,000.00	616,758.80	
		FRTR 0% 02/25/24	1,420,000.00	1,444,949.40	
		FRTR 0% 02/25/26	1,690,000.00	1,737,134.10	
		FRTR 0% 02/25/27	320,000.00	329,113.60	
		FRTR 0% 03/25/23	1,880,000.00	1,901,845.60	
		FRTR 0% 03/25/24	2,240,000.00	2,281,843.20	
		FRTR 0% 03/25/25	2,310,000.00	2,366,364.00	
		FRTR 0% 11/25/29	3,300,000.00	3,377,286.00	

		FRTR 0% 11/25/30	2,480,000.00	2,522,532.00	
		FRTR 0% 11/25/31	850,000.00	857,862.50	
		FRTR 1.25% 05/25/34	2,400,000.00	2,758,176.00	
		FRTR 1.25% 05/25/36	2,410,000.00	2,782,224.50	
		FRTR 1.5% 05/25/31	2,950,000.00	3,435,216.00	
		FRTR 1.5% 05/25/50	1,960,000.00	2,401,764.40	
		FRTR 1.75% 05/25/23	2,600,000.00	2,717,468.00	
		FRTR 1.75% 05/25/66	850,000.00	1,150,509.00	
		FRTR 1.75% 06/25/39	2,010,000.00	2,526,147.90	
		FRTR 1.75% 11/25/24	2,020,000.00	2,185,559.20	
		FRTR 1% 05/25/27	2,480,000.00	2,701,860.80	
		FRTR 1% 11/25/25	2,240,000.00	2,400,854.40	
		FRTR 2.25% 05/25/24	2,040,000.00	2,212,563.60	
		FRTR 2.25% 10/25/22	3,120,000.00	3,235,689.60	
		FRTR 2.5% 05/25/30	2,900,000.00	3,616,068.00	
		FRTR 2.75% 10/25/27	3,280,000.00	3,956,860.80	
		FRTR 2% 05/25/48	2,140,000.00	2,891,867.60	
		FRTR 3.25% 05/25/45	1,710,000.00	2,774,201.40	
		FRTR 3.5% 04/25/26	3,120,000.00	3,739,257.60	
		FRTR 4.25% 10/25/23	2,870,000.00	3,193,219.40	
		FRTR 4.5% 04/25/41	2,340,000.00	4,190,846.40	
		FRTR 4.75% 04/25/35	1,810,000.00	2,970,173.80	
		FRTR 4% 04/25/55	1,070,000.00	2,131,407.90	
		FRTR 4% 04/25/60	1,080,000.00	2,258,604.00	
		FRTR 4% 10/25/38	1,600,000.00	2,615,776.00	
		FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	3,657,575.00	
		FRTR 5.75% 10/25/32	2,150,000.00	3,574,074.00	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	1,867,542.00	
		FRTR 8.5% 04/25/23	1,100,000.00	1,278,343.00	
		IRISH 0.2% 05/15/27	460,000.00	478,390.80	
		IRISH 0.2% 10/18/30	470,000.00	485,364.30	
		IRISH 0.4% 05/15/35	180,000.00	185,554.80	
		IRISH 0.55% 04/22/41	110,000.00	112,369.40	
		IRISH 0.9% 05/15/28	440,000.00	479,234.80	
		IRISH 0% 10/18/31	80,000.00	80,398.40	
		IRISH 1.1% 05/15/29	550,000.00	610,120.50	
		IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	770,654.10	
		IRISH 1.35% 03/18/31	340,000.00	389,755.60	
		IRISH 1.5% 05/15/50	400,000.00	489,588.00	
		IRISH 1.7% 05/15/37	470,000.00	574,593.80	
		IRISH 1% 05/15/26	730,000.00	785,720.90	
		IRISH 2.4% 05/15/30	770,000.00	950,056.80	
		IRISH 2% 02/18/45	580,000.00	776,040.00	

		IRISH 3.4% 03/18/24	510,000.00	565,003.50	
		IRISH 3.9% 03/20/23	650,000.00	699,172.50	
		IRISH 5.4% 03/13/25	700,000.00	854,980.00	
		NETHER 0.25% 07/15/25	920,000.00	955,880.00	
		NETHER 0.25% 07/15/29	630,000.00	665,481.60	
		NETHER 0.5% 01/15/40	620,000.00	680,605.00	
		NETHER 0.5% 07/15/26	1,260,000.00	1,334,894.40	
		NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	974,475.00	
		NETHER 0.75% 07/15/28	1,040,000.00	1,134,640.00	
		NETHER 0% 01/15/24	780,000.00	795,116.40	
		NETHER 0% 01/15/27	480,000.00	496,387.20	
		NETHER 0% 01/15/38	350,000.00	351,540.00	
		NETHER 0% 01/15/52	570,000.00	547,029.00	
		NETHER 0% 07/15/30	850,000.00	878,968.00	
		NETHER 0% 07/15/31	530,000.00	545,862.90	
		NETHER 1.75% 07/15/23	1,000,000.00	1,050,220.00	
		NETHER 2.25% 07/15/22	750,000.00	771,832.50	
		NETHER 2.5% 01/15/33	920,000.00	1,216,148.00	
		NETHER 2.75% 01/15/47	1,110,000.00	1,875,644.70	
		NETHER 2% 07/15/24	1,460,000.00	1,581,574.20	
		NETHER 3.75% 01/15/23	300,000.00	320,235.00	
		NETHER 3.75% 01/15/42	1,060,000.00	1,882,697.80	
		NETHER 4% 01/15/37	1,070,000.00	1,760,492.40	
		NETHER 5.5% 01/15/28	1,010,000.00	1,415,747.30	
		NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	786,051.00	
		OBL 0% 04/05/24	1,760,000.00	1,797,928.00	
		OBL 0% 04/10/26	900,000.00	931,995.00	
		OBL 0% 04/11/25	1,420,000.00	1,461,677.00	
		OBL 0% 04/14/23	1,110,000.00	1,124,618.70	
		OBL 0% 10/07/22	1,530,000.00	1,543,923.00	
		OBL 0% 10/10/25	1,170,000.00	1,208,715.30	
		OBL 0% 10/18/24	2,150,000.00	2,205,276.50	
		RAGB 0.5% 02/20/29	700,000.00	746,816.00	
		RAGB 0.5% 04/20/27	650,000.00	690,950.00	
		RAGB 0.75% 02/20/28	620,000.00	671,100.40	
		RAGB 0.75% 03/20/51	290,000.00	317,326.70	
		RAGB 0.75% 10/20/26	660,000.00	707,856.60	
		RAGB 0.85% 06/30/20	200,000.00	211,338.00	
		RAGB 0% 02/20/30	660,000.00	677,127.00	
		RAGB 0% 02/20/31	480,000.00	489,451.20	
		RAGB 0% 04/20/25	50,000.00	51,258.50	
		RAGB 0% 07/15/23	650,000.00	659,301.50	

		RAGB 0% 07/15/24	590,000.00	602,508.00	
		RAGB 0% 09/20/22	430,000.00	433,590.50	
		RAGB 0% 10/20/40	220,000.00	209,475.20	
		RAGB 1.2% 10/20/25	640,000.00	691,884.80	
		RAGB 1.5% 02/20/47	540,000.00	694,094.40	
		RAGB 1.5% 11/02/86	200,000.00	289,684.00	
		RAGB 1.65% 10/21/24	560,000.00	603,708.00	
		RAGB 1.75% 10/20/23	750,000.00	792,135.00	
		RAGB 2.1% 09/20/17	340,000.00	631,444.60	
		RAGB 2.4% 05/23/34	530,000.00	695,471.30	
		RAGB 3.15% 06/20/44	470,000.00	774,870.20	
		RAGB 3.4% 11/22/22	1,210,000.00	1,276,404.80	
		RAGB 3.8% 01/26/62	230,000.00	507,449.00	
		RAGB 4.15% 03/15/37	920,000.00	1,505,644.40	
		RAGB 4.85% 03/15/26	730,000.00	919,938.70	
		RAGB 6.25% 07/15/27	690,000.00	975,963.60	
		RFGB 0.125% 04/15/36	270,000.00	272,195.10	
		RFGB 0.125% 04/15/52	210,000.00	196,849.80	
		RFGB 0.125% 09/15/31	200,000.00	206,236.00	
		RFGB 0.25% 09/15/40	200,000.00	202,764.00	
		RFGB 0.5% 04/15/26	470,000.00	496,122.60	
		RFGB 0.5% 09/15/27	380,000.00	404,844.40	
		RFGB 0.5% 09/15/28	470,000.00	502,768.40	
		RFGB 0.5% 09/15/29	290,000.00	310,865.50	
		RFGB 0.75% 04/15/31	270,000.00	296,635.50	
		RFGB 0.875% 09/15/25	300,000.00	319,623.00	
		RFGB 0% 09/15/23	100,000.00	101,601.00	
		RFGB 0% 09/15/24	290,000.00	296,652.60	
		RFGB 0% 09/15/30	250,000.00	256,255.00	
		RFGB 1.125% 04/15/34	270,000.00	310,481.10	
		RFGB 1.375% 04/15/47	230,000.00	295,044.00	
		RFGB 1.5% 04/15/23	440,000.00	457,045.60	
		RFGB 1.625% 09/15/22	380,000.00	390,119.40	
		RFGB 2.625% 07/04/42	340,000.00	513,597.20	
		RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	468,091.60	
		RFGB 2% 04/15/24	310,000.00	333,507.30	
		RFGB 4% 07/04/25	320,000.00	380,476.80	
		SPGB 0.1% 04/30/31	1,220,000.00	1,207,995.20	
		SPGB 0.25% 07/30/24	1,000,000.00	1,023,060.00	
		SPGB 0.35% 07/30/23	1,170,000.00	1,191,528.00	
		SPGB 0.45% 10/31/22	800,000.00	810,936.00	
		SPGB 0.5% 04/30/30	1,980,000.00	2,053,537.20	
		SPGB 0.5% 10/31/31	350,000.00	358,141.00	

		SPGB 0.6% 10/31/29	1,200,000.00	1,257,552.00	
		SPGB 0.8% 07/30/27	480,000.00	509,942.40	
		SPGB 0.85% 07/30/37	460,000.00	468,974.60	
		SPGB 0% 01/31/25	1,240,000.00	1,261,055.20	
		SPGB 0% 01/31/26	500,000.00	508,655.00	
		SPGB 0% 01/31/28	680,000.00	686,636.80	
		SPGB 0% 04/30/23	1,360,000.00	1,373,763.20	
		SPGB 0% 05/31/24	350,000.00	354,935.00	
		SPGB 1.2% 10/31/40	750,000.00	794,227.50	
		SPGB 1.25% 10/31/30	1,200,000.00	1,323,492.00	
		SPGB 1.3% 10/31/26	1,460,000.00	1,588,348.60	
		SPGB 1.4% 04/30/28	1,020,000.00	1,126,845.00	
		SPGB 1.4% 07/30/28	1,190,000.00	1,318,044.00	
		SPGB 1.45% 04/30/29	750,000.00	836,775.00	
		SPGB 1.45% 10/31/27	1,840,000.00	2,032,850.40	
		SPGB 1.45% 10/31/71	220,000.00	210,073.60	
		SPGB 1.5% 04/30/27	1,970,000.00	2,175,313.40	
		SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,348,862.50	
		SPGB 1.85% 07/30/35	1,290,000.00	1,517,104.50	
		SPGB 1.95% 04/30/26	1,340,000.00	1,490,321.20	
		SPGB 1.95% 07/30/30	1,350,000.00	1,575,315.00	
		SPGB 1% 10/31/50	940,000.00	902,174.40	
		SPGB 2.15% 10/31/25	1,760,000.00	1,957,155.20	
		SPGB 2.35% 07/30/33	1,290,000.00	1,587,061.20	
		SPGB 2.7% 10/31/48	1,060,000.00	1,462,089.80	
		SPGB 2.75% 10/31/24	1,560,000.00	1,728,214.80	
		SPGB 2.9% 10/31/46	1,100,000.00	1,558,084.00	
		SPGB 3.45% 07/30/66	980,000.00	1,605,622.20	
		SPGB 3.8% 04/30/24	1,500,000.00	1,680,810.00	
		SPGB 4.2% 01/31/37	1,310,000.00	2,012,697.10	
		SPGB 4.4% 10/31/23	1,320,000.00	1,469,410.80	
		SPGB 4.65% 07/30/25	1,410,000.00	1,703,054.40	
		SPGB 4.7% 07/30/41	1,300,000.00	2,226,861.00	
		SPGB 4.8% 01/31/24	1,150,000.00	1,305,917.00	
		SPGB 4.9% 07/30/40	1,310,000.00	2,272,443.90	
		SPGB 5.15% 10/31/28	1,100,000.00	1,521,828.00	
		SPGB 5.15% 10/31/44	950,000.00	1,785,354.00	
		SPGB 5.4% 01/31/23	1,790,000.00	1,953,337.50	
		SPGB 5.75% 07/30/32	1,450,000.00	2,313,721.50	
		SPGB 5.9% 07/30/26	1,360,000.00	1,791,786.40	
		SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	3,431,587.50	
	ユーロ 小計		381,200,000.00	454,127,192.90	

				(59,054,700,164)	
	イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,450,000.00	1,440,111.00	
		UKT 0.125% 01/31/23	2,050,000.00	2,051,681.00	
		UKT 0.125% 01/31/24	980,000.00	978,765.20	
		UKT 0.125% 01/31/28	1,320,000.00	1,294,246.80	
		UKT 0.25% 07/31/31	620,000.00	594,511.80	
		UKT 0.375% 10/22/30	1,090,000.00	1,067,153.60	
		UKT 0.5% 07/22/22	1,800,000.00	1,807,866.00	
		UKT 0.5% 10/22/61	670,000.00	578,665.60	
		UKT 0.625% 06/07/25	1,160,000.00	1,178,815.20	
		UKT 0.625% 07/31/35	1,140,000.00	1,102,801.80	
		UKT 0.625% 10/22/50	970,000.00	877,529.90	
		UKT 0.75% 07/22/23	940,000.00	952,849.80	
		UKT 0.875% 01/31/46	350,000.00	338,670.50	
		UKT 0.875% 10/22/29	550,000.00	565,389.00	
		UKT 1.25% 07/22/27	1,190,000.00	1,252,486.90	
		UKT 1.25% 07/31/51	60,000.00	63,613.80	
		UKT 1.25% 10/22/41	1,440,000.00	1,508,731.20	
		UKT 1.5% 07/22/26	820,000.00	869,503.40	
		UKT 1.5% 07/22/47	1,310,000.00	1,457,375.00	
		UKT 1.625% 10/22/28	1,400,000.00	1,519,252.00	
		UKT 1.625% 10/22/54	850,000.00	1,003,663.00	
		UKT 1.625% 10/22/71	430,000.00	570,601.40	
		UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	707,556.00	
		UKT 1.75% 07/22/57	1,140,000.00	1,418,661.60	
		UKT 1.75% 09/07/22	1,640,000.00	1,670,963.20	
		UKT 1.75% 09/07/37	1,340,000.00	1,509,134.80	
		UKT 1% 04/22/24	1,450,000.00	1,484,510.00	
		UKT 2.25% 09/07/23	1,160,000.00	1,213,336.80	
		UKT 2.5% 07/22/65	940,000.00	1,487,456.00	
		UKT 2.75% 09/07/24	820,000.00	886,100.20	
		UKT 2% 09/07/25	420,000.00	450,706.20	
		UKT 3.25% 01/22/44	1,430,000.00	2,079,377.30	
		UKT 3.5% 01/22/45	1,280,000.00	1,950,681.60	
		UKT 3.5% 07/22/68	910,000.00	1,825,505.50	
		UKT 3.75% 07/22/52	800,000.00	1,389,368.00	
		UKT 4.25% 03/07/36	1,200,000.00	1,765,296.00	
		UKT 4.25% 06/07/32	1,290,000.00	1,770,550.80	
		UKT 4.25% 09/07/39	820,000.00	1,275,559.20	
		UKT 4.25% 12/07/27	750,000.00	932,595.00	
		UKT 4.25% 12/07/40	970,000.00	1,536,858.30	
		UKT 4.25% 12/07/46	1,060,000.00	1,829,528.20	
		UKT 4.25% 12/07/49	810,000.00	1,463,119.20	

	UKT 4.25% 12/07/55	1,040,000.00	2,040,698.40	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,080,000.00	1,581,076.80	
	UKT 4.5% 12/07/42	1,170,000.00	1,965,822.30	
	UKT 4.75% 12/07/30	850,000.00	1,172,371.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	880,000.00	1,426,990.40	
	UKT 4% 01/22/60	840,000.00	1,678,034.40	
	UKT 5% 03/07/25	600,000.00	703,926.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	450,000.00	630,387.00	
イギリスポンド 小計		50,330,000.00	62,920,454.10 (9,559,504,591)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	3,340,000.00	3,341,402.80	
	SGB 0.75% 05/12/28	3,860,000.00	4,071,026.20	
	SGB 0.75% 11/12/29	3,770,000.00	3,988,923.90	
	SGB 1.5% 11/13/23	5,670,000.00	5,908,990.50	
	SGB 1% 11/12/26	4,940,000.00	5,247,416.20	
	SGB 2.25% 06/01/32	1,850,000.00	2,261,218.00	
	SGB 2.5% 05/12/25	4,630,000.00	5,121,613.40	
	SGB 3.5% 03/30/39	2,520,000.00	3,813,818.40	
スウェーデンクローナ 小計		30,580,000.00	33,754,409.40 (428,680,999)	
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	1,730,000.00	1,739,013.30	
	NGB 1.375% 08/19/30	3,120,000.00	3,176,253.60	
	NGB 1.5% 02/19/26	3,110,000.00	3,189,242.80	
	NGB 1.75% 02/17/27	2,900,000.00	3,018,436.00	
	NGB 1.75% 03/13/25	3,120,000.00	3,219,808.80	
	NGB 1.75% 09/06/29	2,470,000.00	2,588,461.20	
	NGB 2% 04/26/28	2,510,000.00	2,663,110.00	
	NGB 2% 05/24/23	4,940,000.00	5,071,107.60	
	NGB 3% 03/14/24	3,640,000.00	3,853,668.00	
ノルウェークローネ 小計		27,540,000.00	28,519,101.30 (355,348,002)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/22	3,190,000.00	3,225,791.80	
	DGB 0.25% 11/15/52	1,630,000.00	1,610,880.10	
	DGB 0.5% 11/15/27	4,350,000.00	4,604,127.00	
	DGB 0.5% 11/15/29	6,410,000.00	6,838,123.90	
	DGB 0% 11/15/31	810,000.00	820,562.40	
	DGB 1.5% 11/15/23	4,170,000.00	4,375,831.20	
	DGB 1.75% 11/15/25	4,230,000.00	4,657,272.30	
	DGB 4.5% 11/15/39	8,240,000.00	14,901,216.00	
デンマーククローネ 小計		33,030,000.00	41,033,804.70 (717,681,244)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.75% 04/25/25	720,000.00	722,484.00	

		POLGB 0% 07/25/22	2,580,000.00	2,579,896.80	
		POLGB 1.25% 10/25/30	1,200,000.00	1,171,176.00	
		POLGB 2.25% 10/25/24	2,860,000.00	3,007,004.00	
		POLGB 2.5% 01/25/23	1,700,000.00	1,759,211.00	
		POLGB 2.5% 04/25/24	1,880,000.00	1,983,738.40	
		POLGB 2.5% 07/25/26	3,420,000.00	3,663,675.00	
		POLGB 2.5% 07/25/27	1,910,000.00	2,060,011.40	
		POLGB 2.75% 04/25/28	2,590,000.00	2,848,689.20	
		POLGB 2.75% 10/25/29	3,640,000.00	4,026,022.00	
		POLGB 3.25% 07/25/25	2,470,000.00	2,707,564.60	
		POLGB 4% 10/25/23	1,980,000.00	2,141,865.00	
		POLGB 5.75% 04/25/29	900,000.00	1,188,468.00	
		POLGB 5.75% 09/23/22	1,500,000.00	1,600,290.00	
	ポーランドズロチ 小計		29,350,000.00	31,460,095.40 (893,246,488)	
	オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	1,730,000.00	1,728,460.30	
		ACGB 0.25% 11/21/25	1,000,000.00	989,950.00	
		ACGB 0.5% 09/21/26	1,540,000.00	1,529,651.20	
		ACGB 1.25% 05/21/32	1,140,000.00	1,141,801.20	
		ACGB 1.5% 06/21/31	1,190,000.00	1,227,068.50	
		ACGB 1.75% 06/21/51	990,000.00	918,650.70	
		ACGB 1.75% 11/21/32	850,000.00	892,797.50	
		ACGB 1% 11/21/31	1,810,000.00	1,774,017.20	
		ACGB 1% 12/21/30	2,220,000.00	2,192,516.40	
		ACGB 2.25% 05/21/28	630,000.00	688,401.00	
		ACGB 2.25% 11/21/22	430,000.00	442,814.00	
		ACGB 2.5% 05/21/30	1,860,000.00	2,084,427.60	
		ACGB 2.75% 04/21/24	620,000.00	666,072.20	
		ACGB 2.75% 05/21/41	810,000.00	923,983.20	
		ACGB 2.75% 06/21/35	630,000.00	731,814.30	
		ACGB 2.75% 11/21/27	1,400,000.00	1,568,896.00	
		ACGB 2.75% 11/21/28	770,000.00	870,746.80	
		ACGB 2.75% 11/21/29	1,640,000.00	1,866,861.20	
		ACGB 3.25% 04/21/25	1,250,000.00	1,383,675.00	
		ACGB 3.25% 04/21/29	1,630,000.00	1,909,740.60	
		ACGB 3.25% 06/21/39	650,000.00	795,938.00	
		ACGB 3.75% 04/21/37	810,000.00	1,049,986.80	
		ACGB 3% 03/21/47	730,000.00	869,378.90	
		ACGB 4.25% 04/21/26	1,200,000.00	1,407,576.00	
		ACGB 4.5% 04/21/33	800,000.00	1,081,944.00	
		ACGB 4.75% 04/21/27	1,430,000.00	1,756,068.60	
		ACGB 5.5% 04/21/23	1,810,000.00	1,982,022.40	
		ACGB 5.75% 07/15/22	2,090,000.00	2,206,454.80	

オーストラリアドル 小計		33,660,000.00	36,681,714.40 (2,980,756,112)	
シンガポールドル	SIGB 1.75% 02/01/23	410,000.00	418,687.90	
	SIGB 1.875% 03/01/50	160,000.00	164,878.40	
	SIGB 2.125% 06/01/26	450,000.00	477,967.50	
	SIGB 2.25% 08/01/36	440,000.00	474,430.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	500,000.00	533,530.00	
	SIGB 2.375% 07/01/39	230,000.00	252,721.70	
	SIGB 2.625% 05/01/28	190,000.00	208,901.20	
	SIGB 2.75% 03/01/46	710,000.00	842,358.20	
	SIGB 2.75% 04/01/42	300,000.00	350,334.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	540,000.00	564,786.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	560,000.00	629,636.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	460,000.00	521,713.60	
	SIGB 2% 02/01/24	270,000.00	280,589.40	
	SIGB 3.125% 09/01/22	570,000.00	587,499.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	340,000.00	408,914.60	
	SIGB 3.5% 03/01/27	530,000.00	603,569.30	
	SIGB 3% 09/01/24	510,000.00	549,086.40	
シンガポールドル 小計		7,170,000.00	7,869,603.20 (638,854,387)	
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,220,000.00	1,241,081.60	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,300,000.00	1,333,475.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	100,000.00	103,521.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	300,000.00	315,219.00	
	MGS 3.757% 05/22/40	150,000.00	146,184.00	
	MGS 3.795% 09/30/22	800,000.00	819,072.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	550,000.00	570,476.50	
	MGS 3.828% 07/05/34	250,000.00	251,052.50	
	MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	875,996.00	
	MGS 3.882% 03/14/25	690,000.00	725,031.30	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,890,000.00	1,992,532.50	
	MGS 3.892% 03/15/27	780,000.00	823,110.60	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,160,000.00	1,227,976.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	360,000.00	383,392.80	
	MGS 3.906% 07/15/26	820,000.00	866,969.60	
	MGS 3.955% 09/15/25	1,030,000.00	1,087,690.30	
	MGS 4.059% 09/30/24	750,000.00	789,667.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	890,000.00	938,460.50	
	MGS 4.232% 06/30/31	850,000.00	918,408.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,270,000.00	1,349,997.30	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,160,000.00	1,249,992.80	

		MGS 4.498% 04/15/30	1,260,000.00	1,384,311.60	
		MGS 4.642% 11/07/33	1,160,000.00	1,268,668.80	
		MGS 4.736% 03/15/46	1,090,000.00	1,158,713.60	
		MGS 4.762% 04/07/37	1,160,000.00	1,285,024.80	
		MGS 4.893% 06/08/38	1,360,000.00	1,508,144.80	
		MGS 4.921% 07/06/48	900,000.00	978,930.00	
		MGS 4.935% 09/30/43	530,000.00	583,084.80	
	マレーシアリンギット 小計		24,640,000.00	26,176,185.20 (684,344,950)	
	イスラエルシェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	110,000.00	110,177.80	
		ILGOV 0.5% 04/30/25	620,000.00	625,399.08	
		ILGOV 0.75% 07/31/22	3,180,000.00	3,203,952.39	
		ILGOV 1.5% 05/31/37	1,020,000.00	984,604.57	
		ILGOV 1.5% 11/30/23	370,000.00	382,402.10	
		ILGOV 1.75% 08/31/25	1,040,000.00	1,104,611.04	
		ILGOV 1% 03/31/30	1,310,000.00	1,306,586.79	
		ILGOV 2.25% 09/28/28	1,400,000.00	1,542,685.89	
		ILGOV 3.75% 03/31/24	2,000,000.00	2,194,959.00	
		ILGOV 3.75% 03/31/47	1,460,000.00	1,915,636.06	
		ILGOV 4.25% 03/31/23	200,000.00	214,115.34	
		ILGOV 5.5% 01/31/42	1,270,000.00	2,051,023.96	
		ILGOV 6.25% 10/30/26	3,050,000.00	3,973,962.12	
	イスラエルシェケル 小計		17,030,000.00	19,610,116.14 (662,908,210)	
合計				146,695,295,351 (146,695,295,351)	

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　190銘柄	100.0%	45.5%
カナダドル	国債証券　30銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券　13銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券　338銘柄	100.0%	40.3%
イギリスポンド	国債証券　50銘柄	100.0%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券　9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.5%

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%	2.0%
シンガポールドル	国債証券　17銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	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。

【中間財務諸表】

【インデックスコレクション（バランス株式３０）】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期中間計算期間(2021年7月27日から2022年1月26日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 （2021年 7月26日現在）	第12期中間計算期間 （2022年 1月26日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	681,829,425	610,603,719
親投資信託受益証券	128,612,884,880	131,485,988,849
未収入金	9,433,221	131,790,475
流動資産合計	129,304,147,526	132,228,383,043
資産合計	129,304,147,526	132,228,383,043
負債の部		
流動負債		
未払解約金	27,065,897	50,957,100
未払受託者報酬	13,716,279	14,726,076
未払委託者報酬	82,297,612	88,356,366
未払利息	1,223	933
その他未払費用	1,075,109	1,116,626
流動負債合計	124,156,120	155,157,101
負債合計	124,156,120	155,157,101
純資産の部		
元本等		
元本	74,988,698,593	77,255,552,981
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	54,191,292,813	54,817,672,961
（分配準備積立金）	14,242,034,535	13,818,001,819
元本等合計	129,179,991,406	132,073,225,942
純資産合計	129,179,991,406	132,073,225,942
負債純資産合計	129,304,147,526	132,228,383,043

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期中間計算期間 自　2020年 7月28日 至　2021年 1月27日	第12期中間計算期間 自　2021年 7月27日 至　2022年 1月26日
営業収益		
受取利息	2,389	2,986
有価証券売買等損益	6,245,612,088	△937,463,071
営業収益合計	6,245,614,477	△937,460,085
営業費用		
支払利息	147,883	155,852
受託者報酬	12,992,330	14,726,076
委託者報酬	77,953,933	88,356,366
その他費用	1,073,282	1,116,626
営業費用合計	92,167,428	104,354,920
営業利益又は営業損失（△）	6,153,447,049	△1,041,815,005
経常利益又は経常損失（△）	6,153,447,049	△1,041,815,005
中間純利益又は中間純損失（△）	6,153,447,049	△1,041,815,005
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	91,845,251	35,030,313
期首剰余金又は期首欠損金（△）	41,060,224,838	54,191,292,813
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,014,109,972	3,367,361,971
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,014,109,972	3,367,361,971
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,574,304,466	1,664,136,505
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,574,304,466	1,664,136,505
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	48,561,632,142	54,817,672,961

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月26日から翌年7月25日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第12期中間計算期間は2021年 7月27日から2022年 1月26日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

	第11期 (2021年 7月26日現在)	第12期中間計算期間 (2022年 1月26日現在)
１. 計算期間の末日における受益権の総数	74,988,698,593口	77,255,552,981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 1.7227円 (1万口当たり純資産額) (17,227円)	1口当たり純資産額 1.7096円 (1万口当たり純資産額) (17,096円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	第12期中間計算期間 (2022年 1月26日現在)
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第12期中間計算期間 (2022年 1月26日現在)
	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。

（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11期 自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日	第12期中間計算期間 自 2021年 7月27日 至 2022年 1月26日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	71,224,303,613円	74,988,698,593円
期中追加設定元本額	9,629,005,674円	4,568,746,049円
期中一部解約元本額	5,864,610,694円	2,301,891,661円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

【インデックスコレクション（バランス株式５０）】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期中間計算期間(2021年7月27日から2022年1月26日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 （2021年 7月26日現在）	第12期中間計算期間 （2022年 1月26日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	98,735,496	92,620,574
親投資信託受益証券	18,191,206,271	19,724,507,123
未収入金	-	14,787,570
流動資産合計	18,289,941,767	19,831,915,267
資産合計	18,289,941,767	19,831,915,267
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,134,007	8,567,972
未払受託者報酬	1,878,027	2,178,417
未払委託者報酬	11,268,076	13,070,451
未払利息	177	141
その他未払費用	469,448	544,541
流動負債合計	23,749,735	24,361,522
負債合計	23,749,735	24,361,522
純資産の部		
元本等		
元本	8,351,781,813	9,113,454,369
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	9,914,410,219	10,694,099,376
（分配準備積立金）	4,072,034,139	3,935,997,541
元本等合計	18,266,192,032	19,807,553,745
純資産合計	18,266,192,032	19,807,553,745
負債純資産合計	18,289,941,767	19,831,915,267

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期中間計算期間 自　2020年 7月28日 至　2021年 1月27日	第12期中間計算期間 自　2021年 7月27日 至　2022年 1月26日
営業収益		
受取利息	289	447
有価証券売買等損益	1,339,365,246	△129,570,607
営業収益合計	1,339,365,535	△129,570,160
営業費用		
支払利息	17,512	22,139
受託者報酬	1,663,455	2,178,417
委託者報酬	9,980,643	13,070,451
その他費用	415,802	544,541
営業費用合計	12,077,412	15,815,548
営業利益又は営業損失（△）	1,327,288,123	△145,385,708
経常利益又は経常損失（△）	1,327,288,123	△145,385,708
中間純利益又は中間純損失（△）	1,327,288,123	△145,385,708
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	22,370,943	12,110,196
期首剰余金又は期首欠損金（△）	6,543,144,247	9,914,410,219
剰余金増加額又は欠損金減少額	738,415,297	1,292,739,668
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	738,415,297	1,292,739,668
剰余金減少額又は欠損金増加額	254,898,779	355,554,607
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	254,898,779	355,554,607
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	8,331,577,945	10,694,099,376

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月26日から翌年7月25日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第12期中間計算期間は2021年 7月27日から2022年 1月26日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

	第11期 (2021年 7月26日現在)	第12期中間計算期間 (2022年 1月26日現在)
１. 計算期間の末日における受益権の総数	8,351,781,813口	9,113,454,369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 2.1871円 (1万口当たり純資産額) (21,871円)	1口当たり純資産額 2.1734円 (1万口当たり純資産額) (21,734円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	第12期中間計算期間 (2022年 1月26日現在)
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第12期中間計算期間 (2022年 1月26日現在)
	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。

（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11期 自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日	第12期中間計算期間 自 2021年 7月27日 至 2022年 1月26日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	7,380,420,310円	8,351,781,813円
期中追加設定元本額	1,599,018,504円	1,060,823,851円
期中一部解約元本額	627,657,001円	299,151,295円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

【インデックスコレクション（バランス株式７０）】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期中間計算期間(2021年7月27日から2022年1月26日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 （2021年 7月26日現在）	第12期中間計算期間 （2022年 1月26日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	64,491,151	89,244,335
親投資信託受益証券	11,419,045,759	12,996,169,668
未収入金	-	2,017,813
流動資産合計	11,483,536,910	13,087,431,816
資産合計	11,483,536,910	13,087,431,816
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,132,271	30,523,126
未払受託者報酬	1,147,461	1,422,557
未払委託者報酬	6,884,699	8,535,284
未払利息	115	136
その他未払費用	286,807	355,583
流動負債合計	22,451,353	40,836,686
負債合計	22,451,353	40,836,686
純資産の部		
元本等		
元本	4,277,881,661	4,890,328,053
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	7,183,203,896	8,156,267,077
（分配準備積立金）	2,581,982,802	2,390,780,277
元本等合計	11,461,085,557	13,046,595,130
純資産合計	11,461,085,557	13,046,595,130
負債純資産合計	11,483,536,910	13,087,431,816

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期中間計算期間 自　2020年 7月28日 至　2021年 1月27日	第12期中間計算期間 自　2021年 7月27日 至　2022年 1月26日
営業収益		
受取利息	197	300
有価証券売買等損益	1,078,860,521	△74,822,296
営業収益合計	1,078,860,718	△74,821,996
営業費用		
支払利息	9,862	14,980
受託者報酬	964,582	1,422,557
委託者報酬	5,787,442	8,535,284
その他費用	241,081	355,583
営業費用合計	7,002,967	10,328,404
営業利益又は営業損失（△）	1,071,857,751	△85,150,400
経常利益又は経常損失（△）	1,071,857,751	△85,150,400
中間純利益又は中間純損失（△）	1,071,857,751	△85,150,400
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	36,673,922	26,056,961
期首剰余金又は期首欠損金（△）	4,323,101,542	7,183,203,896
剰余金増加額又は欠損金減少額	738,432,154	1,686,370,863
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	738,432,154	1,686,370,863
剰余金減少額又は欠損金増加額	351,098,770	602,100,321
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	351,098,770	602,100,321
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	5,745,618,755	8,156,267,077

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月26日から翌年7月25日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第12期中間計算期間は2021年 7月27日から2022年 1月26日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

	第11期 (2021年 7月26日現在)	第12期中間計算期間 (2022年 1月26日現在)
１. 計算期間の末日における受益権の総数	4,277,881,661口	4,890,328,053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 2.6791円 (1万口当たり純資産額) (26,791円)	1口当たり純資産額 2.6678円 (1万口当たり純資産額) (26,678円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	第12期中間計算期間 (2022年 1月26日現在)
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第12期中間計算期間 (2022年 1月26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	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。 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	第11期 自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日	第12期中間計算期間 自 2021年 7月27日 至 2022年 1月26日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,642,734,613円	4,277,881,661円
期中追加設定元本額	1,243,904,534円	970,053,710円
期中一部解約元本額	608,757,486円	357,607,318円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。
なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月26日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,354,573,401
株式	283,931,764,110
未収入金	699,981,242
未収配当金	408,984,921
前払金	76,570,500
差入委託証拠金	96,170,000
流動資産合計	286,568,044,174
資産合計	286,568,044,174
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	76,573,250
未払解約金	109,594,563
未払利息	2,071
流動負債合計	186,169,884
負債合計	186,169,884
純資産の部	
元本等	
元本	133,824,161,133
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	152,557,713,157
元本等合計	286,381,874,290
純資産合計	286,381,874,290
負債純資産合計	286,568,044,174

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月26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。

	2022年 1月26日現在
	(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）

	2022年 1月26日現在	
1． 計算期間の末日における受益権の総数		133,824,161,133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	2.1400円
	(1万口当たり純資産額)	(21,400円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月26日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 1月26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月27日
期首元本額	133,516,172,873円
期中追加設定元本額	5,303,513,850円
期中一部解約元本額	4,995,525,590円
期末元本額	133,824,161,133円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	608,524,004円
ＤＣ日本株式インデックスファンド	304,190,251円
ＤＣ日本株式インデックスファンドＬ	53,422,370,569円
ＤＣ日本株式インデックスファンドＡ	662,643,847円
ＤＣバランスファンド３０	2,254,991,255円
ＤＣバランスファンド５０	3,549,008,037円
ＤＣバランスファンド７０	2,090,488,285円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	569,385,899円
日本株式インデックスｅ	1,468,215,928円
インデックスコレクション（国内株式）	20,517,428,274円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	12,006,126,744円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	2,720,851,378円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	2,421,631,974円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,488,338,572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）	2,742,346,221円
日本株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	1,033,912,938円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	50,341,123円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	586,623,737円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	69,340,895円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	133,090,283円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	142,986,993円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	752,148,719円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	441,799,952円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	7,684,846,303円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	741,553,588円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	76,194,709円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	1,248,608,764円

区分	2022年 1月26日現在
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	27,517,329円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	155,906,629円
バランスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	2,007,960,587円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	57,459,576円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	57,700,426円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	21,526,991円
バランスファンドＶＡ２（適格機関投資家専用）	602,738,620円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	269,200,632円
バランスファンドＶＡ３（適格機関投資家専用）	4,575,585,624円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	86,576,528円
国内バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	35,564,611円
国内バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	7,827,604円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	126,641,597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）	3,965,137円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 1月26日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,307,950,500	－	2,231,380,000	△76,570,500
合計		2,307,950,500	－	2,231,380,000	△76,570,500

(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はありません。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月26日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	276,966,910
国債証券	322,905,847,450
地方債証券	20,742,411,700
特殊債券	24,027,100,437
社債券	18,179,658,000

	2022年 1月26日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	38,680
未収入金	498,702,600
未収利息	683,938,140
前払費用	13,195,029
流動資産合計	387,327,858,946
資産合計	387,327,858,946
負債の部	
流動負債	
未払金	200,000,000
未払解約金	234,539,093
未払利息	423
流動負債合計	434,539,516
負債合計	434,539,516
純資産の部	
元本等	
元本	282,007,001,300
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	104,886,318,130
元本等合計	386,893,319,430
純資産合計	386,893,319,430
負債純資産合計	387,327,858,946

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月26日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 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。 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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 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	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）

	2022年 1月26日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数	282,007,001,300口
2． 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。
	有価証券 100,738,000円
3． 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 1.3719円
	(1万口当たり純資産額) (13,719円)

（注）担保資産の有価証券は、「国債証券」であります。上記金額には、約定未受渡債券を含んでおります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月26日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 1月26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月27日
期首元本額	277,547,967,709円
期中追加設定元本額	11,136,452,995円
期中一部解約元本額	6,677,419,404円
期末元本額	282,007,001,300円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	814,168,491円
ＤＣ日本債券インデックスファンド	2,021,889,654円
ＤＣ日本債券インデックスファンドＬ	42,555,102,275円
ＤＣバランスファンド３０	10,884,097,378円
ＤＣバランスファンド５０	7,677,057,161円
ＤＣバランスファンド７０	2,098,961,581円
日本債券インデックスｅ	1,159,103,937円
インデックスコレクション（国内債券）	37,112,355,186円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	58,307,508,991円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	5,870,313,239円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	2,429,944,342円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	50,069,518,047円
日本債券パッシブファンド私募Ａ（適格機関投資家専用）	3,869,218,049円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	195,247,559円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	928,182,580円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	132,220,953円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	83,134,693円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	354,568,203円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	3,179,999,979円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	1,039,861,987円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	11,841,954,941円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	156,184,562円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	313,242,082円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	3,078,989,033円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	180,950,439円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	361,204,022円
バランスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	3,130,266,080円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	377,851,464円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	853,764,325円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	70,757,736円
バランスファンドＶＡ２（適格機関投資家専用）	3,277,944,812円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	1,468,187,886円
バランスファンドＶＡ３（適格機関投資家専用）	24,838,848,050円

区分	2022年 1月26日現在
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	468,941,778円
国内バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	136,366,191円
国内バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	39,248,387円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	624,646,842円
私募日本債券インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	5,198,385円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2022年 1月26日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引 買建	603,800,000	－	603,840,000	40,000
合計		603,800,000	－	603,840,000	40,000

(注)1.時価の算定方法

債券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.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.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月26日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	5,929,636,615
コール・ローン	1,056,667,167
株式	288,361,934,616
投資信託受益証券	167,565,761
投資証券	6,820,588,548
派生商品評価勘定	4,197,499
未収入金	1
未収配当金	209,540,714
前払金	556,839,170
差入委託証拠金	2,659,615,731
流動資産合計	305,766,585,822
資産合計	305,766,585,822
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	570,090,931
未払解約金	402,759,102
未払利息	1,615

	2022年 1月26日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	972,851,648
負債合計	972,851,648
純資産の部	
元本等	
元本	72,448,220,480
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	232,345,513,694
元本等合計	304,793,734,174
純資産合計	304,793,734,174
負債純資産合計	305,766,585,822

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月26日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(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。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)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、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。 (2)為替予約取引

	2022年 1月26日現在
	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。 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。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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。 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。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 1月26日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		72,448,220,480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	4.2071円
	(1万口当たり純資産額)	(42,071円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月26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。

	2022年 1月26日現在
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 1月26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月27日
期首元本額	71,393,866,315円
期中追加設定元本額	5,106,434,353円
期中一部解約元本額	4,052,080,188円
期末元本額	72,448,220,480円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,517,125,371円
ＤＣ外国株式インデックスファンド	4,728,592,981円
ＤＣ外国株式インデックスファンドＬ	24,976,179,439円
ＤＣバランスファンド３０	601,297,934円
ＤＣバランスファンド５０	1,233,704,745円

区分	2022年 1月26日現在
ＤＣバランスファンド７０	801,923,955円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	279,715,103円
外国株式インデックスｅ	4,697,837,628円
インデックスコレクション（外国株式）	14,014,086,521円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	3,240,101,726円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	935,503,166円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	920,043,906円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,486,444,962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）	1,474,140,876円
私募外国株式パッシブファンド２（適格機関投資家専用）	121,291,247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）	462,370,071円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	25,732,538円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	293,738,782円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	33,905,250円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	65,076,402円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	361,025,252円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	262,627,314円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	196,086,453円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	3,865,478,181円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	430,431,708円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	111,755,233円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	610,499,591円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	13,455,561円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	80,238,028円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	84,275,003円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	253,862,669円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	10,524,384円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	64,642,372円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	185,744,227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）	8,761,901円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 1月26日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,924,541,512	－	9,367,702,342	△556,839,170
合計		9,924,541,512	－	9,367,702,342	△556,839,170

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2022年 1月26日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	994,492,716	－	984,909,395	△9,583,321
	アメリカドル	789,931,296	－	784,361,585	△5,569,711
	ユーロ	157,431,360	－	154,416,360	△3,015,000
	イギリスポンド	47,130,060	－	46,131,450	△998,610
	売建	406,217,723	－	405,688,664	529,059
	アメリカドル	313,494,315	－	313,056,520	437,795
	ユーロ	38,420,586	－	38,338,294	82,292
	イギリスポンド	23,054,340	－	23,072,640	△18,300
	スウェーデンクローナ	11,807,712	－	11,808,000	△288
	デンマーククローネ	12,131,070	－	12,103,210	27,860
	香港ドル	7,309,700	－	7,310,000	△300
合計		1,400,710,439	－	1,390,598,059	△9,054,262

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月26日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	124,547,762
コール・ローン	1,694,640,274

	2022年 1月26日現在
項目	金額（円）
国債証券	146,386,982,896
派生商品評価勘定	937,815
未収利息	938,890,084
前払金	24,799,154
前払費用	31,310,965
差入委託証拠金	261,470,814
流動資産合計	149,463,579,764
資産合計	149,463,579,764
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	49,464,904
未払金	3,153,475
未払解約金	131,589,124
未払利息	2,591
流動負債合計	184,210,094
負債合計	184,210,094
純資産の部	
元本等	
元本	56,733,186,326
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	92,546,183,344
元本等合計	149,279,369,670
純資産合計	149,279,369,670
負債純資産合計	149,463,579,764

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月26日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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。 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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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。

	2022年 1月26日現在
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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。 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。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 1月26日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		56,733,186,326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	2.6313円
	(1万口当たり純資産額)	(26,313円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月26日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2022年 1月26日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 1月26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月27日
期首元本額	55,642,880,509円
期中追加設定元本額	3,988,829,993円
期中一部解約元本額	2,898,524,176円
期末元本額	56,733,186,326円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,025,244,585円
ＤＣ外国債券インデックスファンド	1,921,578,069円
ＤＣ外国債券インデックスファンドＬ	13,940,454,637円
ＤＣバランスファンド３０	881,586,393円
ＤＣバランスファンド５０	911,665,062円
ＤＣバランスファンド７０	210,440,743円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	476,819,051円
外国債券インデックスｅ	1,065,224,854円
インデックスコレクション（外国債券）	8,464,842,368円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	4,624,852,378円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	726,882,938円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	231,642,111円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	4,239,801,585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）	2,663,453,714円
外国債券インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	466,757,648円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	100,911,626円

区分	2022年 1月26日現在
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	475,523,216円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	279,389,751円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	178,750,455円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	300,625,235円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	1,428,528,043円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	586,360,911円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	6,181,680,838円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	354,527,848円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	223,772,042円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	1,572,067,952円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	92,404,142円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	188,430,829円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	96,471,683円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	48,430,816円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	72,280,801円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	228,932,346円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	70,082,152円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	1,381,975,014円
私募外国債券インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	20,794,490円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2022年 1月26日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,669,383,178	－	1,644,584,024	△24,799,154
合計		1,669,383,178	－	1,644,584,024	△24,799,154

(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はありません。

通貨関連

（2022年 1月26日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,534,686,922	－	1,510,958,987	△23,727,935
	アメリカドル	748,986,558	－	739,802,700	△9,183,858
	カナダドル	64,214,770	－	63,081,060	△1,133,710
	ユーロ	614,659,608	－	603,510,607	△11,149,001
	イギリスポンド	106,825,986	－	104,564,620	△2,261,366
合計		1,534,686,922	－	1,510,958,987	△23,727,935

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

２【ファンドの現況】

【インデックスコレクション（バランス株式３０）】

【純資産額計算書】

（2022年 2月28日現在）

Ⅰ　資産総額	132,178,747,100円
Ⅱ　負債総額	111,253,623円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	132,067,493,477円
Ⅳ　発行済口数	77,642,106,951口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7010円
（1万口当たり純資産額）	（17,010円）

【インデックスコレクション（バランス株式５０）】

【純資産額計算書】

（2022年 2月28日現在）

Ⅰ　資産総額	20,007,031,281円
Ⅱ　負債総額	28,573,197円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	19,978,458,084円
Ⅳ　発行済口数	9,208,010,330口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1697円
（1万口当たり純資産額）	（21,697円）

【インデックスコレクション（バランス株式７０）】

【純資産額計算書】

（2022年 2月28日現在）

Ⅰ　資産総額	13,251,432,865円
Ⅱ　負債総額	53,451,332円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	13,197,981,533円
Ⅳ　発行済口数	4,937,980,116口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.6727円
（1万口当たり純資産額）	（26,727円）

（参考）

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 2月28日現在）

Ⅰ　資産総額	286,503,121,042円
Ⅱ　負債総額	716,973,933円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	285,786,147,109円
Ⅳ　発行済口数	133,831,370,038口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1354円
（1万口当たり純資産額）	（21,354円）

日本債券マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 2月28日現在）

Ⅰ　資産総額	393,002,681,919円
Ⅱ　負債総額	9,913,303,993円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	383,089,377,926円
Ⅳ　発行済口数	281,702,466,489口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3599円
（1万口当たり純資産額）	（13,599円）

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 2月28日現在）

Ⅰ　資産総額	313,048,325,411円
Ⅱ　負債総額	1,376,416,586円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	311,671,908,825円
Ⅳ　発行済口数	72,695,877,306口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.2873円
（1万口当たり純資産額）	（42,873円）

外国債券マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 2月28日現在）

Ⅰ　資産総額	148,075,247,644円
Ⅱ　負債総額	312,794,302円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	147,762,453,342円
Ⅳ　発行済口数	56,852,618,481口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5990円
（1万口当たり純資産額）	（25,990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。

①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。

②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。

③受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載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。

④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。

⑤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。

⑥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（2022年 2月28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

①会社の意思決定機構

会社に取締役（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、監査等委員以外の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発します。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。

②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

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2022年 4月26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。

2022年2月28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	536	14,909,551
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	71	247,430
単位型公社債投資信託	55	270,791
合計	662	15,427,772

3【委託会社等の経理状況】

(1)　委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35期事業年度（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。
また、第36期事業年度の中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

	前事業年度 （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）
負債の部		
流動負債		
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
固定負債		
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
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	305	500
その他利益剰余金		
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
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△587	791
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】

（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）
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 （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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	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

（リース取引関係）

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、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を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。

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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。

②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。

③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				
	米ドル	投資有価証券子会社株式	2,819	－	△44
	英ポンド		2,660	－	△67
	カナダドル		6	－	△0
	スイスフラン		35	－	△0
	香港ドル		71	－	△1
	ユーロ		72	－	△0
合計			5,666	－	△114

（注）　1．時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

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	投資有価証券子会社株式			
	売建				
	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おります。

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

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㈱	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
① 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。
② 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㈱	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
① 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。
② 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

中間貸借対照表

（単位：百万円）

	第36期中間会計期間末 （2021年9月30日）
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	18,523
金銭の信託	15,986
未収委託者報酬	9,080
未収運用受託報酬	6,066

その他		5,520
流動資産合計		55,177
固定資産		
有形固定資産	※1	1,024
無形固定資産		5,276
投資その他の資産		
投資有価証券		6,629
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		208
その他		37
投資その他の資産合計		12,511
固定資産合計		18,813
資産合計		73,990
負債の部		
流動負債		
未払金		8,383
未払法人税等		474
賞与引当金		302
その他	※2	1,946
流動負債合計		11,106
固定負債		
退職給付引当金		781
資産除去債務		153
その他		10
固定負債合計		945
負債合計		12,051

（単位：百万円）

	第36期中間会計期間末 （2021年9月30日）
純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	39,182
利益剰余金合計	41,782
株主資本合計	61,022
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	995
繰延ヘッジ損益	△78

評価・換算差額等合計	916
純資産合計	61,938
負債・純資産合計	73,990

中間損益計算書

（単位：百万円）

		第36期中間会計期間 （自　2021年4月1日 至　2021年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		20,978
運用受託報酬		5,746
その他営業収益		201
営業収益合計		26,925
営業費用		15,801
一般管理費	※1	5,504
営業利益		5,620
営業外収益	※2	971
営業外費用	※3	1,067
経常利益		5,525
特別損失		120
税引前中間純利益		5,404
法人税、住民税及び事業税		1,663
法人税等調整額		19
法人税等合計		1,683
中間純利益		3,721

中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日　至 2021年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	－	－	－
当中間期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

当中間期変動額					
剰余金の配当			△2,797	△2,797	△2,797
中間純利益			3,721	3,721	3,721
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	－	－	923	923	923
当中間期末残高	500	2,100	39,182	41,782	61,022

	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	791	△65	726	60,824
当中間期変動額				
剰余金の配当				△2,797
中間純利益				3,721
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	203	△13	190	190
当中間期変動額合計	203	△13	190	1,114
当中間期末残高	995	△78	916	61,938

重要な会計方針

第36期中間会計期間
（自　2021年4月1日
至　2021年9月30日）

1．資産の評価基準及び評価方法
有価証券
子会社株式
移動平均法による原価法によっております。
その他有価証券
市場価格のない株式等以外のもの
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。）
市場価格のない株式等
移動平均法による原価法によっております。

2．デリバティブの評価基準及び評価方法
時価法によっております。

3．金銭の信託の評価基準及び評価方法
時価法によっております。

4．固定資産の減価償却の方法
(1) 有形固定資産
定額法によっております。
(2) 無形固定資産
定額法によっております。
ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法

によっております。

5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用　　：発生事業年度に損益処理

数理計算上の差異　：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間会計期末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

7．収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(3) 投資助言業務

当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(4) 成功報酬

当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

8．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、ヘッジ対象は子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。

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。

（会計方針の変更）

第36期中間会計期間 （自　2021年4月1日 至　2021年9月30日）
１．「収益認識に関する会計基準」の適用 「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号　2020年3月31日。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。この変更が中間財務諸表に与える影響はありません。 ２．「時価の算定に関する会計基準」の適用 「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号　2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号　2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。この変更が中間財務諸表に与える影響はありません。

（追加情報）

第36期中間会計期間 （自　2021年4月1日 至　2021年9月30日）
退職給付債務及び費用の算定方法の変更 従来、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末の自己都合要支給額を退職給付とする方法を用いた簡便法を適用しておりましたが、対象となる従業員数の増加に伴い、当中間会計期間より原則法による計算を併用しております。これにより、退職給付引当金が120百万円増加し、同額を退職給付費用として特別損失に計上しております。 なお、退職給付見込額の各期間への帰属方法などについては、重要な会計方針　６．引当金の計上基準（2）退職給付引当金をご参照ください。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第36期中間会計期間末 （2021年9月30日）
※1　有形固定資産の減価償却累計額　591百万円 ※2　仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

第36期中間会計期間 （自　2021年4月1日 至　2021年9月30日）
※1　減価償却実施額 有形固定資産　90百万円 無形固定資産　376百万円 ※2　営業外収益の主要項目 金銭の信託運用益　738百万円 投資有価証券償還益　219百万円 ※3　営業外費用の主要項目 デリバティブ費用　1,012百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）
第36期中間会計期間（自 2021年4月1日　至 2021年9月30日）
１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式　（株）	3,000	－	－	3,000

２．配当に関する事項
配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

（金融商品関係）
第36期中間会計期間末（2021年9月30日）
金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項
　中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格のない非上場株式及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31 号 2019年7月4日）第26 項に従い経過措置を適用した投資信託は、次表には含まれておりません。

　また、金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。
　　レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価
　　レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
　　レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価
　時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先度が最も低いレベルに時価を分類しております。

（１）時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

区　分	中間貸借対照表計上額（百万円）（*1、*2）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計

金銭の信託(*3)	1,051	1,296	－	2,347
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	242	(103)	－	138
ヘッジ会計が適用されているもの	－	(79)	－	(79)
デリバティブ取引計	242	(183)	－	58

(*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)投資有価証券は当社が直接保有する投資信託であり、上記に含めておりません。当該投資有価証券の中間貸借対照表計上額は6,629百万円であります。
(*3)金銭の信託の信託財産のうち、投資信託は上記に含めておりません。投資信託（中間貸借対照表計上額13,639百万円）も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は15,986百万円であります。
(*4)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。

（２）時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債
現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明
金銭の信託
金銭の信託の信託財産のうち、上場有価証券は市場価格を用いて評価しております。当該有価証券は活発な市場で取引されているため、その時価をレベル1の時価に分類しております。また、金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。
デリバティブ取引
株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

（注２）市場価格のない非上場株式の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。
（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
子会社株式	5,636

（有価証券関係）
第36期中間会計期間末（2021年9月30日）
１．子会社株式
市場価格のある子会社株式はありません。
なお、市場価格のない子会社株式の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。
(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

２．その他有価証券
(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額

貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	5,034	3,583	1,451
小計	5,034	3,583	1,451
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,595	1,611	△16
小計	1,595	1,611	△16
合計	6,629	5,195	1,434

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額0百万円）は、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第36期中間会計期間（自　2021年4月1日　至　2021年9月30日）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	4,614	－	△98	△98
	英ポンド	260	－	1	1
	カナダドル	81	－	△1	△1
	スイスフラン	98	－	△0	△0
	香港ドル	177	－	△3	△3
	ユーロ	497	－	△1	△1
合計		5,729	－	△103	△103

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(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	19,350	－	242	242
合計		19,350	－	242	242

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)

原則的処理方法	為替予約取引 売建 米ドル 英ポンド カナダドル スイスフラン 香港ドル ユーロ 人民元	投資有価証券 子会社株式	 4,438 3,125 4 78 120 115 16	 － － － － － － －	 △94 17 △0 △0 △2 △0 △0
合計			7,900	－	△79

（収益認識関係）

第36期中間会計期間（自　2021年4月1日　至　2021年9月30日）

１．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

２．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針７．収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

３．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第36期中間会計期間（自　2021年4月1日　至　2021年9月30日）

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

（関連情報）

第36期中間会計期間（自　2021年4月1日　至　2021年9月30日）

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

(1)営業収益

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

(2)有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,205百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド（*）	3,454百万円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第36期中間会計期間（自　2021年4月1日　至　2021年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）
第36期中間会計期間（自　2021年4月1日　至　2021年9月30日）
該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）
第36期中間会計期間（自　2021年4月1日　至　2021年9月30日）
該当事項はありません。

（１株当たり情報）

第36期中間会計期間 （自　2021年4月1日 至　2021年9月30日）
1株当たり純資産額　20,646,304円65銭 1株当たり中間純利益　1,240,458円75銭 なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第36期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）
中間純利益	3,721百万円
普通株式に係る中間純利益	3,721百万円
普通株主に帰属しない金額	―
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）
該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常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

2022年 4月26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

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2021年3月末日現在）

③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
三井住友信託銀行株式会社	342,037	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【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

①名称　　：株式会社日本カストディ銀行

②設立年月日　：2000年6月20日

③資本金の額　：51,000百万円（2021年3月末日現在）

④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。

⑤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。

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤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みます。）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
業務執行社員　　公認会計士　藤　澤　　孝　　印

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　竹　内　知　明　　印

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じ

て、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

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

２．ＸＢＲＬ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9月24日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　中島紀子　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式３０）の2020年7月28日から2021年7月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスコレクション（バランス株式３０）の2021年7月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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．ＸＢＲＬ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9月24日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　中島紀子　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式５０）の2020年7月28日から2021年7月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスコレクション（バランス株式５０）の2021年7月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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．ＸＢＲＬ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9月24日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　中島紀子　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式７０）の2020年7月28日から2021年7月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスコレクション（バランス株式７０）の2021年7月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年12月１日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　三　上　和　彦

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　藤　澤　　孝

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年４月１日から2022年３月31日までの第36期事業年度の中間会計期間（2021年４月１日から2021年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年４月１日から2021年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

（注）１．上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年3月25日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　後藤知弘　印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式３０）の2021年7月27日から2022年1月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、インデックスコレクション（バランス株式３０）の2022年1月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年7月27日から2022年1月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

・　不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

（注）１．上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年3月25日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　後藤知弘　印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式５０）の2021年7月27日から2022年1月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、インデックスコレクション（バランス株式５０）の2022年1月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年7月27日から2022年1月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

・　不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

（注）１．上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年3月25日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　後藤知弘　印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式７０）の2021年7月27日から2022年1月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、インデックスコレクション（バランス株式７０）の2022年1月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年7月27日から2022年1月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

・　不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

（注）１．上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。