

【表紙】	
【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2022年5月20日
【計算期間】	第10期 自 2021年2月23日 至 2022年2月21日
【ファンド名】	A M C /ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）
【発行者名】	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 高村 孝
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目23番1号
【事務連絡者氏名】	菅野 真人
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目23番1号
【電話番号】	03-4530-7171
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【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】

当ファンドは、株式会社トータルアセットデザインが算出した資産配分に基づき、日本および世界主要国の株式や公社債等を主要投資対象とする資産別のインデックス型マザーファンド受益証券への投資を通じて、中長期的に「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」に連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。

委託会社は、受託会社と合意のうえ、2兆円を限度として信託金を追加できるものとします。また委託会社は、受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

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)	補足分類
単位型	国 内	株 式	インデックス型
追加型	海 外	債 券	
	内 外	不動産投信 その他資産 () 資産複合	
			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。

■ 当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型	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います。
投資対象地域	内外	目論見書又は信託約款において、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います。
投資対象資産 (収益の源泉)	資産複合	目論見書又は信託約款において、株式、債券、不動産投信及びその他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います。
補足分類	インデックス型	目論見書又は信託約款において、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
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり ()	日経 225
	年2回	日本			
	年4回	北米			
債券 一般 国債 社債	年6回 (隔月)	欧州			
		アジア			

その他債券 クレジット属性 （ ）	年12回 （毎月）	オセアニア			TOPIX
不動産投信	日々	中南米			
	その他 （ ）	アフリカ	ファンド・ オブ・ファンズ	なし	その他 （AMCリスク バジェット型 資産配分モデル 指数）
その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株式、 債券）、資産配分変 更型））		中近東 （中東）			
資産複合 資産配分固定型 資産配分変動型		エマージング			

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

（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。

■ 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）、資産配分変更型））	目論見書又は信託約款において、株式、債券、不動産投資以外の資産に投資する旨の記載があるものをいい、括弧内の記載は、組入資産を表します。
決算頻度	年1回	目論見書又は信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を含む）	目論見書又は信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産（日本を含む）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書又は信託約款において、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います。
為替ヘッジ	なし	目論見書又は信託約款において、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います。
対象インデックス	その他（AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数）	「その他」とは日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

ファンドの特色

- 1 株式会社トータルアセットデザインが算出した資産配分に基づき、マザーファンドの配分を行います。**
日本および世界主要国の株式や公社債等、運用資産全体のリスク（＝収益のブレ）総量をバジェット化することにより、株式会社トータルアセットデザインが決定した資産配分に基づき、資産別のインデックス型マザーファンドの配分を行います。なお、資産配分は定期的に見直しが行われます。
- <株式会社トータルアセットデザインの概要>**
1998年2月に設立され、年金基金ならびに金融機関等の資産運用について、資産配分の策定・運用機関の選択と配分構成・リスク管理に至るまで、トータルなコンサルティングサービスを提供しています。なお、2015年1月29日付にて、株式会社イー・エム・シーは、株式会社トータルアセットデザインに社名変更されました。
- 2 マザーファンドは、それぞれのベンチマークに連動した投資成果の獲得を目指し、当ファンドは、「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」に連動した投資成果の獲得を目指します。**
※AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数は、株式会社トータルアセットデザインが決定した資産配分に基づき、投資対象とするマザーファンドのベンチマークのリターンを合成した指数であり、当ファンドの投資成果の比較基準となるベンチマークとします。
投資対象とするマザーファンドのベンチマークについては「マザーファンドの概要」をご参照ください。
- 3 実質的に保有する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。**
※投資対象国の通貨と円との間の為替変動により基準価額は変動します。

投資対象とするマザーファンドの概要

日本株式インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、TOPIX(東証株価指数配当込み)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	日本の取引所に上場されている株式
投資態度	・ TOPIX（東証株価指数配当込み）をベンチマークとします。 ・ 株式の組入比率は、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。

※TOPIX(東証株価指数配当込み)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。

日本債券インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、NOMURA-BPI総合指数の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	わが国の公社債等
投資態度	・ NOMURA-BPI総合指数をベンチマークとします。 ・ 債券組入比率は原則として高位を維持します。

※NOMURA-BPI総合指数は、日本の国債、事業債(社債)、地方債、政府保証債等の固定利付債券で構成される債券価格指数です。

外国株式インデックス・オープン・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、MSCI コクサイ指数(円ベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	日本を除く世界の取引所に上場されている株式(これに準ずるものを含みます。)
投資態度	・ MSCI コクサイ指数(円ベース)をベンチマークとします。 ・ 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。 ・ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

※MSCI コクサイ指数は、日本を除く世界の主要先進国の株式で構成される株価指数であり、投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。

外国債券インデックス・マザー・ファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等
投資態度	・ FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとします。 ・ 公社債への投資は原則として高位を維持します。 ・ 外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。

※FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、日本を除く世界の主要国の国債で構成される債券価格指数であり、投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。

■ ベンチマーク(オリジナル指数)

以下に掲げるベンチマークは、マザーファンドのベンチマークです。

TOPIX(東証株価指数配当込み)

- ① TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」と言います。)の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利はJPXが有します。
- ② JPXは、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- ③ JPXは、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ JPXは、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤ 当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥ JPXは、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。
- ⑦ JPXは、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社または当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- ⑧ 上記に限らず、JPXは当ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

NOMURA-BPI総合指数

NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。また、野村證券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

MSCI コクサイ指数

MSCI コクサイ指数は、MSCI Inc.の登録商標です。

当ファンドは、MSCI Inc.(以下、「MSCI」といいます。)、MSCIの関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者(以下、総称して「MSCI関係者」といいます。))が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数はMSCIが独占的に所有しています。MSCIおよびMSCI指数は、MSCIおよびその関連会社のサービスマークであり、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社(以下、「SSGA」といいます。))は特定の目的のためにその使用を許諾されています。MSCI関係者は、当ファンドの所有者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIおよびその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、当ファンドまたは当ファンドの発行者(SSGA)、所有者あるいはいかなる個人または法人に関わらず、MSCIにより決定、作成、計算されています。MSCI関係者は、MSCI指数の決定、作成、あるいは計算において、当ファンドの発行者(SSGA)、所有者あるいはいかなる個人または法人の要求を考慮にいれる義務は一切ありません。MSCI関係者は、当ファンドの発行時期、発行価格または発行数量の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI関係者は、当ファンドの発行者(SSGA)、所有者あるいはいかなる個人または法人に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI関係者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。MSCI関係者は、明示的にも黙示的にも、当ファンドの発行者(SSGA)、所有者あるいはいかなる個人または法人が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について、保証を行うものではありません。MSCI関係者は、MSCI指数およびそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。MSCI指数およびそれに含まれるデータに関し、MSCI関係者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI関係者は、特定目的のための市場性および適切性について、何ら保証しないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害(逸失利益を含む。)につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI関係者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、または所有者あるいはいかなる個人または法人は、MSCIの許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを保証、推奨、売買、または宣伝するためにいかなるMSCIのトレードネーム、トレードマーク、またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCIの書面による許諾を得ることなくMSCIとの関係を一切主張することはできません。

FTSE世界国債インデックス(除く日本)

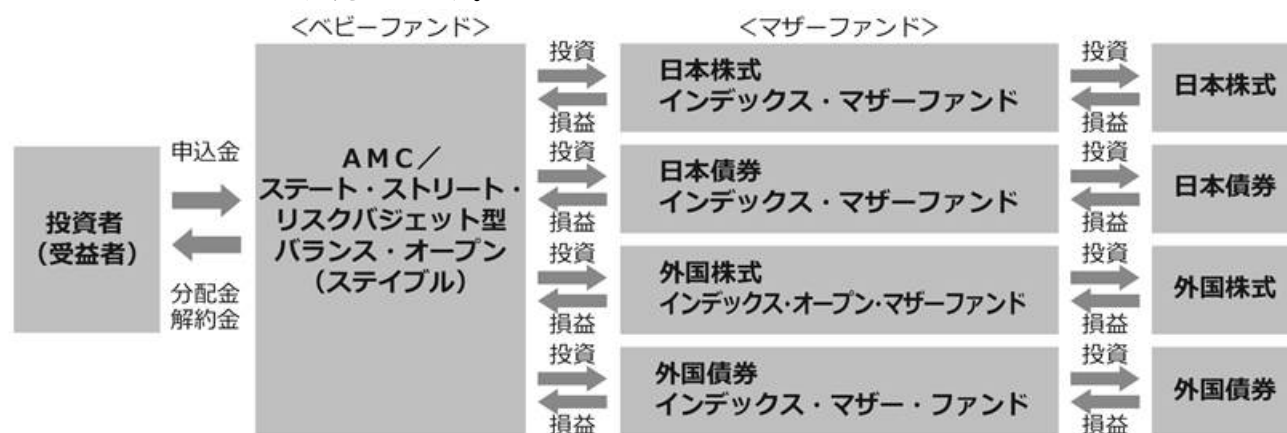
FTSE世界国債インデックス(除く日本)(以下、「WGBI」といいます。))は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、当ファンドのスポンサーではなく、当ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。WGBIのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。WGBIに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(2)【ファンドの沿革】

2012年3月9日 投資信託契約締結、設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】

当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金をマザーファンドの受益証券に投資して、その実質的な運用を行う仕組みです。また、マザーファンドの損益はすべてベビーファンドに還元されます。



各マザーファンドには、当ファンド以外にも、当該各マザーファンドに投資する他のファンド（ベビーファンド）があります。

ファンドの関係法人

ファンドの関係法人は以下のとおりです。

- 1）ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます。）

委託会社は、信託財産の運用指図、目論見書および運用報告書の作成等を行います。

- 2）三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）

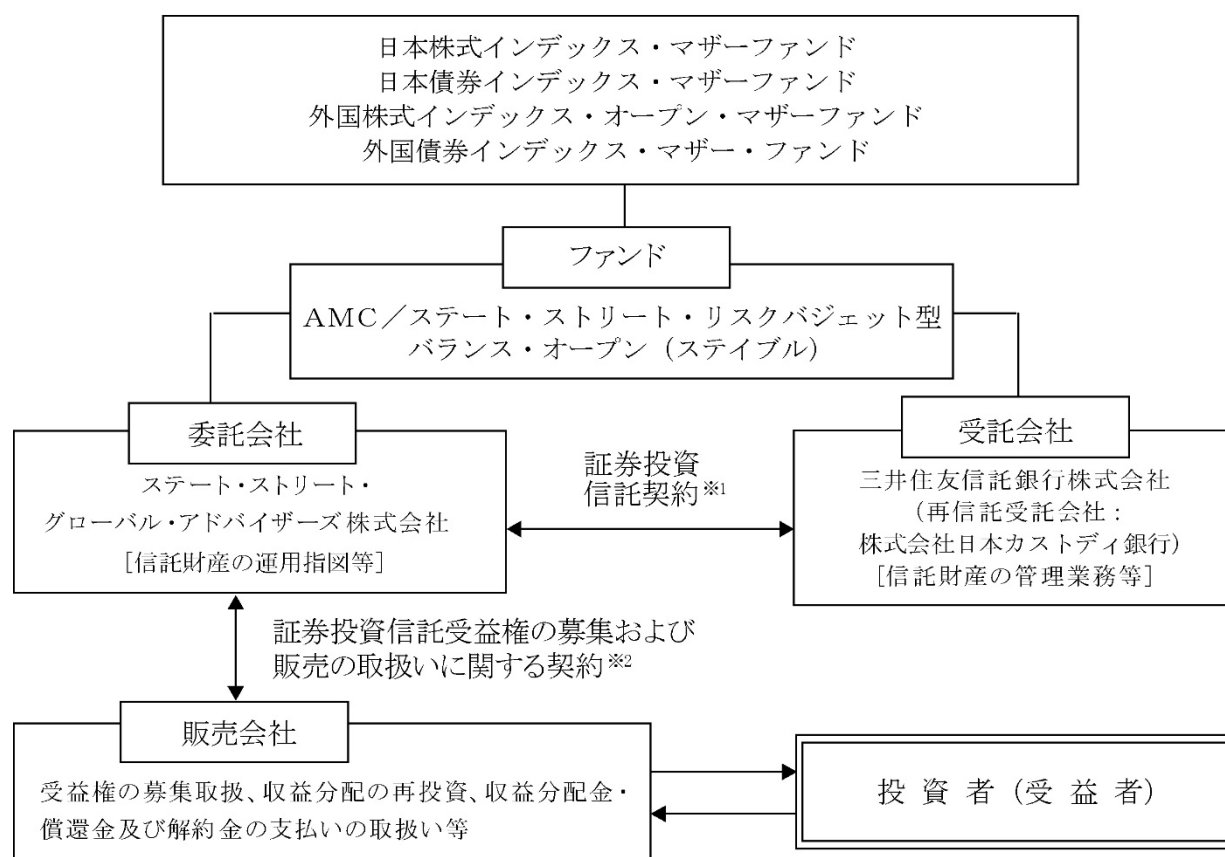
（再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行）

受託会社は、信託財産の管理業務、信託財産の計算等を行います。また、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。

- 3）販売会社

販売会社は、受益権の募集の取扱い、販売、一部解約の実行の請求の受付けならびに収益分配金、一部解約代金および償還金の支払い等を行います。

ファンド関係法人



1 証券投資信託契約

委託会社、受託会社および受益者に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益権に関する事項ならびに信託の元本および収益の管理ならび運営に関する事項等が定められます。

なお、ファンドは、委託会社と受託会社とが証券投資信託契約を締結することにより成立します。証券投資信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づき、あらかじめ監督官庁に届け出た信託約款の内容に基づいて締結されます。

2 証券投資信託受益権の募集および販売に関する契約

販売会社の募集の取扱い、換金の取扱い、償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められます。

委託会社の概況（本書提出日現在）

1）資本金の額

3 億 1 千万円

2）沿革

1998年 2 月25日	ステート・ストリート投資顧問株式会社 設立
1998年 3 月31日	投資顧問業の登録
1998年 8 月28日	ステート・ストリート投信投資顧問株式会社に商号変更
1998年 9 月30日	投資一任契約に係る業務の認可
1998年 9 月30日	証券投資信託の委託会社としての認可取得
2007年 9 月30日	金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第345号）
2008年 7 月 1 日	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社に商号変更

3）大株主の状況

氏名又は名称	住所	所有株式数	所有比率
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社	東京都港区虎ノ門一丁目23番1号虎ノ門ヒルズ森タワー	6,200株	100%

2【投資方針】

（１）【投資方針】

当ファンドは、株式会社トータルアセットデザインが算出した資産配分に基づき、日本および世界主要国の株式や公社債等を主要投資対象とする資産別のインデックス型マザーファンド受益証券への投資を通じて、中長期的に「ＡＭＣリスクバジェット型資産配分モデル指数」に連動した投資成果を目指して運用を行います。

株式会社トータルアセットデザインが、日本および世界主要国の株式や公社債等、運用資産全体のリスク（＝収益のブレ）総量をバジェット化することにより決定した資産配分に基づき、各資産のベンチマークのリターンを合成した指数で、資産配分は定期的に見直しが行われます。

「日本株式インデックス・マザーファンド」、「日本債券インデックス・マザーファンド」、「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」および「外国債券インデックス・マザー・ファンド」（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）を主要投資対象とします。

「ＡＭＣリスクバジェット型資産配分モデル指数」をベンチマークとします。

各マザーファンド受益証券のベンチマークは下記の通りで、各マザーファンド受益証券においては、それぞれのベンチマークに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行います。

日本株式インデックス・マザーファンド

[ベンチマーク：TOPIX（東証株価指数配当込み）]

日本債券インデックス・マザーファンド

[ベンチマーク：NOMURA - BPI総合指数]

外国株式インデックス・オープン・マザーファンド

[ベンチマーク：MSCI コクサイ指数（円ベース）¹]

外国債券インデックス・マザー・ファンド

[ベンチマーク：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）²]

¹ MSCIコクサイ指数の構成国の国別指数および構成通貨の通貨別指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出したものです。

² FTSE世界国債インデックス（除く日本）の構成通貨の通貨別指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出したものです。

マザーファンド受益証券の組入に伴う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。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記（５）の3）4）5）に定めるものに限ります。以下同じ。）を行うことができます。

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、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、また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。

大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場

合には、上記のような運用が行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 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。）

- （a）有価証券
- （b）デリバティブ取引に係る権利
- （c）金銭債権
- （d）約束手形

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

- （a）為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

委託会社は、信託金を、主としてステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社を委託会社とし、三井住友信託銀行株式会社を受託会社として締結された「日本株式インデックス・マザーファンド」、「日本債券インデックス・マザーファンド」、「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」および「外国債券インデックス・マザー・ファンド」（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）および次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券（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) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券（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。）および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14) 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

- 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または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 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) 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
- 20) 外国の者に対する権利で19)の有価証券の性質を有するもの
- 21) 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。）
- 22) 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。）

なお、1)の証券または証書、12)および17)の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券ならびに12)および17)の証券または証書のうち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、13)の証券および14)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

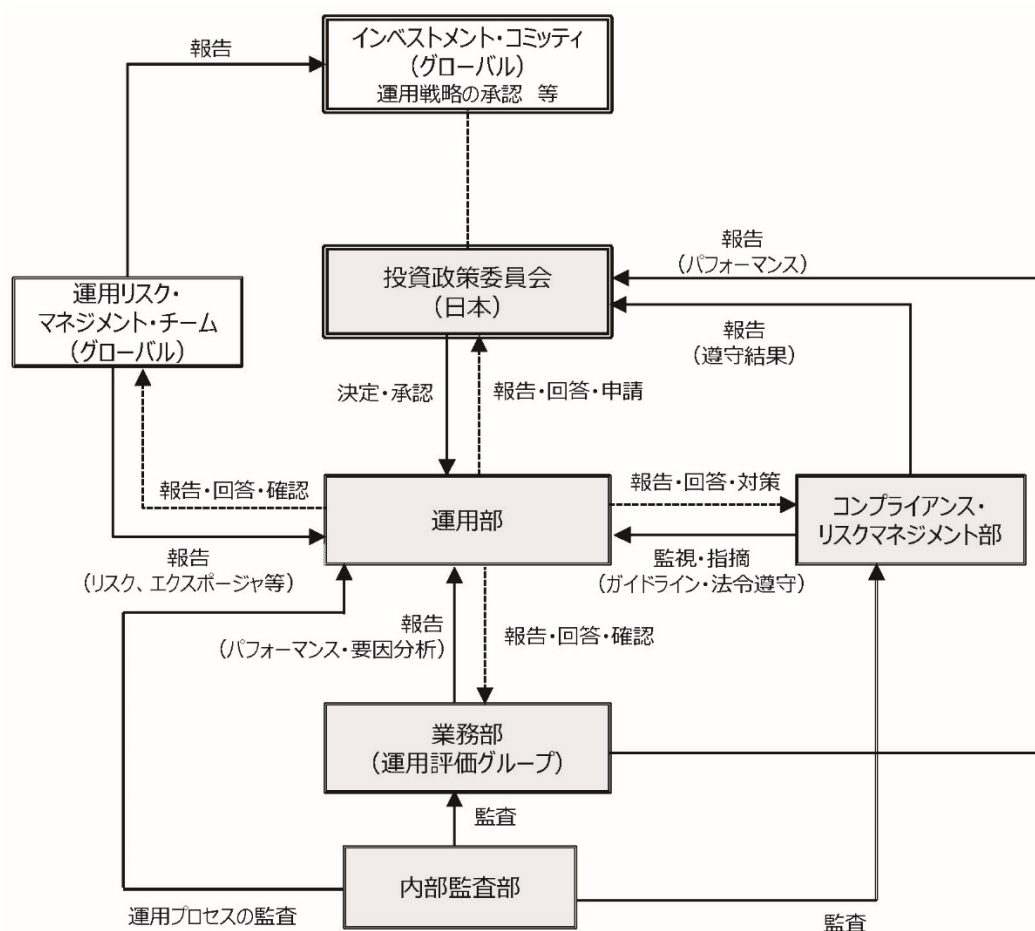
- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形

上記 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、上記 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。

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券（取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。以下同じ。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

上記 において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド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投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(3) 【運用体制】



委託会社において、運用部の各ファンド担当者がそのポートフォリオ管理・運用を行っています。運用モデル／プロセスは基本的に、グループ会社、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・トラスト・カンパニー（所在地：アメリカ合衆国マサチューセッツ州ボストン市）を中心とした各運用戦略グループ全体で共通のものを使用し、またモデルの改善、運用パフォーマンス、市場環境に関する情報などについて海外運用拠点と十分なコミュニケーションをとることによって、質の高い運用サービスの提供を目指しています。

ファンド担当者は、いずれも国内外の有価証券市場に精通した経験豊富な投資運用の専門家であり、資産クラス・運用戦略ごとの運用チームに配置されています。また、チーム・アプローチによって運用を行うため、特定の担当者に依存することない安定した運用体制となっています。

運用の報告は、投資政策委員会に対してなされます。投資政策委員会は、チーフ・インベストメント・オフィサー、各運用戦略責任者、業務部の代表等により構成されています。投資政策委員会においては、各ファンドのパフォーマンス、ガイドラインに対する適合性、同一戦略のファンド間でのパフォーマンスの乖離状況等の報告を受けます。

グローバルには、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ (SSGA) のグローバル組織である運用リスク・マネジメント・チームが、ポートフォリオの運用リスクモニタリングを定期的に行っています。当チームは運用チームとは独立した組織で、SSGAグローバルのチーフ・リスク・オフィサーに直接報告を行っており、ポートフォリオが顧客のガイドラインや運用戦略に即したリスクをとっているか、また目標リターンに見合ったリスクをとっているか、リスクに対する寄与が意図したエクスポージャーによるものか否か等、運用戦略の中身に実質的にフォーカスしたかたちでモニタリングを行い、その結果は継続的に運用担当チームにフィードバックされています。

当チームが行った戦略代表口座の分析結果は、インベストメント・コミッティ (グローバル) およびグローバルの運用戦略責任者によってレビューされています。

上記運用体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として2月20日。ただし、該当日が休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利子、配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の範囲内とします。

分配金額は、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、分配対象金額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

なお、上記は収益分配方針であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

< 収益分配金に関する留意事項 >

- ・ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- ・ 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・ 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

（５）【投資制限】

信託約款の「運用の基本方針」に定める主な投資制限

- 1) マザーファンド受益証券の投資割合には制限を設けません。
- 2) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）の実質投資割合には制限を設けません。
- 3) 公社債の実質投資割合には制限を設けません。
- 4) 外貨建資産の実質投資割合には制限を設けません。
- 5) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）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。
- 6) デリバティブ取引は、後記の3)4)5)の範囲で行います。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

信託約款上のその他の投資制限

- 1) 投資する株式等の範囲（信託約款第18条）

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、または取引所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（上場予定または登録予定の株式、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または登録されることが確認できるものを含みます。）とします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。

2) 信用取引の指図範囲（信託約款第19条）

- (a) 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り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (b) 上記(a)の信用取引の指図にあたっては、当該売り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り付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- (c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の売り付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- (d) 上記(b)においてマザーファンドの信託財産に属する当該売り付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド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り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。
- (e) 委託会社は、上記(a)の取引を行うにあ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。

3) 先物取引等の運用指図（信託約款第20条）

- (a) 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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の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。）。)
- (b) 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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (c) 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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の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。

4) スワップ取引の運用指図（信託約款第21条）

- (a) 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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

- (b) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として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可能なものについてはこの限りではありません。
 - (c) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち当該信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少してスワップ取引の想定元本の合計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スワップ取引の一部解約を指図するものとします。
 - (d) 上記(c)においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の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信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
 - (e) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。
 - (f) 委託会社は、スワップ取引を行うにあ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。
- 5) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（信託約款第22条）
- (a) 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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引およ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。
 - (b) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として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。
 - (c) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。
 - (d) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあ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。
- 6) 有価証券の貸付の指図および範囲（信託約款第23条）
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券を貸付けることの指図をすることができます。
 - (b) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって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。
- 7) 公社債の空売りの指図範囲（信託約款第24条）
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引渡しまた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。
 - (b) 上記(a)の売り付けの指図にあたっては、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - (c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- 8) 公社債の借入れ（信託約款第25条）

- (a) 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あ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。
- (b) 上記(a)の指図にあたっては、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。
- (c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)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り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。
- (d) 上記(a)の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- 9) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款第26条）
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 10) 外国為替予約取引の指図および範囲（信託約款第27条）
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産の額と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との合計額についての為替変動リスクを回避するため、もしくはベンチマークとの連動性を維持するため、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。
- (b) 上記(a)の予約取引の指図は、原則として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の額と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との合計額の為替変動リスクを回避するため、もしくはベンチマークとの連動性を維持するための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。
- (c) 上記(b)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。
- (d) 上記(a)および(b)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド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。
- 11) デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第22条の2）
- 委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則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。
- 法令に基づく投資制限
- 1) 同一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第9条）
- 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すべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に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、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- 2) デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）
- 委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定め

た合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

（参考）「日本株式インデックス・マザーファンド」の概要

当ファンドが主たる投資対象とする「日本株式インデックス・マザーファンド」の概要は、以下の通りです。

（１）投資方針

この投資信託は、中長期的な観点から、TOPIX（東証株価指数配当込み）に連動した投資成果を目指して運用を行います。

日本の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

TOPIX（東証株価指数配当込み）をベンチマークとします。

株式の組入比率は、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、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および金利に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）および金利先渡取引を行うことができます。

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむをえない事情が発生した場合には、上記のような運用が行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

（２）投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託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。

１）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。）

- （a）有価証券
- （b）デリバティブ取引に係る権利
- （c）金銭債権
- （d）約束手形

２）次に掲げる特定資産以外の資産

- （a）為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- １）株券または新株引受権証書
- ２）国債証券
- ３）地方債証券
- ４）特別の法律により法人の発行する債券

- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券（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) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券（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。）および新株予約権証券
- 12) 投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 13) 投資証券もしくは投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 16) 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
- 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 18) 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。）

なお、1)の証券または証書、15)の証書のうち1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券、15)の証書のうち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、12)の証券および13)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、上記に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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。）
- 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

上記の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、上記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。

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

信用取引の指図は、信託約款第15条の範囲で行います。

有価証券先物取引等は、信託約款第16条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第17条の範囲で行います。

金利先渡取引は、信託約款第18条の範囲で行います。

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第18条の2）

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則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。

（参考）「日本債券インデックス・マザーファンド」の概要

当ファンドが主たる投資対象とする「日本債券インデックス・マザーファンド」の概要は、以下の通りです。

（１）投資方針

この投資信託は、中長期的な観点から、NOMURA-BPI総合指数に連動した投資成果を目指して運用を行います。

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

NOMURA-BPI総合指数をベンチマークとします。

債券組入比率は原則として高位を維持します。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、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および金利に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）ならびに金利先渡取引を行うことができます。

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、上記のような運用が行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

（２）投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託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。

１）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。）

（a）有価証券

（b）デリバティブ取引に係る権利

（c）金銭債権

（d）約束手形

2）次に掲げる特定資産以外の資産

（a）為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1）株券または新株引受権証券
- 2）国債証券
- 3）地方債証券
- 4）特別の法律により法人の発行する債券
- 5）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6）特定目的会社に係る特定社債券（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）協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9）特定目的会社に係る優先出資証券（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。）および新株予約権証券
- 12）投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 13）投資証券もしくは投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 14）オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、）
- 15）預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 16）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
- 17）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、）
- 18）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。）

なお、1）の証券または証書、15）の証書のうち1）の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2）から6）までの証券、15）の証書のうち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、12）の証券および13）の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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

上記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、上記 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。

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

（３）主な投資制限

公社債の投資割合には制限を設けません。

株式への投資は、転換社債の転換請求および新株予約権（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号および第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、）の行使により取得可能なものに限り、実質的投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等は、信託約款第15条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第16条の範囲で行います。

金利先渡し取引は、信託約款第17条の範囲で行います。

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第17条の2）

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則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。

（参考）「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の概要

当ファンドが主たる投資対象とする「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の概要は、以下の通りです。

（１）投資方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式を投資対象とし、中長期的に日本を除く世界の主要国の株式市場（MSCIコクサイ指数）の動きに連動した投資成果の獲得をめざして運用を行う事を基本とします。

日本を除く世界各国の取引所上場株式（これに準ずるものを含みます。）を主要投資対象とします。

株式への投資にあたっては、日本を除く世界各国の株式（これに準ずるものを含みます。）を主要投資対象とし、MSCIコクサイ指数に連動した投資成果をめざして運用を行います。

株式の組入率は、原則として高位を維持します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

信託財産に属する資産の価格変動および金利変動により生じるリスク（為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれを行う。以下同じ。）を減じるため、ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実

現するために限定して、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、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および金利に係るオプション取引なら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およ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。

信託財産に属する資産の価格変動および金利変動により生じるリスクを減じるため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

（２）投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託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。

１）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。）

- （ａ）有価証券
- （ｂ）デリバティブ取引に係る権利
- （ｃ）金銭債権
- （ｄ）約束手形

２）次に掲げる特定資産以外の資産

- （ａ）為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- １）株券または新株引受権証書
- ２）国債証券
- ３）地方債証券
- ４）特別の法律により法人の発行する債券
- ５）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- ６）コマーシャル・ペーパー
- ７）新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- ８）外国または外国の者の発行する証券または証書で、１）から７）までの証券または証書の性質を有するもの
- ９）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号定めるものをいいます。）
- 10）投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（クローズド・エンド型の会社型外国投資信託証券を除きます。以下同じ。）（金融商品取引法第2条第1項第11号定めるものをいいます。）
- 11）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。）
- 12）外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 13）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
- 14）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。）
- 15）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。）

なお、１）の証券または証書および８）の証券または証書のうち１）の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、２）から５）までの証券および８）の証券または証書のうち２）から５）までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。また、９）または１０）の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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

上記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託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 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。

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の１００分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

（３）主な投資制限

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には制限を設けません。

投資信託証券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。

同一銘柄の株式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。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は信託約款第１７条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第１８条の範囲で行います。

金利先物取引及び為替先渡取引は、信託約款第１９条の範囲で行います。

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第１９条の２）

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則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。

（参考）「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の概要

当ファンドが主たる投資対象とする「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の概要は、以下の通りです。

（１）投資方針

この投資信託は、主として日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象とし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指して運用を行います。

日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象とします。

公社債への投資は原則として高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、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、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および金利に係るオプション取引なら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および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。その際の実質投資比率は、原則として信託財産の純資産総額の100%以内とします。また、実質投資比率がこの上限を超過した場合には、速やかに調整するものとします。なお、ここでいう実質投資比率は、現物資産の時価総額と有価証券先物等の買建玉の時価総額の合計額から売建玉の時価総額を差引いた額の、純資産総額に対する比率をいいます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。

資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては上記の運用ができないことがあります。

（２）投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託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。

- １）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。）
 - （ａ）有価証券
 - （ｂ）デリバティブ取引に係る権利
 - （ｃ）金銭債権
 - （ｄ）約束手形
- ２）次に掲げる特定資産以外の資産
 - （ａ）為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- １）株券または新株引受権証書
- ２）国債証券
- ３）地方債証券
- ４）特別の法律により法人の発行する債券
- ５）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- ６）特定目的会社に係る特定社債券（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）協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券（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。）および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14) 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 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または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 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) 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
- 20) 外国の者に対する権利で19) の有価証券の性質を有するもの。
- 21) 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。）
- 22) 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。）

なお、1) の証券または証書、12) および17) の証券または証書のうち1) の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2) から6) までの証券ならびに12) および17) の証券または証書のうち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、13) の証券および14) の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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

上記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、上記 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。

委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

（3）主な投資制限

公社債の投資割合には制限を設けません。

株式への投資は、転換社債、ならびに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

および第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。)の転換による取得に限り、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下としま
す。

有価証券先物取引等は、信託約款15条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款16条の範囲で行います。

金利先渡取引及び為替先渡取引は、信託約款17条の範囲で行います。

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第17条の2）

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則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【投資リスク】

（１）ファンドのリスク特性

当ファンドは、主にマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本および世界主要国の株
式や公社債等に分散投資を行いますが、主として以下に掲げる要因等により基準価額が大きく変動す
る場合があります、その運用成果（損益）はすべて投資者の皆さまに帰属します。

したがって、投資者の皆さま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。

なお、投資信託は預貯金とは異なります。

当ファンドの主なリスクおよび留意点は以下のとおりですが、当ファンドのリスクおよび留意点を完
全に網羅しておりませんのでご注意ください。また、ファンドのリスクは以下に限定されるものでは
ありません。

資産配分リスク

当ファンドは、国内外の株式や公社債等、運用資産全体のリスク（＝収益のブレ）総量をバジェット
化することにより、市場環境に応じて決定した最適な資産配分比率に変更する運用を行います。この
資産配分がファンドの収益の源泉となる場合もありますが、投資対象資産が予期しない値動きをした
場合、損失を被る可能性があります。

株価変動リスク

当ファンドは、日本および世界主要国の株式を実質的な投資対象としていることから、株式の投資に
係る価格変動リスクを伴います。一般に、株式の価格は、個々の企業の活動および業績、経営方針、なら
びに法令順守の状況等に反応して変動するほか、投資対象国の経済情勢および景気見通し、ならびに
金利変動、為替相場およびそれらの見通し等にも反応して変動します。したがって、マザーファンドに
組み入れられる株式の価格は短期的または長期的に下落する可能性があります。

信用リスク

当ファンドは、日本および世界主要国の株式や公社債等を実質的な投資対象としていることから、株
式の発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ること
があります。また公社債等の価格は、公社債等の発行体の経営・財務状況の変化およびそれらに関す
る外部評価の変化等、信用状況によって変動し、特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および
償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはでき

なくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともあります。）。したがって、このような状態が生じた場合には、当ファンドが実質的に保有する株式や公社債等の価格が下落し、基準価額が下落する要因となります。また、金融商品取引の相手方や受託会社の決済不履行または債務不履行等により損失を被ることがあります。運用資産の規模等によっては、当ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

金利変動リスク

当ファンドは、日本および世界主要国の公社債等を実質的な投資対象としていることから、金利変動リスクを伴います。一般に、公社債等の価格は、金利が上昇した場合には下落し、金利が下落した場合には上昇します（価格の変動幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。したがって、金利が上昇した場合、当ファンドが実質的に保有する公社債等の価格が下落し、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

当ファンドの実質的な投資対象である世界主要国の株式や公社債等（日本を除く）は外貨建資産であるため、当ファンドの基準価額は為替変動の影響を受けます。一般に、主な為替相場の変動要因としては、金利変動、中央銀行等による政策金利の変更または為替介入、政治的要因等があります。

流動性リスク

投資対象となる有価証券の市場規模や取引量が少ない状況や解約資金を手当てするために実質的に保有する有価証券を大量に売却しなければならない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

また、解約資金の手当てが間に合わず、売却した有価証券等の売却代金回収までの期間、一時的に当ファンドで資金借入を行うことによって解約金の支払いに対応する場合があります、その場合の借入金利は当ファンドが負担することになります。

投資対象国への投資リスク

当ファンドが実質的に保有する有価証券の発行国（投資対象国）における政治不安や社会不安、あるいは他国との外交関係の悪化などの要因により、投資成果に大きく影響することがあります。また、投資対象国の政府当局による、海外からの投資規制や課徴的な税制、海外からの送付金規制などの様々な規制の導入や政策変更等により、投資対象国の有価証券への投資に悪影響が及ぶ可能性があります。

デリバティブ取引のリスク

先物・スワップ取引等のデリバティブ取引を用いた投資手法は運用の効率を高めるため、または証券価格、市場金利、為替等の変動による当ファンドおよびマザーファンドへの影響を低減するために用いられますが、デリバティブ取引は必ず用いられるわけではなく、また用いられたとしても本来の目的を達成できる保証はありません。

パッシブ運用のリスク

当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドはパッシブ運用を採用しています。パッシブ運用とは、ベンチマーク（参考指数）とするインデックスと連動する投資成果を目指す運用手法であり、ファンド・マネージャーが経済情勢、市場分析等に基づき個別銘柄の売買を行うことによりインデックスを上回る投資成果を目指すアクティブ運用とは異なります。

マザーファンドは、投資成果をインデックスにできるだけ連動させるため、原則としてポートフォリオにおける時価構成をインデックスにおける銘柄別時価構成比に近づけるように投資対象銘柄の売買を行います。ただし、インデックス採用銘柄の変更や資本異動等によりポートフォリオの調整が行われる場合等、個別銘柄の売買等にあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があるため、基準価額の変動率がインデックスの変動率に一致せず、ファンドの投資成果がインデックスの投資成果に

連動しない場合があります。また、インデックス採用銘柄の売買停止等の理由により当該銘柄に投資できない場合、インデックスの投資成果に連動させるため、インデックス採用銘柄以外の銘柄に投資する場合があります。

ファミリーファンド方式のリスク

当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のファンド（ベビーファンド）に追加設定・解約等に伴う資金変動等があり、その結果、当該マザーファンドにおいて有価証券の売買等が行われた場合等には、その売買による組入有価証券等の価格の変化や売買手数料等の負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあり、これにより、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

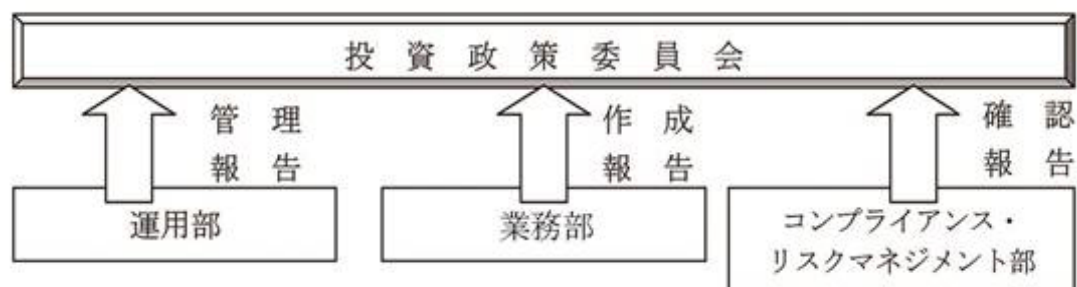
（２）その他の留意点

当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。

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や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。

（３）リスク管理体制



運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは信託約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行います。

業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率と対ベンチマーク超過リターンの算出と要因分析を行います。

コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しております。

投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をします。

委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行います。

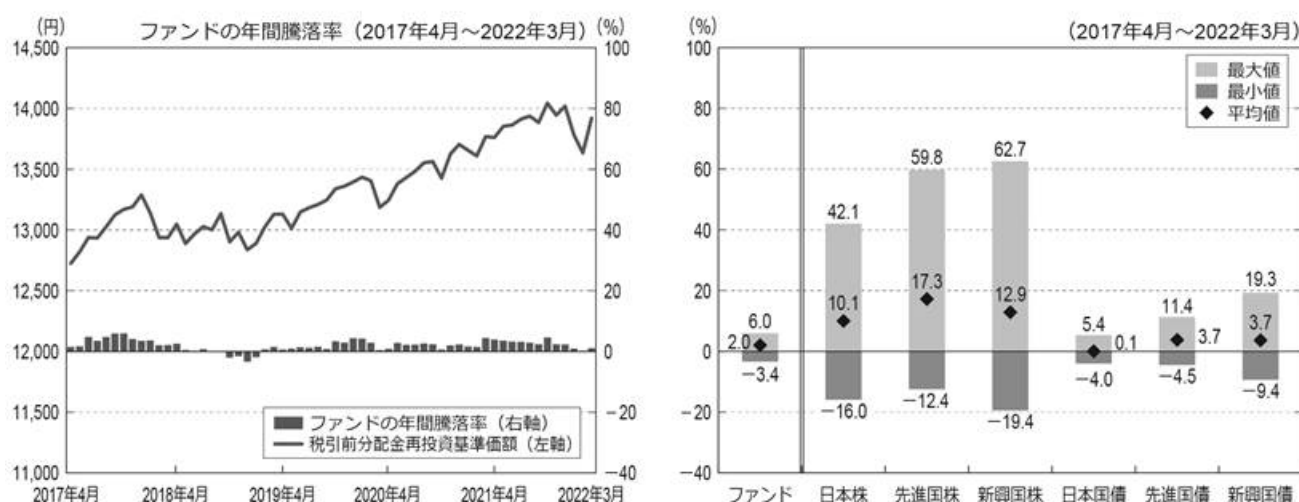
取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

上記リスクに対する管理体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

＜参考情報＞代表的な資産クラスと騰落率の比較等

投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

＜ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移＞ ＜ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較＞



- ・上記の左グラフは、各月末におけるファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。
- ・分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算していますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- ・年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- ・ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を分配時に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。
- ・上記の右グラフは、ファンドと代表的な資産クラスについて、上記記載の5年間の年間騰落率の平均値・最大値・最小値を表示しています。
- ・代表的な資産クラスの全てが当ファンドの投資対象とは限りません。また、海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して円換算しています。

※上記のグラフは過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

日本株：東証株価指数(TOPIX)（配当込み）

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

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

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

日本国債：NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、同指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

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（除く日本、円ベース）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。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

新興国債：JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ベース）

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ベース）は、J.P.Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

申込手数料（購入時手数料）は、取得申込受付日（購入申込受付日）の翌営業日の基準価額に2.2%（税抜2.0%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。

購入時手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の事務等の対価です。

「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合の購入時手数料は、無手数料とします。

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

ただし、換金時に信託財産留保額（換金申込受付日の翌営業日の基準価額に0.05%の率を乗じて得た額）が差し引かれます。

（３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、日々のファンドの純資産総額に年率0.825%（税抜0.75%）の信託報酬率を乗じて得た額とします。

ファンドの信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末（当日が休業日の場合は翌営業日とします。）または信託終了のときに信託財産中から支払います。

< 信託報酬率の配分（税抜） >

支払先	信託報酬率（年率）	役務の内容
委託会社	0.60%	委託した資金の運用の対価
販売会社	0.10%	交付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	0.05%	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

（注）マザーファンドで有価証券の貸付の指図を行った場合は、その品貸料のうち当ファンドに属するとみなした額の100分の50以内の額を、別途、信託財産から支払います。

消費税等相当額は、消費税および地方消費税に相当する金額です。

（４）【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します（信託約款第38条）。

信託財産に係る監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末（ただし、当日が休業日の場合は翌営業日とします。）または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

上記に定める信託事務の処理等に要する諸費用は、マザーファンドに関連して生じた諸費用のうちマザーファンドにおいて負担せずかつ委託会社の合理的判断によりこの信託に関連して生じたと認めるものを含みます。

ファンドの組入れ有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等は、信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料に対する消費税等相当額および先物取引、オプション取引等に要する費用についても信託財産が負担します。

信託財産において資金借入れを行った場合、当該借入金の利息は、信託財産中より支弁します。

上記のほか、信託約款の規定に基づく運用指図等により生じた費用をご負担いただく場合があります。

その他の手数料等は、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することはできません。

上記（１）～（４）の当該手数料等の合計額については、投資者の皆さまがファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することはできません。

（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、日本の居住者（法人を含みます。）である受益者については、以下のような取扱いとなります。なお、税制が改正された場合には、その内容が変更されることがあります。

■ 個人、法人別の課税について ■

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。

なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税（配当控除は適用されません。）のいずれかを選択することもできます。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

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

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

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

法人の投資者に対する課税

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%）の税率で源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

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

上記の内容は、税法もしくは確定拠出年金法が改正された場合等には変更となることがあります。

<注1> 個別元本について

投資者ごとの信託時の受益権の価額等が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行うつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

<注2> 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

上記は、2022年3月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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】

(1)【投資状況】

(2022年3月31日現在)

種類	国 / 地域名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	4,218,953,035	85.26
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		729,575,446	14.74
純資産総額		4,948,528,481	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（日本株式インデックス・マザーファンド）

(2022年3月31日現在)

種類	国 / 地域名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	83,875,537,140	96.49
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		3,047,325,721	3.51
純資産総額		86,922,862,861	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（日本債券インデックス・マザーファンド）

(2022年3月31日現在)

種類	国 / 地域名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	148,043,880,900	82.50
特殊債券	日本	13,747,672,376	7.66
地方債証券	日本	11,028,596,091	6.15
社債券	日本	7,309,237,100	4.07
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		685,775,685	0.38
純資産総額		179,443,610,782	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

(2022年3月31日現在)

種類	国 / 地域名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	150,203,602,971	68.63
	イギリス	9,181,301,271	4.20
	カナダ	7,984,358,336	3.65
	フランス	6,878,351,823	3.14
	スイス	6,301,421,844	2.88
	ドイツ	5,073,745,211	2.32
	オーストラリア	4,657,992,589	2.13
	オランダ	2,698,022,933	1.23
	スウェーデン	2,188,432,675	1.00
	香港	1,709,573,372	0.78
	デンマーク	1,638,574,803	0.75
	イタリア	1,452,270,498	0.66
	スペイン	1,406,089,902	0.64
	シンガポール	824,521,806	0.38

	ベルギー	588,760,487	0.27
	フィンランド	584,555,180	0.27
	ノルウェー	481,168,383	0.22
	イスラエル	444,450,576	0.20
	アイルランド	363,655,098	0.17
	ポルトガル	128,767,680	0.06
	オーストリア	126,342,204	0.06
	ニュージーランド	123,879,697	0.06
	小計	205,039,839,339	93.70
投資証券	アメリカ	4,326,456,716	1.98
	オーストラリア	294,595,464	0.13
	イギリス	130,487,510	0.06
	フランス	94,016,101	0.04
	シンガポール	86,452,508	0.04
	香港	68,653,430	0.03
	カナダ	27,467,607	0.01
	小計	5,028,129,336	2.29
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		8,782,180,953	4.01
純資産総額		218,850,149,628	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

（2022年3月31日現在）

種類	国 / 地域名	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	54,272,352,807	47.64
	フランス	10,947,131,478	9.61
	イタリア	9,858,910,181	8.65
	ドイツ	8,009,819,485	7.03
	スペイン	6,329,618,381	5.56
	イギリス	6,108,856,255	5.36
	ベルギー	2,430,562,630	2.13
	カナダ	2,294,925,120	2.01
	オランダ	2,051,280,397	1.80
	オーストラリア	1,834,215,294	1.61
	オーストリア	1,543,615,036	1.36
	中国	1,362,202,540	1.20
	アイルランド	879,347,112	0.77
	メキシコ	856,906,943	0.75
	フィンランド	665,274,375	0.58
	マレーシア	603,133,595	0.53
	イスラエル	507,636,298	0.45
	ポーランド	506,469,120	0.45
	シンガポール	486,004,451	0.43
	デンマーク	477,962,250	0.42
	スウェーデン	321,997,572	0.28
	ノルウェー	294,707,175	0.26
	小計	112,642,928,495	98.88
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		1,281,416,472	1.12

純資産総額	113,924,344,967	100.00
-------	-----------------	--------

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

（2022年3月31日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 （口）	簿価 単価 （円）	簿価金額 （円）	評価 単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	親投資信託 受益証券	外国債券インデックス・マザー・ファンド	-	864,844,189	2.5264	2,184,942,359	2.5970	2,246,000,358	45.39
2	日本	親投資信託 受益証券	日本債券インデックス・マザーファンド	-	1,146,597,358	1.2687	1,454,688,068	1.2677	1,453,541,470	29.37
3	日本	親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・オープン・マザーファンド	-	60,143,809	4.1908	252,050,674	4.6590	280,210,006	5.66
4	日本	親投資信託 受益証券	日本株式インデックス・マザーファンド	-	68,904,278	3.3693	232,159,183	3.4715	239,201,201	4.84

（注１）投資有価証券は4銘柄です。

（注２）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（％）
親投資信託受益証券	-	85.26
合 計		85.26

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

【投資不動産物件】

該当する事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当する事項はありません。

<参考情報>

親投資信託受益証券（日本株式インデックス・マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2022年3月31日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 （株）	簿価 単価 （円）	簿価金額 （円）	評価 単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,597,800	1,845.00	2,947,941,000	2,222.50	3,551,110,500	4.09
2	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	197,600	11,110.00	2,195,336,000	12,730.00	2,515,448,000	2.89
3	日本	株式	キーエンス	電気機器	28,600	51,800.00	1,481,480,000	57,250.00	1,637,350,000	1.88
4	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,951,000	678.90	1,324,533,900	760.30	1,483,345,300	1.71
5	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	20,000	51,930.00	1,038,600,000	63,250.00	1,265,000,000	1.46
6	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	232,500	4,666.00	1,084,845,000	5,414.00	1,258,755,000	1.45
7	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	323,800	3,377.00	1,093,472,600	3,545.00	1,147,871,000	1.32
8	日本	株式	任天堂	その他製品	17,800	57,220.00	1,018,516,000	61,670.00	1,097,726,000	1.26
9	日本	株式	三菱商事	卸売業	232,800	4,167.00	970,077,600	4,601.00	1,071,112,800	1.23
10	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	185,600	4,707.00	873,619,200	5,559.00	1,031,750,400	1.19
11	日本	株式	信越化学工業	化学	53,000	16,045.00	850,385,000	18,790.00	995,870,000	1.15
12	日本	株式	日立製作所	電気機器	151,700	4,953.00	751,370,100	6,165.00	935,230,500	1.08
13	日本	株式	KDDI	情報・通信業	225,600	3,781.00	852,993,600	4,005.00	903,528,000	1.04
14	日本	株式	ダイキン工業	機械	40,200	19,650.00	789,930,000	22,410.00	900,882,000	1.04

15	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	217,300	3,983.00	865,505,900	4,144.00	900,491,200	1.04
16	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	247,900	3,419.00	847,570,100	3,498.00	867,154,200	1.00
17	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	248,300	3,112.00	772,709,600	3,487.00	865,822,100	1.00
18	日本	株式	H O Y A	精密機器	61,500	13,035.00	801,652,500	14,030.00	862,845,000	0.99
19	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	215,300	3,898.00	839,239,400	3,907.00	841,177,100	0.97
20	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	35,600	21,185.00	754,186,000	23,510.00	836,956,000	0.96
21	日本	株式	三井物産	卸売業	241,200	3,072.00	740,966,400	3,328.00	802,713,600	0.92
22	日本	株式	日本電産	電気機器	81,700	9,165.00	748,780,500	9,748.00	796,411,600	0.92
23	日本	株式	村田製作所	電気機器	92,600	7,196.00	666,349,600	8,117.00	751,634,200	0.86
24	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	102,500	6,276.00	643,290,000	7,128.00	730,620,000	0.84
25	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	121,500	5,505.00	668,857,500	5,813.00	706,279,500	0.81
26	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	468,800	1,472.00	690,073,600	1,428.00	669,446,400	0.77
27	日本	株式	第一三共	医薬品	247,900	2,457.50	609,214,250	2,680.00	664,372,000	0.76
28	日本	株式	S M C	機械	9,200	61,670.00	567,364,000	68,840.00	633,328,000	0.73
29	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	397,800	1,483.00	589,937,400	1,567.00	623,352,600	0.72
30	日本	株式	ファナック	電気機器	27,700	18,825.00	521,452,500	21,645.00	599,566,500	0.69

（注１）評価金額の上位30銘柄について記載しています。

（注２）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（％）
株式	電気機器	17.46
	輸送用機器	8.07
	情報・通信業	7.94
	化学	6.22
	卸売業	5.89
	サービス業	5.68
	機械	5.16
	銀行業	5.11
	医薬品	4.74
	小売業	4.08
	食料品	3.13
	陸運業	2.97
	精密機器	2.43
	その他製品	2.34
	保険業	2.16
	建設業	2.13
	不動産業	1.90
	その他金融業	1.10
	電気・ガス業	1.09
	鉄鋼	0.81
	非鉄金属	0.79
	証券、商品先物取引業	0.74
	ガラス・土石製品	0.71
	ゴム製品	0.64
	海運業	0.62
	金属製品	0.55
	繊維製品	0.43
	石油・石炭製品	0.43

	空運業	0.41
	鉱業	0.30
	パルプ・紙	0.20
	倉庫・運輸関連業	0.17
	水産・農林業	0.09
合 計		96.49

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	TOPIX（先物） （2022年6月限）	大阪取引所	買建	151	2,844,522,040	2,939,215,000	3.38

（注１）投資比率は、純資産総額に対する当該取引の評価金額の比率です。

（注２）先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

（注３）先物取引の評価においては、原則として主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（日本債券インデックス・マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第428回利付国債 (2年)	0.005	2023/09/01	3,000,000,000	100.11	3,003,540,000	100.09	3,002,760,000	1.67
2	日本	国債証券	第149回利付国債 (5年)	0.005	2026/09/20	2,600,000,000	100.11	2,602,938,000	99.95	2,598,830,000	1.45
3	日本	国債証券	第146回利付国債 (5年)	0.100	2025/12/20	2,350,000,000	100.51	2,362,008,500	100.42	2,360,058,000	1.32
4	日本	国債証券	第365回利付国債 (10年)	0.100	2031/12/20	2,300,000,000	99.28	2,283,459,000	98.95	2,275,896,000	1.27
5	日本	国債証券	第141回利付国債 (5年)	0.100	2024/09/20	2,200,000,000	100.38	2,208,380,000	100.33	2,207,326,000	1.23
6	日本	国債証券	第148回利付国債 (5年)	0.005	2026/06/20	2,000,000,000	100.15	2,003,000,000	100.00	2,000,000,000	1.11
7	日本	国債証券	第144回利付国債 (5年)	0.100	2025/06/20	1,900,000,000	100.44	1,908,417,000	100.41	1,907,942,000	1.06
8	日本	国債証券	第145回利付国債 (5年)	0.100	2025/09/20	1,800,000,000	100.47	1,808,604,000	100.41	1,807,488,000	1.01
9	日本	国債証券	第350回利付国債 (10年)	0.100	2028/03/20	1,800,000,000	100.69	1,812,492,000	100.20	1,803,744,000	1.01
10	日本	国債証券	第359回利付国債 (10年)	0.100	2030/06/20	1,800,000,000	100.45	1,808,154,000	99.55	1,791,954,000	1.00
11	日本	国債証券	第364回利付国債 (10年)	0.100	2031/09/20	1,750,000,000	99.76	1,745,870,000	99.02	1,732,920,000	0.97
12	日本	国債証券	第136回利付国債 (5年)	0.100	2023/06/20	1,700,000,000	100.23	1,703,927,000	100.20	1,703,519,000	0.95
13	日本	国債証券	第360回利付国債 (10年)	0.100	2030/09/20	1,700,000,000	100.33	1,705,763,000	99.45	1,690,752,000	0.94

14	日本	国債証券	第363回利付国債 (10年)	0.100	2031/06/20	1,630,000,000	99.95	1,629,250,200	99.13	1,615,965,700	0.90
15	日本	国債証券	第147回利付国債 (5年)	0.005	2026/03/20	1,600,000,000	100.14	1,602,256,000	100.03	1,600,624,000	0.89
16	日本	国債証券	第137回利付国債 (5年)	0.100	2023/09/20	1,550,000,000	100.26	1,554,169,500	100.23	1,553,642,500	0.87
17	日本	国債証券	第355回利付国債 (10年)	0.100	2029/06/20	1,530,000,000	100.72	1,541,138,400	99.89	1,528,347,600	0.85
18	日本	国債証券	第351回利付国債 (10年)	0.100	2028/06/20	1,500,000,000	100.72	1,510,845,000	100.15	1,502,310,000	0.84
19	日本	国債証券	第340回利付国債 (10年)	0.400	2025/09/20	1,480,000,000	101.54	1,502,792,000	101.45	1,501,578,400	0.84
20	日本	国債証券	第9回利付国債(4 0年)	0.400	2056/03/20	1,730,000,000	87.20	1,508,560,000	84.89	1,468,666,200	0.82
21	日本	国債証券	第356回利付国債 (10年)	0.100	2029/09/20	1,450,000,000	100.67	1,459,778,000	99.81	1,447,303,000	0.81
22	日本	国債証券	第362回利付国債 (10年)	0.100	2031/03/20	1,400,000,000	100.08	1,401,246,000	99.25	1,389,500,000	0.77
23	日本	国債証券	第38回利付国債 (30年)	1.800	2043/03/20	1,100,000,000	122.98	1,352,835,000	120.99	1,330,956,000	0.74
24	日本	国債証券	第341回利付国債 (10年)	0.300	2025/12/20	1,300,000,000	101.27	1,316,510,000	101.17	1,315,236,000	0.73
25	日本	国債証券	第140回利付国債 (5年)	0.100	2024/06/20	1,300,000,000	100.34	1,304,459,000	100.31	1,304,030,000	0.73
26	日本	国債証券	第353回利付国債 (10年)	0.100	2028/12/20	1,300,000,000	100.74	1,309,711,000	100.03	1,300,429,000	0.72
27	日本	国債証券	第155回利付国債 (20年)	1.000	2035/12/20	1,200,000,000	108.76	1,305,156,000	108.01	1,296,168,000	0.72
28	日本	国債証券	第358回利付国債 (10年)	0.100	2030/03/20	1,300,000,000	100.56	1,307,280,000	99.64	1,295,385,000	0.72
29	日本	国債証券	第349回利付国債 (10年)	0.100	2027/12/20	1,260,000,000	100.66	1,268,391,600	100.25	1,263,225,600	0.70
30	日本	国債証券	第352回利付国債 (10年)	0.100	2028/09/20	1,260,000,000	100.71	1,269,059,400	100.09	1,261,209,600	0.70

（注1）評価金額の上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（％）
国債証券	-	82.50
特殊債券	-	7.66
地方債証券	-	6.15
社債券	-	4.07
合 計		100.38

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当する事項はありません。

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2022年3月31日現在）

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	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	502,068	19,611.77	9,846,443,947	21,757.27	10,923,629,184	4.99
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	218,232	41,198.02	8,990,727,103	38,413.32	8,383,016,828	3.83
3	アメリカ	株式	AMAZON COM INC	小売	13,988	435,471.55	6,091,376,052	407,071.58	5,694,117,370	2.60
4	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	26,100	138,656.22	3,618,927,390	133,893.43	3,494,618,682	1.60
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	9,212	356,229.55	3,281,586,687	347,437.06	3,200,590,199	1.46
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	8,781	357,657.84	3,140,593,573	349,165.20	3,066,019,683	1.40
7	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	76,400	40,848.88	3,120,854,920	33,889.79	2,589,180,032	1.18
8	アメリカ	株式	META PLATFORMS, INC-A	メディア・娯楽	72,452	41,371.49	2,997,447,316	27,886.56	2,020,437,153	0.92
9	アメリカ	株式	UNITED HEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	28,791	55,320.27	1,592,726,181	63,743.15	1,835,229,313	0.84
10	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	80,425	19,551.80	1,572,453,716	21,980.02	1,767,743,116	0.81
11	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	39,934	34,528.66	1,378,867,779	43,767.88	1,747,826,835	0.80
12	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	90,390	19,732.93	1,783,660,419	17,200.69	1,554,770,423	0.71
13	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	74,139	18,238.55	1,352,188,436	18,895.79	1,400,915,130	0.64
14	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	51,095	24,023.93	1,227,502,861	27,409.24	1,400,475,143	0.64
15	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	85,993	15,918.05	1,368,841,217	15,981.67	1,374,312,023	0.63
16	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	129,351	7,538.00	975,047,850	10,253.83	1,326,343,707	0.61
17	アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	31,939	49,790.69	1,590,265,160	37,752.41	1,205,774,523	0.55
18	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	59,095	14,056.49	830,668,365	20,253.09	1,196,856,779	0.55
19	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	26,814	39,533.19	1,060,043,061	44,334.55	1,188,786,720	0.54
20	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	225,387	5,579.76	1,257,605,389	5,262.76	1,186,159,941	0.54
21	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	171,288	6,413.23	1,098,510,367	6,418.13	1,099,348,925	0.50
22	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	53,957	14,306.16	771,917,858	20,041.36	1,081,371,796	0.49
23	オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	12,626	96,346.15	1,216,466,616	85,054.73	1,073,901,147	0.49
24	スイス	株式	ROCHE HOLDING AG GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	21,460	47,383.05	1,016,840,253	49,145.83	1,054,669,554	0.48
25	アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	12,546	69,069.57	866,546,857	77,239.10	969,041,812	0.44
26	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO NEW	メディア・娯楽	55,464	18,090.46	1,003,369,600	17,252.09	956,870,163	0.44

27	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	125,307	6,680.04	837,056,549	7,613.88	954,072,699	0.44
28	アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	13,487	67,911.76	915,925,950	70,554.16	951,564,000	0.43
29	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	128,682	6,824.46	878,185,985	6,859.95	882,753,308	0.40
30	アメリカ	株式	LILLY (ELI) & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	24,809	31,188.64	773,759,061	35,479.63	880,214,316	0.40

（注１）評価金額の上位30銘柄について記載しています。

（注２）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

（注３）2022年3月31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います。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（％）
株式	ソフトウェア・サービス	10.80
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.92
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.45
	メディア・娯楽	6.13
	資本財	5.80
	銀行	5.73
	小売	4.98
	半導体・半導体製造装置	4.84
	各種金融	4.64
	ヘルスケア機器・サービス	4.61
	エネルギー	4.30
	素材	4.26
	食品・飲料・タバコ	3.70
	保険	3.01
	公益事業	2.88
	自動車・自動車部品	2.41
	運輸	1.97
	消費者サービス	1.70
	耐久消費財・アパレル	1.62
	家庭用品・パーソナル用品	1.55
	食品・生活必需品小売り	1.46
	電気通信サービス	1.46
	商業・専門サービス	1.10
	不動産	0.38
	小 計	93.70
投資証券	-	2.29
合 計		95.99

（注１）投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

（注２）2022年3月31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います。

投資不動産物件

該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	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	MINI S&P 500	シカゴ商業 取引所	買建	アメリ カ・ドル	208	43,613,241.64	47,798,400.00	5,850,046,176	2.67
	EURO STOXX 50	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	買建	ユーロ	162	5,911,812.01	6,258,060.00	855,476,802	0.39
	SPI 200	シドニー先 物取引所	買建	オースト ラリア・ド ル	17	3,027,275.00	3,180,700.00	292,624,400	0.13
	FTSE100INDEX	インターコ ンチネンタ ル取引所	買建	イギリス ・ポンド	24	1,705,872.00	1,803,960.00	290,239,124	0.13
	S&P 60	モントリ オール取引 所	買建	カナダ・ ドル	11	2,839,401.68	2,924,460.00	286,304,634	0.13
	FSMI INDEX	ユーレック ス・チュー リッヒ取引 所	買建	スイス・ フラン	16	1,833,120.00	1,932,960.00	256,194,518	0.12

（注１）投資比率は、純資産総額に対する当該取引の評価金額（2022年3月31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います）の比率です。

（注２）先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

（注３）先物取引の評価においては、原則として主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2022年3月31日現在）

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1.500	2023/03/31	9,000,000	12,282.98	1,105,468,551	12,212.70	1,099,143,471	0.96
2	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.125	2024/02/29	9,000,000	12,393.84	1,115,446,207	12,192.62	1,097,336,312	0.96
3	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.375	2024/08/15	8,300,000	12,465.61	1,034,645,851	12,210.79	1,013,495,810	0.89
4	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1.625	2023/05/31	6,300,000	12,295.41	774,611,094	12,200.75	768,647,446	0.67
5	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.750	2024/02/15	6,000,000	12,538.75	752,325,594	12,330.79	739,847,550	0.65
6	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.500	2024/05/15	6,000,000	12,491.42	749,485,762	12,264.33	735,860,311	0.65
7	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1.750	2023/05/15	5,800,000	12,314.53	714,243,182	12,223.70	708,974,672	0.62
8	中国	国債 証券	CHINESE GOVERNMENT BOND	2.690	2026/08/12	35,100,000	1,943.74	682,255,117	1,939.06	680,613,209	0.60
9	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.625	2023/02/28	5,500,000	12,425.03	683,376,804	12,348.95	679,192,790	0.60
10	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.500	2023/08/15	5,500,000	12,447.92	684,635,793	12,308.32	676,957,733	0.59
11	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.875	2023/09/30	5,200,000	12,526.32	651,369,139	12,373.34	643,413,789	0.56
12	アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.250	2024/11/15	5,200,000	12,437.40	646,745,095	12,162.50	632,450,325	0.56

13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2024/09/30	5,200,000	12,393.42	644,457,932	12,135.25	631,033,278	0.55
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2025/05/15	5,200,000	12,390.07	644,283,908	12,090.79	628,721,251	0.55
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2028/08/15	5,000,000	12,951.34	647,567,399	12,529.67	626,483,812	0.55
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.750	2028/02/15	5,000,000	12,829.43	641,471,808	12,423.54	621,177,055	0.55
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	5,200,000	12,142.42	631,406,187	11,809.20	614,078,436	0.54
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2024/03/31	5,000,000	12,388.64	619,432,043	12,185.93	609,296,621	0.53
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2023/10/31	5,000,000	12,275.81	613,790,629	12,134.77	606,738,866	0.53
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2023/09/30	5,000,000	12,234.21	611,710,960	12,101.78	605,089,465	0.53
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2025/02/15	5,000,000	12,348.48	617,424,082	12,066.88	603,344,453	0.53
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2025/11/30	4,800,000	12,721.38	610,626,655	12,382.90	594,379,383	0.52
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/02/15	5,000,000	12,152.46	607,623,323	11,831.67	591,583,539	0.52
24	フランス	国債証券	FRENCH GOVERNMENT BOND	2.750	2027/10/25	3,850,000	15,671.69	603,360,376	15,204.32	585,366,350	0.51
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2025/07/31	4,600,000	12,691.74	583,820,380	12,373.34	569,173,736	0.50
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2031/08/15	5,100,000	11,516.13	587,322,837	11,099.24	566,061,399	0.50
27	ドイツ	国債証券	GERMAN GOVERNMENT BOND	2.000	2023/08/15	4,000,000	14,210.19	568,407,895	14,108.36	564,334,782	0.50
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2027/01/31	4,800,000	12,077.92	579,740,393	11,698.76	561,540,621	0.49
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2051/05/15	4,700,000	12,522.50	588,557,731	11,919.63	560,223,013	0.49
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2031/02/15	5,000,000	11,432.44	571,622,495	11,024.66	551,233,085	0.48

（注１）評価金額の上位30銘柄について記載しています。

（注２）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

（注３）2022年3月31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います。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（％）
国債証券	-	98.88
合 計		98.88

（注１）投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

（注２）2022年3月31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います。

投資不動産物件

該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当する事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

2022年3月31日及び同日前１年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

計算期間・月末		純資産総額（円）		１口当たりの純資産額（円）	
第1期	（2013年 2月20日）	分配付： 213,198,476	分配付： 1.0667	分配落： 213,198,476	分配落： 1.0667
第2期	（2014年 2月20日）	分配付： 1,623,142,054	分配付： 1.1583	分配落： 1,616,135,543	分配落： 1.1533
第3期	（2015年 2月20日）	分配付： 1,749,455,838	分配付： 1.2424	分配落： 1,726,925,712	分配落： 1.2264
第4期	（2016年 2月22日）	分配付： 2,799,520,026	分配付： 1.1999	分配落： 2,783,188,603	分配落： 1.1929
第5期	（2017年 2月20日）	分配付： 3,353,263,422	分配付： 1.2368	分配落： 3,315,305,934	分配落： 1.2228
第6期	（2018年 2月20日）	分配付： 4,218,203,352	分配付： 1.2495	分配落： 4,167,563,611	分配落： 1.2345
第7期	（2019年 2月20日）	分配付： 4,251,424,588	分配付： 1.2434	分配落： 4,213,813,566	分配落： 1.2324
第8期	（2020年 2月20日）	分配付： 4,636,953,719	分配付： 1.2790	分配落： 4,582,572,120	分配落： 1.2640
第9期	（2021年 2月22日）	分配付： 4,734,124,014	分配付： 1.2791	分配落： 4,697,113,247	分配落： 1.2691
第10期	（2022年 2月21日）	分配付： 4,854,785,226	分配付： 1.2675	分配落： 4,835,634,300	分配落： 1.2625
2021年 3月末日		4,766,498,135	1.2772		
4月末日		4,764,227,017	1.2765		
5月末日		4,802,167,004	1.2851		
6月末日		4,810,988,459	1.2861		
7月末日		4,639,818,669	1.2906		
8月末日		4,645,422,644	1.2929		
9月末日		4,622,509,261	1.2879		
10月末日		4,980,963,340	1.3028		
11月末日		4,951,688,785	1.2936		
12月末日		4,976,058,100	1.3005		
2022年 1月末日		4,896,273,395	1.2787		
2月末日		4,842,820,849	1.2598		
3月末日		4,948,528,481	1.2861		

【分配の推移】

計算期間		一口当たりの分配金
第1期	自2012年 3月 9日 至2013年 2月20日	0.0000円
第2期	自2013年 2月21日 至2014年 2月20日	0.0050円
第3期	自2014年 2月21日 至2015年 2月20日	0.0160円

第4期	自2015年 2月21日 至2016年 2月22日	0.0070円
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	0.0140円
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	0.0150円
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	0.0110円
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	0.0150円
第9期	自2020年 2月21日 至2021年 2月22日	0.0100円
第10期	自2021年 2月23日 至2022年 2月21日	0.0050円

【収益率の推移】

計算期間		収益率
第1期	自2012年 3月 9日 至2013年 2月20日	6.7%
第2期	自2013年 2月21日 至2014年 2月20日	8.6%
第3期	自2014年 2月21日 至2015年 2月20日	7.7%
第4期	自2015年 2月21日 至2016年 2月22日	2.2%
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	3.7%
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	2.2%
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	0.7%
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	3.8%
第9期	自2020年 2月21日 至2021年 2月22日	1.2%
第10期	自2021年 2月23日 至2022年 2月21日	0.1%

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末の分配落基準価額（設定時は当初元本額）を控除した額を、前期末の分配落基準価額（同）で除して得た数に100を乗じて得た数です。

（４）【設定及び解約の実績】

計算期間		設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第1期	自2012年 3月 9日 至2013年 2月20日	199,976,258	109,100	199,867,158
第2期	自2013年 2月21日 至2014年 2月20日	1,202,700,140	1,264,903	1,401,302,395
第3期	自2014年 2月21日 至2015年 2月20日	12,384,800	5,554,258	1,408,132,937

第4期	自2015年 2月21日 至2016年 2月22日	932,006,609	7,079,090	2,333,060,456
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	468,679,521	90,490,774	2,711,249,203
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	757,459,918	92,726,355	3,375,982,766
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	128,819,369	85,618,294	3,419,183,841
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	271,844,830	65,588,688	3,625,439,983
第9期	自2020年 2月21日 至2021年 2月22日	129,832,227	54,195,439	3,701,076,771
第10期	自2021年 2月23日 至2022年 2月21日	321,813,640	192,705,055	3,830,185,356

（注１）日本国外における設定、解約はありません。

（注２）第１期の設定口数は、当初募集期間の設定口数を含みます。

(参考情報) 運用実績

(2022年3月31日現在)

基準価額・純資産の推移



※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。分配金再投資基準価額は税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算したものです。

<基準価額・純資産総額>

基準価額	12,861円
純資産総額	4,949百万円

分配の推移

決算期	分配金
第6期 (2018年2月20日)	150円
第7期 (2019年2月20日)	110円
第8期 (2020年2月20日)	150円
第9期 (2021年2月22日)	100円
第10期 (2022年2月21日)	50円
設定来累計	980円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	投資銘柄 (上位3銘柄)	国/ 地域名	種類	業種	利率	償還日	投資比率
外国債券 インデックス・マザー・ファンド	45.39%	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	1.500%	2023/03/31	0.96%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	2.125%	2024/02/29	0.96%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	2.375%	2024/08/15	0.89%
日本債券 インデックス・マザー・ファンド	29.37%	第4 2 8 回利付国債(2年)	日本	国債証券	—	0.005%	2023/09/01	1.67%
		第1 4 9 回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.005%	2026/09/20	1.45%
		第1 4 6 回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.100%	2025/12/20	1.32%
外国株式 インデックス・オープン・ マザー・ファンド	5.66%	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	—	—	4.99%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	—	—	3.83%
		AMAZON COM INC	アメリカ	株式	小売	—	—	2.60%
日本株式 インデックス・マザー・ファンド	4.84%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	4.09%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	—	—	2.89%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	—	—	1.88%

※各マザーファンドの投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する各マザーファンドの評価金額の比率であり、投資銘柄(上位3銘柄)の投資比率は、各マザーファンド純資産総額に対する各投資銘柄の評価金額の比率です。

年間収益率の推移 (暦年ベース)



※ベンチマークは、株式会社トータルアセットデザインが決定した資産配分に基づき、組入れマザーファンドの各ベンチマークのリターンを合成したAMCリスクバジェット型資産配分モデル指数です。

※2022年のファンドとベンチマークの年間収益率は年初から3月末までで算出しています。

※年間収益率の推移は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

※基準価額と同一基準のデータを取得できないため、設定時以前のベンチマークの収益率は記載していません。

- 上記の運用実績は、過去の実績であり将来の成果を保証するものではありません。
- 上記のベンチマークの情報は参考情報です。
- 最新の運用実績は委託会社のホームページ、または販売会社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】

- 1) 当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社に所定の方法で取引口座を開設のうえ、当ファンドの取得申込みを行ってください。なお、確定拠出年金制度のご利用による取得申込みの場合は、確定拠出年金制度にかかる手続き必要となります。
- 2) 当ファンドには「分配金再投資コース」と「分配金受取コース」があります。なお、取扱い可能なコースおよびコース名については異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。その際、「分配金再投資コース」をお申し込みいただく方は、ご購入に際して、当ファンドに係る「自動けいぞく投資契約」（別の名称で同様の内容を有する契約を含みます。）を販売会社との間で結んでいただきます。ただし、「分配金再投資コース」を申し込まれた場合でも、分配金を定期的に受け取る旨の契約を締結することもできます。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- 3) 当ファンドの取得申込みの申込受付締切時間は、原則として販売会社の営業日の午後3時までとし、この受付時刻を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。
- 4) 申込単位（購入単位）は、販売会社が定める単位にて受付けます。なお、1億円または1億口を超える大口の取得申込みには、制限を設けることがあります。
- 5) 取得申込価額（購入価額）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。基準価額は、販売会社または委託会社においてご確認いただけます。基準価額の照会方法については、後記「3 資産管理等の概要（1）資産の評価 3）基準価額の公表」をご参照ください。
- 6) 取得申込代金（購入代金）は、購入価額に取得申込の口数を乗じて得た金額に申込手数料（購入時手数料）および当該手数料に係る消費税等相当額を加えた金額です。
- 7) 購入代金は販売会社が定める期日までにお支払いください。
- 8) 購入時手数料は前記「4 手数料及び税金（1）申込手数料」をご参照ください。
- 9) 購入申込不可日は、原則として、米国もしくは英国の取引所または銀行の休業日、またはフランスおよびドイツ両国の取引所または銀行の休業日に該当する日です。
- 10) 取引所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（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更、クーデター等政変、テロリズム、戦争、天災地変等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）があるときは、委託会社の判断により、受益権の取得申込の受付を中止することおよび既に受付けた受益権の取得申込の受付けを取り消すことがあります。
- 11) 当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社に取得申込と同時にまたはあらかじめ、当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。販売会社は、当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

2【換金（解約）手続等】

- 1) 受益者（当ファンドの受益権を取得した者）は、自己に帰属する受益権につき、取得申込みを行った販売会社を通じ、委託会社に一部解約の実行の請求を行うことにより、当ファンドを換金することができます。
- 2) 当ファンドの換金申込みの申込受付締切時間は、原則として販売会社の営業日の午後3時までとし、この受付時刻を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。
- 3) 解約単位（換金単位）は、販売会社が定める単位にて受付けます。なお、1億円または1億口を超える大口の換金申込みには、制限を設けることがあります。
- 4) 解約価額（換金価額）は、換金申込受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を控除した価額です。換金価額は、販売会社または委託会社においてご確認いただけます。換金価額の照会

方法については、後記「3 資産管理等の概要（1）資産の評価 3）基準価額の公表」をご参照ください。

- 5) 信託財産留保額は、上記4)の基準価額に0.05%の率を乗じて得た額とします。
上記金額は1口当たりの金額です。換金口数に応じてご負担いただきます。
- 6) 換金代金（換金価額に換金する口数を乗じて得た金額）は、原則として換金申込受付日から起算して5営業日目以降にお支払いします。
- 7) 換金申込不可日は、原則として、米国もしくは英国の取引所または銀行の休業日、またはフランスおよびドイツ両国の取引所または銀行の休業日に該当する日です。
- 8) 取引所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（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更、クーデター等政変、テロリズム、戦争、天災地変等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）があるときは、委託会社の判断により、受益権の換金申込の受付を中止することおよび既に受付けた受益権の換金申込の受付けを取り消すことがあります。
- 9) 換金申込みを行う受益者は、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、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

1）基準価額の算出方法

基準価額とは、算出日において、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入公社債を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法^{*}により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」）を、算出日における受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当りの価額で表示されます。

^{*} 一部償却原価法とは、残存期間1年以内の公社債等について適用するアキュムレーションまたはアモチゼーションによる評価をいいます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
投資信託証券	原則として、基準価額算出日の基準価額で評価します。ただし、上場している場合は、原則として、基準価額計算日の取引所の終値で評価します。
株式	原則として、基準価額計算日の取引所の終値で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日における以下のいずれかの価額で評価します。 日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値） 証券会社、銀行等の提示する価額 価格情報会社の提供する価額
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行います。

外国で取引されているものについては、原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日の終値等で評価します。

２）基準価額の算出頻度

基準価額は原則として委託会社の営業日において日々算出されます。

３）基準価額の公表

基準価額は、販売会社にてご確認いただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の紙面に、「AMC安定型」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

<照会先>

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

（受付時間：原則として委託会社の営業日午前 9 時～午後 5 時）

ホームページアドレス：www.ssga.com/jp

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

当ファンドの信託期間は無期限ですが、後記（５）の１）２）３）５）の理由により信託は終了します。

（４）【計算期間】

１）当ファンドの計算期間は、毎年２月21日から翌年２月20日までとすることを原則とします。

２）上記１）の規定にかかわらず、上記１）の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のときは、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、後記（５）の１）２）３）５）に定める信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

１）信託契約の解約

（ａ）委託会社は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することによりこの信託の受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合または下回ることが明らかとなった場合、もしくはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

（ｂ）株式会社トータルアセットデザインがベンチマークである「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」の算出および提供をしないこととなった場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させるものとします。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

（ｃ）委託会社は、上記（ａ）の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約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、当ファンド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發します。

（ｄ）上記（ｃ）の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の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（ｄ）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、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- (e) 上記(c)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以上にあたる多数をもって行います。
- (f) 上記(c)から上記(e)までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面また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、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(c)から上記(e)までに規定するこの信託契約の解約の手続を行うことが困難な場合には適用しません。
- 2) 信託契約に関する監督官庁の命令
- (a) 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- (b) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後記6)の規定にしたがいます。
- 3) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い
- (a) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。
- (b) 上記(a)の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、後記6)の書面決議が否決となる場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- 4) 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い
- (a) 委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。
- (b) 委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。
- 5) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い
- (a) 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して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、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、後記6)の規定にしたがい、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。
- (b) 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- 6) 信託約款の変更等
- (a) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本6)に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- (b) 委託会社は、上記(a)の事項（信託約款の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあつてはその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、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）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、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およ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、

当ファンド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發します。

- (c) 上記(b)の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の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(c)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行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (d) 上記(b)の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行います。
- (e) 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- (f) 上記(b)から上記(e)までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面また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。
- (g) 上記(a)から上記(f)までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る一または複数の他の投資信託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。

7) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

この信託は、受益者が前記「2 換金（解約）手続等」に規定する一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、上記1)に規定する投資信託の解約または上記6)に規定する重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

8) 運用報告書の交付

毎決算時（毎年2月20日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日。）および償還時に、期中の運用経過等を記載した運用報告書を作成します。

- (a) 交付運用報告書は、知れている受益者に対して販売会社を通じて交付されます。
- (b) 運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページ（www.ssga.com/jp）に掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、販売会社を通じて交付されます。

9) 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。

10) 関係法人との契約の更改に関する手続き等

委託会社と販売会社との間で締結する「募集・販売等に関する契約」（別の名称で同様の権利義務を規定する契約を含みます。）は、契約期間満了3ヶ月前までに、別段の意思表示のない限り、原則として1年毎に自動的に更新されるものとします。

4 【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

分配金請求権

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

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を

除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、自動けいぞく投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後1ヶ月以内の委託会社の指定する日から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかか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または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払われます。

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」の記載をご参照ください。

書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの信託契約の解約または重大な約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを使用することができます。

帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- （２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2021年2月23日から2022年2月21日まで)の財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

A M C / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (2021年 2月22日現在)	第10期 (2022年 2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	562,108	3,124,559
コール・ローン	729,542,983	748,260,273
親投資信託受益証券	4,026,434,635	4,123,840,284
流動資産合計	4,756,539,726	4,875,225,116
資産合計	4,756,539,726	4,875,225,116
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	37,010,767	19,150,926
未払解約金	2,439,613	21,780
未払受託者報酬	1,314,096	1,343,159
未払委託者報酬	18,397,201	18,804,127
未払利息	1,992	2,020
その他未払費用	262,810	268,804
流動負債合計	59,426,479	39,590,816
負債合計	59,426,479	39,590,816
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,701,076,771	1 3,830,185,356
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	996,036,476	1,005,448,944
(分配準備積立金)	267,726,376	256,422,903
元本等合計	4,697,113,247	4,835,634,300
純資産合計	4,697,113,247	4,835,634,300
負債純資産合計	4,756,539,726	4,875,225,116

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自 2020年 2月21日 至 2021年 2月22日	第10期 自 2021年 2月23日 至 2022年 2月21日
営業収益		
有価証券売買等損益	95,775,204	34,105,649
営業収益合計	95,775,204	34,105,649
営業費用		
支払利息	700,944	709,822
受託者報酬	2,565,799	2,638,797
委託者報酬	35,921,004	36,943,057
その他費用	526,544	532,685
営業費用合計	39,714,291	40,824,361
営業利益又は営業損失（ ）	56,060,913	6,718,712
経常利益又は経常損失（ ）	56,060,913	6,718,712
当期純利益又は当期純損失（ ）	56,060,913	6,718,712
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（ ）	282,005	3,662,626
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	957,132,137	996,036,476
剰余金増加額又は欠損金減少額	33,843,302	90,749,436
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	33,843,302	90,749,436
剰余金減少額又は欠損金増加額	14,271,114	51,804,704
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	14,271,114	51,804,704
分配金	1 37,010,767	1 19,150,926
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	996,036,476	1,005,448,944

（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、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間 2022年2月20日が休日のため、当計算期間は2021年2月23日から2022年2月21日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	第9期 (2021年 2月22日現在)	第10期 (2022年 2月21日現在)
1 期首元本額	3,625,439,983円	3,701,076,771円
期中追加設定元本額	129,832,227円	321,813,640円
期中一部解約元本額	54,195,439円	192,705,055円
2 受益権の総数	3,701,076,771口	3,830,185,356口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第9期 自 2020年 2月21日 至 2021年 2月22日	第10期 自 2021年 2月23日 至 2022年 2月21日
1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（35,908,145円）、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（20,434,773円）、収益調整金（728,310,100円）及び分配準備積立金（248,394,225円）より分配対象収益は1,033,047,243円（1万口当たり2,791円）であり、うち37,010,767円（1万口当たり100円）を分配金額としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（21,423,171円）、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（749,026,041円）及び分配準備積立金（254,150,658円）より分配対象収益は1,024,599,870円（1万口当たり2,675円）であり、うち19,150,926円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

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	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが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。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「（４）附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスクに晒されております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第9期 (2021年 2月22日現在)	第10期 (2022年 2月21日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（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。 (3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左

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。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
---------------------------	---	--

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	第9期 （2021年 2月22日現在）	第10期 （2022年 2月21日現在）
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額	当計算期間の損益に 含まれた評価差額
親投資信託受益証券	62,348,719	22,350,431
合計	62,348,719	22,350,431

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

該当する事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当する事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第9期 （2021年 2月22日現在）	第10期 （2022年 2月21日現在）
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2691円 （12,691円）	1.2625円 （12,625円）

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・オープン・マザーファンド	60,143,809	252,050,674	
	外国債券インデックス・マザー・ファンド	864,844,189	2,184,942,359	
	日本株式インデックス・マザーファンド	68,904,278	232,159,183	
	日本債券インデックス・マザーファンド	1,146,597,358	1,454,688,068	
合計		2,140,489,634	4,123,840,284	

（注）親投資信託受益証券における券面総額は、証券数です。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

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

該当する事項はありません。

< 参考 >

当ファンドは「日本株式インデックス・マザーファンド」、「日本債券インデックス・マザーファンド」、「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」及び「外国債券インデックス・マザー・ファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「日本株式インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2021年 2月22日現在)	(2022年 2月21日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		326,844	8,316,271
コール・ローン		424,200,395	1,991,556,633
株式		102,630,639,840	83,096,381,980
派生商品評価勘定		19,894,820	3,419,580
未収配当金		138,709,857	132,421,098
前払金		—	43,753,000
差入委託証拠金		24,000,000	88,245,000
流動資産合計		103,237,771,756	85,364,093,562
資産合計		103,237,771,756	85,364,093,562
負債の部			
流動負債			
前受金		17,025,000	—
派生商品評価勘定		511,320	56,572,520
未払金		—	714,640
未払解約金		54,490,000	80,762,000
未払利息		1,158	5,377
その他未払費用		95	799
流動負債合計		72,027,573	138,055,336
負債合計		72,027,573	138,055,336
純資産の部			
元本等			
元本	1	30,837,565,787	25,294,590,585
剰余金			
剰余金又は欠損金()		72,328,178,396	59,931,447,641
元本等合計		103,165,744,183	85,226,038,226
純資産合計		103,165,744,183	85,226,038,226
負債純資産合計		103,237,771,756	85,364,093,562

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年3月6日から、翌年3月5日までであります。

(2) 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	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、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 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(2021年 2月22日現在)	(2022年 2月21日現在)
1 期首元本額	39,957,438,054円	30,837,565,787円
期中追加設定元本額	4,496,542,874円	2,872,328,195円
期中一部解約元本額	13,616,415,141円	8,415,303,397円
元本の内訳		
ファンド名		
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	77,885,317円	68,904,278円
日本株式インデックス・ファンド（年金1）＜適格機関投資家限定＞	966,270,156円	859,722,220円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	1,800,931円	1,114,502円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	59,201,981円	41,611,804円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	108,056円	101,750円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	3,085,321円	2,929,213円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	10,424,368円	9,020,758円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	5,334,743,584円	4,714,525,381円

日本株式インデックス・ファンドVA1 ＜適格機関投資家限定＞	305,896,023円	325,274,735円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	2,807,158円	2,688,492円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	806,857,855円	675,167,737円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	572,925,014円	516,333,400円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	42,340,565円	33,446,008円
日本株式インデックス・ファンドM＜適格機関投資家限定＞	76,543,985円	74,771,376円
日本株式インデックス・ファンドS＜適格機関投資家限定＞	8,413,872,369円	8,228,214,822円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	156,975,461円	129,494,025円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	1,923,669,346円	1,698,014,258円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	310,112,500円	255,626,431円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	1,384,202,736円	1,176,319,740円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	42,681,797円	36,795,063円
日本株式インデックス・ファンドF O F＜適格機関投資家限定＞	4,358,069,504円	— 円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	15,785,928円	13,711,613円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	17,029,816円	15,816,264円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	9,311,206円	7,558,463円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	485,099,134円	415,348,450円
バランスファンドVA20A＜適格機関投資家限定＞	1,890,835円	1,503,156円
バランスファンドVA35B＜適格機関投資家限定＞	2,455,575円	2,349,417円
日本株式インデックス・ファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	283,343,486円	77,848,054円
4資産インデックスバランスVA20＜適格機関投資家限定＞	262,441,846円	230,562,712円
世界分散ファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	1,254,941,539円	1,078,407,897円
T a dリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）年金＜適格機関投資家限定＞	76,579,661円	72,763,467円
フレックス資産配分戦略ファンド＜適格機関投資家限定＞	195,842,569円	67,019,425円

T a d リスクバジェット型マルチ配分 戦略ファンド（ステイブル）＜適格機 関投資家限定＞	42,010,156円	48,862,230円
ステート・ストリート日本株式イン デックス・オープン	2,812,488,573円	3,993,393,519円
世界バランス 4 0 V A ＜適格機関投資 家限定＞	7,210,502円	4,150,810円
世界バランス 6 0 V A ＜適格機関投資 家限定＞	48,644,371円	25,623,020円
グローバルバランス 4 0 V A ＜適格機 関投資家限定＞	531,262円	212,618円
グローバルバランス 4 0 V A 2 ＜適格 機関投資家限定＞	447,501,796円	370,701,614円
グローバルバランス 4 0 V A 3 ＜適格 機関投資家限定＞	17,116,080円	13,814,006円
グローバルバランス 5 0 V A ＜適格機 関投資家限定＞	6,867,425円	4,867,857円
計	30,837,565,787円	25,294,590,585円
2 受益権の総数	30,837,565,787口	25,294,590,585口

（金融商品に関する注記）

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	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが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。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「（3）附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク等の市場リスクに晒されております。 デリバティブ取引には、ファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、ファンドの効率的な運用に資することを目的に利用している株価指数先物取引があり、株価変動リスクに晒されております。

3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。
------------------	---

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2021年 2月22日現在)	(2022年 2月21日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（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。 (3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左

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。 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
---------------------------	--	---

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	（2021年 2月22日現在）	（2022年 2月21日現在）
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	22,250,182,487	688,704,466
合計	22,250,182,487	688,704,466

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始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を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

（単位：円）

区 分	種 類	（2021年 2月22日現在）			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX（先物）	465,475,000	—	484,875,000	19,400,000
	合 計	465,475,000	—	484,875,000	19,400,000

（単位：円）

区 分	種 類	（2022年 2月21日現在）			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX（先物）	2,137,161,000	—	2,084,080,000	53,081,000
	合 計	2,137,161,000	—	2,084,080,000	53,081,000

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。この

ような時価が発表されていない場合には、最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

- ２．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- ３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- ４．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
- ５．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当する事項はありません。

（１口当たり情報に関する注記）

	（ 2021年 2月22日現在 ）	（ 2022年 2月21日現在 ）
1口当たり純資産額 （ 1万口当たり純資産額 ）	3.3455円 （ 33,455円 ）	3.3693円 （ 33,693円 ）

（３）附属明細表

第１ 有価証券明細表

株式

銘 柄	株数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
極洋	1,400	3,205.00	4,487,000	
日本水産	43,000	550.00	23,650,000	
マルハニチロ	6,700	2,579.00	17,279,300	
ハウスイ	200	817.00	163,400	
雪国まいたけ	3,100	1,221.00	3,785,100	
カネコ種苗	1,400	1,546.00	2,164,400	
サカタのタネ	5,200	3,400.00	17,680,000	
ホクト	3,600	1,959.00	7,052,400	
ホクリヨウ	700	687.00	480,900	
ヒノキヤグループ	1,000	2,384.00	2,384,000	
ショーボンドホールディングス	6,200	5,230.00	32,426,000	
ミライト・ホールディングス	13,900	1,935.00	26,896,500	
タマホーム	2,600	2,289.00	5,951,400	
サンヨーホームズ	600	752.00	451,200	
日本アクア	1,600	588.00	940,800	
ファーストコーポレーション	900	732.00	658,800	
ベステラ	800	1,277.00	1,021,600	
R o b o t H o m e	6,900	206.00	1,421,400	
キャンディル	600	493.00	295,800	
スペースバリューホールディングス	1,100	1,145.00	1,259,500	
住石ホールディングス	6,800	137.00	931,600	
日鉄鉱業	1,000	6,370.00	6,370,000	
三井松島ホールディングス	1,700	1,638.00	2,784,600	
I N P E X	173,300	1,127.00	195,309,100	
石油資源開発	5,100	2,680.00	13,668,000	
K & Oエナジーグループ	2,000	1,584.00	3,168,000	
ダイセキ環境ソリューション	700	1,145.00	801,500	
第一カッター興業	1,200	1,309.00	1,570,800	
明豊ファシリティワークス	1,700	710.00	1,207,000	
安藤・間	21,400	934.00	19,987,600	
東急建設	13,100	729.00	9,549,900	
コムシスホールディングス	13,900	2,800.00	38,920,000	
ビーアールホールディングス	5,600	345.00	1,932,000	
高松コンストラクショングループ	2,600	1,999.00	5,197,400	
東建コーポレーション	1,200	9,220.00	11,064,000	
ソネック	700	1,030.00	721,000	
ヤマウラ	1,900	994.00	1,888,600	

オリエンタル白石	14,200	242.00	3,436,400	
大成建設	28,800	3,805.00	109,584,000	
大林組	99,700	969.00	96,609,300	
清水建設	93,400	780.00	72,852,000	
飛鳥建設	2,800	1,128.00	3,158,400	
長谷工コーポレーション	29,700	1,512.00	44,906,400	
松井建設	3,800	741.00	2,815,800	
銭高組	500	4,085.00	2,042,500	
鹿島建設	73,000	1,565.00	114,245,000	
不動テトラ	2,100	1,550.00	3,255,000	
大木建設	1,000	1,323.00	1,323,000	
鉄建建設	2,000	1,924.00	3,848,000	
西松建設	6,100	3,875.00	23,637,500	
三井住友建設	22,300	448.00	9,990,400	
大豊建設	1,500	3,675.00	5,512,500	
佐田建設	2,600	474.00	1,232,400	
ナカノフドー建設	2,200	343.00	754,600	
奥村組	5,900	3,225.00	19,027,500	
東鉄工業	4,400	2,526.00	11,114,400	
イチケン	800	1,844.00	1,475,200	
富士ビー・エス	1,200	494.00	592,800	
浅沼組	1,100	5,320.00	5,852,000	
戸田建設	41,800	769.00	32,144,200	
熊谷組	5,200	2,877.00	14,960,400	
北野建設	700	2,149.00	1,504,300	
植木組	800	1,504.00	1,203,200	
矢作建設工業	4,600	783.00	3,601,800	
ピーエス三菱	3,100	611.00	1,894,100	
日本ハウスホールディングス	7,100	454.00	3,223,400	
大東建託	10,200	12,760.00	130,152,000	
新日本建設	4,500	743.00	3,343,500	
N I P P O	2,400	4,000.00	9,600,000	
東亜道路工業	500	5,020.00	2,510,000	
日本道路	1,000	9,890.00	9,890,000	
東亜建設工業	2,400	2,673.00	6,415,200	
日本国土開発	9,500	532.00	5,054,000	
若築建設	1,800	1,898.00	3,416,400	
東洋建設	11,000	592.00	6,512,000	
五洋建設	39,400	621.00	24,467,400	
世紀東急工業	5,100	818.00	4,171,800	
福田組	1,100	4,220.00	4,642,000	
日本ドライケミカル	800	1,776.00	1,420,800	
住友林業	25,500	2,270.00	57,885,000	
日本基礎技術	2,900	666.00	1,931,400	
巴コーポレーション	4,200	503.00	2,112,600	
大和ハウス工業	92,100	3,352.00	308,719,200	
ライト工業	6,200	1,942.00	12,040,400	
積水ハウス	108,200	2,373.50	256,812,700	
日特建設	1,900	736.00	1,398,400	
北陸電気工事	2,100	805.00	1,690,500	
ユアテック	6,000	713.00	4,278,000	
日本リーテック	2,200	1,438.00	3,163,600	
四電工	1,000	1,599.00	1,599,000	
中電工	4,700	2,152.00	10,114,400	
関電工	16,300	878.00	14,311,400	
きんでん	22,200	1,635.00	36,297,000	
東京エネシス	3,200	945.00	3,024,000	
トーエネック	1,000	3,330.00	3,330,000	
住友電設	2,400	2,241.00	5,378,400	
日本電設工業	5,700	1,537.00	8,760,900	
エクシオグループ	15,000	2,391.00	35,865,000	

新日本空調	2,600	2,036.00	5,293,600	
日本工営	1,900	2,996.00	5,692,400	
九電工	7,700	3,110.00	23,947,000	
三機工業	6,400	1,502.00	9,612,800	
日揮ホールディングス	30,700	1,093.00	33,555,100	
中外炉工業	1,100	1,581.00	1,739,100	
ヤマト	2,800	708.00	1,982,400	
太平電業	2,200	2,688.00	5,913,600	
高砂熱学工業	9,000	1,985.00	17,865,000	
三晃金属工業	500	2,527.00	1,263,500	
NECネットエスアイ	10,500	1,758.00	18,459,000	
朝日工業社	700	3,045.00	2,131,500	
明星工業	6,800	724.00	4,923,200	
大気社	4,900	3,065.00	15,018,500	
ダイダン	2,200	2,307.00	5,075,400	
日比谷総合設備	3,200	1,888.00	6,041,600	
ニッポン	9,500	1,696.00	16,112,000	
日清製粉グループ本社	36,000	1,654.00	59,544,000	
日東富士製粉	400	4,250.00	1,700,000	
昭和産業	2,900	2,700.00	7,830,000	
鳥越製粉	2,700	669.00	1,806,300	
中部飼料	3,500	1,042.00	3,647,000	
フィード・ワン	4,500	682.00	3,069,000	
東洋精糖	500	1,100.00	550,000	
日本甜菜製糖	1,600	1,701.00	2,721,600	
DM三井製糖ホールディングス	3,000	1,999.00	5,997,000	
塩水港精糖	3,900	217.00	846,300	
日新製糖	1,500	1,795.00	2,692,500	
LIFULL	9,100	239.00	2,174,900	
ミクシィ	6,900	2,240.00	15,456,000	
ジェイエイシーリクルートメント	2,600	1,787.00	4,646,200	
日本M&Aセンターホールディングス	49,800	1,686.00	83,962,800	
メンバーズ	1,000	2,877.00	2,877,000	
中広	500	389.00	194,500	
UTグループ	4,400	3,415.00	15,026,000	
アイティメディア	1,000	1,571.00	1,571,000	
E・Jホールディングス	1,700	1,163.00	1,977,100	
夢真ビーネックスグループ	9,800	1,550.00	15,190,000	
コシダカホールディングス	7,700	635.00	4,889,500	
アルトナー	600	875.00	525,000	
パソナグループ	3,400	2,457.00	8,353,800	
CDS	700	1,609.00	1,126,300	
リンクアンドモチベーション	6,900	433.00	2,987,700	
エス・エム・エス	10,400	3,065.00	31,876,000	
サニーサイドアップグループ	800	731.00	584,800	
パーソルホールディングス	30,400	2,503.00	76,091,200	
リニカル	1,900	672.00	1,276,800	
クックパッド	10,000	254.00	2,540,000	
エスクリ	1,200	408.00	489,600	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	1,600	590.00	944,000	
森永製菓	7,500	3,610.00	27,075,000	
中村屋	800	3,375.00	2,700,000	
江崎グリコ	8,800	3,875.00	34,100,000	
名糖産業	1,500	1,676.00	2,514,000	
井村屋グループ	1,900	2,256.00	4,286,400	
不二家	1,800	2,517.00	4,530,600	
山崎製パン	23,900	1,542.00	36,853,800	
第一屋製パン	500	549.00	274,500	
モロゾフ	1,000	2,731.00	2,731,000	
亀田製菓	1,800	4,115.00	7,407,000	
寿スビリッツ	3,100	6,220.00	19,282,000	

カルビー	14,500	2,564.00	37,178,000	
森永乳業	5,900	5,610.00	33,099,000	
六甲バター	2,400	1,565.00	3,756,000	
ヤクルト本社	23,600	6,160.00	145,376,000	
明治ホールディングス	21,100	6,870.00	144,957,000	
雪印メグミルク	7,800	1,992.00	15,537,600	
プリマハム	4,000	2,428.00	9,712,000	
日本ハム	12,200	4,400.00	53,680,000	
林兼産業	1,200	502.00	602,400	
丸大食品	3,300	1,513.00	4,992,900	
S Foods	2,900	3,220.00	9,338,000	
柿安本店	1,100	2,567.00	2,823,700	
伊藤ハム米久ホールディングス	20,900	689.00	14,400,100	
学情	1,000	1,036.00	1,036,000	
スタジオアリス	1,500	2,195.00	3,292,500	
クロスキャット	700	1,767.00	1,236,900	
シミックホールディングス	1,600	1,509.00	2,414,400	
エプコ	500	689.00	344,500	
システナ	45,200	386.00	17,447,200	
N J S	800	2,009.00	1,607,200	
デジタルアーツ	1,700	6,000.00	10,200,000	
日鉄ソリューションズ	4,600	3,530.00	16,238,000	
総合警備保障	12,100	4,235.00	51,243,500	
キューブシステム	1,700	907.00	1,541,900	
いちご	36,200	279.00	10,099,800	
WOW WORLD	400	1,110.00	444,000	
日本駐車場開発	35,900	139.00	4,990,100	
コア	1,300	1,522.00	1,978,600	
カカクコム	22,300	2,553.00	56,931,900	
アイロムグループ	1,100	1,910.00	2,101,000	
セントケア・ホールディング	2,300	818.00	1,881,400	
サイネックス	400	605.00	242,000	
ルネサンス	1,800	1,087.00	1,956,600	
ディップ	5,300	3,460.00	18,338,000	
S B Sホールディングス	2,400	3,030.00	7,272,000	
デジタルホールディングス	2,200	1,552.00	3,414,400	
新日本科学	3,900	1,538.00	5,998,200	
キャリアデザインセンター	700	1,243.00	870,100	
ベネフィット・ワン	11,000	2,455.00	27,005,000	
エムスリー	53,600	4,001.00	214,453,600	
ツカダ・グローバルホールディング	2,800	327.00	915,600	
プラス	200	671.00	134,200	
アウトソーシング	17,600	1,310.00	23,056,000	
ウェルネット	3,200	447.00	1,430,400	
ワールドホールディングス	1,300	2,077.00	2,700,100	
ディー・エヌ・エー	11,700	1,734.00	20,287,800	
博報堂D Yホールディングス	42,300	1,518.00	64,211,400	
ぐるなび	5,100	416.00	2,121,600	
タカミヤ	4,200	383.00	1,608,600	
ジャパンベストレスキューシステム	2,000	999.00	1,998,000	
ファンコミュニケーションズ	8,100	412.00	3,337,200	
ライク	900	1,906.00	1,715,400	
ビジネス・ブレークスルー	1,800	432.00	777,600	
エスプール	8,800	985.00	8,668,000	
W D Bホールディングス	1,500	2,668.00	4,002,000	
手間いらず	400	4,970.00	1,988,000	
ティア	2,300	435.00	1,000,500	
C D G	400	1,327.00	530,800	
アドウェイズ	4,400	642.00	2,824,800	
バリューコマース	2,400	3,325.00	7,980,000	
インフォマート	33,200	618.00	20,517,600	

サッポロホールディングス	11,000	2,408.00	26,488,000	
アサヒグループホールディングス	75,100	5,115.00	384,136,500	
キリンホールディングス	117,300	2,012.00	236,007,600	
宝ホールディングス	21,600	1,176.00	25,401,600	
オエノンホールディングス	8,800	346.00	3,044,800	
養命酒製造	1,000	1,775.00	1,775,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	22,600	1,517.00	34,284,200	
サントリー食品インターナショナル	21,300	4,685.00	99,790,500	
ダイドーグループホールディングス	1,600	5,200.00	8,320,000	
伊藤園	9,700	6,710.00	65,087,000	
キーコーヒー	3,100	2,071.00	6,420,100	
ユニカフェ	1,000	971.00	971,000	
ジャパンフーズ	400	1,233.00	493,200	
日清オイリオグループ	4,100	2,995.00	12,279,500	
不二製油グループ本社	6,900	2,236.00	15,428,400	
かどや製油	400	3,630.00	1,452,000	
J - オイルミルズ	2,900	1,742.00	5,051,800	
ローソン	7,000	4,855.00	33,985,000	
サンエー	2,400	4,100.00	9,840,000	
カワチ薬品	2,300	2,406.00	5,533,800	
エービーシー・マート	4,900	5,220.00	25,578,000	
ハードオフコーポレーション	1,700	800.00	1,360,000	
高千穂交易	1,400	1,567.00	2,193,800	
アスクル	7,000	1,692.00	11,844,000	
ゲオホールディングス	4,400	1,512.00	6,652,800	
アダストリア	3,300	1,739.00	5,738,700	
ジーフット	1,800	331.00	595,800	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	800	385.00	308,000	
オルバヘルスケアホールディングス	500	1,528.00	764,000	
伊藤忠食品	800	5,030.00	4,024,000	
くら寿司	3,300	3,795.00	12,523,500	
キャンドウ	1,100	2,066.00	2,272,600	
エレマテック	2,800	1,067.00	2,987,600	
アイケイ	800	408.00	326,400	
バルグループホールディングス	2,700	1,598.00	4,314,600	
J A L U X	800	2,558.00	2,046,400	
エディオン	14,300	1,194.00	17,074,200	
あらた	2,500	3,900.00	9,750,000	
サーラコーポレーション	6,700	643.00	4,308,100	
ワッツ	1,300	707.00	919,100	
トーメンデバイス	400	6,180.00	2,472,000	
ハローズ	1,200	2,763.00	3,315,600	
J Pホールディングス	9,100	226.00	2,056,600	
フジオフードグループ本社	2,600	1,317.00	3,424,200	
あみやき亭	700	3,020.00	2,114,000	
東京エレクトロン デバイス	900	5,360.00	4,824,000	
ひらまつ	5,200	208.00	1,081,600	
フィールズ	2,600	614.00	1,596,400	
双日	34,600	1,958.00	67,746,800	
アルフレッサ ホールディングス	34,800	1,752.00	60,969,600	
大黒天物産	1,000	4,690.00	4,690,000	
ハニーズホールディングス	2,600	1,025.00	2,665,000	
ファーマライズホールディングス	800	716.00	572,800	
キッコーマン	23,000	8,990.00	206,770,000	
味の素	70,500	3,324.00	234,342,000	
ブルドックソース	1,400	2,005.00	2,807,000	
キューピー	16,700	2,441.00	40,764,700	
ハウス食品グループ本社	12,000	3,015.00	36,180,000	
カゴメ	12,200	3,035.00	37,027,000	
焼津水産化学工業	1,500	917.00	1,375,500	
アリアケジャパン	2,900	5,740.00	16,646,000	

ビエトロ	500	1,805.00	902,500	
エバラ食品工業	800	2,799.00	2,239,200	
やまみ	200	1,838.00	367,600	
ニチレイ	14,500	2,579.00	37,395,500	
横浜冷凍	8,900	867.00	7,716,300	
東洋水産	15,300	4,925.00	75,352,500	
イトアンドホールディングス	1,100	2,299.00	2,528,900	
大冷	400	1,888.00	755,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,800	511.00	919,800	
日清食品ホールディングス	12,500	9,200.00	115,000,000	
永谷園ホールディングス	1,400	2,015.00	2,821,000	
一正蒲鉾	1,300	797.00	1,036,100	
フジッコ	2,900	1,956.00	5,672,400	
ロック・フィールド	3,400	1,590.00	5,406,000	
日本たばこ産業	171,200	2,323.00	397,697,600	
ケンコーマヨネーズ	1,700	1,406.00	2,390,200	
わらべや日洋ホールディングス	2,200	1,833.00	4,032,600	
なとり	1,700	2,070.00	3,519,000	
イフジ産業	700	952.00	666,400	
ピクルスコーポレーション	1,600	1,512.00	2,419,200	
ファーマフーズ	3,100	1,565.00	4,851,500	
北の達人コーポレーション	10,900	221.00	2,408,900	
ユーグレナ	16,500	754.00	12,441,000	
紀文食品	1,900	1,192.00	2,264,800	
スター・マイカ・ホールディングス	1,800	1,239.00	2,230,200	
S R Eホールディングス	800	3,590.00	2,872,000	
A Dワークスグループ	8,100	141.00	1,142,100	
片倉工業	3,500	2,289.00	8,011,500	
ゲンゼ	2,100	3,840.00	8,064,000	
ヒューリック	74,900	1,067.00	79,918,300	
神栄	400	855.00	342,000	
ラサ商事	1,700	1,014.00	1,723,800	
アルペン	2,400	2,141.00	5,138,400	
ハブ	1,300	608.00	790,400	
ラクーンホールディングス	2,300	1,117.00	2,569,100	
クオールホールディングス	3,800	1,292.00	4,909,600	
アルコニックス	3,500	1,344.00	4,704,000	
神戸物産	24,300	3,770.00	91,611,000	
ソリトンシステムズ	1,500	1,497.00	2,245,500	
ジンズホールディングス	2,100	6,530.00	13,713,000	
ビックカメラ	18,900	1,011.00	19,107,900	
D C Mホールディングス	19,600	1,107.00	21,697,200	
ペッパーフードサービス	4,100	355.00	1,455,500	
ハイパー	600	476.00	285,600	
M o n o t a R O	39,600	2,190.00	86,724,000	
東京一番フーズ	700	599.00	419,300	
D Dホールディングス	1,600	558.00	892,800	
あい ホールディングス	4,600	1,782.00	8,197,200	
ディービーエックス	1,200	1,048.00	1,257,600	
きちりホールディングス	1,200	415.00	498,000	
アークランドサービスホールディングス	2,300	2,254.00	5,184,200	
J . フロント リテイリング	37,700	1,030.00	38,831,000	
ドトール・日レスホールディングス	5,600	1,606.00	8,993,600	
マツキヨココカラ&カンパニー	19,200	4,525.00	86,880,000	
ブロンコビリー	1,700	2,241.00	3,809,700	
Z O Z O	21,500	3,280.00	70,520,000	
トレジャー・ファクトリー	1,200	949.00	1,138,800	
物語コーポレーション	1,500	6,640.00	9,960,000	
三越伊勢丹ホールディングス	54,800	967.00	52,991,600	
東洋紡	12,500	1,251.00	15,637,500	
ユニチカ	9,600	309.00	2,966,400	

富士紡ホールディングス	1,400	3,620.00	5,068,000	
日清紡ホールディングス	19,700	1,041.00	20,507,700	
倉敷紡績	2,700	1,911.00	5,159,700	
ダイワボウホールディングス	15,200	1,770.00	26,904,000	
シキボウ	1,700	912.00	1,550,400	
日東紡績	4,800	3,105.00	14,904,000	
トヨタ紡織	13,100	2,160.00	28,296,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	7,400	2,633.00	19,484,200	
H a m e e	900	1,136.00	1,022,400	
マーケットエンタープライズ	200	701.00	140,200	
ラクト・ジャパン	1,100	2,039.00	2,242,900	
ウエルシアホールディングス	16,500	3,090.00	50,985,000	
クリエイトSDホールディングス	4,600	3,130.00	14,398,000	
グリムス	1,500	2,126.00	3,189,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	5,300	808.00	4,282,400	
八洲電機	2,200	956.00	2,103,200	
メディアスホールディングス	1,700	911.00	1,548,700	
レスターホールディングス	2,900	1,977.00	5,733,300	
ジューテックホールディングス	800	1,230.00	984,000	
丸善CHIHホールディングス	3,400	372.00	1,264,800	
大光	1,100	698.00	767,800	
OCHIホールディングス	800	1,357.00	1,085,600	
TOKAIホールディングス	15,100	907.00	13,695,700	
黒谷	700	666.00	466,200	
ミサワ	500	647.00	323,500	
ティーライフ	500	1,346.00	673,000	
Cominix	800	745.00	596,000	
エー・ピーホールディングス	800	456.00	364,800	
三洋貿易	3,100	1,016.00	3,149,600	
チムニー	900	1,137.00	1,023,300	
シュッピン	2,400	1,136.00	2,726,400	
ビューティガレージ	500	3,260.00	1,630,000	
オイシックス・ラ・大地	4,600	2,616.00	12,033,600	
ウイン・パートナーズ	2,200	1,044.00	2,296,800	
ネクステージ	6,300	2,578.00	16,241,400	
ジョイフル本田	9,500	1,556.00	14,782,000	
鳥貴族ホールディングス	1,000	1,836.00	1,836,000	
ホットランド	2,300	1,315.00	3,024,500	
すかいらくホールディングス	40,400	1,495.00	60,398,000	
SFPホールディングス	1,700	1,415.00	2,405,500	
綿半ホールディングス	2,500	1,321.00	3,302,500	
日本毛織	9,400	893.00	8,394,200	
ダイトウボウ	5,000	90.00	450,000	
トーア紡コーポレーション	1,400	407.00	569,800	
ダイドーリミテッド	5,900	146.00	861,400	
ヨシックスホールディングス	600	2,276.00	1,365,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	9,400	1,057.00	9,935,800	
三栄建築設計	1,300	1,615.00	2,099,500	
野村不動産ホールディングス	16,200	2,842.00	46,040,400	
三重交通グループホールディングス	6,200	470.00	2,914,000	
サムティ	5,200	2,134.00	11,096,800	
ディア・ライフ	4,200	517.00	2,171,400	
コーセーアールイー	1,300	577.00	750,100	
地主	2,100	1,783.00	3,744,300	
プレサンスコーポレーション	4,000	1,868.00	7,472,000	
フィル・カンパニー	500	1,131.00	565,500	
THEグローバル社	1,700	176.00	299,200	
ハウスコム	400	1,279.00	511,600	
日本管理センター	1,800	1,022.00	1,839,600	
サンセイランディック	900	805.00	724,500	
エストラスト	600	576.00	345,600	

フージャースホールディングス	3,900	691.00	2,694,900	
オープンハウスグループ	10,000	5,000.00	50,000,000	
東急不動産ホールディングス	92,300	664.00	61,287,200	
飯田グループホールディングス	26,100	2,194.00	57,263,400	
イーランド	500	1,371.00	685,500	
ムゲンエステート	1,700	480.00	816,000	
帝国繊維	3,500	1,908.00	6,678,000	
日本コークス工業	28,200	135.00	3,807,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,600	1,068.00	1,708,800	
ミタチ産業	900	912.00	820,800	
B E E N O S	1,600	1,462.00	2,339,200	
あさひ	2,500	1,306.00	3,265,000	
日本調剤	2,000	1,381.00	2,762,000	
コスモス薬品	3,200	15,760.00	50,432,000	
シップヘルスケアホールディングス	10,000	2,301.00	23,010,000	
トーエル	1,400	910.00	1,274,000	
ソフトクリエイティブホールディングス	1,300	4,075.00	5,297,500	
セブン&アイ・ホールディングス	122,600	5,726.00	702,007,600	
クリエイティブ・レストランツ・ホールディング	17,100	735.00	12,568,500	
明治電機工業	1,100	1,044.00	1,148,400	
ツルハホールディングス	6,800	9,200.00	62,560,000	
デリカフーズホールディングス	1,400	550.00	770,000	
スターティアホールディングス	600	596.00	357,600	
サンマルクホールディングス	2,400	1,631.00	3,914,400	
フェリシモ	800	1,184.00	947,200	
トリドールホールディングス	7,800	2,575.00	20,085,000	
帝人	29,300	1,418.00	41,547,400	
東レ	225,500	660.00	148,830,000	
クラレ	45,500	1,084.00	49,322,000	
旭化成	206,500	1,090.00	225,085,000	
T O K Y O B A S E	2,700	442.00	1,193,400	
稲葉製作所	1,700	1,303.00	2,215,100	
宮地エンジニアリンググループ	900	3,580.00	3,222,000	
トーカロ	8,100	1,326.00	10,740,600	
アルファC o	1,300	1,092.00	1,419,600	
S U M C O	48,400	1,958.00	94,767,200	
川田テクノロジーズ	700	3,825.00	2,677,500	
R S T e c h n o l o g i e s	1,000	5,250.00	5,250,000	
ジェイテックコーポレーション	300	1,503.00	450,900	
信和	1,900	832.00	1,580,800	
ビーロッド	2,300	505.00	1,161,500	
ファーストブラザーズ	500	817.00	408,500	
A n d D oホールディングス	1,600	910.00	1,456,000	
シーアールイー	800	1,655.00	1,324,000	
プロパティエージェンツ	500	1,498.00	749,000	
ケイアイスター不動産	1,400	5,000.00	7,000,000	
アグレ都市デザイン	400	1,357.00	542,800	
グッドコムアセット	1,600	1,136.00	1,817,600	
ジェイ・エス・ビー	600	3,210.00	1,926,000	
テンポイノベーション	1,200	834.00	1,000,800	
グローバル・リンク・マネジメント	300	853.00	255,900	
フェイスネットワーク	200	1,307.00	261,400	
住江織物	700	1,951.00	1,365,700	
日本フエルト	2,000	450.00	900,000	
イチカワ	600	1,412.00	847,200	
エコナックホールディングス	9,000	87.00	783,000	
日東製網	400	1,457.00	582,800	
芦森工業	800	905.00	724,000	
アツギ	2,400	609.00	1,461,600	
ウィルプラスホールディングス	400	904.00	361,600	
J Mホールディングス	2,100	1,782.00	3,742,200	

コメダホールディングス	6,900	2,129.00	14,690,100	
サツドラホールディングス	1,500	636.00	954,000	
アレンザホールディングス	2,500	1,057.00	2,642,500	
串カツ田中ホールディングス	800	2,032.00	1,625,600	
パロックジャパンリミテッド	2,400	850.00	2,040,000	
クスリのアオキホールディングス	3,100	6,960.00	21,576,000	
ダイニック	1,400	754.00	1,055,600	
共和レザー	1,700	674.00	1,145,800	
ビーバンドットコム	400	586.00	234,400	
力の源ホールディングス	1,500	563.00	844,500	
FOOD & LIFE COMPANIE	18,300	3,755.00	68,716,500	
アセンテック	1,000	699.00	699,000	
セーレン	6,500	2,223.00	14,449,500	
ソトー	1,000	837.00	837,000	
東海染工	300	1,165.00	349,500	
小松マテーレ	5,000	1,292.00	6,460,000	
ワコールホールディングス	7,900	2,013.00	15,902,700	
ホギメディカル	4,300	3,300.00	14,190,000	
クラウディアホールディングス	1,300	238.00	309,400	
T S Iホールディングス	9,900	320.00	3,168,000	
マツオカコーポレーション	900	1,163.00	1,046,700	
ワールド	4,000	1,234.00	4,936,000	
T I S	29,700	2,584.00	76,744,800	
J N Sホールディングス	2,100	414.00	869,400	
グリー	14,600	808.00	11,796,800	
GMOペパボ	300	2,286.00	685,800	
コーエーテクモホールディングス	9,900	3,985.00	39,451,500	
三菱総合研究所	1,400	3,710.00	5,194,000	
ボルテージ	900	351.00	315,900	
電算	400	2,282.00	912,800	
A G S	1,600	792.00	1,267,200	
ファインデックス	2,800	694.00	1,943,200	
ブレインパッド	2,400	1,060.00	2,544,000	
K L a b	6,000	398.00	2,388,000	
ボルトウウィン・ピットクルーホールディ	4,100	1,029.00	4,218,900	
ネクソン	70,400	2,508.00	176,563,200	
アイスタイル	9,300	189.00	1,757,700	
エムアップホールディングス	3,600	883.00	3,178,800	
エイチーム	2,100	709.00	1,488,900	
エニグモ	3,100	674.00	2,089,400	
テクノスジャパン	2,800	440.00	1,232,000	
e n i s h	2,000	337.00	674,000	
コロブラ	10,700	630.00	6,741,000	
オルトプラス	2,400	302.00	724,800	
ブロードリーフ	15,200	328.00	4,985,600	
クロス・マーケティンググループ	1,200	850.00	1,020,000	
デジタルハーツホールディングス	1,400	1,471.00	2,059,400	
システム情報	2,200	1,008.00	2,217,600	
メディアドゥ	1,200	2,427.00	2,912,400	
じげん	7,500	298.00	2,235,000	
ブイキューブ	3,300	758.00	2,501,400	
エンカレッジ・テクノロジー	500	522.00	261,000	
サイバーリンクス	1,000	900.00	900,000	
ディー・エル・イー	2,200	224.00	492,800	
フィックスターズ	3,200	678.00	2,169,600	
CARTA HOLDINGS	1,200	2,353.00	2,823,600	
オプティム	2,200	875.00	1,925,000	
セレス	1,100	1,321.00	1,453,100	
S H I F T	1,600	19,920.00	31,872,000	
特種東海製紙	1,900	4,105.00	7,799,500	
ティーガイア	2,700	1,724.00	4,654,800	

セック	400	2,075.00	830,000	
テクマトリックス	5,400	1,557.00	8,407,800	
プロシップ	1,000	1,430.00	1,430,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	8,100	2,838.00	22,987,800	
GMOペイメントゲートウェイ	6,000	10,190.00	61,140,000	
ザッパラス	1,600	492.00	787,200	
システムリサーチ	900	1,762.00	1,585,800	
インターネットイニシアティブ	8,400	3,405.00	28,602,000	
さくらインターネット	3,200	513.00	1,641,600	
ヴィンクス	900	971.00	873,900	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	700	4,170.00	2,919,000	
SRAホールディングス	1,600	2,863.00	4,580,800	
システムインテグレータ	800	535.00	428,000	
朝日ネット	2,900	597.00	1,731,300	
eBASE	3,600	618.00	2,224,800	
アバント	3,500	1,044.00	3,654,000	
アドソル日進	1,100	1,601.00	1,761,100	
ODKソリューションズ	600	655.00	393,000	
フリービット	1,800	894.00	1,609,200	
コムチュア	3,600	2,762.00	9,943,200	
サイバーコム	500	938.00	469,000	
アステリア	2,600	706.00	1,835,600	
アイル	1,700	1,295.00	2,201,500	
王子ホールディングス	130,100	606.00	78,840,600	
日本製紙	14,900	1,148.00	17,105,200	
三菱製紙	4,600	315.00	1,449,000	
北越コーポレーション	20,300	752.00	15,265,600	
中越パルプ工業	1,300	990.00	1,287,000	
巴川製紙所	1,200	884.00	1,060,800	
大王製紙	15,100	1,777.00	26,832,700	
阿波製紙	1,000	330.00	330,000	
マークライنز	1,600	2,625.00	4,200,000	
メディカル・データ・ビジョン	4,100	1,015.00	4,161,500	
gumi	4,200	543.00	2,280,600	
ショーケース	600	432.00	259,200	
モバイルファクトリー	800	927.00	741,600	
テラスカイ	1,000	1,428.00	1,428,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,400	1,258.00	1,761,200	
PCIホールディングス	1,200	951.00	1,141,200	
パイブドHD	500	2,575.00	1,287,500	
アイビーシー	800	557.00	445,600	
ネオジャパン	700	1,059.00	741,300	
PR TIMES	600	2,882.00	1,729,200	
ラクス	10,700	1,674.00	17,911,800	
ランドコンピュータ	600	855.00	513,000	
ダブルスタンダード	800	1,816.00	1,452,800	
オープンドア	2,000	1,944.00	3,888,000	
マイネット	900	487.00	438,300	
アカツキ	1,300	2,783.00	3,617,900	
ベネフィットジャパン	200	1,921.00	384,200	
Ubicomホールディングス	800	2,042.00	1,633,600	
カナミックネットワーク	3,300	444.00	1,465,200	
ノムラシステムコーポレーション	1,200	221.00	265,200	
レンゴー	29,400	861.00	25,313,400	
トーモク	2,000	1,729.00	3,458,000	
ザ・バック	2,300	2,700.00	6,210,000	
チェンジ	5,800	1,611.00	9,343,800	
シンクロ・フード	1,800	261.00	469,800	
オークネット	1,700	1,536.00	2,611,200	
キャピタル・アセット・プランニング	500	796.00	398,000	
セグエグループ	600	523.00	313,800	

エイトレッド	600	1,905.00	1,143,000	
マクロミル	6,300	1,178.00	7,421,400	
ビーグリー	800	1,238.00	990,400	
オロ	1,000	2,412.00	2,412,000	
ユーザーローカル	1,000	1,472.00	1,472,000	
テモナ	500	385.00	192,500	
ニーズウェル	500	608.00	304,000	
マネーフォワード	4,800	4,485.00	21,528,000	
サインポスト	600	861.00	516,600	
昭和電工	27,000	2,239.00	60,453,000	
住友化学	228,800	549.00	125,611,200	
住友精化	1,400	3,300.00	4,620,000	
日産化学	16,900	6,490.00	109,681,000	
ラサ工業	1,000	1,593.00	1,593,000	
クレハ	2,500	8,920.00	22,300,000	
多木化学	1,200	4,705.00	5,646,000	
テイカ	2,200	1,318.00	2,899,600	
石原産業	5,100	1,034.00	5,273,400	
片倉コープアグリ	600	1,177.00	706,200	
日本曹達	4,000	3,355.00	13,420,000	
東ソー	44,900	1,830.00	82,167,000	
トクヤマ	9,900	1,832.00	18,136,800	
セントラル硝子	5,100	2,062.00	10,516,200	
東亜合成	17,200	1,074.00	18,472,800	
大阪ソーダ	2,900	3,120.00	9,048,000	
関東電化工業	6,700	1,181.00	7,912,700	
デンカ	11,400	3,525.00	40,185,000	
イビデン	16,700	5,440.00	90,848,000	
信越化学工業	53,500	17,510.00	936,785,000	
日本カーバイド工業	1,000	1,444.00	1,444,000	
電算システムホールディングス	1,200	2,755.00	3,306,000	
堺化学工業	2,100	1,996.00	4,191,600	
第一稀元素化学工業	2,800	988.00	2,766,400	
エア・ウォーター	29,500	1,677.00	49,471,500	
日本酸素ホールディングス	29,900	2,272.00	67,932,800	
日本化学工業	900	2,460.00	2,214,000	
東邦アセチレン	700	1,214.00	849,800	
日本パーカライジング	16,000	997.00	15,952,000	
高圧ガス工業	5,200	689.00	3,582,800	
チタン工業	500	1,660.00	830,000	
四国化成工業	4,100	1,437.00	5,891,700	
戸田工業	600	2,546.00	1,527,600	
ステラ ケミファ	1,700	2,389.00	4,061,300	
保土谷化学工業	900	4,260.00	3,834,000	
日本触媒	5,200	5,680.00	29,536,000	
大日精化工業	2,700	2,201.00	5,942,700	
カネカ	8,100	3,755.00	30,415,500	
協和キリン	37,300	3,050.00	113,765,000	
三菱瓦斯化学	28,900	1,982.00	57,279,800	
三井化学	28,300	2,978.00	84,277,400	
J S R	29,000	3,410.00	98,890,000	
東京応化工業	5,000	7,210.00	36,050,000	
大阪有機化学工業	2,700	2,985.00	8,059,500	
三菱ケミカルホールディングス	208,200	826.80	172,139,760	
K Hネオケム	5,100	2,792.00	14,239,200	
ダイセル	44,800	869.00	38,931,200	
住友ベークライト	4,900	4,880.00	23,912,000	
積水化学工業	65,200	1,950.00	127,140,000	
日本ゼオン	28,000	1,331.00	37,268,000	
アイカ工業	8,700	3,190.00	27,753,000	
宇部興産	14,600	2,177.00	31,784,200	

積水樹脂	4,700	1,922.00	9,033,400	
タキロンシーアイ	7,100	558.00	3,961,800	
旭有機材	1,800	2,044.00	3,679,200	
ニチバン	1,600	1,789.00	2,862,400	
リケンテクノス	8,000	464.00	3,712,000	
大倉工業	1,700	1,866.00	3,172,200	
積水化成品工業	4,700	452.00	2,124,400	
群栄化学工業	700	3,505.00	2,453,500	
タイガースポリマー	2,100	450.00	945,000	
ミライアル	900	1,538.00	1,384,200	
ダイキアクシス	1,300	722.00	938,600	
ダイキョーニシカワ	6,400	574.00	3,673,600	
竹本容器	1,400	815.00	1,141,000	
森六ホールディングス	1,800	1,856.00	3,340,800	
恵和	800	4,435.00	3,548,000	
日本化薬	24,500	1,127.00	27,611,500	
カーリットホールディングス	3,500	690.00	2,415,000	
ソルクシーズ	3,000	402.00	1,206,000	
C Lホールディングス	600	1,032.00	619,200	
プレステージ・インターナショナル	11,800	700.00	8,260,000	
フェイス	900	679.00	611,100	
プロトコーポレーション	3,200	1,229.00	3,932,800	
ハイマックス	900	1,219.00	1,097,100	
アミューズ	1,700	2,098.00	3,566,600	
野村総合研究所	60,300	3,785.00	228,235,500	
ドリームインキュベータ	800	2,532.00	2,025,600	
サイバネットシステム	2,100	627.00	1,316,700	
クイック	2,000	1,578.00	3,156,000	
T A C	2,500	226.00	565,000	
C Eホールディングス	2,100	463.00	972,300	
日本システム技術	500	2,080.00	1,040,000	
電通グループ	31,300	4,805.00	150,396,500	
インテージホールディングス	3,500	1,759.00	6,156,500	
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,600	1,308.00	2,092,800	
東邦システムサイエンス	700	924.00	646,800	
びあ	1,100	3,250.00	3,575,000	
イオンファンタジー	1,200	2,083.00	2,499,600	
ソースネクスト	12,900	155.00	1,999,500	
シーティーエス	3,600	808.00	2,908,800	
ネクシィーズグループ	900	572.00	514,800	
インフォコム	3,500	2,011.00	7,038,500	
メディカルシステムネットワーク	2,600	513.00	1,333,800	
日本精化	2,200	2,004.00	4,408,800	
扶桑化学工業	2,800	4,480.00	12,544,000	
トリケミカル研究所	3,300	2,776.00	9,160,800	
シンプレクス・ホールディングス	3,800	1,559.00	5,924,200	
H E R O Z	900	888.00	799,200	
ラクスル	3,400	3,060.00	10,404,000	
I P S	800	1,975.00	1,580,000	
F I G	3,100	281.00	871,100	
システムサポート	1,000	1,029.00	1,029,000	
A D E K A	14,300	2,599.00	37,165,700	
日油	10,600	5,030.00	53,318,000	
ミヨシ油脂	1,100	1,135.00	1,248,500	
新日本理化	5,000	238.00	1,190,000	
ハリマ化成グループ	2,400	818.00	1,963,200	
イーソル	1,900	482.00	915,800	
アルテリア・ネットワークス	4,100	1,312.00	5,379,200	
東海ソフト	600	907.00	544,200	
ウイングアーク1 s t	1,800	1,212.00	2,181,600	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン	600	1,663.00	997,800	

サーバーワークス	300	2,302.00	690,600	
東名	200	920.00	184,000	
ヴィッツ	200	1,276.00	255,200	
トピラシシステムズ	500	780.00	390,000	
S a n s a n	11,200	982.00	10,998,400	
L i n k - U	600	731.00	438,600	
ギフト	2,800	834.00	2,335,200	
花王	70,400	5,327.00	375,020,800	
第一工業製薬	1,000	2,706.00	2,706,000	
石原ケミカル	1,600	1,337.00	2,139,200	
日華化学	1,200	760.00	912,000	
ニイタカ	700	2,381.00	1,666,700	
三洋化成工業	1,900	5,080.00	9,652,000	
ベース	600	4,980.00	2,988,000	
J M D C	2,900	5,480.00	15,892,000	
武田薬品工業	250,000	3,494.00	873,500,000	
アステラス製薬	275,800	1,990.50	548,979,900	
大日本住友製薬	19,900	1,247.00	24,815,300	
塩野義製薬	40,000	7,585.00	303,400,000	
わかもと製薬	4,300	290.00	1,247,000	
日本新薬	8,300	7,570.00	62,831,000	
中外製薬	99,500	3,909.00	388,945,500	
科研製薬	5,000	4,140.00	20,700,000	
エーザイ	38,100	5,773.00	219,951,300	
理研ビタミン	3,200	1,780.00	5,696,000	
ロート製薬	16,300	3,755.00	61,206,500	
小野薬品工業	73,000	2,853.00	208,269,000	
久光製薬	8,500	3,645.00	30,982,500	
有機合成薬品工業	3,000	269.00	807,000	
持田製薬	4,000	3,885.00	15,540,000	
参天製薬	59,300	1,284.00	76,141,200	
扶桑薬品工業	1,100	2,315.00	2,546,500	
日本ケミファ	400	2,070.00	828,000	
ツムラ	9,800	3,195.00	31,311,000	
日医工	10,200	836.00	8,527,200	
テルモ	90,000	3,636.00	327,240,000	
H . U . グループホールディングス	7,900	3,040.00	24,016,000	
キッセイ薬品工業	5,600	2,407.00	13,479,200	
生化学工業	5,500	897.00	4,933,500	
栄研化学	5,700	1,739.00	9,912,300	
日水製薬	1,200	989.00	1,186,800	
鳥居薬品	1,700	2,959.00	5,030,300	
J C R ファーマ	9,000	2,144.00	19,296,000	
東和薬品	4,600	3,005.00	13,823,000	
富士製薬工業	2,100	1,010.00	2,121,000	
ゼリア新薬工業	5,800	1,958.00	11,356,400	
第一三共	250,000	2,549.50	637,375,000	
キョーリン製薬ホールディングス	6,300	1,830.00	11,529,000	
大幸薬品	5,000	601.00	3,005,000	
ダイト	2,000	2,941.00	5,882,000	
大塚ホールディングス	66,100	4,030.00	266,383,000	
大正製薬ホールディングス	7,600	5,720.00	43,472,000	
ペプチドリーム	16,700	2,043.00	34,118,100	
大日本塗料	3,400	818.00	2,781,200	
日本ペイントホールディングス	117,000	1,060.00	124,020,000	
関西ペイント	32,300	2,399.00	77,487,700	
神東塗料	2,000	153.00	306,000	
中国塗料	7,400	907.00	6,711,800	
日本特殊塗料	2,400	879.00	2,109,600	
藤倉化成	3,700	461.00	1,705,700	
太陽ホールディングス	4,600	3,020.00	13,892,000	

D I C	13,100	2,657.00	34,806,700	
サカティンクス	6,200	935.00	5,797,000	
東洋インキＳＣホールディングス	6,700	1,890.00	12,663,000	
T & K T O K A	2,400	900.00	2,160,000	
アルプス技研	2,600	1,955.00	5,083,000	
サニックス	4,900	197.00	965,300	
ダイオーズ	700	1,006.00	704,200	
日本空調サービス	3,100	788.00	2,442,800	
オリエンタルランド	35,900	21,155.00	759,464,500	
フォーカスシステムズ	2,200	899.00	1,977,800	
ダスキン	7,000	2,774.00	19,418,000	
パーク２４	17,000	1,768.00	30,056,000	
明光ネットワークジャパン	4,000	569.00	2,276,000	
ファルコホールディングス	1,600	2,006.00	3,209,600	
クレスコ	2,200	1,774.00	3,902,800	
フジ・メディア・ホールディングス	30,000	1,255.00	37,650,000	
秀英予備校	1,000	428.00	428,000	
田谷	800	559.00	447,200	
ラウンドワン	8,400	1,311.00	11,012,400	
リゾートトラスト	14,000	1,971.00	27,594,000	
オービック	9,800	17,660.00	173,068,000	
ジャストシステム	4,500	5,330.00	23,985,000	
T D C ソフト	2,600	1,105.00	2,873,000	
Zホールディングス	453,600	557.80	253,018,080	
ビー・エム・エル	4,000	3,265.00	13,060,000	
トレンドマイクロ	16,700	5,890.00	98,363,000	
りらいあコミュニケーションズ	4,500	1,047.00	4,711,500	
I Dホールディングス	1,800	849.00	1,528,200	
リソー教育	13,700	390.00	5,343,000	
日本オラクル	5,100	8,130.00	41,463,000	
早稲田アカデミー	1,200	1,001.00	1,201,200	
アルファシステムズ	800	3,715.00	2,972,000	
フューチャー	6,600	1,328.00	8,764,800	
C A C H o l d i n g s	1,800	1,297.00	2,334,600	
S B テクノロジー	1,100	2,517.00	2,768,700	
トーセ	700	719.00	503,300	
ユー・エス・エス	34,000	1,959.00	66,606,000	
オービックビジネスコンサルタント	3,000	4,155.00	12,465,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	14,200	2,907.00	41,279,400	
アイティフォー	3,900	779.00	3,038,100	
東京個別指導学院	2,800	624.00	1,747,200	
東計電算	400	4,975.00	1,990,000	
サイバーエージェント	74,900	1,491.00	111,675,900	
楽天グループ	156,100	966.00	150,792,600	
エクスネット	500	986.00	493,000	
クリーク・アンド・リバー社	1,500	1,672.00	2,508,000	
モーニングスター	4,700	578.00	2,716,600	
テー・オー・ダブリュー	5,000	297.00	1,485,000	
大塚商会	16,900	4,240.00	71,656,000	
サイボウズ	4,300	1,287.00	5,534,100	
山田コンサルティンググループ	1,800	1,154.00	2,077,200	
セントラルスポーツ	1,100	2,409.00	2,649,900	
バラカ	800	1,699.00	1,359,200	
電通国際情報サービス	4,600	3,715.00	17,089,000	
A C C E S S	4,000	581.00	2,324,000	
デジタルガレージ	5,200	3,905.00	20,306,000	
E M システムズ	5,300	706.00	3,741,800	
ウェザーニューズ	1,000	7,600.00	7,600,000	
C I J	2,000	808.00	1,616,000	
ビジネスエンジニアリング	300	3,590.00	1,077,000	
日本エンタープライズ	4,000	172.00	688,000	

WOWOW	1,600	1,748.00	2,796,800	
スカラ	2,900	670.00	1,943,000	
インテリジェント ウェイブ	1,800	577.00	1,038,600	
フルキャストホールディングス	2,500	2,273.00	5,682,500	
エン・ジャパン	4,900	2,914.00	14,278,600	
あすか製薬ホールディングス	3,800	1,068.00	4,058,400	
サワイグループホールディングス	6,900	4,425.00	30,532,500	
富士フイルムホールディングス	55,900	7,531.00	420,982,900	
コニカミノルタ	69,300	501.00	34,719,300	
資生堂	59,300	6,746.00	400,037,800	
ライオン	38,400	1,516.00	58,214,400	
高砂香料工業	2,100	2,711.00	5,693,100	
マンダム	6,900	1,392.00	9,604,800	
ミルボン	3,900	6,020.00	23,478,000	
ファンケル	12,800	3,255.00	41,664,000	
コーセー	6,000	13,360.00	80,160,000	
コタ	2,000	1,597.00	3,194,000	
シーボン	400	1,828.00	731,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	13,700	1,862.00	25,509,400	
ノエビアホールディングス	2,700	5,180.00	13,986,000	
アジュバンホールディングス	800	1,145.00	916,000	
新日本製薬	900	1,348.00	1,213,200	
エスデー	2,000	1,561.00	3,122,000	
アグロ カネショウ	1,000	1,186.00	1,186,000	
コニシ	5,200	1,557.00	8,096,400	
長谷川香料	5,600	2,345.00	13,132,000	
星光 P M C	2,100	602.00	1,264,200	
小林製薬	8,900	9,830.00	87,487,000	
荒川化学工業	2,800	1,127.00	3,155,600	
メック	2,400	2,859.00	6,861,600	
日本高純度化学	800	2,531.00	2,024,800	
タカラバイオ	8,400	2,425.00	20,370,000	
J C U	3,600	4,595.00	16,542,000	
新田ゼラチン	2,500	652.00	1,630,000	
O A T アグリオ	800	1,887.00	1,509,600	
デクセリアルズ	8,200	2,960.00	24,272,000	
アース製薬	2,600	5,670.00	14,742,000	
北興化学工業	2,900	837.00	2,427,300	
大成ラミック	1,000	2,766.00	2,766,000	
クミアイ化学工業	11,900	793.00	9,436,700	
日本農薬	5,500	533.00	2,931,500	
富士興産	1,000	947.00	947,000	
ニチレキ	3,700	1,309.00	4,843,300	
ユシロ化学工業	1,600	1,048.00	1,676,800	
ビービー・カストロール	1,100	1,285.00	1,413,500	
富士石油	8,700	268.00	2,331,600	
M O R E S C O	1,300	1,142.00	1,484,600	
出光興産	35,300	3,015.00	106,429,500	
E N E O S ホールディングス	478,400	454.30	217,337,120	
コスモエネルギーホールディングス	9,200	2,519.00	23,174,800	
テスホールディングス	1,800	1,253.00	2,255,400	
インフロニア・ホールディングス	42,500	1,060.00	45,050,000	
横浜ゴム	18,600	1,765.00	32,829,000	
T O Y O T I R E	16,900	1,602.00	27,073,800	
ブリヂストン	91,600	5,134.00	470,274,400	
住友ゴム工業	28,800	1,174.00	33,811,200	
藤倉コンポジット	2,400	685.00	1,644,000	
オカモト	1,900	4,005.00	7,609,500	
アキレス	2,100	1,269.00	2,664,900	
フコク	1,700	974.00	1,655,800	
ニッタ	3,400	2,734.00	9,295,600	

クリエートメディック	1,000	978.00	978,000	
住友理工	6,500	599.00	3,893,500	
三ツ星ベルト	3,800	2,111.00	8,021,800	
バンドー化学	5,000	852.00	4,260,000	
A G C	29,200	5,600.00	163,520,000	
日本板硝子	15,100	509.00	7,685,900	
石塚硝子	500	2,048.00	1,024,000	
有沢製作所	4,700	993.00	4,667,100	
日本山村硝子	1,500	805.00	1,207,500	
日本電気硝子	12,900	2,824.00	36,429,600	
オハラ	1,200	1,148.00	1,377,600	
住友大阪セメント	5,900	3,545.00	20,915,500	
太平洋セメント	18,200	2,321.00	42,242,200	
リソルホールディングス	400	4,390.00	1,756,000	
日本ヒューム	3,300	700.00	2,310,000	
日本コンクリート工業	6,600	299.00	1,973,400	
三谷セキサン	1,500	6,260.00	9,390,000	
アジアパイルホールディングス	4,700	431.00	2,025,700	
東海カーボン	26,900	1,137.00	30,585,300	
日本カーボン	1,700	4,160.00	7,072,000	
東洋炭素	2,100	3,145.00	6,604,500	
ノリタケカンパニーリミテド	1,800	4,455.00	8,019,000	
T O T O	22,700	5,070.00	115,089,000	
日本碍子	34,400	1,857.00	63,880,800	
日本特殊陶業	24,200	2,122.00	51,352,400	
ダントーホールディングス	3,000	324.00	972,000	
M A R U W A	1,100	14,290.00	15,719,000	
品川リフラクトリーズ	800	3,915.00	3,132,000	
黒崎播磨	600	4,375.00	2,625,000	
ヨータイ	2,200	1,262.00	2,776,400	
イソライト工業	1,300	1,266.00	1,645,800	
東京窯業	3,800	304.00	1,155,200	
ニッカトー	1,900	572.00	1,086,800	
フジミインコーポレーテッド	2,600	6,490.00	16,874,000	
クニミネ工業	1,100	1,015.00	1,116,500	
エーアンドエーマテリアル	800	912.00	729,600	
ニチアス	7,300	2,623.00	19,147,900	
日本製鉄	140,800	2,074.00	292,019,200	
神戸製鋼所	58,600	614.00	35,980,400	
中山製鋼所	4,500	467.00	2,101,500	
合同製鉄	1,600	1,379.00	2,206,400	
ジェイ エフ イー ホールディングス	84,900	1,707.00	144,924,300	
東京製鉄	10,600	1,144.00	12,126,400	
共英製鋼	3,500	1,613.00	5,645,500	
大和工業	6,100	3,670.00	22,387,000	
東京鐵鋼	1,200	1,370.00	1,644,000	
大阪製鐵	1,700	1,220.00	2,074,000	
淀川製鋼所	4,200	2,730.00	11,466,000	
丸一鋼管	11,100	2,969.00	32,955,900	
モリ工業	900	2,539.00	2,285,100	
大同特殊鋼	5,200	4,185.00	21,762,000	
日本高周波鋼業	1,400	344.00	481,600	
日本冶金工業	2,300	2,913.00	6,699,900	
山陽特殊製鋼	3,200	2,077.00	6,646,400	
愛知製鋼	1,700	2,630.00	4,471,000	
日立金属	33,900	2,074.00	70,308,600	
日本金属	1,000	1,334.00	1,334,000	
大平洋金属	1,900	3,355.00	6,374,500	
新日本電工	20,000	344.00	6,880,000	
栗本鐵工所	1,500	1,539.00	2,308,500	
虹技	500	955.00	477,500	

日本鋳鉄管	300	999.00	299,700	
日本製鋼所	9,500	3,675.00	34,912,500	
三菱製鋼	1,900	1,333.00	2,532,700	
日亜鋼業	4,300	279.00	1,199,700	
日本精線	500	4,415.00	2,207,500	
エンビプロ・ホールディングス	1,200	1,279.00	1,534,800	
大紀アルミニウム工業所	4,900	1,673.00	8,197,700	
日本軽金属ホールディングス	7,900	1,824.00	14,409,600	
三井金属鉱業	8,500	3,325.00	28,262,500	
東邦亜鉛	1,800	2,694.00	4,849,200	
三菱マテリアル	20,700	2,089.00	43,242,300	
住友金属鉱山	40,200	5,439.00	218,647,800	
DOWAホールディングス	8,600	4,900.00	42,140,000	
古河機械金属	5,100	1,300.00	6,630,000	
エス・サイエンス	19,300	24.00	463,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	3,200	860.00	2,752,000	
東邦チタニウム	5,500	910.00	5,005,000	
UACJ	4,900	2,363.00	11,578,700	
CKサンエツ	700	4,025.00	2,817,500	
古河電気工業	9,900	2,402.00	23,779,800	
住友電気工業	117,600	1,580.00	185,808,000	
フジクラ	34,900	655.00	22,859,500	
昭和電線ホールディングス	2,700	1,857.00	5,013,900	
東京特殊電線	400	2,851.00	1,140,400	
タツタ電線	5,400	451.00	2,435,400	
カナレ電気	400	1,510.00	604,000	
平河ヒューテック	1,800	1,172.00	2,109,600	
リョービ	3,800	1,111.00	4,221,800	
アーレスティ	3,100	379.00	1,174,900	
アサヒホールディングス	12,600	2,153.00	27,127,800	
東洋製罐グループホールディングス	20,200	1,588.00	32,077,600	
ホッカンホールディングス	1,800	1,398.00	2,516,400	
コロナ	1,800	901.00	1,621,800	
横河ブリッジホールディングス	5,500	2,062.00	11,341,000	
駒井ハルテック	600	2,048.00	1,228,800	
高田機工	300	2,888.00	866,400	
三和ホールディングス	29,900	1,281.00	38,301,900	
文化シャッター	9,500	1,057.00	10,041,500	
三協立山	3,900	639.00	2,492,100	
アルインコ	2,300	912.00	2,097,600	
東洋シャッター	600	562.00	337,200	
LIXIL	49,500	2,600.00	128,700,000	
日本ファイルコン	2,200	519.00	1,141,800	
ノーリツ	6,000	1,567.00	9,402,000	
長府製作所	3,300	1,982.00	6,540,600	
リンナイ	5,900	9,600.00	56,640,000	
ユニプレス	5,100	814.00	4,151,400	
ダイニチ工業	1,400	697.00	975,800	
日東精工	3,800	510.00	1,938,000	
三洋工業	400	1,844.00	737,600	
岡部	6,200	721.00	4,470,200	
ジーテクト	3,800	1,456.00	5,532,800	
東プレ	5,800	1,225.00	7,105,000	
高周波熱錬	5,900	597.00	3,522,300	
東京製綱	1,800	844.00	1,519,200	
サンコール	2,100	492.00	1,033,200	
モリテック スチール	2,800	311.00	870,800	
パイオラックス	4,600	1,767.00	8,128,200	
エイチワン	3,200	657.00	2,102,400	
日本発條	28,800	894.00	25,747,200	
中央発條	1,500	791.00	1,186,500	

アドバネクス	600	1,658.00	994,800	
三浦工業	13,700	3,155.00	43,223,500	
タクマ	10,600	1,446.00	15,327,600	
テクノプロ・ホールディングス	18,200	3,305.00	60,151,000	
アトラグループ	700	259.00	181,300	
インターワークス	700	372.00	260,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	1,400	3,680.00	5,152,000	
K e e P e r 技研	2,000	2,182.00	4,364,000	
ファーストロジック	400	808.00	323,200	
三機サービス	800	1,010.00	808,000	
G u n o s y	1,900	799.00	1,518,100	
デザインワン・ジャパン	600	186.00	111,600	
イー・ガーディアン	1,200	2,535.00	3,042,000	
リブセンス	2,500	176.00	440,000	
ジャパンマテリアル	9,500	1,728.00	16,416,000	
ベクトル	4,000	1,098.00	4,392,000	
ウチヤマホールディングス	1,300	324.00	421,200	
チャーム・ケア・コーポレーション	2,200	1,064.00	2,340,800	
キャリアリンク	1,000	1,418.00	1,418,000	
I B J	2,400	793.00	1,903,200	
アサンテ	1,200	1,561.00	1,873,200	
バリューHR	1,200	2,462.00	2,954,400	
M & A キャピタルパートナーズ	2,500	4,955.00	12,387,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,100	1,373.00	1,510,300	
E R I ホールディングス	900	1,150.00	1,035,000	
アビスト	400	2,911.00	1,164,400	
シグマクシス・ホールディングス	1,600	2,029.00	3,246,400	
ウィルグループ	2,100	1,206.00	2,532,600	
エスクロー・エージェント・ジャパン	5,000	178.00	890,000	
メドピア	2,400	2,835.00	6,804,000	
レアジョブ	600	787.00	472,200	
リクルートホールディングス	234,500	4,643.00	1,088,783,500	
エラン	4,100	939.00	3,849,900	
ツガミ	6,500	1,270.00	8,255,000	
オークマ	3,700	4,755.00	17,593,500	
芝浦機械	3,400	3,055.00	10,387,000	
アマダ	49,600	1,038.00	51,484,800	
アイダエンジニアリング	8,200	974.00	7,986,800	
滝澤鉄工所	1,000	1,204.00	1,204,000	
F U J I	14,500	2,323.00	33,683,500	
牧野フライス製作所	3,400	3,700.00	12,580,000	
オーエスジー	14,700	1,973.00	29,003,100	
ダイジェット工業	400	1,005.00	402,000	
旭ダイヤモンド工業	8,700	573.00	4,985,100	
D M G 森精機	18,800	1,691.00	31,790,800	
ソディック	6,900	767.00	5,292,300	
ディスコ	4,600	33,950.00	156,170,000	
日東工器	1,600	1,604.00	2,566,400	
日進工具	2,600	1,416.00	3,681,600	
パンチ工業	2,900	494.00	1,432,600	
富士ダイス	1,600	617.00	987,200	
土木管理総合試験所	1,200	323.00	387,600	
ネットマーケティング	1,300	408.00	530,400	
日本郵政	396,900	969.50	384,794,550	
ベルシステム 2 4 ホールディングス	4,300	1,369.00	5,886,700	
鎌倉新書	3,200	492.00	1,574,400	
S M N	400	594.00	237,600	
一蔵	400	374.00	149,600	
グローバルキッズCOMPANY	400	793.00	317,200	
エアトリ	1,900	3,205.00	6,089,500	
アトラエ	2,200	1,975.00	4,345,000	

ストライク	1,200	4,345.00	5,214,000	
ソラスト	7,700	1,029.00	7,923,300	
セラク	1,000	1,157.00	1,157,000	
インソース	3,000	1,914.00	5,742,000	
豊田自動織機	25,700	9,090.00	233,613,000	
豊和工業	1,600	824.00	1,318,400	
ＯＫＫ	1,000	733.00	733,000	
石川製作所	900	1,442.00	1,297,800	
東洋機械金属	1,900	564.00	1,071,600	
津田駒工業	800	589.00	471,200	
エンシュウ	1,100	650.00	715,000	
島精機製作所	4,600	1,829.00	8,413,400	
オプトラン	3,900	1,905.00	7,429,500	
ＮＣホールディングス	800	1,855.00	1,484,000	
イワキポンプ	2,200	1,022.00	2,248,400	
フリュー	3,000	1,013.00	3,039,000	
ヤマシンフィルタ	6,700	359.00	2,405,300	
日阪製作所	3,800	821.00	3,119,800	
やまびこ	6,000	1,313.00	7,878,000	
野村マイクロ・サイエンス	700	3,495.00	2,446,500	
平田機工	1,500	5,270.00	7,905,000	
ベガサスミシン製造	3,300	531.00	1,752,300	
マルマエ	1,200	2,396.00	2,875,200	
タツモ	1,500	1,575.00	2,362,500	
ナブテスコ	17,900	3,155.00	56,474,500	
三井海洋開発	3,300	1,176.00	3,880,800	
レオン自動機	3,300	1,014.00	3,346,200	
ＳＭＣ	9,300	67,490.00	627,657,000	
ホソカワミクロン	2,200	2,647.00	5,823,400	
ユニオンツール	1,200	3,590.00	4,308,000	
オイレス工業	4,600	1,556.00	7,157,600	
日精エー・エス・ビー機械	1,100	2,957.00	3,252,700	
サトーホールディングス	4,300	2,001.00	8,604,300	
技研製作所	2,800	3,675.00	10,290,000	
日本エアーテック	1,500	1,023.00	1,534,500	
カワタ	800	1,009.00	807,200	
日精樹脂工業	2,300	1,002.00	2,304,600	
オカダアイヨン	1,200	1,423.00	1,707,600	
ワイエイシイホールディングス	1,200	1,069.00	1,282,800	
小松製作所	144,200	2,725.50	393,017,100	
住友重機械工業	18,200	2,747.00	49,995,400	
日立建機	12,700	2,921.00	37,096,700	
日工	4,600	623.00	2,865,800	
巴工業	1,200	2,310.00	2,772,000	
井関農機	3,100	1,218.00	3,775,800	
ＴＯＷＡ	2,700	2,314.00	6,247,800	
丸山製作所	800	1,509.00	1,207,200	
北川鉄工所	1,600	1,344.00	2,150,400	
シンニッタン	4,100	226.00	926,600	
ローツェ	1,600	10,410.00	16,656,000	
タカキタ	1,300	615.00	799,500	
クボタ	154,100	2,058.00	317,137,800	
荏原実業	1,400	2,157.00	3,019,800	
東洋エンジニアリング	4,400	566.00	2,490,400	
三菱化工機	1,000	2,008.00	2,008,000	
月島機械	5,800	1,042.00	6,043,600	
帝国電機製作所	2,100	1,397.00	2,933,700	
東京機械製作所	1,300	770.00	1,001,000	
新東工業	7,400	700.00	5,180,000	
澁谷工業	2,800	2,438.00	6,826,400	
アイチ コーポレーション	4,400	859.00	3,779,600	

小森コーポレーション	7,900	736.00	5,814,400	
鶴見製作所	2,600	1,785.00	4,641,000	
住友精密工業	500	1,922.00	961,000	
日本ギア工業	1,200	272.00	326,400	
酒井重工業	600	2,963.00	1,777,800	
荏原製作所	13,200	5,650.00	74,580,000	
石井鐵工所	500	3,005.00	1,502,500	
西島製作所	3,100	959.00	2,972,900	
北越工業	3,200	896.00	2,867,200	
ダイキン工業	40,500	21,450.00	868,725,000	
オルガノ	900	7,740.00	6,966,000	
トーヨーカネツ	1,200	2,403.00	2,883,600	
栗田工業	17,200	4,730.00	81,356,000	
椿本チエイン	4,100	3,285.00	13,468,500	
大同工業	1,700	925.00	1,572,500	
日機装	9,600	782.00	7,507,200	
木村化工機	2,700	819.00	2,211,300	
レイズネクスト	4,700	1,120.00	5,264,000	
アネスト岩田	5,300	816.00	4,324,800	
ダイフク	17,500	8,380.00	146,650,000	
サムコ	800	2,298.00	1,838,400	
加藤製作所	1,800	819.00	1,474,200	
油研工業	500	1,752.00	876,000	
タダノ	16,500	980.00	16,170,000	
フジテック	11,800	2,693.00	31,777,400	
C K D	9,500	2,020.00	19,190,000	
キトー	2,600	1,676.00	4,357,600	
平和	9,000	1,945.00	17,505,000	
理想科学工業	2,400	2,171.00	5,210,400	
S A N K Y O	6,800	3,225.00	21,930,000	
日本金銭機械	3,600	628.00	2,260,800	
マースグループホールディングス	2,000	1,635.00	3,270,000	
フクシマガリレイ	2,200	3,855.00	8,481,000	
オーイズミ	900	394.00	354,600	
ダイコク電機	1,400	1,243.00	1,740,200	
竹内製作所	4,800	2,602.00	12,489,600	
アマノ	8,300	2,255.00	18,716,500	
J U K I	4,300	676.00	2,906,800	
サンデン	4,200	202.00	848,400	
ジャノメ	3,000	719.00	2,157,000	
ブラザー工業	38,800	2,091.00	81,130,800	
マックス	4,200	1,711.00	7,186,200	
モリタホールディングス	5,300	1,247.00	6,609,100	
グローリー	8,300	2,087.00	17,322,100	
新晃工業	2,900	1,720.00	4,988,000	
大和冷機工業	4,600	1,127.00	5,184,200	
セガサミーホールディングス	31,500	2,145.00	67,567,500	
日本ビストンリング	1,300	1,370.00	1,781,000	
リケン	1,300	2,572.00	3,343,600	
T P R	4,200	1,416.00	5,947,200	
ツバキ・ナカシマ	7,100	964.00	6,844,400	
ホシザキ	9,300	7,870.00	73,191,000	
大豊工業	2,900	718.00	2,082,200	
日本精工	59,800	738.00	44,132,400	
N T N	68,000	226.00	15,368,000	
ジェイテクト	30,800	1,029.00	31,693,200	
不二越	2,700	4,190.00	11,313,000	
ミネベアミツミ	54,800	2,516.00	137,876,800	
日本トムソン	8,500	534.00	4,539,000	
T H K	17,900	2,704.00	48,401,600	
ユーシン精機	2,400	684.00	1,641,600	

前澤給装工業	2,100	980.00	2,058,000	
イーグル工業	3,800	1,063.00	4,039,400	
前澤工業	1,800	625.00	1,125,000	
日本ピラー工業	3,200	2,827.00	9,046,400	
キット	11,000	671.00	7,381,000	
日立製作所	153,000	6,009.00	919,377,000	
東芝	55,600	4,516.00	251,089,600	
三菱電機	318,100	1,425.00	453,292,500	
富士電機	19,200	6,060.00	116,352,000	
東洋電機製造	1,200	963.00	1,155,600	
安川電機	34,200	4,665.00	159,543,000	
シンフォニアテクノロジー	4,000	1,280.00	5,120,000	
明電舎	5,500	2,367.00	13,018,500	
オリジン	700	1,233.00	863,100	
山洋電気	1,400	4,910.00	6,874,000	
デンヨー	2,700	1,715.00	4,630,500	
PHCホールディングス	3,700	1,551.00	5,738,700	
ベйкаレント・コンサルティング	2,100	42,700.00	89,670,000	
Orchestra Holdings	600	2,710.00	1,626,000	
アイモパイル	800	1,222.00	977,600	
キャリアインデックス	1,400	675.00	945,000	
MS - Japan	1,200	815.00	978,000	
船場	500	742.00	371,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディング	9,600	1,486.00	14,265,600	
フルテック	400	1,312.00	524,800	
グリーンズ	1,500	512.00	768,000	
ツナググループ・ホールディングス	400	266.00	106,400	
GameWith	700	449.00	314,300	
ソウルドアウト	700	1,804.00	1,262,800	
MS & Consulting	500	701.00	350,500	
ウェルビー	2,100	1,190.00	2,499,000	
エル・ティー・エス	300	1,980.00	594,000	
ミダックホールディングス	1,300	2,323.00	3,019,900	
日総工産	2,300	848.00	1,950,400	
キュービーネットホールディングス	1,400	1,702.00	2,382,800	
RPAホールディングス	3,300	331.00	1,092,300	
三櫻工業	4,300	713.00	3,065,900	
マキタ	38,700	4,136.00	160,063,200	
東芝テック	3,400	4,910.00	16,694,000	
芝浦メカトロニクス	600	7,680.00	4,608,000	
マブチモーター	7,300	4,180.00	30,514,000	
日本電産	82,400	9,956.00	820,374,400	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,600	380.00	608,000	
トレックス・セミコンダクター	1,700	2,485.00	4,224,500	
東光高岳	1,800	1,435.00	2,583,000	
ダブル・スコープ	9,400	1,067.00	10,029,800	
宮越ホールディングス	1,200	868.00	1,041,600	
ダイヘン	3,500	4,150.00	14,525,000	
ヤーマン	5,100	931.00	4,748,100	
JVCケンウッド	27,000	189.00	5,103,000	
ミマキエンジニアリング	2,700	726.00	1,960,200	
I - P E X	1,400	1,466.00	2,052,400	
日新電機	7,600	1,414.00	10,746,400	
大崎電気工業	6,200	487.00	3,019,400	
オムロン	26,500	7,867.00	208,475,500	
日東工業	4,200	1,597.00	6,707,400	
I D E C	3,900	2,407.00	9,387,300	
正興電機製作所	1,100	1,080.00	1,188,000	
不二電機工業	600	1,064.00	638,400	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	10,300	2,395.00	24,668,500	
サクサホールディングス	700	1,402.00	981,400	

メルコホールディングス	700	3,730.00	2,611,000	
テクノメディカ	700	1,541.00	1,078,700	
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	1,000	1,012.00	1,012,000	
日本電気	40,400	5,120.00	206,848,000	
富士通	28,600	16,150.00	461,890,000	
沖電気工業	12,800	887.00	11,353,600	
岩崎通信機	1,300	816.00	1,060,800	
電気興業	1,500	2,362.00	3,543,000	
サンケン電気	3,000	5,220.00	15,660,000	
ナカヨ	800	1,123.00	898,400	
アイホン	1,700	2,114.00	3,593,800	
ルネサスエレクトロニクス	172,600	1,392.00	240,259,200	
セイコーエプソン	39,400	1,838.00	72,417,200	
ワコム	24,600	850.00	20,910,000	
アルバック	6,300	5,800.00	36,540,000	
アクセル	1,200	1,111.00	1,333,200	
E I Z O	2,400	3,665.00	8,796,000	
ジャパンディスプレイ	110,000	44.00	4,840,000	
日本信号	8,400	881.00	7,400,400	
京三製作所	7,100	422.00	2,996,200	
能美防災	4,300	2,021.00	8,690,300	
ホーチキ	2,200	1,213.00	2,668,600	
星和電機	1,400	484.00	677,600	
エレコム	7,400	1,548.00	11,455,200	
パナソニック	339,300	1,209.00	410,213,700	
シャープ	36,200	1,181.00	42,752,200	
アンリツ	20,400	1,624.00	33,129,600	
富士通ゼネラル	8,700	2,567.00	22,332,900	
ソニーグループ	199,300	11,890.00	2,369,677,000	
T D K	46,100	4,760.00	219,436,000	
帝国通信工業	1,300	1,374.00	1,786,200	
タムラ製作所	11,700	601.00	7,031,700	
アルプスアルパイン	28,100	1,209.00	33,972,900	
池上通信機	1,300	642.00	834,600	
日本電波工業	2,900	1,141.00	3,308,900	
鈴木	1,600	829.00	1,326,400	
メイコー	2,500	3,850.00	9,625,000	
日本トリム	700	2,700.00	1,890,000	
ローランド ディー . ジー .	2,000	2,839.00	5,678,000	
フォスター電機	3,400	773.00	2,628,200	
S M K	800	2,180.00	1,744,000	
ヨコオ	2,300	2,624.00	6,035,200	
ティアック	3,000	120.00	360,000	
ホシデン	7,600	1,206.00	9,165,600	
ヒロセ電機	4,900	16,980.00	83,202,000	
日本航空電子工業	7,400	1,847.00	13,667,800	
T O A	3,300	767.00	2,531,100	
マクセル	6,300	1,212.00	7,635,600	
古野電気	3,700	1,052.00	3,892,400	
ユニデンホールディングス	700	3,435.00	2,404,500	
スミダコーポレーション	3,100	839.00	2,600,900	
アイコム	1,300	2,358.00	3,065,400	
リオン	1,200	2,079.00	2,494,800	
本多通信工業	2,700	490.00	1,323,000	
横河電機	31,800	1,815.00	57,717,000	
新電元工業	1,300	2,984.00	3,879,200	
アズビル	18,600	4,110.00	76,446,000	
東亜ディーケーケー	1,500	912.00	1,368,000	
日本光電工業	13,100	3,140.00	41,134,000	
チノー	1,000	1,503.00	1,503,000	
共和電業	3,100	379.00	1,174,900	

日本電子材料	1,700	1,993.00	3,388,100	
堀場製作所	5,900	6,560.00	38,704,000	
アドバンテスト	23,600	9,380.00	221,368,000	
小野測器	1,600	483.00	772,800	
エスベック	2,500	2,035.00	5,087,500	
キーエンス	28,800	52,500.00	1,512,000,000	
日置電機	1,500	6,570.00	9,855,000	
シスメックス	26,900	8,330.00	224,077,000	
日本マイクロニクス	5,500	1,697.00	9,333,500	
メガチップス	2,900	3,805.00	11,034,500	
OBARA GROUP	1,400	3,140.00	4,396,000	
IMAGICA GROUP	2,500	656.00	1,640,000	
澤藤電機	400	1,534.00	613,600	
デンソー	70,000	8,431.00	590,170,000	
原田工業	1,200	991.00	1,189,200	
コーセル	3,800	819.00	3,112,200	
イリソ電子工業	2,700	4,100.00	11,070,000	
オプテックスグループ	5,300	1,606.00	8,511,800	
千代田インテグレ	1,400	1,917.00	2,683,800	
アイ・オー・データ機器	1,200	1,297.00	1,556,400	
レーザーテック	14,000	21,170.00	296,380,000	
スタンレー電気	22,200	2,841.00	63,070,200	
岩崎電気	1,200	2,281.00	2,737,200	
ウシオ電機	16,400	1,869.00	30,651,600	
岡谷電機産業	3,100	307.00	951,700	
ヘリオス テクノ ホールディング	2,700	292.00	788,400	
エノモト	1,000	1,500.00	1,500,000	
日本セラミック	3,000	2,490.00	7,470,000	
遠藤照明	1,400	1,009.00	1,412,600	
古河電池	2,400	1,256.00	3,014,400	
双信電機	1,800	556.00	1,000,800	
山一電機	2,200	1,915.00	4,213,000	
図研	2,100	2,988.00	6,274,800	
日本電子	6,600	6,510.00	42,966,000	
カシオ計算機	23,000	1,296.00	29,808,000	
ファナック	27,900	21,525.00	600,547,500	
日本シイエムケイ	6,100	594.00	3,623,400	
エンブラス	800	2,619.00	2,095,200	
大真空	4,400	1,073.00	4,721,200	
ローム	14,200	9,210.00	130,782,000	
浜松ホトニクス	22,800	5,640.00	128,592,000	
三井ハイテック	3,100	8,160.00	25,296,000	
新光電気工業	9,300	4,755.00	44,221,500	
京セラ	44,700	6,854.00	306,373,800	
協栄産業	300	1,571.00	471,300	
太陽誘電	15,400	5,150.00	79,310,000	
村田製作所	93,400	7,938.00	741,409,200	
双葉電子工業	5,300	675.00	3,577,500	
日東電工	19,200	8,260.00	158,592,000	
北陸電気工業	1,100	1,296.00	1,425,600	
東海理化電機製作所	8,300	1,563.00	12,972,900	
ニチコン	9,900	1,226.00	12,137,400	
日本ケミコン	3,000	1,899.00	5,697,000	
K O A	4,300	1,414.00	6,080,200	
三井E & Sホールディングス	12,100	359.00	4,343,900	
日立造船	26,800	773.00	20,716,400	
三菱重工業	50,000	3,339.00	166,950,000	
川崎重工業	23,200	2,084.00	48,348,800	
I H I	19,800	2,678.00	53,024,400	
名村造船所	10,800	279.00	3,013,200	
サノヤスホールディングス	4,800	129.00	619,200	

スプリックス	800	1,427.00	1,141,600	
マネジメントソリューションズ	1,400	3,075.00	4,305,000	
プロレド・パートナーズ	600	783.00	469,800	
and factory	300	397.00	119,100	
テノ・ホールディングス	300	582.00	174,600	
フロンティア・マネジメント	600	792.00	475,200	
ピアラ	200	525.00	105,000	
コプロ・ホールディングス	200	1,054.00	210,800	
ギークス	400	1,055.00	422,000	
カーブスホールディングス	8,200	699.00	5,731,800	
フォーラムエンジニアリング	2,200	854.00	1,878,800	
Fast Fitness Japan	500	1,786.00	893,000	
日本車輛製造	1,100	2,105.00	2,315,500	
三菱ロジスネクスト	4,100	937.00	3,841,700	
近畿車輛	600	1,066.00	639,600	
一家ホールディングス	400	524.00	209,600	
フルサト・マルカホールディングス	2,800	2,350.00	6,580,000	
ヤマエグループホールディングス	2,200	1,054.00	2,318,800	
藤久ホールディングス	1,000	650.00	650,000	
F P G	10,700	875.00	9,362,500	
島根銀行	700	555.00	388,500	
じもとホールディングス	2,200	682.00	1,500,400	
全国保証	7,500	4,830.00	36,225,000	
めぶきフィナンシャルグループ	162,700	281.00	45,718,700	
ジャパンインベストメントアドバイザー	2,500	1,147.00	2,867,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	4,100	2,074.00	8,503,400	
九州フィナンシャルグループ	64,600	414.00	26,744,400	
かんぽ生命保険	31,500	2,079.00	65,488,500	
ゆうちょ銀行	74,000	1,014.00	75,036,000	
あんしん保証	1,300	285.00	370,500	
富山第一銀行	8,500	320.00	2,720,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	179,000	490.00	87,710,000	
ジェイリース	1,100	1,740.00	1,914,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	20,600	843.00	17,365,800	
イントラスト	800	589.00	471,200	
日本モーゲージサービス	1,800	1,007.00	1,812,600	
C a s a	1,200	835.00	1,002,000	
アルヒ	4,600	1,022.00	4,701,200	
プレミアグループ	1,400	4,160.00	5,824,000	
日産自動車	375,100	598.10	224,347,310	
いすゞ自動車	99,800	1,638.00	163,472,400	
トヨタ自動車	1,611,500	2,173.00	3,501,789,500	
日野自動車	39,600	1,095.00	43,362,000	
三菱自動車工業	118,700	325.00	38,577,500	
エフテック	2,600	527.00	1,370,200	
レシップホールディングス	1,800	540.00	972,000	
G M B	700	778.00	544,600	
ファルテック	700	708.00	495,600	
武蔵精密工業	7,200	1,875.00	13,500,000	
日産車体	4,500	673.00	3,028,500	
新明和工業	8,900	935.00	8,321,500	
極東開発工業	5,700	1,476.00	8,413,200	
トピー工業	2,500	1,118.00	2,795,000	
ティラド	900	2,524.00	2,271,600	
曙ブレーキ工業	16,900	171.00	2,889,900	
タチエス	5,800	1,145.00	6,641,000	
N O K	15,600	1,233.00	19,234,800	
フタバ産業	7,800	403.00	3,143,400	
K Y B	3,300	3,095.00	10,213,500	
市光工業	3,700	506.00	1,872,200	
大同メタル工業	6,400	636.00	4,070,400	

プレス工業	15,400	380.00	5,852,000	
ミクニ	4,600	407.00	1,872,200	
太平洋工業	6,600	1,016.00	6,705,600	
河西工業	4,400	288.00	1,267,200	
アイシン	23,300	4,375.00	101,937,500	
マツダ	99,800	931.00	92,913,800	
今仙電機製作所	1,900	592.00	1,124,800	
本田技研工業	250,500	3,662.00	917,331,000	
スズキ	72,700	4,864.00	353,612,800	
S U B A R U	91,100	1,975.50	179,968,050	
安永	1,600	832.00	1,331,200	
ヤマハ発動機	41,500	2,646.00	109,809,000	
小糸製作所	17,500	6,250.00	109,375,000	
T B K	3,900	406.00	1,583,400	
エクセディ	4,500	1,721.00	7,744,500	
ミツバ	6,200	394.00	2,442,800	
豊田合成	10,300	2,257.00	23,247,100	
愛三工業	4,800	749.00	3,595,200	
盟和産業	500	1,012.00	506,000	
日本プラス	2,900	548.00	1,589,200	
ヨロズ	2,900	973.00	2,821,700	
エフ・シー・シー	5,400	1,459.00	7,878,600	
新家工業	900	1,760.00	1,584,000	
シマノ	12,800	26,620.00	340,736,000	
テイ・エス テック	13,400	1,568.00	21,011,200	
三十三フィナンシャルグループ	2,600	1,522.00	3,957,200	
第四北越フィナンシャルグループ	5,200	2,703.00	14,055,600	
ひろぎんホールディングス	46,700	685.00	31,989,500	
マーキュリアホールディングス	900	522.00	469,800	
おきなわフィナンシャルグループ	2,800	2,412.00	6,753,600	
ダイレクトマーケティングミックス	3,400	1,492.00	5,072,800	
ポピンズホールディングス	800	2,247.00	1,797,600	
L I T A L I C O	2,400	2,870.00	6,888,000	
十六フィナンシャルグループ	4,300	2,427.00	10,436,100	
北國フィナンシャルホールディングス	2,900	3,310.00	9,599,000	
ネットプロテクションズホールディングス	7,400	563.00	4,166,200	
ジャムコ	1,900	811.00	1,540,900	
小野建	2,700	1,622.00	4,379,400	
はるやまホールディングス	1,600	563.00	900,800	
南陽	600	1,948.00	1,168,800	
ノジマ	5,000	2,550.00	12,750,000	
佐島電機	2,200	907.00	1,995,400	
カッパ・クリエイト	4,300	1,376.00	5,916,800	
エコートレーディング	1,000	601.00	601,000	
伯東	2,000	2,353.00	4,706,000	
コンドーテック	2,300	1,021.00	2,348,300	
中山福	2,300	405.00	931,500	
ライトオン	2,400	712.00	1,708,800	
ナガイレーベン	4,300	2,145.00	9,223,500	
三菱食品	3,000	3,150.00	9,450,000	
良品計画	36,000	1,764.00	63,504,000	
三城ホールディングス	4,900	249.00	1,220,100	
松田産業	2,400	2,274.00	5,457,600	
第一興商	6,000	3,610.00	21,660,000	
メディパルホールディングス	33,800	2,094.00	70,777,200	
アドヴァングループ	3,100	940.00	2,914,000	
S P K	1,400	1,306.00	1,828,400	
萩原電気ホールディングス	1,100	2,087.00	2,295,700	
アルビス	1,100	2,215.00	2,436,500	
アズワン	4,500	6,660.00	29,970,000	
スズデン	1,100	2,168.00	2,384,800	

尾家産業	800	1,021.00	816,800	
シモジマ	1,800	1,023.00	1,841,400	
ドウシシャ	3,100	1,547.00	4,795,700	
小津産業	700	2,005.00	1,403,500	
コナカ	4,200	353.00	1,482,600	
高速	1,700	1,521.00	2,585,700	
ハウス オブ ローゼ	300	1,704.00	511,200	
G - 7ホールディングス	3,000	1,688.00	5,064,000	
たけびし	1,000	1,447.00	1,447,000	
イオン北海道	5,700	1,144.00	6,520,800	
コジマ	5,300	549.00	2,909,700	
ヒマラヤ	1,200	1,001.00	1,201,200	
コーナン商事	4,500	3,670.00	16,515,000	
ネットワンシステムズ	12,000	2,751.00	33,012,000	
エコス	1,300	1,954.00	2,540,200	
ワタミ	3,700	951.00	3,518,700	
マルシェ	700	459.00	321,300	
リックス	600	1,625.00	975,000	
システムソフト	6,200	91.00	564,200	
パン・パシフィック・インターナショナルホ	62,600	1,876.00	117,437,600	
丸文	2,600	712.00	1,851,200	
西松屋チェーン	7,100	1,356.00	9,627,600	
ゼンショーホールディングス	15,300	2,709.00	41,447,700	
ハピネット	2,800	1,589.00	4,449,200	
幸楽苑ホールディングス	2,100	1,427.00	2,996,700	
ハークスレイ	1,600	469.00	750,400	
橋本総業ホールディングス	600	2,008.00	1,204,800	
日本ライフライン	9,200	1,037.00	9,540,400	
サイゼリヤ	4,600	2,893.00	13,307,800	
タカショー	1,900	673.00	1,278,700	
V Tホールディングス	12,500	491.00	6,137,500	
アルゴグラフィックス	2,400	3,175.00	7,620,000	
魚力	900	2,066.00	1,859,400	
I D O M	9,400	657.00	6,175,800	
日本エム・ディ・エム	1,900	1,564.00	2,971,600	
ボブラ	700	148.00	103,600	
フジ・コーポレーション	1,800	1,177.00	2,118,600	
ユナイテッドアローズ	3,200	1,771.00	5,667,200	
進和	2,000	2,025.00	4,050,000	
エスケイジャパン	900	424.00	381,600	
ダイトロン	1,400	1,789.00	2,504,600	
ハイデイ日高	4,700	1,721.00	8,088,700	
シークス	4,600	1,130.00	5,198,000	
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i	2,200	201.00	442,200	
コロワイド	13,000	1,733.00	22,529,000	
ピーシーデボコーポレーション	4,100	282.00	1,156,200	
田中商事	800	643.00	514,400	
オーハシテクニカ	1,700	1,364.00	2,318,800	
壱番屋	2,200	4,615.00	10,153,000	
白銅	1,000	2,553.00	2,553,000	
トップカルチャー	1,700	293.00	498,100	
P L A N T	700	659.00	461,300	
スギホールディングス	6,300	6,410.00	40,383,000	
ダイコー通産	300	1,210.00	363,000	
薬王堂ホールディングス	1,300	2,412.00	3,135,600	
島津製作所	40,900	4,020.00	164,418,000	
J M S	2,600	609.00	1,583,400	
クボテック	1,100	268.00	294,800	
長野計器	2,200	1,281.00	2,818,200	
ブイ・テクノロジー	1,400	3,525.00	4,935,000	
スター精密	4,700	1,493.00	7,017,100	

東京計器	1,900	1,046.00	1,987,400	
愛知時計電機	1,200	1,892.00	2,270,400	
インターアクション	1,700	2,002.00	3,403,400	
オーバル	2,500	270.00	675,000	
東京精密	5,400	4,725.00	25,515,000	
マニー	12,800	1,579.00	20,211,200	
ニコン	48,500	1,250.00	60,625,000	
トプコン	14,900	1,490.00	22,201,000	
オリンパス	166,800	2,317.50	386,559,000	
理研計器	2,600	4,745.00	12,337,000	
S C R E E Nホールディングス	5,500	11,560.00	63,580,000	
キヤノン電子	2,900	1,612.00	4,674,800	
タムロン	2,500	2,310.00	5,775,000	
H O Y A	62,100	14,975.00	929,947,500	
シード	1,500	510.00	765,000	
ノーリツ鋼機	2,900	1,790.00	5,191,000	
エー・アンド・デイ	2,600	912.00	2,371,200	
朝日インテック	34,800	2,289.00	79,657,200	
キヤノン	158,100	2,823.00	446,316,300	
リコー	88,200	1,048.00	92,433,600	
シチズン時計	37,100	506.00	18,772,600	
リズム	1,200	1,455.00	1,746,000	
大研医器	2,400	527.00	1,264,800	
メニコン	10,500	2,895.00	30,397,500	
シンシア	400	492.00	196,800	
中本ボックス	800	1,680.00	1,344,000	
スノーピーク	4,200	2,549.00	10,705,800	
パラマウントベッドホールディングス	6,200	1,990.00	12,338,000	
トランザクション	1,700	974.00	1,655,800	
粧美堂	1,600	418.00	668,800	
ニホンフラッシュ	2,900	1,028.00	2,981,200	
前田工織	3,500	3,225.00	11,287,500	
永大産業	3,900	299.00	1,166,100	
アートネイチャー	2,600	725.00	1,885,000	
バンダイナムコホールディングス	28,500	7,790.00	222,015,000	
アイフィスジャパン	900	672.00	604,800	
共立印刷	6,000	163.00	978,000	
S H O E I	3,000	4,590.00	13,770,000	
フランスベッドホールディングス	4,000	915.00	3,660,000	
マーベラス	4,800	734.00	3,523,200	
パイロットコーポレーション	5,300	4,645.00	24,618,500	
萩原工業	2,200	1,213.00	2,668,600	
エイベックス	5,300	1,364.00	7,229,200	
フジシールインターナショナル	7,800	1,743.00	13,595,400	
タカラトミー	13,200	1,267.00	16,724,400	
広済堂ホールディングス	2,300	870.00	2,001,000	
エステールホールディングス	1,000	653.00	653,000	
レック	3,700	943.00	3,489,100	
タカノ	900	703.00	632,700	
三光合成	3,400	353.00	1,200,200	
プロネクサス	2,700	1,081.00	2,918,700	
ホクシン	3,100	149.00	461,900	
ウッドワン	1,000	1,014.00	1,014,000	
大建工業	1,800	2,231.00	4,015,800	
きもと	6,100	211.00	1,287,100	
凸版印刷	48,300	2,273.00	109,785,900	
大日本印刷	37,600	2,952.00	110,995,200	
共同印刷	900	2,834.00	2,550,600	
N I S S H A	6,700	1,356.00	9,085,200	
光村印刷	300	1,497.00	449,100	
藤森工業	2,900	4,005.00	11,614,500	

ヴィア・ホールディングス	5,400	161.00	869,400	
TAKARA & COMPANY	2,000	1,846.00	3,692,000	
前澤化成工業	2,100	1,271.00	2,669,100	
未来工業	1,300	1,520.00	1,976,000	
アシックス	28,100	2,252.00	63,281,200	
ツツミ	900	1,869.00	1,682,100	
ウェーブロックホールディングス	1,100	717.00	788,700	
J S P	1,800	1,589.00	2,860,200	
ニチハ	4,400	2,585.00	11,374,000	
ローランド	2,200	4,080.00	8,976,000	
エフピコ	5,900	3,195.00	18,850,500	
小松ウオール工業	1,100	1,877.00	2,064,700	
ヤマハ	18,500	5,460.00	101,010,000	
河合楽器製作所	900	2,971.00	2,673,900	
クリナップ	3,000	552.00	1,656,000	
ビジョン	19,200	2,311.00	44,371,200	
天馬	2,500	2,586.00	6,465,000	
兼松サステック	200	1,703.00	340,600	
キングジム	2,500	881.00	2,202,500	
象印マホービン	8,700	1,427.00	12,414,900	
リンテック	6,900	2,614.00	18,036,600	
信越ポリマー	5,200	1,087.00	5,652,400	
東リ	8,200	227.00	1,861,400	
イトーキ	6,100	359.00	2,189,900	
任天堂	18,000	58,770.00	1,057,860,000	
三菱鉛筆	5,200	1,250.00	6,500,000	
松風	1,400	1,784.00	2,497,600	
タカラスタンダード	6,800	1,346.00	9,152,800	
コクヨ	15,400	1,591.00	24,501,400	
ナカバヤシ	3,200	507.00	1,622,400	
ニフコ	10,600	3,495.00	37,047,000	
立川ブラインド工業	1,300	1,088.00	1,414,400	
グロープライド	2,800	2,630.00	7,364,000	
オカムラ	11,100	1,173.00	13,020,300	
バルカー	2,700	2,545.00	6,871,500	
MUTOHホールディングス	500	2,043.00	1,021,500	
伊藤忠商事	219,100	3,834.00	840,029,400	
丸紅	309,000	1,236.50	382,078,500	
スクロール	4,400	935.00	4,114,000	
高島	400	2,377.00	950,800	
ヨンドシーホールディングス	2,800	1,725.00	4,830,000	
三陽商会	1,600	875.00	1,400,000	
長瀬産業	17,300	1,856.00	32,108,800	
ナイガイ	1,200	281.00	337,200	
蝶理	1,900	1,781.00	3,383,900	
豊田通商	31,500	5,040.00	158,760,000	
オンワードホールディングス	18,300	292.00	5,343,600	
三共生興	4,600	571.00	2,626,600	
兼松	11,600	1,407.00	16,321,200	
美津濃	3,100	2,272.00	7,043,200	
ツカモトコーポレーション	500	1,339.00	669,500	
ルックホールディングス	900	1,585.00	1,426,500	
三井物産	243,300	3,075.00	748,147,500	
日本紙パルプ商事	1,700	4,160.00	7,072,000	
東京エレクトロン	20,200	55,140.00	1,113,828,000	
カメイ	3,600	1,042.00	3,751,200	
東都水産	100	3,920.00	392,000	
OUGホールディングス	400	2,721.00	1,088,400	
スターゼン	2,300	2,124.00	4,885,200	
セイコーホールディングス	4,600	2,344.00	10,782,400	
山善	13,500	1,020.00	13,770,000	

椿本興業	600	4,115.00	2,469,000	
住友商事	197,700	1,899.00	375,432,300	
日本ユニシス	9,700	3,035.00	29,439,500	
内田洋行	1,400	4,595.00	6,433,000	
三菱商事	234,800	4,061.00	953,522,800	
第一実業	1,400	4,310.00	6,034,000	
キヤノンマーケティングジャパン	7,900	2,466.00	19,481,400	
西華産業	1,600	1,603.00	2,564,800	
佐藤商事	2,500	1,225.00	3,062,500	
菱洋エレクトロ	1,800	2,136.00	3,844,800	
東京産業	2,700	698.00	1,884,600	
ユアサ商事	2,900	2,986.00	8,659,400	
神鋼商事	700	3,850.00	2,695,000	
トルク	2,600	212.00	551,200	
阪和興業	6,200	3,275.00	20,305,000	
正栄食品工業	2,000	4,165.00	8,330,000	
カナデン	2,500	1,015.00	2,537,500	
菱電商事	2,400	1,761.00	4,226,400	
ニプロ	23,900	1,101.00	26,313,900	
岩谷産業	7,500	5,360.00	40,200,000	
ナイス	1,000	1,838.00	1,838,000	
ニチモウ	400	2,830.00	1,132,000	
極東貿易	800	2,244.00	1,795,200	
アステナホールディングス	4,800	416.00	1,996,800	
兼松エレクトロニクス	1,700	3,895.00	6,621,500	
三愛石油	8,000	933.00	7,464,000	
稲畑産業	6,900	2,490.00	17,181,000	
G S I クレオス	1,400	1,152.00	1,612,800	
明和産業	2,900	1,114.00	3,230,600	
クワザワホールディングス	1,300	609.00	791,700	
キムラタン	14,500	18.00	261,000	
ゴールドウイン	5,600	5,990.00	33,544,000	
ユニ・チャーム	61,300	4,355.00	266,961,500	
デサント	6,100	2,880.00	17,568,000	
キング	1,700	529.00	899,300	
ワキタ	6,100	1,000.00	6,100,000	
ヤマトインターナショナル	2,500	292.00	730,000	
東邦ホールディングス	10,000	1,874.00	18,740,000	
サンゲツ	8,200	1,579.00	12,947,800	
ミツウロコグループホールディングス	4,500	1,043.00	4,693,500	
シナネンホールディングス	1,200	3,295.00	3,954,000	
伊藤忠エネクス	6,800	1,025.00	6,970,000	
サンリオ	9,600	2,427.00	23,299,200	
サンワテクノス	1,800	1,349.00	2,428,200	
リョーサン	3,400	2,317.00	7,877,800	
新光商事	4,100	917.00	3,759,700	
トーヨー	1,400	1,061.00	1,485,400	
三信電気	1,600	1,695.00	2,712,000	
東陽テクニカ	3,300	1,071.00	3,534,300	
モスフードサービス	4,100	3,015.00	12,361,500	
加賀電子	2,800	3,145.00	8,806,000	
三益半導体工業	2,400	2,355.00	5,652,000	
都築電気	1,300	1,385.00	1,800,500	
ソーダニッカ	3,300	777.00	2,564,100	
立花エレテック	2,400	1,588.00	3,811,200	
木曽路	4,200	2,222.00	9,332,400	
S R S ホールディングス	3,900	823.00	3,209,700	
千趣会	5,900	372.00	2,194,800	
タカキュー	3,300	112.00	369,600	
リテールパートナーズ	4,000	1,176.00	4,704,000	
ケーヨー	5,600	879.00	4,922,400	

上新電機	3,600	2,088.00	7,516,800	
日本瓦斯	15,300	1,738.00	26,591,400	
ロイヤルホールディングス	5,400	1,951.00	10,535,400	
東天紅	300	951.00	285,300	
いなげや	3,400	1,394.00	4,739,600	
チヨダ	3,200	750.00	2,400,000	
ライフコーポレーション	3,000	2,958.00	8,874,000	
リンガーハット	4,000	2,222.00	8,888,000	
Mr M a x H D	3,800	604.00	2,295,200	
テンアライド	3,100	319.00	988,900	
A O K I ホールディングス	6,100	610.00	3,721,000	
オークワ	4,800	958.00	4,598,400	
コメリ	4,800	2,776.00	13,324,800	
青山商事	6,800	738.00	5,018,400	
しまむら	3,600	10,080.00	36,288,000	
はせがわ	2,100	304.00	638,400	
高島屋	23,000	1,161.00	26,703,000	
松屋	6,700	720.00	4,824,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	14,900	864.00	12,873,600	
近鉄百貨店	1,200	2,592.00	3,110,400	
丸井グループ	24,700	2,294.00	56,661,800	
クレディセゾン	20,100	1,357.00	27,275,700	
アクシアル リテイリング	2,400	3,285.00	7,884,000	
井筒屋	1,700	396.00	673,200	
イオン	120,500	2,614.00	314,987,000	
イズミ	5,600	3,200.00	17,920,000	
フォーバル	1,200	842.00	1,010,400	
平和堂	5,900	1,993.00	11,758,700	
フジ	3,900	2,099.00	8,186,100	
ヤオコー	3,600	6,570.00	23,652,000	
ゼビオホールディングス	3,700	948.00	3,507,600	
ケースホールディングス	28,800	1,253.00	36,086,400	
P A L T A C	4,400	4,450.00	19,580,000	
三谷産業	4,200	315.00	1,323,000	
O l y m p i c グループ	1,900	709.00	1,347,100	
日産東京販売ホールディングス	5,900	235.00	1,386,500	
新生銀行	20,400	2,162.00	44,104,800	
あおぞら銀行	17,500	2,709.00	47,407,500	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,967,800	739.10	1,454,400,980	
りそなホールディングス	359,000	536.70	192,675,300	
三井住友トラスト・ホールディングス	59,300	4,158.00	246,569,400	
三井住友フィナンシャルグループ	217,200	4,277.00	928,964,400	
千葉銀行	104,600	774.00	80,960,400	
群馬銀行	60,100	398.00	23,919,800	
武蔵野銀行	4,600	1,929.00	8,873,400	
千葉興業銀行	7,100	276.00	1,959,600	
筑波銀行	11,800	219.00	2,584,200	
七十七銀行	9,800	1,556.00	15,248,800	
青森銀行	2,400	1,930.00	4,632,000	
秋田銀行	2,000	1,736.00	3,472,000	
山形銀行	3,400	999.00	3,396,600	
岩手銀行	2,200	1,949.00	4,287,800	
東邦銀行	27,500	223.00	6,132,500	
東北銀行	1,400	1,019.00	1,426,600	
みちのく銀行	2,300	895.00	2,058,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	26,400	2,383.00	62,911,200	
静岡銀行	76,300	900.00	68,670,000	
スルガ銀行	27,300	451.00	12,312,300	
八十二銀行	71,200	440.00	31,328,000	
山梨中央銀行	3,500	963.00	3,370,500	
大垣共立銀行	6,200	2,055.00	12,741,000	

福井銀行	2,800	1,476.00	4,132,800	
清水銀行	1,200	1,639.00	1,966,800	
富山銀行	600	2,274.00	1,364,400	
滋賀銀行	5,900	2,262.00	13,345,800	
南都銀行	4,700	2,129.00	10,006,300	
百五銀行	29,300	359.00	10,518,700	
京都銀行	11,200	5,580.00	62,496,000	
紀陽銀行	10,600	1,551.00	16,440,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	19,500	967.00	18,856,500	
山陰合同銀行	18,500	688.00	12,728,000	
中国銀行	25,000	909.00	22,725,000	
鳥取銀行	900	1,258.00	1,132,200	
伊予銀行	41,900	635.00	26,606,500	
百十四銀行	3,500	1,792.00	6,272,000	
四国銀行	4,700	810.00	3,807,000	
阿波銀行	4,900	2,315.00	11,343,500	
大分銀行	1,900	2,042.00	3,879,800	
宮崎銀行	1,900	2,246.00	4,267,400	
佐賀銀行	1,900	1,566.00	2,975,400	
琉球銀行	6,700	860.00	5,762,000	
セブン銀行	92,800	247.00	22,921,600	
みずほフィナンシャルグループ	401,200	1,592.00	638,710,400	
高知銀行	1,300	762.00	990,600	
山口フィナンシャルグループ	36,400	736.00	26,790,400	
芙蓉総合リース	3,300	7,700.00	25,410,000	
みずほリース	4,900	3,220.00	15,778,000	
東京センチュリー	6,100	5,700.00	34,770,000	
S B Iホールディングス	38,700	3,045.00	117,841,500	
日本証券金融	12,200	906.00	11,053,200	
アイフル	53,400	363.00	19,384,200	
日本アジア投資	2,300	175.00	402,500	
長野銀行	1,200	1,270.00	1,524,000	
名古屋銀行	2,300	3,125.00	7,187,500	
北洋銀行	47,000	268.00	12,596,000	
愛知銀行	1,000	4,825.00	4,825,000	
中京銀行	1,300	1,635.00	2,125,500	
大光銀行	1,100	1,477.00	1,624,700	
愛媛銀行	4,600	981.00	4,512,600	
トマト銀行	1,400	1,070.00	1,498,000	
京葉銀行	13,100	520.00	6,812,000	
栃木銀行	14,600	233.00	3,401,800	
北日本銀行	1,000	1,742.00	1,742,000	
東和銀行	5,300	584.00	3,095,200	
福島銀行	3,400	246.00	836,400	
大東銀行	1,800	753.00	1,355,400	
リコーリース	2,800	3,795.00	10,626,000	
イオンフィナンシャルサービス	17,300	1,240.00	21,452,000	
アコム	62,400	323.00	20,155,200	
ジャックス	3,400	3,265.00	11,101,000	
オリエントコーポレーション	84,200	124.00	10,440,800	
オリックス	190,500	2,368.00	451,104,000	
三菱H C キャピタル	115,800	614.00	71,101,200	
ジャフコ グループ	12,000	1,708.00	20,496,000	
九州リースサービス	1,700	602.00	1,023,400	
トモニホールディングス	23,900	354.00	8,460,600	
大和証券グループ本社	234,900	691.40	162,409,860	
野村ホールディングス	478,900	538.30	257,791,870	
岡三証券グループ	24,500	391.00	9,579,500	
丸三証券	9,100	547.00	4,977,700	
東洋証券	11,700	155.00	1,813,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	35,800	420.00	15,036,000	

光世証券	900	476.00	428,400	
水戸証券	8,100	280.00	2,268,000	
いちよし証券	6,100	663.00	4,044,300	
松井証券	15,300	817.00	12,500,100	
S O M P Oホールディングス	51,500	5,339.00	274,958,500	
日本取引所グループ	79,400	2,192.50	174,084,500	
マネックスグループ	25,400	512.00	13,004,800	
極東証券	4,100	772.00	3,165,200	
岩井コスモホールディングス	3,100	1,416.00	4,389,600	
アイザワ証券グループ	5,500	898.00	4,939,000	
フィデアホールディングス	2,800	1,412.00	3,953,600	
池田泉州ホールディングス	35,400	189.00	6,690,600	
アニコム ホールディングス	8,700	770.00	6,699,000	
M S & A Dインシュアランスグループホール	70,300	3,982.00	279,934,600	
マネーパートナーズグループ	4,400	235.00	1,034,000	
スパークス・グループ	15,400	261.00	4,019,400	
小林洋行	1,300	227.00	295,100	
第一生命ホールディングス	154,400	2,638.50	407,384,400	
東京海上ホールディングス	103,300	7,033.00	726,508,900	
アドバンテッジリスクマネジメント	1,400	662.00	926,800	
イー・ギャランティ	4,700	2,079.00	9,771,300	
アサックス	1,500	687.00	1,030,500	
N E Cキャピタルソリューション	1,200	2,180.00	2,616,000	
T & Dホールディングス	81,400	1,771.00	144,159,400	
アドバンスクリエイト	1,200	1,003.00	1,203,600	
三井不動産	143,000	2,592.50	370,727,500	
三菱地所	206,100	1,813.50	373,762,350	
平和不動産	5,400	3,985.00	21,519,000	
東京建物	30,900	1,816.00	56,114,400	
ダイビル	8,000	2,196.00	17,568,000	
京阪神ビルディング	4,800	1,506.00	7,228,800	
住友不動産	65,800	3,639.00	239,446,200	
太平洋興発	1,500	639.00	958,500	
テーオーシー	5,600	695.00	3,892,000	
東京楽天地	500	3,960.00	1,980,000	
レオパレス21	33,700	215.00	7,245,500	
スターツコーポレーション	4,400	2,555.00	11,242,000	
フジ住宅	3,500	659.00	2,306,500	
空港施設	3,200	560.00	1,792,000	
明和地所	1,300	604.00	785,200	
ゴールドクレスト	2,400	1,857.00	4,456,800	
リログループ	16,600	1,712.00	28,419,200	
エスリード	1,300	1,774.00	2,306,200	
日神グループホールディングス	5,200	508.00	2,641,600	
日本エスコン	6,000	758.00	4,548,000	
タカラレーベン	12,800	320.00	4,096,000	
A V A N T I A	2,000	837.00	1,674,000	
イオンモール	15,900	1,660.00	26,394,000	
毎日コムネット	1,200	699.00	838,800	
ファースト住建	1,400	1,197.00	1,675,800	
ランド	176,700	10.00	1,767,000	
カチタス	7,700	3,260.00	25,102,000	
東祥	1,800	1,708.00	3,074,400	
トーセイ	4,600	1,077.00	4,954,200	
穴吹興産	700	1,960.00	1,372,000	
サンフロンティア不動産	3,700	1,080.00	3,996,000	
F Jネクストホールディングス	3,200	997.00	3,190,400	
インテリックス	600	626.00	375,600	
ランドビジネス	1,700	239.00	406,300	
サンネクスタグループ	1,000	1,087.00	1,087,000	
グランディハウス	2,100	572.00	1,201,200	

東武鉄道	31,100	2,923.00	90,905,300	
相鉄ホールディングス	10,100	2,237.00	22,593,700	
東急	80,200	1,583.00	126,956,600	
京浜急行電鉄	40,800	1,270.00	51,816,000	
小田急電鉄	47,300	2,127.00	100,607,100	
京王電鉄	16,500	5,280.00	87,120,000	
京成電鉄	22,100	3,400.00	75,140,000	
富士急行	3,800	4,070.00	15,466,000	
新京成電鉄	800	2,033.00	1,626,400	
東日本旅客鉄道	56,000	7,173.00	401,688,000	
西日本旅客鉄道	38,500	5,091.00	196,003,500	
東海旅客鉄道	26,400	15,930.00	420,552,000	
西武ホールディングス	41,500	1,233.00	51,169,500	
鴻池運輸	5,000	1,163.00	5,815,000	
西日本鉄道	8,900	2,656.00	23,638,400	
ハマキョウレックス	2,200	2,899.00	6,377,800	
サカイ引越センター	1,500	4,475.00	6,712,500	
近鉄グループホールディングス	30,100	3,580.00	107,758,000	
阪急阪神ホールディングス	37,700	3,510.00	132,327,000	
南海電気鉄道	13,400	2,384.00	31,945,600	
京阪ホールディングス	13,500	3,065.00	41,377,500	
神戸電鉄	800	3,410.00	2,728,000	
名古屋鉄道	24,700	2,130.00	52,611,000	
山陽電気鉄道	2,300	1,996.00	4,590,800	
アルプス物流	2,400	1,053.00	2,527,200	
トランコム	800	7,220.00	5,776,000	
ヤマトホールディングス	42,200	2,186.00	92,249,200	
山九	7,900	3,990.00	31,521,000	
日新	2,300	1,716.00	3,946,800	
丸運	2,800	246.00	688,800	
丸全昭和運輸	2,500	3,190.00	7,975,000	
センコーグループホールディングス	15,000	940.00	14,100,000	
トナミホールディングス	700	3,810.00	2,667,000	
ニッコンホールディングス	10,200	2,179.00	22,225,800	
日本石油輸送	400	2,641.00	1,056,400	
福山通運	5,000	4,100.00	20,500,000	
セイノーホールディングス	20,400	1,217.00	24,826,800	
エスライン	1,100	923.00	1,015,300	
神奈川中央交通	700	3,570.00	2,499,000	
日立物流	5,800	5,950.00	34,510,000	
丸和運輸機関	6,300	1,051.00	6,621,300	
C & F ロジホールディングス	3,200	1,246.00	3,987,200	
日本郵船	25,200	10,190.00	256,788,000	
商船三井	16,700	9,160.00	152,972,000	
川崎汽船	9,300	7,620.00	70,866,000	
N S ユナイテッド海運	1,700	4,145.00	7,046,500	
明治海運	3,100	919.00	2,848,900	
飯野海運	13,700	863.00	11,823,100	
共栄タンカー	600	1,028.00	616,800	
九州旅客鉄道	23,300	2,576.00	60,020,800	
S G ホールディングス	56,900	2,517.00	143,217,300	
N I P P O N E X P R E S S ホールディン	10,400	7,330.00	76,232,000	
日本航空	69,000	2,365.00	163,185,000	
A N A ホールディングス	76,500	2,612.50	199,856,250	
パスコ	600	1,310.00	786,000	
T R E ホールディングス	4,100	1,529.00	6,268,900	
人・夢・技術グループ	1,300	1,889.00	2,455,700	
西本W i s m e t t a c ホールディングス	700	2,815.00	1,970,500	
シルバーライフ	500	1,143.00	571,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	400	2,003.00	801,200	
G e n k y D r u g S t o r e s	1,400	3,730.00	5,222,000	

コア商事ホールディングス	2,500	697.00	1,742,500	
国際紙パルプ商事	7,400	363.00	2,686,200	
ナルミヤ・インターナショナル	600	1,023.00	613,800	
ブックオフグループホールディングス	1,900	1,030.00	1,957,000	
ギフト	400	2,320.00	928,000	
三菱倉庫	9,500	2,764.00	26,258,000	
三井倉庫ホールディングス	3,300	2,340.00	7,722,000	
住友倉庫	10,700	2,134.00	22,833,800	
澁澤倉庫	1,700	2,223.00	3,779,100	
ヤマタネ	1,500	1,625.00	2,437,500	
東陽倉庫	5,600	322.00	1,803,200	
乾汽船	2,100	2,616.00	5,493,600	
日本トランスシティ	6,400	617.00	3,948,800	
ケイヒン	600	1,421.00	852,600	
中央倉庫	2,100	980.00	2,058,000	
川西倉庫	700	1,165.00	815,500	
安田倉庫	2,800	981.00	2,746,800	
ファイズホールディングス	400	659.00	263,600	
東洋埠頭	900	1,516.00	1,364,400	
上組	16,700	2,192.00	36,606,400	
サンリツ	1,200	835.00	1,002,000	
キムラユニティー	900	1,371.00	1,233,900	
キューソー流通システム	1,400	945.00	1,323,000	
近鉄エクスプレス	5,800	2,949.00	17,104,200	
東海運	2,700	308.00	831,600	
エーアイティー	1,800	1,407.00	2,532,600	
内外トランスライン	1,100	1,885.00	2,073,500	
ショーエイコーポレーション	700	635.00	444,500	
日本コンセプト	1,100	1,456.00	1,601,600	
TBSホールディングス	18,900	1,889.00	35,702,100	
日本テレビホールディングス	26,300	1,328.00	34,926,400	
朝日放送グループホールディングス	3,500	758.00	2,653,000	
テレビ朝日ホールディングス	7,600	1,567.00	11,909,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	26,800	444.00	11,899,200	
テレビ東京ホールディングス	2,400	2,120.00	5,088,000	
日本BS放送	1,000	1,065.00	1,065,000	
ビジョン	5,500	1,154.00	6,347,000	
スマートバリュー	1,000	439.00	439,000	
USEN-NEXT HOLDINGS	3,000	2,324.00	6,972,000	
ワイヤレスゲート	1,100	291.00	320,100	
コネクシオ	1,700	1,391.00	2,364,700	
日本通信	27,100	173.00	4,688,300	
クロップス	800	917.00	733,600	
日本電信電話	326,600	3,330.00	1,087,578,000	
KDDI	227,600	3,793.00	863,286,800	
ソフトバンク	472,800	1,472.00	695,961,600	
光通信	3,600	14,190.00	51,084,000	
エムティーアイ	3,200	474.00	1,516,800	
GMOインターネット	11,100	2,463.00	27,339,300	
ファイバーゲート	1,000	1,292.00	1,292,000	
アйдママーケティングコミュニケーション	1,400	287.00	401,800	
KADOKAWA	17,000	2,509.00	42,653,000	
学研ホールディングス	4,500	1,001.00	4,504,500	
ゼンリン	5,000	1,074.00	5,370,000	
昭文社ホールディングス	1,500	458.00	687,000	
インプレスホールディングス	3,200	202.00	646,400	
東京電力ホールディングス	237,900	367.00	87,309,300	
中部電力	97,300	1,136.00	110,532,800	
関西電力	120,500	1,160.00	139,780,000	
中国電力	49,600	905.00	44,888,000	
北陸電力	29,500	558.00	16,461,000	

東北電力	74,400	739.00	54,981,600	
四国電力	28,500	814.00	23,199,000	
九州電力	65,500	845.00	55,347,500	
北海道電力	27,500	506.00	13,915,000	
沖縄電力	6,400	1,417.00	9,068,800	
電源開発	27,100	1,852.00	50,189,200	
エフオン	2,200	536.00	1,179,200	
イーレックス	4,800	1,664.00	7,987,200	
レノバ	6,300	1,347.00	8,486,100	
東京瓦斯	60,900	2,323.00	141,470,700	
大阪瓦斯	57,600	2,111.00	121,593,600	
東邦瓦斯	14,600	2,992.00	43,683,200	
北海道瓦斯	1,600	1,511.00	2,417,600	
広島ガス	5,800	349.00	2,024,200	
西部ガスホールディングス	3,700	2,237.00	8,276,900	
静岡ガス	8,300	845.00	7,013,500	
メタウォーター	3,300	2,042.00	6,738,600	
アイネット	1,500	1,265.00	1,897,500	
松竹	2,100	11,680.00	24,528,000	
東宝	18,400	4,775.00	87,860,000	
エイチ・アイ・エス	6,800	2,034.00	13,831,200	
東映	1,000	17,120.00	17,120,000	
ラックランド	900	2,820.00	2,538,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	83,100	2,133.00	177,252,300	
共立メンテナンス	5,400	4,395.00	23,733,000	
イチネンホールディングス	3,100	1,301.00	4,033,100	
建設技術研究所	1,900	2,320.00	4,408,000	
スペース	2,000	945.00	1,890,000	
アインホールディングス	4,200	6,470.00	27,174,000	
燦ホールディングス	1,300	1,660.00	2,158,000	
ピー・シー・エー	1,500	1,420.00	2,130,000	
スバル興業	200	8,170.00	1,634,000	
東京テアトル	1,100	1,237.00	1,360,700	
タナベ経営	1,400	642.00	898,800	
ビジネスブレイン太田昭和	1,100	1,501.00	1,651,100	
ナガワ	1,000	9,680.00	9,680,000	
東京都競馬	2,300	4,050.00	9,315,000	
常磐興産	1,300	1,356.00	1,762,800	
カナモト	5,500	2,308.00	12,694,000	
D T S	5,900	2,726.00	16,083,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	14,500	5,540.00	80,330,000	
シーイーシー	3,500	1,090.00	3,815,000	
カプコン	29,400	2,819.00	82,878,600	
西尾レントオール	2,800	2,811.00	7,870,800	
アイ・エス・ピー	1,500	980.00	1,470,000	
アゴーラ ホスピタリティー グループ	29,000	22.00	638,000	
日本空港ビルデング	11,900	5,550.00	66,045,000	
トランス・コスモス	3,900	3,155.00	12,304,500	
乃村工藝社	12,900	946.00	12,203,400	
ジャステック	1,900	1,047.00	1,989,300	
S C S K	21,600	1,913.00	41,320,800	
藤田観光	1,200	2,399.00	2,878,800	
K N T - C Tホールディングス	1,800	1,505.00	2,709,000	
日本管財	3,200	2,800.00	8,960,000	
トーカイ	2,600	1,870.00	4,862,000	
白洋舎	400	1,174.00	469,600	
セコム	29,900	8,744.00	261,445,600	
日本システムウエア	1,100	2,088.00	2,296,800	
セントラル警備保障	1,400	2,360.00	3,304,000	
アイネス	2,800	1,526.00	4,272,800	
丹青社	5,600	727.00	4,071,200	

メイテック	3,700	6,950.00	25,715,000	
T K C	5,300	3,040.00	16,112,000	
富士ソフト	3,300	5,530.00	18,249,000	
応用地質	3,400	2,066.00	7,024,400	
船井総研ホールディングス	6,300	2,182.00	13,746,600	
N S D	10,000	2,137.00	21,370,000	
進学会ホールディングス	1,400	365.00	511,000	
丸紅建材リース	400	1,760.00	704,000	
オオバ	2,200	705.00	1,551,000	
コナミホールディングス	11,300	6,820.00	77,066,000	
いであ	800	1,776.00	1,420,800	
学究社	900	1,644.00	1,479,600	
ベネッセホールディングス	10,100	2,358.00	23,815,800	
イオンディライト	3,800	3,040.00	11,552,000	
ナック	1,600	985.00	1,576,000	
福井コンピュータホールディングス	1,400	3,040.00	4,256,000	
ダイセキ	5,500	4,420.00	24,310,000	
ステップ	1,100	1,846.00	2,030,600	
日鉄物産	2,200	5,330.00	11,726,000	
泉州電業	900	6,260.00	5,634,000	
元気寿司	800	2,600.00	2,080,000	
トラスコ中山	6,600	2,533.00	16,717,800	
ヤマダホールディングス	114,400	406.00	46,446,400	
オートバックスセブン	10,500	1,429.00	15,004,500	
モリト	2,100	731.00	1,535,100	
アークランドサカモト	5,100	1,544.00	7,874,400	
ニトリホールディングス	12,400	16,525.00	204,910,000	
グルメ杵屋	2,500	1,044.00	2,610,000	
愛眼	3,800	185.00	703,000	
ケーユーホールディングス	1,500	1,095.00	1,642,500	
吉野家ホールディングス	10,900	2,395.00	26,105,500	
加藤産業	4,500	3,125.00	14,062,500	
北恵	700	934.00	653,800	
イノテック	1,900	1,429.00	2,715,100	
イエローハット	5,400	1,628.00	8,791,200	
松屋フーズホールディングス	1,500	3,650.00	5,475,000	
J B C C ホールディングス	2,000	1,446.00	2,892,000	
J K ホールディングス	2,700	1,059.00	2,859,300	
サガミホールディングス	4,700	1,221.00	5,738,700	
日伝	2,700	2,235.00	6,034,500	
関西フードマーケット	2,500	1,108.00	2,770,000	
ミロク情報サービス	3,000	1,396.00	4,188,000	
北沢産業	1,900	231.00	438,900	
杉本商事	1,400	2,156.00	3,018,400	
因幡電機産業	8,300	2,621.00	21,754,300	
王将フードサービス	2,100	6,040.00	12,684,000	
ブレナス	3,500	1,996.00	6,986,000	
ミニストップ	2,400	1,434.00	3,441,600	
アークス	6,100	2,192.00	13,371,200	
パローホールディングス	6,900	2,194.00	15,138,600	
東テク	1,000	2,435.00	2,435,000	
ミスミグループ本社	39,300	3,605.00	141,676,500	
アルテック	2,400	288.00	691,200	
ベルク	1,400	5,310.00	7,434,000	
大庄	1,600	1,009.00	1,614,400	
タキヒヨー	900	1,275.00	1,147,500	
ファーストリテイリング	4,200	64,410.00	270,522,000	
ソフトバンクグループ	187,200	5,160.00	965,952,000	
蔵王産業	600	1,889.00	1,133,400	
スズケン	12,200	3,605.00	43,981,000	
サンドラッグ	11,900	3,200.00	38,080,000	

サックスパー ホールディングス	2,700	511.00	1,379,700	
ジェコス	2,200	828.00	1,821,600	
ヤマザワ	800	1,660.00	1,328,000	
やまや	700	2,564.00	1,794,800	
グローセル	3,200	434.00	1,388,800	
ペルーナ	6,600	727.00	4,798,200	
合計	35,038,600	—	83,096,381,980	

株式以外の有価証券
該当する事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

「日本債券インデックス・マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表 (単位：円)

区 分	注記 番号	(2021年 2月22日現在)	(2022年 2月21日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		480,027	2,062,791
コール・ローン		537,238,230	432,597,182
国債証券		131,463,667,900	147,653,807,100
地方債証券		9,657,449,106	11,144,083,947
特殊債券		13,188,803,752	13,784,162,928
社債券		5,377,069,500	7,426,485,500
未収利息		398,230,776	405,851,717
前払費用		4,603,376	6,750,206
流動資産合計		160,627,542,667	180,855,801,371
資産合計		160,627,542,667	180,855,801,371
負債の部			
流動負債			
未払金		—	100,000,000
未払解約金		116,223,662	80,291,183
未払利息		1,467	1,168
その他未払費用		449	740
流動負債合計		116,225,578	180,293,091
負債合計		116,225,578	180,293,091
純資産の部			
元本等			
元本	1	125,544,496,076	142,408,879,533
剰余金			
剰余金又は欠損金()		34,966,821,013	38,266,628,747
元本等合計		160,511,317,089	180,675,508,280
純資産合計		160,511,317,089	180,675,508,280
負債純資産合計		160,627,542,667	180,855,801,371

（注）親投資信託の計算期間は、原則として、毎年3月6日から、翌年3月5日までであります。

（２）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	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 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、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
-------------------	---

（重要な会計上の見積りに関する注記）

当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（ 2021年 2月22日現在 ）	（ 2022年 2月21日現在 ）
1 期首元本額	126,399,340,034円	125,544,496,076円
期中追加設定元本額	26,451,548,900円	28,194,208,595円
期中一部解約元本額	27,306,392,858円	11,329,825,138円
元本の内訳		
ファンド名		
A M C / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	2,571,141,239円	1,146,597,358円
日本債券インデックス・ファンド（年金1）＜適格機関投資家限定＞	3,871,359,299円	4,145,561,580円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	10,676,170円	7,433,390円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	357,638,147円	263,966,341円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	468,118円	490,392円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	10,979,168円	11,910,967円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	34,477,913円	32,015,457円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	13,113,361,295円	12,634,152,650円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	6,695,414円	7,178,062円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	5,563,179,910円	4,869,450,738円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	2,171,224,162円	2,068,538,926円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	15,063,032円	12,884,484円

4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	1,604,024,819円	1,387,394,179円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	6,919,420,511円	6,818,271,354円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	1,792,997,772円	1,595,439,627円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	6,025,578,625円	5,531,075,725円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	157,078,081円	147,547,330円
日本債券インデックス・ファンドV A 1＜適格機関投資家限定＞	91,251,969円	86,760,881円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	74,700,763円	74,286,355円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	38,790,804円	42,156,723円
日本債券インデックス・ファンドV A 2＜適格機関投資家限定＞	13,977,472,080円	18,130,385,917円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	64,180,659円	60,836,011円
バランスファンドV A 2 5 B＜適格機関投資家限定＞	3,950,442,911円	3,667,881,617円
バランスファンドV A 2 0 A＜適格機関投資家限定＞	19,594,067円	17,564,426円
バランスファンドV A 3 5 B＜適格機関投資家限定＞	12,233,807円	12,541,551円
日本債券インデックス・ファンドV A 3＜適格機関投資家限定＞	1,947,793,322円	461,330,787円
日本債券インデックス・ファンド＜適格機関投資家限定＞	757,728,345円	856,700,066円
4資産インデックスバランスV A 2 0＜適格機関投資家限定＞	2,661,470,507円	2,518,868,674円
世界分散ファンドV A 2 5 A＜適格機関投資家限定＞	10,519,759,389円	9,583,442,330円
4資産インデックスバランスV A 5 0＜適格機関投資家限定＞	15,881,612円	14,884,709円
T a dリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）年金＜適格機関投資家限定＞	788,219,500円	319,947,884円
債券マルチ・ファクター戦略ファンド（年金）＜適格機関投資家限定＞	552,279,862円	384,138,329円
T a dリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）＜適格機関投資家限定＞	436,094,205円	213,778,261円
ステート・ストリート日本債券インデックス・オープン	1,866,281,311円	4,736,282,762円
日本債券インデックス・ファンドF＜適格機関投資家限定＞	38,484,657,457円	56,331,731,561円
世界バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	43,193,295円	27,942,699円

世界バランス 60 V A < 適格機関投資家限定 >	171,276,395円	102,209,601円
グローバルバランス 40 V A < 適格機関投資家限定 >	3,017,858円	1,409,812円
グローバルバランス 40 V A 2 < 適格機関投資家限定 >	4,149,548,243円	3,955,098,488円
グローバルバランス 40 V A 3 < 適格機関投資家限定 >	102,436,216円	90,264,950円
グローバルバランス 50 V A < 適格機関投資家限定 >	47,471,449円	38,526,579円
全世界株式ロー・カーボン・ファンド / 為替ヘッジ付き < 適格機関投資家限定 >	543,356,375円	— 円
計	125,544,496,076円	142,408,879,533円
2 受益権の総数	125,544,496,076口	142,408,879,533口

（金融商品に関する注記）

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	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが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。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「（3）附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク等の市場リスクに晒されております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	（2021年 2月22日現在）	（2022年 2月21日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左

2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（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。 (3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左
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。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	(2021年 2月22日現在)	(2022年 2月21日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	4,027,401,200	2,951,774,800
地方債証券	146,837,637	160,742,382
特殊債券	215,757,079	165,358,206
社債券	118,137,400	88,374,700
合計	4,508,133,316	3,366,250,088

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始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を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

該当する事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当する事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	(2021年 2月22日現在)	(2022年 2月21日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2785円 (12,785円)	1.2687円 (12,687円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

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100回利付国債（20年）	200,000,000	225,958,000	
	第101回利付国債（20年）	100,000,000	114,189,000	
	第102回利付国債（20年）	200,000,000	229,480,000	
	第103回利付国債（20年）	200,000,000	228,220,000	
	第104回利付国債（20年）	150,000,000	169,275,000	
	第105回利付国債（20年）	100,000,000	113,323,000	
	第106回利付国債（20年）	200,000,000	227,956,000	
	第107回利付国債（20年）	100,000,000	113,788,000	
	第108回利付国債（20年）	100,000,000	112,429,000	
	第109回利付国債（20年）	200,000,000	225,672,000	
	第10回利付国債（40年）	200,000,000	200,802,000	
	第110回利付国債（20年）	200,000,000	228,486,000	
	第111回利付国債（20年）	200,000,000	230,700,000	
	第112回利付国債（20年）	200,000,000	229,246,000	
	第113回利付国債（20年）	200,000,000	230,160,000	
	第114回利付国債（20年）	300,000,000	346,581,000	
	第115回利付国債（20年）	500,000,000	581,520,000	
	第116回利付国債（20年）	500,000,000	583,600,000	
	第118回利付国債（20年）	300,000,000	346,479,000	
	第11回利付国債（40年）	90,000,000	87,548,400	
	第122回利付国債（20年）	500,000,000	570,810,000	
	第123回利付国債（20年）	300,000,000	351,102,000	
	第126回利付国債（20年）	300,000,000	349,512,000	
	第127回利付国債（20年）	400,000,000	462,436,000	
	第128回利付国債（20年）	500,000,000	579,650,000	
	第12回利付国債（30年）	300,000,000	361,419,000	
	第12回利付国債（40年）	900,000,000	787,878,000	
	第130回利付国債（20年）	400,000,000	460,996,000	
	第132回利付国債（20年）	400,000,000	458,252,000	
	第133回利付国債（20年）	300,000,000	346,581,000	
	第135回利付国債（20年）	400,000,000	459,004,000	
	第135回利付国債（5年）	1,900,000,000	1,903,344,000	
	第136回利付国債（20年）	450,000,000	511,942,500	
	第136回利付国債（5年）	1,700,000,000	1,703,587,000	
	第137回利付国債（20年）	400,000,000	459,756,000	
	第137回利付国債（5年）	1,550,000,000	1,553,658,000	
	第139回利付国債（20年）	300,000,000	341,787,000	
	第139回利付国債（5年）	1,200,000,000	1,203,108,000	
	第13回利付国債（30年）	300,000,000	358,854,000	
	第13回利付国債（40年）	770,000,000	671,239,800	
	第140回利付国債（20年）	300,000,000	345,351,000	
	第140回利付国債（5年）	1,300,000,000	1,303,471,000	

第 1 4 1 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	346,026,000	
第 1 4 1 回利付国債（ 5 年）	2,500,000,000	2,506,750,000	
第 1 4 2 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	349,191,000	
第 1 4 2 回利付国債（ 5 年）	1,000,000,000	1,002,820,000	
第 1 4 3 回利付国債（ 2 0 年）	400,000,000	457,680,000	
第 1 4 3 回利付国債（ 5 年）	400,000,000	401,164,000	
第 1 4 4 回利付国債（ 2 0 年）	1,000,000,000	1,133,440,000	
第 1 4 4 回利付国債（ 5 年）	1,900,000,000	1,905,662,000	
第 1 4 5 回利付国債（ 2 0 年）	450,000,000	520,699,500	
第 1 4 5 回利付国債（ 5 年）	1,800,000,000	1,805,454,000	
第 1 4 6 回利付国債（ 2 0 年）	520,000,000	602,784,000	
第 1 4 6 回利付国債（ 5 年）	2,350,000,000	2,357,167,500	
第 1 4 7 回利付国債（ 2 0 年）	560,000,000	643,865,600	
第 1 4 7 回利付国債（ 5 年）	1,600,000,000	1,599,008,000	
第 1 4 8 回利付国債（ 2 0 年）	500,000,000	569,560,000	
第 1 4 8 回利付国債（ 5 年）	2,000,000,000	1,998,260,000	
第 1 4 9 回利付国債（ 2 0 年）	700,000,000	798,399,000	
第 1 4 9 回利付国債（ 5 年）	2,600,000,000	2,596,412,000	
第 1 4 回利付国債（ 3 0 年）	200,000,000	249,216,000	
第 1 4 回利付国債（ 4 0 年）	800,000,000	746,200,000	
第 1 5 0 回利付国債（ 2 0 年）	470,000,000	530,719,300	
第 1 5 1 回利付国債（ 2 0 年）	550,000,000	607,750,000	
第 1 5 2 回利付国債（ 2 0 年）	550,000,000	608,052,500	
第 1 5 3 回利付国債（ 2 0 年）	750,000,000	839,092,500	
第 1 5 4 回利付国債（ 2 0 年）	940,000,000	1,039,499,000	
第 1 5 5 回利付国債（ 2 0 年）	1,200,000,000	1,295,160,000	
第 1 5 6 回利付国債（ 2 0 年）	620,000,000	617,941,600	
第 1 5 7 回利付国債（ 2 0 年）	400,000,000	386,804,000	
第 1 5 8 回利付国債（ 2 0 年）	570,000,000	573,893,100	
第 1 5 9 回利付国債（ 2 0 年）	500,000,000	509,710,000	
第 1 5 回利付国債（ 3 0 年）	200,000,000	252,288,000	
第 1 6 0 回利付国債（ 2 0 年）	550,000,000	567,803,500	
第 1 6 1 回利付国債（ 2 0 年）	550,000,000	559,020,000	
第 1 6 2 回利付国債（ 2 0 年）	1,000,000,000	1,014,450,000	
第 1 6 3 回利付国債（ 2 0 年）	500,000,000	506,585,000	
第 1 6 4 回利付国債（ 2 0 年）	400,000,000	398,220,000	
第 1 6 5 回利付国債（ 2 0 年）	450,000,000	447,295,500	
第 1 6 6 回利付国債（ 2 0 年）	710,000,000	726,727,600	
第 1 6 7 回利付国債（ 2 0 年）	500,000,000	495,005,000	
第 1 6 8 回利付国債（ 2 0 年）	400,000,000	388,816,000	
第 1 6 9 回利付国債（ 2 0 年）	370,000,000	352,857,900	
第 1 6 回利付国債（ 3 0 年）	500,000,000	632,150,000	
第 1 7 0 回利付国債（ 2 0 年）	420,000,000	399,646,800	
第 1 7 1 回利付国債（ 2 0 年）	400,000,000	379,756,000	
第 1 7 2 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	289,272,000	
第 1 7 3 回利付国債（ 2 0 年）	1,100,000,000	1,058,431,000	
第 1 7 4 回利付国債（ 2 0 年）	900,000,000	864,135,000	
第 1 7 5 回利付国債（ 2 0 年）	480,000,000	468,705,600	
第 1 7 6 回利付国債（ 2 0 年）	600,000,000	584,724,000	

第 1 7 7 回利付国債（ 2 0 年）	820,000,000	782,788,400	
第 1 7 8 回利付国債（ 2 0 年）	1,250,000,000	1,214,275,000	
第 1 7 回利付国債（ 3 0 年）	200,000,000	251,092,000	
第 1 8 回利付国債（ 3 0 年）	200,000,000	249,214,000	
第 1 9 回利付国債（ 3 0 年）	200,000,000	249,804,000	
第 1 回利付国債（ 3 0 年）	300,000,000	360,897,000	
第 1 回利付国債（ 4 0 年）	160,000,000	219,243,200	
第 2 0 回利付国債（ 3 0 年）	100,000,000	127,780,000	
第 2 1 回利付国債（ 3 0 年）	200,000,000	250,766,000	
第 2 2 回利付国債（ 3 0 年）	200,000,000	256,632,000	
第 2 3 回利付国債（ 3 0 年）	100,000,000	128,623,000	
第 2 4 回利付国債（ 3 0 年）	320,000,000	412,265,600	
第 2 5 回利付国債（ 3 0 年）	100,000,000	126,236,000	
第 2 6 回メキシコ合衆国円貨債券（ 2 0 1 8 ）	100,000,000	100,126,000	
第 2 6 回利付国債（ 3 0 年）	150,000,000	191,959,500	
第 2 7 回利付国債（ 3 0 年）	320,000,000	415,782,400	
第 2 8 回利付国債（ 3 0 年）	300,000,000	390,999,000	
第 2 9 回利付国債（ 3 0 年）	200,000,000	258,560,000	
第 2 回利付国債（ 3 0 年）	380,000,000	449,137,200	
第 2 回利付国債（ 4 0 年）	500,000,000	662,395,000	
第 3 0 回利付国債（ 3 0 年）	350,000,000	448,385,000	
第 3 1 回利付国債（ 3 0 年）	400,000,000	507,396,000	
第 3 2 8 回利付国債（ 1 0 年）	500,000,000	503,560,000	
第 3 2 9 回利付国債（ 1 0 年）	500,000,000	505,690,000	
第 3 2 回利付国債（ 3 0 年）	500,000,000	644,355,000	
第 3 3 0 回利付国債（ 1 0 年）	800,000,000	810,656,000	
第 3 3 1 回利付国債（ 1 0 年）	500,000,000	505,080,000	
第 3 3 2 回利付国債（ 1 0 年）	600,000,000	606,900,000	
第 3 3 3 回利付国債（ 1 0 年）	900,000,000	911,556,000	
第 3 3 4 回利付国債（ 1 0 年）	700,000,000	710,003,000	
第 3 3 5 回利付国債（ 1 0 年）	800,000,000	810,400,000	
第 3 3 6 回利付国債（ 1 0 年）	1,000,000,000	1,014,120,000	
第 3 3 7 回利付国債（ 1 0 年）	1,000,000,000	1,008,470,000	
第 3 3 8 回利付国債（ 1 0 年）	650,000,000	657,878,000	
第 3 3 9 回利付国債（ 1 0 年）	900,000,000	911,655,000	
第 3 3 回利付国債（ 3 0 年）	400,000,000	496,076,000	
第 3 4 0 回利付国債（ 1 0 年）	1,480,000,000	1,500,350,000	
第 3 4 1 回利付国債（ 1 0 年）	1,300,000,000	1,313,910,000	
第 3 4 2 回利付国債（ 1 0 年）	800,000,000	802,600,000	
第 3 4 3 回利付国債（ 1 0 年）	1,200,000,000	1,203,876,000	
第 3 4 4 回利付国債（ 1 0 年）	1,200,000,000	1,203,552,000	
第 3 4 5 回利付国債（ 1 0 年）	1,000,000,000	1,003,130,000	
第 3 4 6 回利付国債（ 1 0 年）	800,000,000	802,224,000	
第 3 4 7 回利付国債（ 1 0 年）	750,000,000	751,987,500	
第 3 4 8 回利付国債（ 1 0 年）	900,000,000	902,493,000	
第 3 4 9 回利付国債（ 1 0 年）	1,260,000,000	1,263,288,600	
第 3 4 回利付国債（ 3 0 年）	550,000,000	703,604,000	
第 3 5 0 回利付国債（ 1 0 年）	1,800,000,000	1,804,338,000	
第 3 5 1 回利付国債（ 1 0 年）	1,500,000,000	1,503,300,000	

第 3 5 2 回利付国債（ 1 0 年）	1,260,000,000	1,262,469,600	
第 3 5 3 回利付国債（ 1 0 年）	1,300,000,000	1,302,197,000	
第 3 5 4 回利付国債（ 1 0 年）	1,100,000,000	1,101,540,000	
第 3 5 5 回利付国債（ 1 0 年）	1,530,000,000	1,530,550,800	
第 3 5 6 回利付国債（ 1 0 年）	1,550,000,000	1,550,000,000	
第 3 5 7 回利付国債（ 1 0 年）	1,100,000,000	1,099,142,000	
第 3 5 8 回利付国債（ 1 0 年）	1,300,000,000	1,297,920,000	
第 3 5 9 回利付国債（ 1 0 年）	1,800,000,000	1,795,536,000	
第 3 5 回利付国債（ 3 0 年）	520,000,000	648,096,800	
第 3 6 0 回利付国債（ 1 0 年）	1,700,000,000	1,694,237,000	
第 3 6 1 回利付国債（ 1 0 年）	1,100,000,000	1,094,731,000	
第 3 6 2 回利付国債（ 1 0 年）	1,400,000,000	1,391,236,000	
第 3 6 3 回利付国債（ 1 0 年）	1,630,000,000	1,618,035,800	
第 3 6 4 回利付国債（ 1 0 年）	1,750,000,000	1,734,372,500	
第 3 6 回利付国債（ 3 0 年）	480,000,000	599,841,600	
第 3 7 回利付国債（ 3 0 年）	330,000,000	407,074,800	
第 3 8 回利付国債（ 3 0 年）	1,100,000,000	1,338,161,000	
第 3 9 回利付国債（ 3 0 年）	530,000,000	655,912,100	
第 3 回利付国債（ 3 0 年）	300,000,000	353,493,000	
第 3 回利付国債（ 4 0 年）	250,000,000	332,517,500	
第 4 0 回利付国債（ 3 0 年）	350,000,000	426,562,500	
第 4 1 回利付国債（ 3 0 年）	300,000,000	359,862,000	
第 4 2 4 回利付国債（ 2 年）	800,000,000	800,664,000	
第 4 2 6 回利付国債（ 2 年）	200,000,000	200,162,000	
第 4 2 7 回利付国債（ 2 年）	800,000,000	800,632,000	
第 4 2 8 回利付国債（ 2 年）	3,000,000,000	3,002,280,000	
第 4 2 回利付国債（ 3 0 年）	330,000,000	396,115,500	
第 4 3 0 回利付国債（ 2 年）	800,000,000	800,608,000	
第 4 3 回利付国債（ 3 0 年）	340,000,000	408,401,200	
第 4 4 回利付国債（ 3 0 年）	350,000,000	420,689,500	
第 4 5 回利付国債（ 3 0 年）	420,000,000	487,561,200	
第 4 6 回利付国債（ 3 0 年）	350,000,000	406,423,500	
第 4 7 回利付国債（ 3 0 年）	500,000,000	591,410,000	
第 4 8 回利付国債（ 3 0 年）	500,000,000	569,670,000	
第 4 9 回利付国債（ 3 0 年）	520,000,000	592,508,800	
第 4 回利付国債（ 4 0 年）	250,000,000	335,317,500	
第 5 0 回利付国債（ 3 0 年）	350,000,000	352,488,500	
第 5 1 回利付国債（ 3 0 年）	250,000,000	223,637,500	
第 5 2 回利付国債（ 3 0 年）	400,000,000	374,968,000	
第 5 3 回利付国債（ 3 0 年）	400,000,000	383,428,000	
第 5 4 回利付国債（ 3 0 年）	410,000,000	410,856,900	
第 5 5 回利付国債（ 3 0 年）	390,000,000	390,409,500	
第 5 6 回利付国債（ 3 0 年）	720,000,000	719,229,600	
第 5 7 回利付国債（ 3 0 年）	340,000,000	339,272,400	
第 5 8 回利付国債（ 3 0 年）	480,000,000	477,936,000	
第 5 9 回利付国債（ 3 0 年）	400,000,000	388,344,000	
第 5 回利付国債（ 3 0 年）	100,000,000	118,571,000	
第 5 回利付国債（ 4 0 年）	130,000,000	168,630,800	
第 6 0 回利付国債（ 3 0 年）	340,000,000	345,555,600	

	第 6 1 回利付国債（ 2 0 年）	350,000,000	353,993,500	
	第 6 1 回利付国債（ 3 0 年）	120,000,000	115,940,400	
	第 6 2 回利付国債（ 3 0 年）	250,000,000	228,730,000	
	第 6 3 回利付国債（ 2 0 年）	500,000,000	512,280,000	
	第 6 3 回利付国債（ 3 0 年）	250,000,000	221,855,000	
	第 6 4 回利付国債（ 3 0 年）	310,000,000	274,542,200	
	第 6 5 回利付国債（ 2 0 年）	400,000,000	414,092,000	
	第 6 5 回利付国債（ 3 0 年）	310,000,000	273,984,200	
	第 6 6 回利付国債（ 3 0 年）	290,000,000	256,070,000	
	第 6 7 回利付国債（ 3 0 年）	700,000,000	652,603,000	
	第 6 8 回利付国債（ 2 0 年）	500,000,000	523,000,000	
	第 6 8 回利付国債（ 3 0 年）	600,000,000	559,086,000	
	第 6 9 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	313,176,000	
	第 6 9 回利付国債（ 3 0 年）	200,000,000	191,282,000	
	第 6 回利付国債（ 3 0 年）	180,000,000	218,259,000	
	第 6 回利付国債（ 4 0 年）	150,000,000	191,536,500	
	第 7 0 回利付国債（ 2 0 年）	600,000,000	633,600,000	
	第 7 0 回利付国債（ 3 0 年）	360,000,000	344,199,600	
	第 7 1 回利付国債（ 3 0 年）	780,000,000	745,531,800	
	第 7 2 回利付国債（ 2 0 年）	600,000,000	632,526,000	
	第 7 2 回利付国債（ 3 0 年）	780,000,000	745,297,800	
	第 7 4 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	317,748,000	
	第 7 6 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	211,604,000	
	第 7 7 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	318,327,000	
	第 7 8 回利付国債（ 2 0 年）	250,000,000	265,607,500	
	第 7 回利付国債（ 3 0 年）	300,000,000	362,841,000	
	第 7 回利付国債（ 4 0 年）	160,000,000	196,500,800	
	第 8 0 回利付国債（ 2 0 年）	100,000,000	106,907,000	
	第 8 1 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	214,148,000	
	第 8 3 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	323,784,000	
	第 8 5 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	216,922,000	
	第 8 8 回利付国債（ 2 0 年）	400,000,000	439,296,000	
	第 8 9 回利付国債（ 2 0 年）	400,000,000	437,568,000	
	第 8 回利付国債（ 3 0 年）	300,000,000	349,035,000	
	第 8 回利付国債（ 4 0 年）	50,000,000	57,395,000	
	第 9 0 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	329,667,000	
	第 9 1 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	331,038,000	
	第 9 2 回利付国債（ 2 0 年）	340,000,000	373,724,600	
	第 9 3 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	329,673,000	
	第 9 4 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	331,191,000	
	第 9 5 回利付国債（ 2 0 年）	150,000,000	167,917,500	
	第 9 6 回利付国債（ 2 0 年）	100,000,000	110,883,000	
	第 9 7 回利付国債（ 2 0 年）	150,000,000	167,929,500	
	第 9 8 回利付国債（ 2 0 年）	100,000,000	111,397,000	
	第 9 9 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	223,746,000	
	第 9 回利付国債（ 3 0 年）	100,000,000	112,120,000	
	第 9 回利付国債（ 4 0 年）	1,730,000,000	1,483,163,600	
国債証券	小計	141,620,000,000	147,653,807,100	

地方債証券	第10回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	115,155,000	
	第10回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	114,307,000	
	第111回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,299,000	
	第115回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,535,000	
	第119回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,796,000	
	第11回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	88,804,000	
	第11回静岡県公募公債（20年）	150,000,000	170,425,500	
	第11回川崎市公募公債（30年）	100,000,000	98,248,000	
	第120回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	100,000,000	100,974,000	
	第129回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,262,000	
	第12回東京都公募公債（20年）	100,000,000	111,959,000	
	第130回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,406,000	
	第135回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	100,731,000	
	第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,368,000	
	第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,287,000	
	第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	114,357,000	
	第13回大阪市公募公債（20年）	50,000,000	57,610,000	
	第13回東京都公募公債（20年）	100,000,000	111,583,000	
	第147回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,626,000	
	第14回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	113,006,000	
	第14回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	114,429,000	
	第14回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	114,844,000	
	第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,020,000	
	第15回千葉県公募公債（20年・定時償還）	100,000,000	98,747,000	
	第160回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	96,171,000	
	第181回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,153,000	
	第184回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,095,000	
	第188回共同発行市場公募地方債	30,000,000	30,198,300	
	第188回神奈川県公募公債	100,000,000	100,072,000	
	第18回神奈川県公募公債（20年）	50,000,000	57,446,000	
	第206回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,279,000	
	第209回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,125,000	
	第211回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,023,000	
	第24回千葉県公募公債	100,000,000	99,544,000	
	第26回東京都公募公債（20年）	100,000,000	114,589,000	
	第29回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	96,276,000	
	第2回横浜市公募公債（30年）	100,000,000	125,879,000	
	第2回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	115,412,000	
	第2回兵庫県公募公債（30年）	100,000,000	128,830,000	
	第30回2号宮城県公募公債（10年）	100,000,000	101,285,000	
	第368回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,776,000	
	第36回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	100,724,000	
	第374回大阪府公募公債（10年）	134,000,000	135,779,520	
	第387回大阪府公募公債（10年）	44,040,000	44,560,112	
	第392回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,894,000	
	第3回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	129,840,000	
	第3回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	110,340,000	
	第3回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	106,508,000	
	第469回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	98,662,000	

第４８０回名古屋市政公募債（１０年）	100,000,000	100,473,000	
第４回横浜市公募債（３０年）	100,000,000	128,370,000	
第４回川崎市公募債（２０年）	100,000,000	113,711,000	
第４回兵庫県公募債（１２年）	100,000,000	102,884,000	
第５回大阪市公募債（２０年）	100,000,000	115,039,000	
第６回京都市公募債（２０年）	200,000,000	224,692,000	
第６回札幌市公募債（２０年）	100,000,000	114,890,000	
第６回東京都公募債（２０年）	100,000,000	105,963,000	
第６回兵庫県公募債（１５年）	100,000,000	107,493,000	
第７３９回東京都公募債	100,000,000	100,663,000	
第７４６回東京都公募債	100,000,000	101,457,000	
第７５１回東京都公募債	100,000,000	101,124,000	
第７５９回東京都公募債	100,000,000	99,954,000	
第７７０回東京都公募債	100,000,000	100,290,000	
第７回東京都公募債（２０年）	100,000,000	107,472,000	
第８００回東京都公募債	200,000,000	198,074,000	
平成２４年度第１０回札幌市公募債（１０年）	100,000,000	100,658,000	
平成２４年度第１１回福岡県公募債	100,000,000	100,803,000	
平成２４年度第１２回愛知県公募債（３０年）	10,000,000	12,610,100	
平成２４年度第１４回愛知県公募債（１５年）	100,000,000	106,731,000	
平成２４年度第１回埼玉県公募債	100,000,000	100,183,000	
平成２４年度第１回滋賀県公募債	30,600,000	30,785,742	
平成２４年度第１回福井県公募債	100,000,000	100,538,000	
平成２４年度第２回新潟県公募債	100,000,000	100,793,000	
平成２４年度第４回北海道公募債	100,000,000	100,314,000	
平成２４年度第５回京都府公募債	30,000,000	30,141,300	
平成２４年度第８回愛知県公募債（１０年）	100,000,000	100,430,000	
平成２４年度第８回京都府公募債	30,000,000	30,179,400	
平成２４年度第８回福岡市公募債	100,000,000	100,727,000	
平成２４年度第９回北海道公募債	7,400,000	7,440,108	
平成２５年度第１０回京都府公募債（１５年）	100,000,000	106,368,000	
平成２５年度第１回岡山県公募債（１０年）	100,000,000	101,398,000	
平成２５年度第１回埼玉県公募債	100,000,000	100,664,000	
平成２５年度第６回愛知県公募債（１０年）	100,000,000	101,166,000	
平成２６年度第１回広島県公募債（２０年）	100,000,000	112,068,000	
平成２６年度第５回埼玉県公募債	100,000,000	101,374,000	
平成２６年度第９回静岡県公募債	20,000,000	20,268,400	
平成２７年度第１２回愛知県公募債（１５年）	100,000,000	104,403,000	
平成２７年度第１３回北海道公募債	100,000,000	101,529,000	
平成２７年度第１回岡山県公募債（１０年）	100,000,000	101,264,000	
平成２７年度第２回京都府公募債（１５年）	100,000,000	104,170,000	
平成２７年度第４回札幌市公募債（１０年）	100,000,000	101,493,000	
平成２７年度第９回北海道公募債	100,000,000	101,530,000	
平成２８年度第１回広島県公募債	100,000,000	100,021,000	
平成２８年度第５回広島市公募債	100,000,000	100,698,000	
平成２８年度第６回福岡県公募債	100,000,000	100,409,000	
平成２９年度第１５回北海道公募債	100,000,000	100,387,000	
平成２９年度第１回秋田県公募債	145,900,000	146,295,389	
平成２９年度第２回兵庫県公募債	100,000,000	100,234,000	

	平成２９年度第３回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	100,554,000	
	平成２９年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	100,344,000	
	平成２９年度第５回広島県公募公債	100,000,000	100,587,000	
	平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,377,000	
	平成３０年度第１８回北海道公募公債	20,000,000	19,946,000	
	平成３０年度第１回熊本市公募公債	100,000,000	100,663,000	
	平成３０年度第２回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	101,878,000	
	平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年）	100,000,000	97,182,000	
	平成３０年度第６回広島市公募公債	145,000,000	144,759,300	
	令和２年度第３回長崎県公募公債（１０年）	12,400,000	12,303,776	
	令和２年度第９回静岡県公募公債	100,000,000	99,034,000	
	令和３年度第１回新潟県公募公債	100,000,000	95,034,000	
	令和３年度第４回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	96,346,000	
	令和３年度第６回福岡県公募公債	100,000,000	99,214,000	
地方債証券	小計	10,709,340,000	11,144,083,947	
特殊債券	F１１６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,987,000	
	F１８１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,518,000	
	F１９０回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,964,000	
	F３０８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	108,843,000	
	F４３８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,175,000	
	F５３８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,771,000	
	い第８０３号商工債	100,000,000	100,001,000	
	い第８５５号商工債	100,000,000	99,597,000	
	い第８５６号商工債	200,000,000	199,226,000	
	第１０１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,752,000	62,487,684	
	第１０６回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,613,000	
	第１０６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,826,000	67,309,820	
	第１０８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,917,000	
	第１０回株式会社日本政策金融公庫社債（一般担保付）	100,000,000	115,298,000	
	第１１０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,564,000	145,940,796	
	第１１２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,547,000	
	第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,292,000	76,219,522	
	第１１８回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,345,000	
	第１１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,191,000	77,353,101	
	第１１回公営企業債券（２０年）	100,000,000	106,312,000	
	第１２３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,334,000	
	第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,704,000	79,643,424	
	第１２５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,283,000	
	第１２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,534,000	
	第１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,737,000	81,535,926	
	第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,685,000	82,587,431	
	第１３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,136,000	
	第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,633,000	83,373,737	
	第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,866,000	85,025,548	
	第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,461,000	84,800,533	
	第１３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,346,000	84,439,624	
	第１３回公営企業債券（２０年）	10,000,000	10,695,200	
	第１４５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,590,000	
	第１４６回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,398,000	

第 1 4 9 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,374,000	
第 1 5 7 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,118,000	
第 1 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,969,000	96,518,094	
第 1 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	8,790,000	8,803,976	
第 1 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,890,000	97,079,470	
第 1 7 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,916,000	
第 1 7 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,400,000	97,145,400	
第 1 7 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,312,000	
第 1 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,783,000	97,641,068	
第 1 7 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,128,000	98,430,138	
第 1 7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,859,000	98,579,806	
第 1 7 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,389,000	
第 1 7 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,236,000	
第 1 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	8,809,000	8,824,063	
第 1 8 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,733,000	
第 1 8 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,662,000	
第 1 8 回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	100,742,000	
第 1 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	8,756,000	8,769,134	
第 1 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	143,456,000	
第 1 9 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,794,000	
第 2 0 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000	1,013,000	
第 2 0 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,655,000	
第 2 0 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,179,000	
第 2 0 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,264,000	
第 2 0 回地方公共団体金融機構債券（ 2 0 年 ）	100,000,000	114,570,000	
第 2 1 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,545,000	
第 2 1 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2,000,000	2,028,360	
第 2 1 回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	101,255,000	
第 2 2 回公営企業債券（ 2 0 年 ）	100,000,000	111,628,000	
第 2 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	139,198,000	
第 2 3 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,258,000	
第 2 3 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	13,000,000	13,157,430	
第 2 3 6 号商工債（ 3 年 ）	100,000,000	99,972,000	
第 2 3 回国際協力銀行債券	100,000,000	107,684,000	
第 2 3 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	134,596,800	
第 2 4 0 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,024,000	
第 2 5 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,292,000	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,992,000	39,229,646	
第 2 6 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,030,000	
第 2 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	10,000,000	13,063,600	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,284,000	21,402,865	
第 2 8 回地方公共団体金融機構債券（ 2 0 年 ）	100,000,000	111,141,000	
第 2 8 回道路債券	200,000,000	255,294,000	
第 2 9 回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人	200,000,000	201,646,000	
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,193,000	10,260,885	
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,517,000	23,920,934	
第 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,878,000	24,420,985	
第 3 0 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,740,000	

第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,412,000	23,788,993	
第 3 1 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,026,000	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,871,000	24,241,201	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,970,000	23,136,167	
第 3 3 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,942,000	
第 3 3 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,233,000	
第 3 3 8 回信金中金債（ 5 年 ）	100,000,000	100,060,000	
第 3 4 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	13,000,000	13,015,730	
第 3 4 2 回東京交通債券	30,000,000	30,224,100	
第 3 4 3 回信金中金債（ 5 年 ）	100,000,000	100,080,000	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,750,000	13,076,272	
第 3 5 2 回信金中金債（ 5 年 ）	100,000,000	99,979,000	
第 3 5 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,376,000	
第 3 6 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,582,000	
第 3 6 4 回信金中金債（ 5 年 ）	100,000,000	99,737,000	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,747,000	22,863,490	
第 3 7 8 回信金中金債（ 5 年 ）	100,000,000	99,766,000	
第 3 7 9 回信金中金債（ 5 年 ）	100,000,000	99,740,000	
第 3 7 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,661,000	
第 3 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,292,000	
第 3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,042,000	
第 3 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,954,000	11,103,960	
第 3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,221,000	25,417,759	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,496,000	24,529,589	
第 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,812,000	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	50,984,000	50,783,632	
第 3 回都市再生債券	100,000,000	106,576,000	
第 4 0 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,478,000	
第 4 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	301,812,000	
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,040,000	29,321,428	
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,160,000	58,074,654	
第 4 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,830,000	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,227,000	23,365,244	
第 4 6 回政府保証地方公共団体金融機構債券	33,000,000	33,241,890	
第 4 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,651,000	
第 4 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,861,000	
第 4 9 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,574,000	
第 4 回公営企業債券（ 3 0 年 ）	100,000,000	129,681,000	
第 5 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,908,000	
第 5 1 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,437,000	
第 5 3 回政府保証日本政策金融公庫債券	162,000,000	162,832,680	
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,389,000	32,858,946	
第 5 回国際協力機構債券	100,000,000	114,020,000	
第 6 0 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,424,000	
第 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,764,000	37,397,341	
第 6 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,428,000	
第 6 3 回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人	100,000,000	99,940,000	

	第 6 4 回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人	100,000,000	99,613,000	
	第 6 5 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,414,000	
	第 6 6 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,258,000	
	第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,728,000	41,267,062	
	第 6 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	14,000,000	14,113,960	
	第 6 8 回地方公共団体金融機構債券（ 2 0 年）	100,000,000	98,443,000	
	第 6 8 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,311,000	
	第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,319,000	43,275,041	
	第 6 回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,246,000	
	第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	9,869,000	9,892,882	
	第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,118,000	37,692,383	
	第 7 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,634,000	35,861,082	
	第 7 6 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,331,000	
	第 7 8 回株式会社日本政策投資銀行無担保社債（社債間限定同順位	100,000,000	100,562,000	
	第 7 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,556,000	37,872,747	
	第 7 回阪神高速道路債券	100,000,000	106,428,000	
	第 7 回道路債券	50,000,000	50,440,500	
	第 7 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	107,195,000	
	第 8 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,004,000	41,466,946	
	第 8 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	135,525,000	
	第 8 5 回中日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人	100,000,000	99,890,000	
	第 8 9 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,906,000	
	第 8 回公営企業債券（ 3 0 年）	10,000,000	12,621,400	
	第 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,451,000	11,663,301	
	第 9 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,562,000	
	第 9 6 回株式会社日本政策投資銀行無担保社債（社債間限定同順位	100,000,000	100,063,000	
	第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,393,000	60,595,114	
	第 9 6 回都市再生債券	100,000,000	101,397,000	
	第 9 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,268,000	
	第 9 9 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,244,000	
	第 9 回新関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	106,978,000	
	第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	21,082,000	21,299,777	
	第 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,166,000	12,451,657	
特殊債券	小計	13,235,610,000	13,784,162,928	
社債券	第 1 0 7 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同	200,000,000	219,018,000	
	第 1 0 回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債（ 2 0 1	100,000,000	100,033,000	
	第 1 0 回九州旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約	100,000,000	96,415,000	
	第 1 1 回電源開発株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	105,565,000	
	第 1 2 7 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同	100,000,000	99,645,000	
	第 1 3 0 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同	100,000,000	99,968,000	

第134回三菱地所株式会社無担保社債（担保提供制限等財務上特	100,000,000	99,066,000	
第13回東京地下鉄株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	113,050,000	
第14回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（2017）	100,000,000	99,177,000	
第14回ソフトバンク株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約	100,000,000	99,098,000	
第14回トヨタ自動車株式会社無担保社債（社債間限定同等特約付	100,000,000	100,942,000	
第152回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同	100,000,000	99,577,000	
第15回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債（社債間	100,000,000	100,837,000	
第18回イオンモール株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約	100,000,000	96,495,000	
第18回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債（2018	100,000,000	99,653,000	
第20回NTTファイナンス株式会社無担保社債（社債間限定同順	100,000,000	99,588,000	
第21回株式会社オリエンタルランド無担保社債（社債間限定同順	100,000,000	99,781,000	
第21回三井住友信託銀行株式会社無担保社債（社債間限定同順位	100,000,000	99,983,000	
第22回三菱瓦斯化学株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約	100,000,000	99,633,000	
第23回ルノー円貨社債（2021）	100,000,000	100,014,000	
第23回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債（社債	200,000,000	202,658,000	
第25回日本郵船株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	109,467,000	
第26回トヨタ自動車株式会社無担保社債（社債間限定同等特約付	100,000,000	99,534,000	
第26回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,524,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債（社債間限	100,000,000	101,039,000	
第28回リコーリース株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約	100,000,000	99,881,000	
第28回東京瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	110,663,000	
第298回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,725,000	
第30回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債（201	100,000,000	99,417,000	
第31回株式会社光通信無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,569,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,519,000	
第323回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,850,000	
第32回ANAホールディングス株式会社無担保社債（社債間限定	100,000,000	93,336,000	

第 3 2 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債	100,000,000	104,335,000	
第 3 5 0 回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,421,000	
第 3 5 回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,077,000	
第 3 6 回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０２	100,000,000	99,160,000	
第 3 回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債（社債間限定同順位	100,000,000	101,389,000	
第 3 回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債（社債間	100,000,000	100,577,000	
第 4 2 2 回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,487,000	
第 4 2 6 回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,229,000	
第 4 3 2 回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,810,000	
第 4 5 回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位	100,000,000	114,151,000	
第 4 6 5 回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,844,000	
第 4 7 回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債（阪急電鉄	100,000,000	106,228,000	
第 4 7 回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位	100,000,000	125,577,000	
第 4 8 9 回九州電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	199,764,000	
第 4 回東京地下鉄株式会社社債（一般担保付）	10,000,000	10,922,500	
第 5 0 6 回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,620,000	
第 5 1 0 回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,878,000	
第 5 1 7 回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,216,000	
第 5 2 1 回東北電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	200,480,000	
第 5 2 4 回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,610,000	
第 5 2 回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特	100,000,000	99,961,000	
第 5 3 4 回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	96,169,000	
第 5 4 0 回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,684,000	
第 5 4 5 回中部電力株式会社社債（一般担保付）（グリーン	100,000,000	98,824,000	
第 5 7 回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（特定	100,000,000	101,463,000	
第 5 8 回電源開発株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	98,819,000	
第 6 3 回日本電信電話株式会社電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	100,638,000	
第 6 5 回三菱地所株式会社無担保社債（担保提供制限等財務上特約	100,000,000	115,862,000	
第 6 7 回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債（社債間限定同順位	100,000,000	99,761,000	
第 6 7 回東京瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	94,890,000	
第 6 回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,061,000	
第 7 2 回株式会社ホンダファイナンス無担保社債（社債間限定同順	100,000,000	99,620,000	
第 7 3 回株式会社ホンダファイナンス無担保社債（社債間限定同順	100,000,000	99,269,000	

	第7回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,194,000	
	第8回楽天株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,723,000	
	第96回トヨタファイナンス株式会社無担保社債（社債間限定同等）	200,000,000	199,052,000	
社債券	小計	7,310,000,000	7,426,485,500	
合計		172,874,950,000	180,008,539,475	

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

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

該当する事項はありません。

「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

（単位：円）

区 分	注記 番号	(2021年 2月22日現在)	(2022年 2月21日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		938,867,363	4,969,966,480
金銭信託		549,323	8,261,676
コール・ローン		712,950,439	1,978,482,245
株式		167,983,926,515	185,167,372,213
投資証券		3,658,871,131	4,298,547,977
派生商品評価勘定		75,222,683	12,622,312
未収入金		593,235	41,041,575
未収配当金		183,590,687	191,050,228
差入委託証拠金		879,525,962	1,728,779,788
流動資産合計		174,434,097,338	198,396,124,494
資産合計		174,434,097,338	198,396,124,494
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,154,822	496,985,663
未払解約金		396,904,700	159,043,000
未払利息		1,947	5,342
その他未払費用		55	1,022
流動負債合計		399,061,524	656,035,027
負債合計		399,061,524	656,035,027
純資産の部			
元本等			
元本	1	49,551,945,295	47,184,065,744
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		124,483,090,519	150,556,023,723
元本等合計		174,035,035,814	197,740,089,467

純資産合計		174,035,035,814	197,740,089,467
負債純資産合計		174,434,097,338	198,396,124,494

（注）親投資信託の計算期間は、原則として、毎年12月1日から、翌年11月30日までであります。

（２）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	株式、投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、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 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 外国先物の評価においては、個別法に基づき、原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定しております。 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。
4 その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（ 2021年 2月22日現在 ）	（ 2022年 2月21日現在 ）
1 期首元本額	56,526,014,844円	49,551,945,295円
期中追加設定元本額	16,720,868,331円	5,521,606,426円
期中一部解約元本額	23,694,937,880円	7,889,485,977円
元本の内訳		
ファンド名		
ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン	5,576,571,210円	5,315,474,460円
ステート・ストリートDC外国株式インデックス・オープン	6,332,118,187円	6,330,330,821円
ステート・ストリートDCグローバル株式インデックス・オープン	64,335,681円	76,275,626円
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	73,584,902円	60,143,809円
外国株式インデックス・ファンドVA1（適格機関投資家専用）	1,570,973,014円	2,519,322,111円
外国株式インデックス・ファンドVA2（適格機関投資家専用）	41,545,913円	26,407,556円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	878,687円	442,691円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	56,407,364円	33,036,075円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	62,473円	49,318円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	2,925,442円	2,344,219円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	6,675,997円	4,738,262円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	5,090,361,978円	3,736,418,535円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	1,148,238円	917,334円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	513,754,778円	353,728,849円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	480,192,247円	356,336,772円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	45,764,215円	30,378,834円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	149,026,914円	100,653,224円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	1,843,084,679円	1,330,879,336円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	297,277,842円	199,866,073円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	999,902,745円	695,802,297円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	40,774,505円	29,233,539円

グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	29,495,917円	21,780,444円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	31,802,987円	24,915,442円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	17,267,699円	12,031,668円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	206,701,315円	138,919,975円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	628,755円	392,345円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	943,567円	745,981円
外国株式インデックス・ファンドVA3<適格機関投資家限定>	1,522,054,177円	339,221,706円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	167,893,887円	120,992,558円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	28,344,188円	20,325,527円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）年金<適格機関投資家限定>	23,956,376円	18,650,429円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）<適格機関投資家限定>	13,432,765円	12,601,924円
ステート・ストリート先進国株式インデックス・オープン	222,467,876円	319,209,613円
ステート・ストリート先進国株式インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	3,745,579,689円	2,880,952,979円
全世界株式インデックス・ファンド	699,297,276円	1,331,079,869円
世界バランス40VA<適格機関投資家限定>	20,449,789円	9,938,569円
世界バランス60VA<適格機関投資家限定>	224,746,309円	101,883,747円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	1,456,834円	502,546円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	1,205,737,914円	869,697,340円
グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	47,100,555円	32,663,503円
グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	25,249,624円	15,348,108円
ワールドエクイティ・ファンドVL<適格機関投資家限定>	18,129,970,785円	19,709,431,730円
計	49,551,945,295円	47,184,065,744円
2 受益権の総数	49,551,945,295口	47,184,065,744口

（金融商品に関する注記）

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	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが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。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「（３）附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスクに晒されております。 デリバティブ取引には、株価指数先物取引、為替予約取引があり、株価指数先物取引はファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、効率的な運用に資する目的として、また為替予約取引は保有外貨建資産の売却代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払い目的に関連して利用しております。これらは、それぞれの取引種類により、株価変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク及びカウンターパーティーリスク等の信用リスクに晒されております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	（2021年 2月22日現在）	（2022年 2月21日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（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。 (3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。 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。 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。	(2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
---------------------------	--	--

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	（2021年 2月22日現在）	（2022年 2月21日現在）
	当期間の損益に 含まれた評価差額	当期間の損益に 含まれた評価差額
株式	11,395,433,238	11,184,183,878
投資証券	81,210,328	319,926,555
合計	11,476,643,566	11,504,110,433

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始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を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

（単位：円）

区 分	種 類	(2021年 2月22日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			

市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MINI S&P 500	1,447,421,485	—	1,502,909,209	55,487,724
	S&P 60	105,591,512	—	109,495,711	3,904,199
	SPI 200	82,021,180	—	84,005,262	1,984,082
	FTSE100INDEX	87,128,909	—	87,973,366	844,457
	FSMI INDEX	86,685,385	—	87,502,983	817,598
	EURO STOXX 50	213,218,291	—	223,277,136	10,058,845
合 計		2,022,066,762	—	2,095,163,667	73,096,905

(単位：円)

区 分	種 類	(2022年 2月21日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MINI S&P 500	6,458,191,465	—	6,022,145,457	436,046,008
	S&P 60	365,306,541	—	366,846,440	1,539,899
	SPI 200	269,229,821	—	265,965,480	3,264,341
	FTSE100INDEX	341,950,183	—	350,475,214	8,525,031
	FSMI INDEX	326,381,294	—	312,378,760	14,002,534
	EURO STOXX 50	991,411,651	—	959,733,133	31,678,518
合 計		8,752,470,955	—	8,277,544,484	474,926,471

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は対顧客電信売買相場の仲値で行っており、換算において円未満の端数は切り捨てております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
5. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

通貨関連

(単位：円)

区 分	種 類	(2021年 2月22日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	453,869,765	—	453,564,000	305,765
	カナダ・ドル	7,507,670	—	7,533,000	25,330
	オーストラリア・ドル	8,213,864	—	8,318,000	104,136
	イギリス・ポンド	14,711,284	—	14,796,000	84,716
	ユーロ	33,212,061	—	33,259,200	47,139
	売建				
	アメリカ・ドル	360,974,200	—	360,775,800	198,400
	カナダ・ドル	14,203,600	—	14,230,700	27,100
	オーストラリア・ドル	18,195,800	—	18,299,600	103,800

	イギリス・ポンド	36,945,500	—	36,992,500	47,000
	スイス・フラン	12,951,800	—	12,940,400	11,400
	香港・ドル	5,441,600	—	5,440,000	1,600
	シンガポール・ドル	4,782,600	—	4,784,400	1,800
	スウェーデン・クローナ	5,102,400	—	5,100,000	2,400
	ユーロ	49,866,200	—	49,884,900	18,700
	合 計	1,025,978,344	—	1,025,918,500	29,044

(単位：円)

区 分	種 類	(2022年 2月21日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	1,545,014,055	—	1,539,170,976	5,843,079
	カナダ・ドル	95,586,435	—	94,799,460	786,975
	オーストラリア・ドル	55,485,313	—	55,414,092	71,221
	イギリス・ポンド	65,630,371	—	65,734,326	103,955
	ユーロ	234,835,417	—	232,095,980	2,739,437
	売建				
	アメリカ・ドル	74,781,855	—	74,772,880	8,975
	カナダ・ドル	5,436,960	—	5,417,112	19,848
	オーストラリア・ドル	42,048,405	—	42,180,876	132,471
	イギリス・ポンド	7,815,880	—	7,825,515	9,635
	ユーロ	9,140,530	—	9,127,370	13,160
	合 計	2,135,775,221	—	2,126,538,587	9,436,880

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

(2) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

4. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(2021年 2月22日現在)	(2022年 2月21日現在)
--	-------------------	-------------------

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.5122円 (35,122円)	4.1908円 (41,908円)
---------------------------	----------------------	----------------------

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

通貨	銘 柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	BAKER HUGHES COMPANY	25,149	29.11	732,087.39	
	CHENIERE ENERGY INC	7,111	116.02	825,018.22	
	CHEVRON CORPORATION	59,095	133.42	7,884,454.90	
	CONOCOPHILLIPS	40,888	89.63	3,664,791.44	
	COTERRA ENERGY INC	24,300	22.59	548,937.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	19,900	54.78	1,090,122.00	
	DIAMONDBACK ENERGY	5,200	131.47	683,644.00	
	EOG RESOURCES INC	17,806	111.62	1,987,505.72	
	EXXON MOBIL CORPORATION	129,351	77.36	10,006,593.36	
	HALLIBURTON CO	27,014	32.26	871,471.64	
	HESS CORP	8,700	93.87	816,669.00	
	KINDER MORGAN INC	62,072	16.60	1,030,395.20	
	MARATHON PETROLEUM CORP	19,430	77.02	1,496,498.60	
	OCCIDENTAL PETROLEUM	28,424	39.56	1,124,453.44	
	ONEOK INC NEW	13,600	61.81	840,616.00	
	PHILLIPS 66	13,383	85.07	1,138,491.81	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,024	233.38	1,639,261.12	
	SCHLUMBERGER LTD	42,662	40.21	1,715,439.02	
	VALERO ENERGY CORP	12,403	86.72	1,075,588.16	
	WILLIAMS COS	37,041	29.62	1,097,154.42	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	6,747	241.97	1,632,571.59	
	ALBEMARLE CORP	3,400	190.76	648,584.00	
	AMCOR PLC	21,100	11.88	250,668.00	
	AVERY DENNISON CORP	2,657	180.87	480,571.59	
	BALL CORP	9,904	90.61	897,401.44	
	CELANESE CORPORATION	3,472	144.25	500,836.00	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,500	73.27	476,255.00	
	CORTEVA INC	22,968	50.70	1,164,477.60	
	CROWN HOLDINGS INC	4,000	120.72	482,880.00	
	DOW INC	22,735	60.59	1,377,513.65	
	DUPONT DE NEMOURS INC	15,969	78.77	1,257,878.13	
	EASTMAN CHEMICAL CO	4,355	121.28	528,174.40	
	ECOLAB INC	7,826	178.64	1,398,036.64	
	FMC CORP	3,900	116.89	455,871.00	
	FREEPORT MCMORAN INC	44,766	43.02	1,925,833.32	
	INT'L FLAVORS FRAGRANCES	7,539	134.79	1,016,181.81	
	INT'L PAPER CO	11,890	46.74	555,738.60	
	LINDE PLC	13,073	302.86	3,959,288.78	
	LYONDELLBASELL INDU CL A	8,145	99.84	813,196.80	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,900	383.67	728,973.00	

MOSAIC CO/THE	11,301	45.00	508,545.00	
NEWMONT CORPORATION	21,947	67.67	1,485,153.49	
NUCOR CORP	8,971	122.93	1,102,805.03	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,000	148.47	445,410.00	
PPG INDUSTRIES	7,247	149.64	1,084,441.08	
RPM INTERNATIONAL INC	3,900	86.20	336,180.00	
SEALED AIR CORP	4,603	69.31	319,033.93	
SHERWIN-WILLIAMS CO	7,589	268.07	2,034,383.23	
STEEL DYNAMICS INC	6,200	63.95	396,490.00	
VULCAN MATERIALS CO	4,156	185.31	770,148.36	
WESTROCK COMPANY	8,725	46.65	407,021.25	
3M CO	17,682	147.62	2,610,216.84	
ALLEGION PLC W/I	2,900	114.13	330,977.00	
AMETEK INC	7,000	128.22	897,540.00	
BOEING CO	16,970	209.03	3,547,239.10	
CARRIER GLOBAL CORP	25,156	44.08	1,108,876.48	
CATERPILLAR	16,671	191.95	3,199,998.45	
CUMMINS ENGINE CO	4,412	218.05	962,036.60	
DEERE & CO	8,995	369.10	3,320,054.50	
DOVER CORP	4,414	159.03	701,958.42	
EATON CORP PLC	12,161	153.36	1,865,010.96	
EMERSON ELECTRIC CO	18,249	92.77	1,692,959.73	
FASTENAL CO	17,500	51.20	896,000.00	
FORTIVE CORPORATION	9,734	63.75	620,542.50	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	4,400	88.79	390,676.00	
GENERAC HOLDINGS INC	1,900	294.76	560,044.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	7,260	215.82	1,566,853.20	
GENERAL ELECTRIC CO	33,500	92.69	3,105,115.00	
GRAINGER (WW)	1,367	473.93	647,862.31	
HEICO CORP	1,400	141.98	198,772.00	
HEICO CORP-CLASS A	2,300	117.41	270,043.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	21,117	182.13	3,846,039.21	
HOWMET AEROSPACE INC	12,229	34.56	422,634.24	
HUNTINGTON INGALLS IND	1,200	186.09	223,308.00	
IDEX CORP	2,400	189.34	454,416.00	
ILLINOIS TOOL WORKS	9,618	215.81	2,075,660.58	
INGERSOLL-RAND INC	11,627	53.07	617,044.89	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,900	60.12	414,828.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	21,724	65.37	1,420,097.88	
KORNIT DIGITAL LTD	1,400	87.84	122,976.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	6,170	217.62	1,342,715.40	
LENNOX INTERNATIONAL	1,000	251.98	251,980.00	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	7,598	386.46	2,936,323.08	
MASCO CORP	7,490	57.56	431,124.40	
NORDSON CORP	1,600	229.51	367,216.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,640	391.25	1,815,400.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	12,678	76.35	967,965.30	

OWENS CORNING	3,400	98.07	333,438.00	
PACCAR INC	10,606	93.81	994,948.86	
PARKER HANNIFIN CORP	3,928	300.03	1,178,517.84	
PENTAIR PLC	5,234	57.81	302,577.54	
PLUG POWER INC	14,800	22.07	326,636.00	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	46,063	93.37	4,300,902.31	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,522	264.59	931,885.98	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,200	440.33	1,409,056.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,900	57.15	280,035.00	
SMITH (A.O.) CORP	4,300	71.20	306,160.00	
SNAP-ON	1,604	215.47	345,613.88	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,060	161.79	818,657.40	
SUNRUN INC	5,300	21.56	114,268.00	
TEXTRON	7,152	69.52	497,207.04	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	7,231	152.33	1,101,498.23	
TRANSDIGM GROUP INC	1,600	648.96	1,038,336.00	
UNITED RENTALS INC	2,196	311.82	684,756.72	
WABTEC CORPORATION	5,406	96.86	523,625.16	
XYLEM INC	5,454	90.66	494,459.64	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	4,400	73.03	321,332.00	
CINTAS CORP	2,799	371.57	1,040,024.43	
CLARIVATE PLC	10,300	16.00	164,800.00	
COPART INC	6,500	122.32	795,080.00	
COSTAR GROUP	12,000	64.95	779,400.00	
EQUIFAX INC	3,803	213.04	810,191.12	
IHS MARKIT LIMITED	11,502	107.11	1,231,979.22	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,100	119.65	490,565.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	4,100	93.01	381,341.00	
REPUBLIC SERVICES INC	6,802	117.54	799,507.08	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	3,540	120.38	426,145.20	
ROLLINS	6,925	31.13	215,575.25	
TRANSUNION	5,900	97.79	576,961.00	
VERISK ANALYTICS INC	4,700	189.30	889,710.00	
WASTE CONNECTIONS INC	8,163	121.00	987,723.00	
WASTE MANAGEMENT (NEW)	12,820	142.33	1,824,670.60	
AMERCO	300	587.43	176,229.00	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,000	91.98	367,920.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	8,216	72.36	594,509.76	
CSX CORP	68,815	34.66	2,385,127.90	
DELTA AIR LINES INC	4,900	42.84	209,916.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,384	106.22	571,888.48	
FEDEX CORP	7,740	222.23	1,720,060.20	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,657	188.29	500,286.53	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	4,500	53.87	242,415.00	
LYFT INC-A	7,900	41.26	325,954.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	7,569	270.22	2,045,295.18	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,950	287.96	849,482.00	

SOUTHWEST AIRLINES CO	4,310	45.98	198,173.80	
UBER TECHNOLOGIES INC	37,800	34.68	1,310,904.00	
UNION PACIFIC CORP	19,866	251.19	4,990,140.54	
UNITED PARCEL SERVICE -CL B	22,197	209.36	4,647,163.92	
APTIV PLC	8,212	141.15	1,159,123.80	
BORGWARNER INC	7,400	43.56	322,344.00	
FORD MOTOR COMPANY	119,725	18.04	2,159,839.00	
GENERAL MOTORS CO	39,899	48.60	1,939,091.40	
LEAR CORP	1,750	171.77	300,597.50	
LUCID GROUP INC	12,300	26.59	327,057.00	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	5,200	66.37	345,124.00	
TESLA INC	25,700	856.98	22,024,386.00	
DR HORTON INC	10,366	83.44	864,939.04	
GARMIN LTD	4,500	114.52	515,340.00	
HASBRO INC	4,000	97.98	391,920.00	
LENNAR CORP-CL A	8,312	89.43	743,342.16	
LULULEMON ATHLETICA INC	3,600	308.66	1,111,176.00	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,900	148.26	281,694.00	
NEWELL BRANDS INC	11,744	25.86	303,699.84	
NIKE B	39,004	142.95	5,575,621.80	
NVR INC	100	4,996.04	499,604.00	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	7,700	29.63	228,151.00	
PULTE GROUP INC	7,863	48.13	378,446.19	
VF CORP	10,498	59.17	621,166.66	
WHIRLPOOL CORP	1,974	204.54	403,761.96	
AIRBNB INC-CLASS A	7,200	174.90	1,259,280.00	
ARAMARK	7,300	37.77	275,721.00	
BOOKING HOLDINGS INC	1,243	2,616.41	3,252,197.63	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	6,500	79.28	515,320.00	
CARNIVAL CORP	24,566	22.17	544,628.22	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	901	1,523.32	1,372,511.32	
DARDEN RESTAURANTS	4,119	144.74	596,184.06	
DOMINO'S PIZZA INC	1,100	435.62	479,182.00	
DRAFTKINGS INC - CL A	9,900	17.29	171,171.00	
EXPEDIA GROUP INC	4,327	209.17	905,078.59	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	8,717	150.41	1,311,123.97	
LAS VEGAS SANDS CORP	11,000	47.12	518,320.00	
MARRIOTT INT'L A	8,444	174.92	1,477,024.48	
MCDONALD'S CORP	22,828	250.60	5,720,696.80	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	6,536	11.12	72,680.32	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	12,300	43.56	535,788.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,100	83.69	594,199.00	
STARBUCKS CORP	35,952	93.34	3,355,759.68	
VAIL RESORTS	1,200	266.00	319,200.00	
WYNN RESORTS LTD	3,000	93.15	279,450.00	
YUM! BRANDS INC	8,958	125.80	1,126,916.40	
ACTIVISION BLIZZARD INC	23,700	81.05	1,920,885.00	

ALPHABET INC-CL A	9,212	2,608.06	24,025,448.72	
ALPHABET INC-CL C	8,781	2,609.35	22,912,702.35	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	15,600	17.90	279,240.00	
CABLE ONE INC	200	1,474.87	294,974.00	
CHARTER COMMUNICATION-A	3,925	596.83	2,342,557.75	
COMCAST CORP-CL A	139,912	46.64	6,525,495.68	
DISCOVERY INC-A	5,145	29.86	153,629.70	
DISCOVERY INC-C	9,651	29.74	287,020.74	
DISH NETWORK CORP-A	7,873	28.96	228,002.08	
DISNEY (WALT) CO NEW	55,464	151.36	8,395,031.04	
ELECTRONIC ARTS	8,624	129.33	1,115,341.92	
FOX CORP	5,138	38.54	198,018.52	
FOX CORPORATION-CLASS A	9,769	42.38	414,010.22	
IAC/INTERACTIVECORP	2,500	109.55	273,875.00	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	12,239	36.11	441,950.29	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	4,400	148.28	652,432.00	
LIBERTY BROADBAND-A	800	145.68	116,544.00	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	5,900	63.03	371,877.00	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	2,473	51.10	126,370.30	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	5,362	51.16	274,319.92	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	5,000	117.44	587,200.00	
MATCH GROUP INC	7,994	107.56	859,834.64	
META PLATFORMS, INC-A	72,852	206.16	15,019,168.32	
NETFLIX INC	13,507	391.29	5,285,154.03	
NEWS CORP - CLASS A	12,156	22.15	269,255.40	
OMNICOM GROUP	6,888	84.12	579,418.56	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	17,915	28.38	508,427.70	
PINTEREST INC- CLASS A	16,700	23.86	398,462.00	
ROKU INC	3,500	112.46	393,610.00	
SEA LTD-ADR	4,200	127.69	536,298.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	30,364	6.03	183,094.92	
SNAP INC - A	32,300	38.01	1,227,723.00	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	3,600	158.50	570,600.00	
TWITTER INC	24,347	34.32	835,589.04	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	6,800	52.54	357,272.00	
ADOVANCE AUTO PARTS	1,950	218.80	426,660.00	
AMAZON COM INC	13,888	3,052.03	42,386,592.64	
AUTOZONE INC	681	1,920.01	1,307,526.81	
BATH & BODY WORKS INC	8,000	52.28	418,240.00	
BEST BUY COMPANY INC	6,986	97.71	682,602.06	
BURLINGTON STORES INC	2,100	221.06	464,226.00	
CARMAX INC	4,950	105.64	522,918.00	
CARVANA CO	2,300	126.40	290,720.00	
CHEWY INC - CLASS A	2,600	44.17	114,842.00	
DOLLAR GENERAL CORP	7,109	199.97	1,421,586.73	
DOLLAR TREE INC	6,803	142.84	971,740.52	
DOORDASH INC - A	3,300	96.21	317,493.00	
EBAY INC	19,822	55.46	1,099,328.12	

ETSY INC	4,000	127.30	509,200.00	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	900	70.69	63,621.00	
GENUINE PARTS CO	4,600	126.86	583,556.00	
HOME DEPOT	32,239	346.87	11,182,741.93	
LKQ CORP	8,465	49.17	416,224.05	
LOWE'S COMPANIES	21,106	222.69	4,700,095.14	
MERCADOLIBRE	1,400	937.26	1,312,164.00	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,128	676.96	1,440,570.88	
POOL CORP	1,200	454.83	545,796.00	
ROSS STORES INC	10,912	93.47	1,019,944.64	
TARGET CORP	14,905	204.39	3,046,432.95	
TJX COMPANIES INC	36,722	66.15	2,429,160.30	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,444	214.18	737,635.92	
ULTA BEAUTY INC	1,616	375.83	607,341.28	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,300	128.09	294,607.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	13,487	512.67	6,914,380.29	
KROGER CO	21,592	45.59	984,379.28	
SYSCO CORP	15,303	83.55	1,278,565.65	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	22,429	46.61	1,045,415.69	
WALMART INC	47,116	137.99	6,501,536.84	
ALTRIA GROUP INC	56,232	51.74	2,909,443.68	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND	17,084	76.39	1,305,046.76	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,380	66.52	623,957.60	
BUNGE LIMITED	4,275	99.30	424,507.50	
CAMPBELL SOUP CO (US)	5,510	44.95	247,674.50	
COCA-COLA CO	125,307	62.54	7,836,699.78	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	1,500	55.40	83,100.00	
CONAGRA BRANDS INC	14,527	36.02	523,262.54	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	5,116	215.85	1,104,288.60	
GENERAL MILLS	18,461	68.15	1,258,117.15	
HORMEL FOODS CORP	9,000	47.45	427,050.00	
JM SMUCKER CO	3,288	138.99	456,999.12	
KELLOGG CO	8,187	66.07	540,915.09	
KEURIG DR PEPPER INC	22,000	38.48	846,560.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,898	97.79	772,345.42	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	5,700	49.00	279,300.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	42,661	66.00	2,815,626.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	12,040	81.27	978,490.80	
PEPSICO INC	42,236	167.71	7,083,399.56	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	47,551	111.61	5,307,167.11	
THE HERSHEY COMPANY	4,400	202.59	891,396.00	
THE KRAFT HEINZ CO/THE	20,455	38.46	786,699.30	
TYSON FOODS INC-CL A	8,926	92.27	823,602.02	
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,500	98.78	740,850.00	
CLOROX CO	3,683	150.55	554,475.65	

COLGATE-PALMOLIVE CO	24,462	79.55	1,945,952.10	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	7,113	302.99	2,155,167.87	
KIMBERLY-CLARK CORP	10,257	133.15	1,365,719.55	
PROCTER & GAMBLE CO	74,139	159.90	11,854,826.10	
ABBOTT LABORATORIES	54,177	116.79	6,327,331.83	
ABIOMED INC	1,400	298.38	417,732.00	
ALIGN TECHNOLOGY	2,300	498.65	1,146,895.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,942	141.50	699,293.00	
ANTHEM INC	7,455	446.24	3,326,719.20	
BAXTER INTERNATIONAL	15,243	82.35	1,255,261.05	
BECTON DICKINSON	8,809	264.04	2,325,928.36	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	43,448	42.55	1,848,712.40	
CARDINAL HEALTH INC	9,271	54.18	502,302.78	
CENTENE CORP	17,722	82.06	1,454,267.32	
CERNER CORP	9,388	91.45	858,532.60	
CIGNA CORP	10,328	228.65	2,361,497.20	
CVS HEALTH CORPORATION	40,321	102.13	4,117,983.73	
DAVITA INC	2,100	115.49	242,529.00	
DENTSPLY SIRONA INC	6,800	55.09	374,612.00	
DEXCOM INC	3,000	381.24	1,143,720.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	19,000	105.62	2,006,780.00	
HCA HEALTHCARE INC	7,833	244.10	1,912,035.30	
HENRY SCHEIN INC	4,500	83.47	375,615.00	
HOLOGIC INC	7,916	70.05	554,515.80	
HUMANA	3,949	421.75	1,665,490.75	
IDEXX LABORATORIES	2,600	489.45	1,272,570.00	
INMODE LTD	1,500	41.58	62,370.00	
INSULET CORP	2,100	234.18	491,778.00	
INTUITIVE SURGICAL INC COM NEW	10,914	280.78	3,064,432.92	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,044	264.47	805,046.68	
MASIMO CORP	1,700	154.34	262,378.00	
MCKESSON CORP	4,758	270.81	1,288,513.98	
MEDTRONIC PLC	41,105	100.58	4,134,340.90	
MOLINA HEALTHCARE INC	1,800	314.87	566,766.00	
NOVOCURE LTD	2,700	76.00	205,200.00	
OAK STREET HEALTH INC	2,900	15.75	45,675.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,746	131.38	492,149.48	
RESMED INC	4,533	231.73	1,050,432.09	
STERIS PLC	3,100	226.03	700,693.00	
STRYKER CORP	10,367	248.14	2,572,467.38	
TELADOC HEALTH INC	4,200	65.00	273,000.00	
TELEFLEX	1,400	315.78	442,092.00	
THE COOPER COS INC	1,531	388.98	595,528.38	
UNITED HEALTH GROUP INC	28,791	467.81	13,468,717.71	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,420	134.79	326,191.80	
VEEVA SYSTEMS A	4,200	217.90	915,180.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	6,531	121.02	790,381.62	

10X GENOMICS INC-CLASS A	2,100	81.56	171,276.00	
ABBVIE INC	53,957	144.03	7,771,426.71	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,220	132.05	1,217,501.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,700	147.50	545,750.00	
AMGEN INC	17,314	220.77	3,822,411.78	
AVANTOR INC	16,300	34.00	554,200.00	
BIOGEN INC	4,501	209.79	944,264.79	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5,721	84.86	485,484.06	
BIO-RAD LABORATORIES-A	700	583.76	408,632.00	
BIO-TECHNE CORP	1,200	401.01	481,212.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	67,876	67.55	4,585,023.80	
CATALENT INC	5,200	99.04	515,008.00	
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,500	293.61	440,415.00	
DANAHER CORP	19,669	266.93	5,250,246.17	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	13,456	25.51	343,262.56	
EXACT SCIENCES CORP	5,000	74.13	370,650.00	
GILEAD SCIENCES INC	38,310	61.05	2,338,825.50	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	6,600	93.37	616,242.00	
ILLUMINA INC	4,500	311.97	1,403,865.00	
INCYTE CORP	5,908	68.53	404,875.24	
IQIVA HOLDINGS INC	5,832	228.27	1,331,270.64	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,901	137.89	262,128.89	
JOHNSON & JOHNSON	80,425	163.36	13,138,228.00	
LILLY (ELI) & CO	24,809	240.31	5,961,850.79	
MERCK & CO	77,260	76.37	5,900,346.20	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	707	1,408.46	995,781.22	
MODERNA INC	10,500	145.74	1,530,270.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,900	85.32	247,428.00	
NOVAVAX INC	2,200	81.89	180,158.00	
PERKINELMER INC	3,500	179.21	627,235.00	
PFIZER	171,288	48.53	8,312,606.64	
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,177	615.13	1,954,268.01	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	10,400	39.41	409,864.00	
SEAGEN INC/WA	3,900	120.26	469,014.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	10,200	8.15	83,130.00	
THERMO ELECTRON CORP	11,971	537.14	6,430,102.94	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,910	229.61	1,816,215.10	
VIATRIS INC	36,671	14.71	539,430.41	
WATERS CORPORATION	1,927	316.18	609,278.86	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,300	369.49	849,827.00	
ZOETIS INC	14,495	191.32	2,773,183.40	
BANK OF AMERICA CORP	231,387	45.96	10,634,546.52	
CITIGROUP INC	61,851	64.14	3,967,123.14	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	13,300	53.25	708,225.00	
FIFTH THIRD BANCORP	21,020	48.23	1,013,794.60	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	300	771.82	231,546.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5,506	168.59	928,256.54	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	46,615	15.85	738,847.75	

JPMORGAN CHASE & CO	91,290	152.14	13,888,860.60	
KEYCORP	29,091	25.64	745,893.24	
M & T BANK CORP	3,891	182.35	709,523.85	
PNC BANK CORP	12,987	201.17	2,612,594.79	
REGIONS FINANCIAL CORP	30,245	23.70	716,806.50	
SIGNATURE BANK	1,800	335.25	603,450.00	
SVB FINANCIAL GROUP	1,800	613.13	1,103,634.00	
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	40,738	62.32	2,538,792.16	
US BANCORP	42,935	57.10	2,451,588.50	
WEBSTER FINANCIAL CORP	5,500	59.70	328,350.00	
WELLS FARGO COMPANY	125,397	55.63	6,975,835.11	
ALLY FINANCIAL INC.	10,975	49.76	546,116.00	
AMERICAN EXPRESS	20,615	194.88	4,017,451.20	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,496	300.56	1,050,757.76	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	10,966	64.17	703,688.22	
BANK NEW YORK MELLO CORP	24,957	56.38	1,407,075.66	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	40,534	314.80	12,760,103.20	
BLACKROCK INC	4,690	756.02	3,545,733.80	
BLACKSTONE INC	20,900	123.86	2,588,674.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	13,599	153.96	2,093,702.04	
CARLYLE GROUP INC/THE	4,400	45.71	201,124.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,200	118.81	380,192.00	
CME GROUP INC	10,989	236.62	2,600,217.18	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	1,100	189.16	208,076.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,132	123.81	1,130,632.92	
EQUITABLE HOLDINGS INC	11,200	33.17	371,504.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,200	403.01	483,612.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	9,205	30.37	279,555.85	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	1,500	42.78	64,170.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	10,284	346.04	3,558,675.36	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	17,225	122.87	2,116,435.75	
INVESCO LTD	10,380	22.47	233,238.60	
KKR & CO INC	16,000	59.14	946,240.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,200	372.01	446,412.00	
MOODY'S CORPORATION	5,149	323.58	1,666,113.42	
MORGAN STANLEY	41,799	95.42	3,988,460.58	
MSCI INC	2,470	527.00	1,301,690.00	
NASDAQ INC	3,640	171.54	624,405.60	
NORTHERN TRUST CORP	6,005	118.52	711,712.60	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,872	108.52	637,229.44	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	5,400	11.81	63,774.00	
S&P GLOBAL INC	7,378	378.67	2,793,827.26	
SCHWAB (CHARLES) CORP	44,135	85.61	3,778,397.35	
SEI INVESTMENTS CO COM	3,600	59.07	212,652.00	
SOFI TECHNOLOGIES INC	15,600	11.39	177,684.00	
STATE STREET CORP	11,131	93.39	1,039,524.09	
SYNCHRONY FINANCIAL	17,315	43.42	751,817.30	

T ROWE PRICE GROUP INC	6,893	143.47	988,938.71	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	3,200	80.67	258,144.00	
UPSTART HOLDINGS INC	600	130.05	78,030.00	
AFLAC	19,410	63.17	1,226,129.70	
ALLEGHANY CORP	448	687.80	308,134.40	
ALLSTATE CORP	9,028	125.89	1,136,534.92	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,300	134.65	309,695.00	
AMERICAN INT'L GROUP	26,117	61.73	1,612,202.41	
AON PLC	6,934	283.80	1,967,869.20	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	12,750	47.10	600,525.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6,100	154.28	941,108.00	
ASSURANT INC	1,800	165.54	297,972.00	
BROWN & BROWN INC	7,600	66.14	502,664.00	
CHUBB LTD	13,384	204.71	2,739,838.64	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,637	125.58	582,314.46	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	800	181.81	145,448.00	
EVEREST RE GROUP LTD	1,200	304.42	365,304.00	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	8,502	47.75	405,970.50	
GLOBE LIFE INC	3,150	105.08	331,002.00	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	10,509	70.53	741,199.77	
LINCOLN NATIONAL CORP	5,515	69.65	384,119.75	
LOEWS CORP	7,005	61.60	431,508.00	
MARKEL CORP	435	1,253.00	545,055.00	
MARSH & MCLENNAN COS	15,475	152.19	2,355,140.25	
METLIFE INC	22,171	69.55	1,541,993.05	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8,186	72.48	593,321.28	
PROGRESSIVE CORP	17,889	106.41	1,903,568.49	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	11,735	114.07	1,338,611.45	
TRAVELERS COS INC/THE ST.PAUL TRAVELERS	7,634	170.63	1,302,589.42	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,028	225.61	908,757.08	
WR BERKLEY CORP	4,415	90.47	399,425.05	
CBRE GROUP INC-A	10,184	99.69	1,015,242.96	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	34,700	5.58	193,626.00	
ZILLOW GROUP INC-A	2,000	60.80	121,600.00	
ZILLOW GROUP INC-C	4,800	60.81	291,888.00	
ACCENTURE PLC-CL A	19,397	321.18	6,229,928.46	
ADOBE INC	14,528	442.56	6,429,511.68	
AFFIRM HOLDINGS INC	2,600	37.33	97,058.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES	5,172	100.33	518,906.76	
ANSYS INC	2,700	299.57	808,839.00	
ASANA INC - CL A	2,000	63.14	126,280.00	
AUTODESK INC	6,737	216.84	1,460,851.08	
AUTOMATIC DATA PROCESS	12,963	200.45	2,598,433.35	
AVALARA INC	2,500	93.40	233,500.00	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	5,300	37.46	198,538.00	
BILL.COM HOLDINGS INC	2,300	224.23	515,729.00	
BLACK KNIGHT INC	5,000	55.86	279,300.00	

BLOCK INC-A	13,000	97.72	1,270,360.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	3,500	142.38	498,330.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	8,400	134.95	1,133,580.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	4,200	66.85	280,770.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	3,203	130.79	418,920.37	
CITRIX SYSTEMS INC	3,870	101.88	394,275.60	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	7,000	95.87	671,090.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	16,055	86.36	1,386,509.80	
COUPA SOFTWARE INC	2,200	115.97	255,134.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	5,900	164.93	973,087.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,200	140.75	168,900.00	
DATADOG INC - CLASS A	5,800	159.02	922,316.00	
DOCUSIGN INC	5,900	110.28	650,652.00	
DROPBOX INC-CLASS A	9,500	23.02	218,690.00	
DYNATRACE INC	5,600	41.64	233,184.00	
EPAM SYSTEMS INC	1,700	443.23	753,491.00	
FAIR ISAAC CORP	900	498.20	448,380.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	18,796	95.64	1,797,649.44	
FISERV INC	18,202	94.13	1,713,354.26	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,381	233.51	555,987.31	
FORTINET INC	4,200	304.85	1,280,370.00	
GARTNER INC	2,500	288.23	720,575.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	8,978	136.62	1,226,574.36	
GODADDY INC-CLASS A	5,500	83.62	459,910.00	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,400	87.81	210,744.00	
HUBSPOT INC	1,400	497.59	696,626.00	
IBM CORP	27,361	124.35	3,402,340.35	
INTUIT CORP	8,326	481.20	4,006,471.20	
JACK HENRY & ASSOCIATES, INC.	2,200	172.46	379,412.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	26,914	369.95	9,956,834.30	
MICROSOFT CORP	218,132	287.93	62,806,746.76	
MONGODB INC	1,800	390.18	702,324.00	
NORTONLIFELOCK INC	18,700	27.97	523,039.00	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	9,100	55.15	501,865.00	
OKTA INC	3,800	164.67	625,746.00	
ORACLE CORP	51,159	74.57	3,814,926.63	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	47,900	11.02	527,858.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	2,940	482.17	1,417,579.80	
PAYCHEX INC	9,851	115.84	1,141,139.84	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,600	318.57	509,712.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	34,122	103.65	3,536,745.30	
PTC INC	3,600	108.86	391,896.00	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,400	146.88	352,512.00	
SALESFORCE COM INC COM	29,927	196.84	5,890,830.68	
SERVICENOW INC	6,084	556.01	3,382,764.84	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	6,400	273.77	1,752,128.00	

SPLUNK INC	5,100	114.70	584,970.00	
SS&C TECHNOLOGIES HLDGS	7,200	73.92	532,224.00	
SYNOPSYS INC	4,615	287.63	1,327,412.45	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	13,000	78.05	1,014,650.00	
TWILIO INC - A	5,000	158.33	791,650.00	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,200	411.28	493,536.00	
UNITY SOFTWARE INC	1,700	99.09	168,453.00	
VERISIGN INC	3,199	208.22	666,095.78	
VISA INC-CLASS A SHARES	51,595	222.69	11,489,690.55	
VMWARE INC	6,323	122.67	775,642.41	
WESTERN UNION CO	12,816	19.73	252,859.68	
WIX.COM LTD	1,800	86.12	155,016.00	
WORKDAY INC CLASS A	5,672	214.47	1,216,473.84	
ZENDESK INC	3,700	115.06	425,722.00	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	6,700	126.96	850,632.00	
ZSCALER INC	2,500	255.22	638,050.00	
AMPHENOL CORP-CL A	18,200	76.23	1,387,386.00	
APPLE INC	505,068	167.30	84,497,876.40	
ARISTA NETWORKS	7,200	125.92	906,624.00	
ARROW ELECTRONICS INC	2,400	123.74	296,976.00	
CDW CORP/DE	4,200	181.76	763,392.00	
CISCO SYSTEMS	128,682	57.21	7,361,897.22	
COGNEX CORP	5,700	65.72	374,604.00	
CORNING	24,428	41.70	1,018,647.60	
DELL TECHNOLOGIES INC-C	8,677	58.90	511,075.30	
F5 INC	1,900	201.69	383,211.00	
HEWLETT-PACKARD CO	36,603	36.20	1,325,028.60	
HP ENTERPRISE CO	40,476	17.33	701,449.08	
IPG PHOTONICS CORP	1,200	136.81	164,172.00	
JUNIPER NETWORKS INC	10,008	34.32	343,474.56	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	5,600	160.59	899,304.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,143	217.81	1,120,196.83	
NETAPP INC	6,848	90.90	622,483.20	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	6,178	108.64	671,177.92	
TE CONNECTIVITY LTD	9,962	143.48	1,429,347.76	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,400	419.92	587,888.00	
TRIMBLE INC	7,843	68.35	536,069.05	
WESTERN DIGITAL CORP	9,492	55.53	527,090.76	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,600	420.31	672,496.00	
AT & T INC	218,083	23.87	5,205,641.21	
LIBERTY GLOBAL PLC A	4,699	26.55	124,758.45	
LIBERTY GLOBAL PLC SERIES C	10,480	26.54	278,139.20	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	30,289	9.94	301,072.66	
T MOBILE US INC	18,990	123.98	2,354,380.20	
VERIZON COMMUNICATIONS	126,484	53.83	6,808,633.72	
AES CORPORATION	21,062	21.26	447,778.12	
ALLIANT ENERGY CORP	7,590	57.10	433,389.00	
AMEREN CORPORATION	7,877	84.67	666,945.59	

AMERICAN ELECTRIC POWER	15,285	85.71	1,310,077.35	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,500	148.26	815,430.00	
ATMOS ENERGY CORP	4,058	106.04	430,310.32	
CENTERPOINT ENERGY INC	18,256	26.61	485,792.16	
CMS ENERGY CORP	9,100	62.51	568,841.00	
CONSOLIDATED EDISON	10,559	84.61	893,396.99	
CONSTELLATION ENERGY	9,936	45.41	451,193.76	
DOMINION ENERGY INC	24,660	79.15	1,951,839.00	
DTE ENERGY	6,066	119.35	723,977.10	
DUKE ENERGY CORP	23,465	99.81	2,342,041.65	
EDISON INTERNATIONAL	11,916	59.94	714,245.04	
ENTERGY CORP	6,320	104.62	661,198.40	
ESSENTIAL UTILITIES INC	7,400	45.52	336,848.00	
EVERGY INC	7,100	60.97	432,887.00	
EVERSOURCE ENERGY	10,771	82.82	892,054.22	
EXELON CORP	29,809	41.63	1,240,948.67	
FIRSTENERGY CORP	17,116	40.98	701,413.68	
NEXTERA ENERGY INC	59,860	74.15	4,438,619.00	
NISOURCE INC	12,800	28.45	364,160.00	
NRG ENERGY INC	8,100	38.43	311,283.00	
P G & E CORP	45,200	11.41	515,732.00	
PPL CORPORATION	23,366	26.10	609,852.60	
PUBLIC SV ENTERPRISE CO	15,402	64.68	996,201.36	
SEMPRA ENERGY	9,741	135.51	1,320,002.91	
SOUTHERN CO	32,339	63.77	2,062,258.03	
UGI CORP	6,500	38.04	247,260.00	
VISTRA CORP	13,100	21.45	280,995.00	
WEC ENERGY GROUP INC	9,586	90.00	862,740.00	
XCEL ENERGY INC	16,544	66.00	1,091,904.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	49,942	113.83	5,684,897.86	
ANALOG DEVICES	16,366	160.36	2,624,451.76	
APPLIED MATERIALS	27,541	133.35	3,672,592.35	
BROADCOM INC	12,546	579.99	7,276,554.54	
ENPHASE ENERGY INC	3,800	140.35	533,330.00	
ENTEGRIS INC	4,100	130.19	533,779.00	
INTEL CORP	123,928	45.04	5,581,717.12	
KLA CORPORATION	4,648	358.30	1,665,378.40	
LAM RESEARCH CORP	4,300	569.99	2,450,957.00	
MARVELL TECHNOLOGY INC	25,400	67.34	1,710,436.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	16,420	71.78	1,178,627.60	
MICRON TECHNOLOGY	34,330	90.80	3,117,164.00	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,300	457.35	594,555.00	
NVIDIA CORP	76,400	236.42	18,062,488.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	8,091	187.09	1,513,745.19	
ON SEMICONDUCTOR CORP	13,000	60.20	782,600.00	
QORVO INC	3,325	133.20	442,890.00	
QUALCOMM	34,418	167.64	5,769,833.52	
SKYWORKS SOLUTIONS INC.	5,051	136.58	689,865.58	

	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	1,600	257.91	412,656.00	
	TERADYNE INC	5,000	114.83	574,150.00	
	TEXAS INSTRUMENTS	28,186	166.74	4,699,733.64	
アメリカ・ドル 小計		9,636,886		1,164,155,924.27 (133,947,780,647)	
カナダ・ドル	CAMECO CORP	12,122	25.83	313,111.26	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	36,090	66.19	2,388,797.10	
	CENOVUS ENERGY INC	39,748	19.60	779,060.80	
	ENBRIDGE INC	61,771	52.55	3,246,066.05	
	IMPERIAL OIL LTD	7,385	55.40	409,129.00	
	KEYERA CORP	6,842	30.03	205,465.26	
	PARKLAND CORPORATION	5,300	33.67	178,451.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	17,149	42.23	724,202.27	
	SUNCOR ENERGY INC	45,230	37.06	1,676,223.80	
	TC ENERGY CORP	29,707	66.81	1,984,724.67	
	TOURMALINE OIL CORP	9,400	46.13	433,622.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	14,131	70.09	990,441.79	
	BARRICK GOLD CORP	54,180	29.53	1,599,935.40	
	CCL INDUSTRIES INC	4,700	62.89	295,583.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	18,528	33.95	629,025.60	
	FRANCO NEV CORP	5,862	188.61	1,105,631.82	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	17,900	11.12	199,048.00	
	KINROSS GOLD CORP	40,963	7.42	303,945.46	
	LUNDIN MINING CORP	20,600	11.66	240,196.00	
	NEWMONT CORPORATION	2,388	86.17	205,773.96	
	NUTRIEN LTD	17,353	96.69	1,677,861.57	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	6,800	30.50	207,400.00	
	TECK RESOURCES LTD	14,708	45.30	666,272.40	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,800	123.19	344,932.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	13,647	55.49	757,272.03	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	7,000	12.26	85,820.00	
	CAE Inc.	9,550	32.44	309,802.00	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	2,500	107.93	269,825.00	
	WSP GLOBAL INC	3,500	149.99	524,965.00	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	4,700	36.28	170,516.00	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,500	65.43	229,005.00	
	THOMSON REUTERS CORPORATION	5,262	127.80	672,483.60	
	AIR CANADA	4,800	25.40	121,920.00	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	21,625	159.13	3,441,186.25	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	20,365	92.33	1,880,300.45	
	TFI INTERNATIONAL INC	2,500	130.44	326,100.00	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	8,938	98.78	882,895.64	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,015	48.46	291,486.90	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	8,533	72.78	621,031.74	
	QUEBECOR INC -CL B	5,900	30.10	177,590.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	13,656	37.30	509,368.80	
	CANADIAN TIRE CORP.	1,831	192.39	352,266.09	
	DOLLARAMA INC	8,785	64.29	564,787.65	

ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	24,900	49.66	1,236,534.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	5,266	39.43	207,638.38	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,072	98.17	497,918.24	
METRO INC	7,418	66.93	496,486.74	
WESTON (GEORGE)	2,290	137.93	315,859.70	
SAPUTO INC	8,307	30.97	257,267.79	
BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	9,891	30.54	302,071.14	
CANOPY GROWTH CORP	7,300	9.80	71,540.00	
BANK OF MONTREAL	19,694	146.48	2,884,777.12	
BANK OF NOVA SCOTIA	37,122	91.87	3,410,398.14	
CANADIAN IMPERIAL BANK	13,714	160.61	2,202,605.54	
NATIONAL BANK OF CANADA	10,246	101.64	1,041,403.44	
ROYAL BANK OF CANADA	43,542	141.05	6,141,599.10	
TRONTO-DOMINION BANK	55,648	106.23	5,911,487.04	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	43,045	67.91	2,923,185.95	
IGM FINANCIAL INC	2,833	44.71	126,663.43	
ONEX CORPORATION	2,309	87.37	201,737.33	
TMX GROUP LTD	1,800	124.83	224,694.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	757	645.67	488,772.19	
GREAT-WEST LIFECO INC	8,646	39.03	337,453.38	
IA FINANCIAL CORP INC	3,293	79.17	260,706.81	
INTACT FINANCIAL CORP	5,000	183.61	918,050.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	59,120	26.90	1,590,328.00	
POWER CORP OF CANADA	17,433	40.29	702,375.57	
SUN LIFE FINANCIAL INC	17,791	67.68	1,204,094.88	
FIRSTSERVICE CORP	1,300	175.97	228,761.00	
BLACKBERRY LTD	15,900	8.49	134,991.00	
CGI INC	6,884	105.52	726,399.68	
CONSTELLATION SOFTWARE	655	2,058.83	1,348,533.65	
LIGHTSPEED COMMERCE INC-SUB VOTE	2,900	33.93	98,397.00	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	1,500	67.65	101,475.00	
OPEN TEXT CORP	8,584	54.51	467,913.84	
SHOPIFY INC - CLASS A	3,500	837.00	2,929,500.00	
BCE INC	2,115	66.72	141,112.80	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	10,704	66.33	709,996.32	
TELUS CORP	13,164	32.13	422,959.32	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	20,000	17.75	355,000.00	
ALTAGAS LTD	8,313	27.62	229,605.06	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	4,050	44.36	179,658.00	
CANADIAN UTILITIES LTD A	3,800	34.98	132,924.00	
EMERA	8,200	58.80	482,160.00	
FORTIS INC	14,730	57.76	850,804.80	
HYDRO ONE	9,800	31.27	306,446.00	
NORTHLAND POWER INC	6,500	36.93	240,045.00	
カナダ・ドル 小計	1,199,300		77,035,852.74 (6,957,107,860)	

オーストラリア・ドル	AMPOL LIMITED	7,690	31.25	240,312.50	
	SANTOS	94,054	7.00	658,378.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	6,459	25.57	165,156.63	
	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	30,288	27.44	831,102.72	
	AMCOR PLC-CDI	26,650	16.52	440,258.00	
	BHP GROUP LIMITED	90,026	47.96	4,317,646.96	
	BLUESCOPE STEEL LTD	15,345	19.08	292,782.60	
	EVOLUTION MINING LTD	52,484	4.14	217,283.76	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	51,469	19.85	1,021,659.65	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	13,928	46.17	643,055.76	
	NEWCREST MINING	25,883	24.36	630,509.88	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	33,945	9.58	325,193.10	
	ORICA	13,202	14.85	196,049.70	
	RIO TINTO LTD	11,292	119.25	1,346,571.00	
	SOUTH32 LTD	151,335	4.57	691,600.95	
	REECE LTD	8,674	20.28	175,908.72	
	BRAMBLES LTD	46,352	10.13	469,545.76	
	AURIZON HOLDINGS LTD	57,849	3.71	214,619.79	
	QANTAS AIRWAYS LTD	26,005	5.31	138,086.55	
	TRANSURBAN GROUP	92,834	12.91	1,198,486.94	
	ARISTOCRAT LEISURE LIMITED	18,927	39.84	754,051.68	
	CROWN RESORTS LTD	13,347	12.31	164,301.57	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,813	101.40	183,838.20	
	IDP EDUCATION LTD	6,244	27.49	171,647.56	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	69,014	5.25	362,323.50	
	REA GROUP LTD	1,584	133.67	211,733.28	
	SEEK LTD	10,386	27.20	282,499.20	
	WESFARMERS LIMITED	34,563	50.41	1,742,320.83	
	COLES GROUP LTD	41,949	16.55	694,255.95	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	39,995	6.51	260,367.45	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	38,614	34.01	1,313,262.14	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	23,596	11.95	281,972.20	
	COCHLEAR LIMITED	1,988	191.08	379,867.04	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,676	64.26	364,739.76	
	SONIC HEALTHCARE LIMITED	14,220	37.60	534,672.00	
	CSL LIMITED	14,596	265.57	3,876,259.72	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	89,126	28.15	2,508,896.90	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	54,160	97.75	5,294,140.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	102,919	30.58	3,147,263.02	
	WESTPAC BANKING	111,870	23.53	2,632,301.10	
	AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	5,948	81.91	487,200.68	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	10,672	191.11	2,039,525.92	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,485	21.70	97,324.50	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	79,212	4.76	377,049.12	
	MEDIBANK PRIVATE LTD.	90,832	3.24	294,295.68	
	QBE INSURANCE GROUP	45,272	11.55	522,891.60	
	SUNCORP GROUP LTD	39,755	11.42	454,002.10	

	LENLEASE GROUP	22,675	10.31	233,779.25	
	BLOCK INC - CDI	2,469	143.60	354,548.40	
	COMPUTERSHARE LIMITED	17,526	22.80	399,592.80	
	WISETECH GLOBAL LTD	4,327	45.39	196,402.53	
	XERO LTD	3,801	103.00	391,503.00	
	TELSTRA CORP	125,976	3.91	492,566.16	
	APA GROUP	37,312	9.90	369,388.80	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	54,587	5.65	308,416.55	
オーストラリア・ドル 小計		2,095,200		46,393,409.16 (3,837,662,805)	
イギリス・ポンド	BP PLC	614,047	3.91	2,403,379.95	
	SHELL PLC-NEW	237,510	19.57	4,648,070.70	
	ANGLO AMERICAN PLC	39,390	35.26	1,388,891.40	
	ANTOFAGASTA PLC	12,248	14.04	171,961.92	
	BHP GROUP LTD	64,410	25.55	1,645,675.50	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	4,297	70.60	303,368.20	
	GLENORE PLC	304,409	4.22	1,284,605.98	
	JOHNSON MATTHEY PLC	5,926	17.94	106,312.44	
	MONDI PLC	15,220	19.24	292,832.80	
	RIO TINTO PLC REG	34,262	56.57	1,938,201.34	
	ASHTREAD GROUP PLC	13,630	47.78	651,241.40	
	BAE SYSTEMS PLC	97,798	5.97	584,245.25	
	BUNZL PLC	10,544	27.36	288,483.84	
	DCC (GB)	3,108	61.84	192,198.72	
	FERGUSON PLC	6,771	111.75	756,659.25	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	137,016	1.54	211,621.21	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	253,553	1.17	296,809.14	
	SMITHS GROUP PLC	12,135	15.15	183,784.57	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,332	116.90	272,610.80	
	EXPERIAN PLC	28,095	28.28	794,526.60	
	INTERTEK GROUP PLC	5,059	51.60	261,044.40	
	RELX PLC	48,945	22.33	1,092,941.85	
	RENTOKIL INITIAL PLC	58,121	4.91	285,315.98	
	BARRATT DEVELOPMENTS	31,827	6.03	191,916.81	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,655	39.49	144,335.95	
	BURBERRY GROUP PLC	12,728	20.33	258,760.24	
	PERSIMMON PLC	10,113	24.14	244,127.82	
	TAYLOR WIMPEY PLC	117,244	1.48	174,048.71	
	COMPASS GROUP PLC	54,344	17.48	949,933.12	
	ENTAIN PLC	18,250	16.50	301,125.00	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	5,440	49.74	270,585.60	
	WHITBREAD PLC	6,304	31.11	196,117.44	
	AUTO TRADER GROUP PLC	29,463	6.33	186,500.79	
	INFORMA PLC	47,051	6.01	282,776.51	
	PEARSON	23,445	6.21	145,593.45	
	WPP PLC	36,194	11.84	428,536.96	

	JD SPORTS FASHION PLC	78,700	1.66	130,405.90	
	KINGFISHER PLC	65,693	3.23	212,188.39	
	NEXT PLC	4,175	68.50	285,987.50	
	OCADO GROUP PLC	15,282	13.00	198,666.00	
	SAINSBURY (J) PLC	50,437	2.78	140,164.42	
	TESCO PLC	235,323	2.94	692,320.26	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	11,344	19.08	216,386.80	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO	66,510	34.09	2,267,325.90	
	COCA COLA HBC AG CDI	6,210	24.25	150,592.50	
	DIAGEO	71,252	36.59	2,606,754.42	
	IMPERIAL BRANDS PLC	29,788	17.79	529,928.52	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	21,782	62.73	1,366,384.86	
	UNILEVER PLC	39,665	38.58	1,530,077.37	
	SMITH&NEOHEW PLC	27,959	11.96	334,389.64	
	ASTRAZENECA PLC	47,306	88.01	4,163,401.06	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	153,586	15.67	2,406,692.62	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,911	19.69	116,358.03	
	BARCLAYS PLC	515,825	1.91	986,051.07	
	HSBC HOLDINGS PLC	623,549	5.44	3,394,600.75	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,163,341	0.51	1,108,063.26	
	NATWEST GROUP PLC	179,044	2.35	419,858.18	
	STANDARD CHARTERED PLC	79,794	5.79	462,166.84	
	3I GROUP PLC	30,582	13.13	401,541.66	
	ABRDN PLC	64,987	2.33	151,679.65	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,488	12.78	133,984.20	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	10,000	66.20	662,000.00	
	M&G PLC	81,141	2.13	173,154.89	
	SCHRODERS PLC	3,844	32.28	124,084.32	
	ST JAMES'S PLACE PLC	16,327	15.17	247,598.95	
	ADMIRAL GROUP PLC	6,324	29.63	187,380.12	
	AVIVA PLC	118,517	4.32	512,230.47	
	LEGAL & GENERAL GROUP	181,507	2.72	494,425.06	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	18,827	6.47	121,810.69	
	PRUDENTIAL PLC	79,725	11.60	924,411.37	
	AVEVA GROUP PLC	3,552	25.19	89,474.88	
	SAGE GROUP PLC/THE	32,913	6.69	220,056.31	
	HALMA PLC	11,903	22.86	272,102.58	
	BT GROUP PLC	271,169	1.97	535,152.02	
	VODAFONE GROUP PLC	848,624	1.38	1,167,536.89	
	NATIONAL GRID PLC	112,975	10.90	1,230,975.60	
	SEVERN TRENT PLC	7,949	28.51	226,625.99	
	SSE PLC	31,711	16.12	511,181.32	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	21,451	10.62	227,702.36	
イギリス・ポンド 小計		8,861,876		56,163,015.26 (8,792,881,670)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	7,136	16.56	118,172.16	
	EMS CHEMIE HOLDING AG RE	212	921.00	195,252.00	
	GIVAUDAN-REG	281	3,650.00	1,025,650.00	

	HOLCIM LTD	15,927	50.06	797,305.62	
	SIKA AG-BEARER	4,324	293.40	1,268,661.60	
	ABB LTD	50,091	31.69	1,587,383.79	
	GEBERIT AG-REG	1,092	600.80	656,073.60	
	SCHINDLER HLDG AG	622	206.40	128,380.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,275	209.30	266,857.50	
	VAT GROUP AG	818	338.80	277,138.40	
	ADECCO GROUP AG-REG	4,626	47.12	217,977.12	
	SGS S.A.	182	2,587.00	470,834.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,708	248.70	424,779.60	
	CIE FINANCIERE RICHEMON REG	15,928	129.35	2,060,286.80	
	THE SWATCH GROUP	1,897	55.20	104,714.40	
	THE SWATCH GROUP AG-B	904	286.20	258,724.80	
	BARRY CALLEBAUT AG REG	99	2,098.00	207,702.00	
	LINDT SPRUENGLI PTG CERT CHF10	32	10,010.00	320,320.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	3	103,600.00	310,800.00	
	NESTLE SA-REG	85,993	118.20	10,164,372.60	
	ALCON INC	15,208	70.44	1,071,251.52	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,719	324.30	557,471.70	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	315	1,433.00	451,395.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	185	500.00	92,500.00	
	LOMZA AG-REG	2,271	599.60	1,361,691.60	
	NOVARTIS AG-REG SHS	66,908	79.83	5,341,265.64	
	ROCHE HOLDING AG GENUSS	21,460	342.55	7,351,123.00	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,002	372.00	372,744.00	
	VIFOR PHARMA AG	1,479	162.10	239,745.90	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	77,335	8.29	640,797.81	
	JULIUS BAER GROUP LTD	6,704	58.30	390,843.20	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	691	1,232.00	851,312.00	
	UBS GROUP AG	107,276	18.65	2,000,697.40	
	BALOISE HOLDING AG REG	1,503	157.60	236,872.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG	956	586.60	560,789.60	
	SWISS RE LTD	9,016	97.80	881,764.80	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,589	433.80	1,990,708.20	
	SWISS PRIME SITE REG	2,361	89.80	212,017.80	
	TEMENOS GROUP AG-REG	2,144	97.74	209,554.56	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	5,383	68.24	367,335.92	
	SWISSCOM	782	549.00	429,318.00	
スイス・フラン 小計		522,437		46,472,587.24 (5,807,679,227)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED	81,623	59.75	4,876,974.25	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	42,000	133.00	5,586,000.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	56,000	21.65	1,212,400.00	
	MTR CORP	48,246	42.80	2,064,928.80	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	40,000	32.80	1,312,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	68,000	48.65	3,308,200.00	
	SANDS CHINA LTD	76,944	24.05	1,850,503.20	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	58,400	16.22	947,248.00	

	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	53,700	23.10	1,240,470.00	
	WH GROUP LIMITED	249,500	5.73	1,429,635.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	111,989	31.35	3,510,855.15	
	HANG SENG BANK	24,300	166.00	4,033,800.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	36,741	434.20	15,952,942.20	
	AIA GROUP LTD	369,284	88.00	32,496,992.00	
	CK ASSET HOLDINGS LIMITED	61,633	53.05	3,269,630.65	
	ESR CAYMAN LTD	57,800	25.70	1,485,460.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	65,000	16.32	1,060,800.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	48,308	34.60	1,671,456.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT COMPANY LIMITED	48,293	32.95	1,591,254.35	
	SINO LAND	104,997	10.40	1,091,968.80	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	41,108	98.60	4,053,248.80	
	SWIRE PACIFIC A	17,500	48.20	843,500.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	35,677	21.15	754,568.55	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	52,125	37.00	1,928,625.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	126,000	10.82	1,363,320.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	20,000	50.90	1,018,000.00	
	CLP HOLDINGS	51,817	79.85	4,137,587.45	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS AND HK ELECTRIC	92,161	7.91	728,993.51	
	HONGKONG CHINA GAS	352,197	12.12	4,268,627.64	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	43,000	50.05	2,152,150.00	
香港・ドル 小計		2,534,343		111,242,140.15 (1,640,821,567)	
シンガポール・ドル	KEPPEL CORP LTD	48,200	6.05	291,610.00	
	SINGAPORE TECH ENGR.	47,700	3.86	184,122.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	46,000	5.42	249,320.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	190,500	0.79	150,495.00	
	WILMAR INTERL LTD SGD0.5	59,800	4.71	281,658.00	
	DBS GROUP HOLDING	55,201	36.45	2,012,076.45	
	OVERSEA-CHINESE BANKING	103,024	13.27	1,367,128.48	
	UNITED OVERSEAS BANK	35,843	32.57	1,167,406.51	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	26,600	9.62	255,892.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	86,375	3.75	323,906.25	
	CITY DEVELOPMENTS	15,700	7.34	115,238.00	
	UOL GROUP LIMITED	16,200	7.30	118,260.00	
	VENTURE CORP LTD	8,400	18.06	151,704.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	260,374	2.55	663,953.70	
シンガポール・ドル 小計		999,917		7,332,770.39 (627,318,506)	

ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	34,695	7.12	247,028.40	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	18,298	28.81	527,165.38	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	13,260	9.40	124,644.00	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	59,287	4.54	268,866.54	
	MERCURY NZ LTD	23,232	5.92	137,533.44	
	MERIDIAN ENERGY LTD	39,492	5.06	199,632.06	
ニュージーランド・ドル 小計		188,264		1,504,869.82 (115,995,365)	
スウェーデン・クローナ	LUNDIN ENERGY AB	5,953	322.30	1,918,651.90	
	BOLIDEN AB	8,595	403.50	3,468,082.50	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	18,203	163.65	2,978,920.95	
	ALFA LAVAL AB	9,881	293.90	2,904,025.90	
	ASSA ABLOY AB-B	30,506	268.70	8,196,962.20	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	20,463	494.00	10,108,722.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	11,858	435.30	5,161,787.40	
	EPIROC AB-A	20,697	190.10	3,934,499.70	
	EPIROC AB-B	12,143	163.60	1,986,594.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	12,545	115.15	1,444,556.75	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	4,596	259.80	1,194,040.80	
	LIFCO AB-B SHS	7,001	202.70	1,419,102.70	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	40,448	77.20	3,122,585.60	
	SANDVIK AB	34,360	237.20	8,150,192.00	
	SKANSKA AB-B	10,601	235.00	2,491,235.00	
	SKF AB-B SHARES	12,333	186.20	2,296,404.60	
	VOLVO AB-A SHS	6,004	208.80	1,253,635.20	
	VOLVO AB-B SHS	43,526	205.45	8,942,416.70	
	SECURITAS B	9,662	114.85	1,109,680.70	
	ELECTROLUX AB-SER B	6,943	179.35	1,245,227.05	
	EVOLUTION AB	5,040	991.90	4,999,176.00	
	EMBRACER GROUP AB	15,636	81.41	1,272,926.76	
	HENNES & MAURITZ B	22,734	173.90	3,953,442.60	
	SWEDISH MATCH AB	47,585	70.90	3,373,776.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	19,157	263.80	5,053,616.60	
	GETINGE AB-B SHS	6,907	351.00	2,424,357.00	
	NORDEA BANK ABP	98,711	109.32	10,791,086.52	
	SKAND. ENSKILDA BANKEN A	49,492	118.45	5,862,327.40	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	45,341	95.26	4,319,183.66	
	SWEDBANK AB	27,501	166.20	4,570,666.20	
	EQT AB	9,303	321.80	2,993,705.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,449	280.60	1,248,389.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,002	276.10	1,381,052.20	
	INVESTOR AB-A SHS	15,095	209.10	3,156,364.50	
	INVESTOR AB-B SHS	55,525	194.26	10,786,286.50	
	KINNEVIK AB - B	7,577	237.95	1,802,947.15	
	LUNDBERGFÖRETAGEN B	2,461	462.00	1,136,982.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	3,145	588.40	1,850,518.00	
	SAGAX AB-B	4,835	254.00	1,228,090.00	

	SINCH AB	13,860	67.08	929,728.80	
	"ERICSSON (LM) TEL,SEK1 SER B"	88,854	94.13	8,363,827.02	
	HEXAGON AB-B SHS	59,964	122.15	7,324,602.60	
	TELE2 AB-B SHS	15,684	130.70	2,049,898.80	
	TELIA COMPANY AB	82,425	37.21	3,066,622.12	
スウェーデン・クロネ 小計		1,032,601		167,266,898.18 (2,047,346,833)	
ノルウェー・クロネ	AKER BP ASA	3,741	256.80	960,688.80	
	EQUINOR ASA	29,725	268.30	7,975,217.50	
	NORSK HYDRO	43,394	77.20	3,350,016.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,989	448.30	2,236,568.70	
	ADEVINTA ASA	7,366	80.10	590,016.60	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,292	204.20	672,226.40	
	SCHIBSTED ASA-CL A	2,120	230.50	488,660.00	
	MOWI ASA	13,758	228.60	3,145,078.80	
	ORKLA ASA	23,588	83.96	1,980,448.48	
	DNB BANK ASA	28,198	209.00	5,893,382.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6,150	213.70	1,314,255.00	
	TELENOR ASA	21,917	136.50	2,991,670.50	
ノルウェー・クロネ 小計		188,238		31,598,229.58 (405,405,285)	
デンマーク・クロネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,291	460.20	1,514,518.20	
	NOVOZYMES A/S B SHARES	6,349	390.60	2,479,919.40	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	285	2,700.00	769,500.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	31,110	164.35	5,112,928.50	
	A P MOLLER MAERSK A/S	179	22,940.00	4,106,260.00	
	A.P. MOLLER-MAERSK A DKK1000	95	21,940.00	2,084,300.00	
	DSV A/S	6,303	1,212.50	7,642,387.50	
	PANDORA A/S	3,028	695.60	2,106,276.80	
	CARLSBERG B	3,046	1,058.00	3,222,668.00	
	AMBU A/S-B	5,261	106.05	557,929.05	
	COLOPLAST B	3,609	909.40	3,282,024.60	
	DEMANT A/S	3,324	267.90	890,499.60	
	GN STORE NORD A/S	3,712	332.90	1,235,724.80	
	GENMAB A/S	1,998	2,099.00	4,193,802.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	51,425	661.80	34,033,065.00	
	DANSKE BANK A/S	22,094	125.40	2,770,587.60	
	TRYG A/S	8,872	151.80	1,346,769.60	
	ORSTED A/S	5,753	671.80	3,864,865.40	
デンマーク・クロネ 小計		159,734		81,214,026.05 (1,423,681,876)	

イスラエル・ シェケル	ICL GROUP LIMITED	22,497	33.68	757,698.96	
	ELBIT SYSTEMS LTD	786	563.00	442,518.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	22,893	26.28	601,628.04	
	BANK HAPOLIM BM	34,354	33.80	1,161,165.20	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	46,155	34.53	1,593,732.15	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	35,010	21.38	748,513.80	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,155	124.50	517,297.50	
	AZRIELI GROUP	1,403	282.50	396,347.50	
	NICE LTD	1,954	738.60	1,443,224.40	
イスラエル・シェケル 小計		169,207		7,662,125.55 (275,064,177)	
ユーロ	ENI SPA	76,863	13.47	1,035,344.61	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	16,564	10.00	165,640.00	
	NESTE OYJ	12,823	35.27	452,267.21	
	OMV AG	4,579	54.16	247,998.64	
	REPSOL SA	44,863	11.73	526,422.44	
	TENARIS SA	14,277	11.31	161,401.48	
	TOTAL SE	76,576	50.66	3,879,340.16	
	AIR LIQUIDE	14,456	150.74	2,179,097.44	
	AKZO NOBEL	5,695	91.36	520,295.20	
	ARKEMA	1,875	126.50	237,187.50	
	BASF SE	28,013	67.26	1,884,154.38	
	COVESTRO	5,886	52.80	310,780.80	
	CRH	23,733	43.28	1,027,164.24	
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,767	29.00	196,243.00	
	FUCHS PETROLUB (PFD)	2,442	37.66	91,965.72	
	HEIDELBERGCEMENT AG	4,703	65.70	308,987.10	
	KONINKLIJKE DSM N.V	5,325	160.80	856,260.00	
	LANXESS AG	2,652	51.06	135,411.12	
	LINDE PLC	2,741	265.35	727,324.35	
	NLG) ARCELORMITTAL	20,388	26.94	549,252.72	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	7,686	48.77	374,846.22	
	SOLVAY	2,314	108.30	250,606.20	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	18,288	18.29	334,396.08	
	SYMRISE AG	3,907	103.30	403,593.10	
	UMICORE	6,243	36.77	229,555.11	
	UPM-KYMMENE	16,215	33.05	535,905.75	
	VOESTALPINE AG	3,551	30.72	109,086.72	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,900	22.32	176,328.00	
	AIRBUS SE	17,983	115.00	2,068,045.00	
	ALSTOM	8,430	25.64	216,145.20	
	BOUYGUES SA	6,885	32.70	225,139.50	
	BRENNTAG SE	4,842	78.50	380,097.00	
	CIE DE SAINT-GOBAIN	15,406	61.85	952,861.10	
	CNH INDUSTRIAL NV	32,157	13.89	446,499.94	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	13,058	31.28	408,388.95	
	DASSAULT AVIATION SA	900	115.00	103,500.00	
	EIFFAGE EUR4 (POST SUBDIV ISIO	2,587	96.78	250,369.86	

FERROVIAL SA	14,656	24.59	360,391.04	
GEA GROUP AG NPV	4,733	41.18	194,904.94	
IMCD NV	1,726	139.65	241,035.90	
KINGSPAN GROUP PLC	4,834	88.38	427,228.92	
KION GROUP AG	2,235	79.60	177,906.00	
KNORR-BREMSE AG	2,182	91.78	200,263.96	
KONE OYJ	10,334	52.50	542,535.00	
LEGRAND PROMESSES EUR4	8,140	86.02	700,202.80	
MTU AERO ENGINES AG	1,680	208.00	349,440.00	
PRYSMIAN SPA EURO.10	7,952	28.84	229,335.68	
RATIONAL AG	151	663.60	100,203.60	
SAFRAN SA	10,414	113.44	1,181,364.16	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	16,499	144.84	2,389,715.16	
SIEMENS AG	23,355	136.34	3,184,220.70	
SIEMENS ENERGY AG	12,340	18.42	227,302.80	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	7,436	16.28	121,058.08	
THALES SA	3,332	84.44	281,354.08	
VINCI SA	16,501	100.98	1,666,270.98	
WARTSILA OYJ	13,590	10.17	138,210.30	
BUREAU VERITAS	9,218	24.47	225,564.46	
RANDSTAD NV	3,926	65.68	257,859.68	
RELX PLC	10,035	26.85	269,439.75	
TELEPERFORMANCE	1,786	330.40	590,094.40	
WOLTERS KLUWER CVA	8,144	87.02	708,690.88	
ADP	906	132.65	120,180.90	
AENA SME SA	2,135	149.55	319,289.25	
ATLANTIA SPA	16,144	16.54	267,021.76	
DEUTSCHE POST AG-REG	30,233	49.15	1,485,951.95	
GETLINK SE	13,683	14.33	196,008.97	
INPOST SA	5,869	5.67	33,294.83	
LUFTHANSA	18,612	7.53	140,222.80	
BAYER MOTOREN WERKEUR1	10,082	95.38	961,621.16	
BAYER MOTOREN WERKNON-VTG PRF EUR1	1,799	80.10	144,099.90	
CONTINENTAL	3,491	87.51	305,497.41	
FAURECIA	3,868	39.64	153,327.52	
FERRARI NV	3,839	194.50	746,685.50	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	26,116	75.59	1,974,108.44	
MICHELIN B	5,153	135.45	697,973.85	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE (PREF)	4,638	84.22	390,612.36	
RENAULT SA	5,976	36.33	217,078.20	
STELLANTIS NV	36,689	16.69	612,412.78	
STELLANTIS NV	25,313	16.71	422,878.97	
VALEO SA	7,345	26.08	191,557.60	
VOLKSWAGEN STAMM	1,010	242.20	244,622.00	
VOLKSWAGEN VORZUG	5,652	180.10	1,017,925.20	

ADIDAS AG	5,806	229.40	1,331,896.40	
ESSILORLUXOTTICA	8,757	166.98	1,462,243.86	
HERMES INTERNATIONAL	966	1,203.00	1,162,098.00	
KERING	2,288	666.60	1,525,180.80	
LVMH	8,479	686.30	5,819,137.70	
MONCLER SPA	5,995	55.08	330,204.60	
PUMA SE	3,065	90.30	276,769.50	
SEB	804	135.10	108,620.40	
ACCOR SA	5,692	32.89	187,209.88	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	2,671	36.61	97,785.31	
PADDY POWER BETFAIR PLC	5,142	126.35	649,691.70	
SODEXO	2,760	79.98	220,744.80	
BOLLORE	26,053	4.79	124,689.65	
PUBLICIS GROUPE	7,232	62.58	452,578.56	
SCOUT24 SE	2,622	51.04	133,826.88	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,988	45.64	136,372.32	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	22,234	19.76	439,432.77	
VIVENDI SE	22,234	11.45	254,579.30	
DELIVERY HERO SE	4,892	47.07	230,266.44	
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA	33,229	25.35	842,355.15	
JUST EAT TAKEAWAY	5,663	36.00	203,839.68	
PROSUS NV	28,471	64.55	1,837,803.05	
ZALANDO SE	6,284	59.48	373,772.32	
CARREFOUR	19,162	18.18	348,365.16	
COLRUYT NV	1,986	35.92	71,337.12	
HELLOFRESH SE	4,629	47.87	221,590.23	
JERONIMO MARTINS	8,284	19.99	165,597.16	
KESKO OYJ-B SHS	8,375	26.17	219,173.75	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	31,853	27.09	862,738.50	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	23,223	55.82	1,296,307.86	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	4,700	49.04	230,488.00	
DANONE	19,539	55.88	1,091,839.32	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	15,854	10.57	167,576.78	
HEINEKEN HOLDING EUR1.6	3,603	78.70	283,556.10	
HEINEKEN NV	7,887	98.30	775,292.10	
JDE PEET'S BV	2,655	27.13	72,016.87	
KERRY GROUP A	5,008	109.75	549,628.00	
PERNOD RICARD	6,387	197.10	1,258,877.70	
REMY COINTREAU	680	177.00	120,360.00	
BEIERSDORF	3,202	91.12	291,766.24	
HENKEL AG & CO KGAA (PREF)	5,380	73.74	396,721.20	
HENKEL KGAA	3,245	71.50	232,017.50	
L'OREAL	7,661	360.75	2,763,705.75	
UNILEVER PLC	39,570	46.28	1,831,299.60	
AMPLIFON SPA	3,732	35.54	132,635.28	
BIOMERIEUX	1,392	99.88	139,032.96	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,212	132.20	160,226.40	

DIASORIN SPA	813	117.30	95,364.90	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO KGAA	6,332	59.36	375,867.52	
FRESENIUS SE & CO KGaA	12,707	37.08	471,112.02	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	28,447	30.02	853,978.94	
ORPEA	1,671	36.71	61,342.41	
SARTORIUS AG-VORZUG	810	399.10	323,271.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	8,684	52.98	460,078.32	
ARGENX SE	1,414	247.90	350,530.60	
BAYER AG	29,952	54.00	1,617,408.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	4,184	85.50	357,732.00	
GRIFOLS SA	9,432	14.60	137,707.20	
IPSEN	1,163	98.86	114,974.18	
MERCK KGAA	3,935	177.30	697,675.50	
ORION OYJ	3,271	44.94	146,998.74	
QIAGEN N.V.	7,232	43.14	311,988.48	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,263	46.20	150,750.60	
SANOFI	34,711	93.03	3,229,164.33	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	873	331.00	288,963.00	
UCB SA	3,817	87.12	332,537.04	
ABN AMRO BANK NV-CVA	13,015	12.67	164,874.02	
BANCA INTESA SPA	503,245	2.72	1,369,832.89	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT	203,111	5.71	1,160,170.03	
BANCO ESPIRITO SANTO SA-REG	141,192	—	—	
BANCO SANTANDER SA	528,779	3.32	1,756,603.83	
BNP PARIBAS	34,316	61.92	2,124,846.72	
CAIXABANK	116,252	3.24	376,191.47	
COMMERZBANK AG	31,163	9.21	287,011.23	
CREDIT AGRICOLE SA	36,061	13.06	470,812.41	
ERSTE GROUP BANK AG	10,810	40.26	435,210.60	
FINECOBANK SPA	19,256	15.99	307,807.16	
ING GROUP N.V.	119,044	12.61	1,501,144.84	
KBC BANCASSURANCE HOLDING NV	7,863	74.42	585,164.46	
MEDIOBANCA	18,507	10.21	188,863.93	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	4,445	24.88	110,591.60	
SOCIETE GENERALE-A	24,661	32.37	798,276.57	
UNICREDIT SPA	64,837	14.63	948,694.98	
AMUNDI SA	1,867	66.60	124,342.20	
DEUTSCHE BANK AG-REG	62,825	13.56	852,158.30	
DEUTSCHE BOERSE AG	5,784	156.35	904,328.40	
EURAZEO	1,267	69.95	88,626.65	
EURONEXT NV	2,584	80.80	208,787.20	
EXOR NV	3,383	72.22	244,320.26	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	3,576	93.50	334,356.00	
SOFINA	490	341.80	167,482.00	
WENDEL	971	91.35	88,700.85	
AEGON NV	53,451	4.76	254,319.85	
AGEAS	5,607	42.75	239,699.25	

ALLIANZ	12,583	214.10	2,694,020.30	
ASSICURAZIONI GENERALI	33,568	18.54	622,350.72	
AXA SA	59,018	26.92	1,588,764.56	
CNP ASSURANCES	5,102	21.80	111,223.60	
HANNOVER RUECK SE	1,886	173.10	326,466.60	
MUENCHENER RUECK AG-REG	4,268	261.60	1,116,508.80	
NN GROUP NV	8,529	49.76	424,403.04	
POSTE ITALIANE	16,160	11.04	178,325.60	
SAMPO INSURANCE CO A	14,839	43.36	643,419.04	
AROUNDTOWN SA	32,616	5.47	178,344.28	
BGP HOLDINGS PLC	1,671,480	—	—	
LEG IMMOBILIEN SE	2,254	112.85	254,363.90	
VONOVIA SE	22,482	46.61	1,047,886.02	
ADYEN NV	604	1,823.40	1,101,333.60	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	13,713	61.34	841,155.42	
BECHTLE AG	2,430	46.25	112,387.50	
CAPGEMINI SA	4,884	185.95	908,179.80	
DASSAULT SYSTEMES SE	20,257	40.69	824,257.33	
EDENRED	7,868	37.69	296,544.92	
NEMETSCHEK SE	1,844	74.90	138,115.60	
NEXI SPA	13,685	12.30	168,257.07	
SAP SE	31,883	102.26	3,260,355.58	
WORLDLINE SA	7,473	44.17	330,045.04	
NOKIA OYJ	164,141	5.03	824,808.52	
CELLNEX TELECOM SA	15,511	38.32	594,381.52	
DEUTSCHE TELEKOM	101,657	17.08	1,735,894.93	
ELISA CORP-A SHARES	4,492	51.14	229,720.88	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	11,662	8.76	102,135.79	
KPN (KON. PTT NEDERLAND	101,562	3.10	314,435.95	
ORANGE S.A.	60,642	11.01	667,789.70	
PROXIMUS	4,987	18.60	92,758.20	
TELECOM ITALIA SPA	255,922	0.41	103,981.10	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	27,651	2.64	72,943.33	
TELEFONICA S.A.	160,209	4.37	699,953.12	
UNITED INTERNET	2,824	34.19	96,552.56	
E.ON SE	68,324	12.13	828,496.82	
EDP ELERGIAS DE PORTUGAL	83,896	3.96	332,395.95	
EDP RENOVAVEIS SA	8,749	18.40	160,981.60	
ELEC DE FRANCE EURO.5	14,437	8.14	117,517.18	
ELIA GROUP SA/NV	978	118.00	115,404.00	
ENAGAS	8,038	18.31	147,175.78	
ENDESA SA	10,330	18.77	193,894.10	
ENEL SPA	248,081	6.44	1,596,401.23	
ENGIE	55,573	14.48	804,697.04	
FORTUM OYJ	14,041	22.77	319,713.57	
IBERDROLA SA	177,680	9.29	1,650,647.20	
NATURGY ENERGY GROUP SA	4,519	24.28	109,721.32	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	13,453	16.97	228,297.41	

RWE AG	19,542	38.34	749,240.28	
SNAM SPA	64,840	4.81	312,010.08	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	43,970	6.74	296,445.74	
UNIPER SE	2,654	38.41	101,940.14	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	20,155	32.56	656,246.80	
VERBUND AG	2,100	94.00	197,400.00	
ASM INTERNATIONAL NV	1,423	286.00	406,978.00	
ASML HOLDING NV	12,626	570.40	7,201,870.40	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	39,829	31.31	1,247,045.99	
STMICROELECTRONICS NV	20,103	38.25	768,939.75	
ユーロ 小計	7,423,971		147,964,301.89 (19,288,626,395)	
合計	35,011,974		185,167,372,213 (185,167,372,213)	

（注）１．通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

２．合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	ア メ リ カ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	17,000	228,480.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	4,200	779,562.00	
		AMERICAN TOWER CORP	13,892	3,173,488.48	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	43,800	311,418.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,315	1,014,413.35	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,550	551,460.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,006	486,671.40	
		CROWN CASTLE INTL CORP	13,166	2,137,368.44	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,600	1,162,720.00	
		DUKE REALTY CORP	11,700	619,164.00	
		EQUINIX INC	2,727	1,889,647.38	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5,300	399,567.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	11,043	931,587.48	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,037	642,530.91	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	4,100	768,668.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	16,900	536,237.00	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	22,148	423,248.28	
		INVITATION HOMES INC	17,600	679,712.00	
		IRON MOUNTAIN INC	8,757	376,638.57	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	17,300	354,650.00	
		MID AMERICA APARTMENT COMM	3,637	743,548.28	
		PROLOGIS INC	22,561	3,216,070.55	
		PUBLIC STORAGE	4,830	1,659,394.80	
		REALTY INCOME CORP	17,238	1,148,567.94	
		REGENCY CENTERS CORP	4,700	312,550.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,400	988,788.00	
		SIMON PPTY (SIMON DEBART	9,980	1,406,681.00	

		SUN COMMUNITIES INC	3,300	611,688.00	
		UDR INC	9,200	499,008.00	
		VENTAS INC COM	11,600	614,104.00	
		VICI PROPERTIES INC	16,900	471,848.00	
		VORNADO REALTY TRUST	4,859	216,176.91	
		WELLTOWER INC	13,191	1,093,006.26	
		WEYERHAEUSER CO	22,860	895,654.80	
		WP CAREY INC	5,500	419,980.00	
アメリカ・ドル 小計			385,897	31,764,298.83 (3,654,800,223)	
	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,800	153,328.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,000	123,700.00	
	カナダ・ドル 小計			7,800	277,028.00 (25,018,398)
	オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	33,903	361,745.01	
		GOODMAN GROUP	50,608	1,167,020.48	
		GPT GROUP	60,418	299,069.10	
		MIRVAC GROUP	122,258	315,425.64	
		SCENTRE GROUP	165,017	524,754.06	
		STOCKLAND	71,820	295,898.40	
		VINCINITY CENTERS	117,781	223,194.99	
オーストラリア・ドル 小計			621,805	3,187,107.68 (263,637,547)	
	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO	26,659	144,651.73	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	21,176	170,127.98	
		SEGRO PLC	36,492	461,806.26	
	イギリス・ポンド 小計			84,327	776,585.97 (121,582,299)
	香港・ドル	LINK REIT	64,887	4,279,297.65	
	香港・ドル 小計			64,887	4,279,297.65 (63,119,640)
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	101,885	288,334.55	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	154,021	329,604.94	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	71,600	132,460.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	88,867	156,405.92	
	シンガポール・ドル 小計			416,373	906,805.41 (77,577,202)
	ユーロ	COVIVIO	1,463	109,666.48	
		GECINA SA	1,365	159,909.75	
		KLEPIERRE	6,452	169,042.40	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,836	273,353.36	
	ユーロ 小計			13,116	711,971.99 (92,812,668)
投資証券 小計				4,298,547,977 (4,298,547,977)	
合計				4,298,547,977 (4,298,547,977)	

- (注) 1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
3. 投資証券における券面総額は、証券数です。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の合計 額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 608銘柄	97.3%	—	72.5%
	投資証券 35銘柄	—	2.7%	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	99.6%	—	3.7%
	投資証券 2銘柄	—	0.4%	
オーストラリア・ドル	株式 55銘柄	93.6%	—	2.2%
	投資証券 7銘柄	—	6.4%	
イギリス・ポンド	株式 79銘柄	98.6%	—	4.7%
	投資証券 3銘柄	—	1.4%	
スイス・フラン	株式 41銘柄	100.0%	—	3.1%
香港・ドル	株式 30銘柄	96.3%	—	0.9%
	投資証券 1銘柄	—	3.7%	
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	89.0%	—	0.4%
	投資証券 4銘柄	—	11.0%	
ニュージーランド・ドル	株式 6銘柄	100.0%	—	0.1%
スウェーデン・クローナ	株式 44銘柄	100.0%	—	1.1%
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	100.0%	—	0.2%
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	100.0%	—	0.8%
イスラエル・シェケル	株式 9銘柄	100.0%	—	0.1%
ユーロ	株式 234銘柄	99.5%	—	10.2%
	投資証券 4銘柄	—	0.5%	

(注) 組入株式時価比率及び組入投資証券時価比率は時価の合計額に対する通貨毎の比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区分	注記 番号	(2021年 2月22日現在)	(2022年 2月21日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		261,226,148	404,762,831
金銭信託		49,454	434,636
コール・ローン		64,184,472	104,085,365

国債証券		138,129,530,256	112,815,109,040
派生商品評価勘定		105,000	150,640
未収入金		391,445,888	—
未収利息		941,126,587	745,402,426
前払費用		32,892,599	18,948,737
流動資産合計		139,820,560,404	114,088,893,675
資産合計		139,820,560,404	114,088,893,675
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		128,000	581,280
未払金		—	605,654,872
未払解約金		263,144,116	224,535,783
未払利息		175	281
その他未払費用		4	87
流動負債合計		263,272,295	830,772,303
負債合計		263,272,295	830,772,303
純資産の部			
元本等			
元本	1	56,125,021,105	44,829,220,968
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		83,432,267,004	68,428,900,404
元本等合計		139,557,288,109	113,258,121,372
純資産合計		139,557,288,109	113,258,121,372
負債純資産合計		139,820,560,404	114,088,893,675

（注）親投資信託の計算期間は、原則として、毎年2月21日から、翌年2月20日までであります。

（２）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	国債証券 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、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

3 その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。
------------------------	---

（重要な会計上の見積りに関する注記）

当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（2021年 2月22日現在）	（2022年 2月21日現在）
1 期首元本額	73,334,845,875円	56,125,021,105円
期中追加設定元本額	13,977,898,071円	7,492,685,110円
期中一部解約元本額	31,187,722,841円	18,788,485,247円
元本の内訳		
ファンド名		
ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン	6,452,831,744円	6,525,734,988円
ステート・ストリートDCグローバル債券インデックス・オープン	26,257,605円	27,752,805円
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	88,566,395円	864,844,189円
外国債券インデックス・ファンド / 為替ヘッジ付き（年金1）＜適格機関投資家限定＞	4,747,875,742円	2,727,903,184円
外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,307,563,720円	945,432,342円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	2,175,827円	1,477,413円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	183,758,012円	131,144,952円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	78,138円	81,946円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	5,656,170円	5,901,645円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	4,384,806円	4,039,197円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	6,797,722,184円	6,334,376,233円

外国債券インデックス・ファンドVA1 ＜適格機関投資家限定＞	91,789,915円	78,290,488円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	1,478,376円	1,522,649円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	2,499,101,282円	2,140,003,570円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	1,220,574,038円	1,128,658,937円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	31,271,771円	25,724,700円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	825,024,786円	696,774,062円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	3,569,958,212円	3,408,874,554円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	933,979,159円	796,702,791円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	2,678,768,938円	2,375,871,421円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	81,154,270円	74,144,512円
外国債券インデックス・ファンド（年金）＜適格機関投資家限定＞	158,208,287円	159,210,423円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	97,480,808円	93,357,417円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	54,679,175円	56,178,677円
外国債券インデックス・ファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	7,101,345,280円	— 円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	44,247,215円	40,736,429円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	624,624,601円	560,225,202円
バランスファンドVA20A＜適格機関投資家限定＞	2,339,798円	2,022,530円
バランスファンドVA35B＜適格機関投資家限定＞	1,903,450円	1,874,506円
外国債券インデックス・ファンドVA3＜適格機関投資家限定＞	3,486,611,388円	916,323,583円
4資産インデックスバランスVA20＜適格機関投資家限定＞	914,770,303円	838,619,218円
世界分散ファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	1,655,521,939円	1,464,119,127円
外国債券インデックス・ファンドA／為替ヘッジ付き＜適格機関投資家限定＞	1,062,611,625円	600,045,110円
4資産インデックスバランスVA50＜適格機関投資家限定＞	33,554,864円	29,466,570円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）年金＜適格機関投資家限定＞	— 円	193,067,286円

債券マルチ・ファクター戦略ファンド （年金）＜適格機関投資家限定＞	292,329,694円	565,394,934円
フレックス資産配分戦略ファンド＜適格機関投資家限定＞	91,235,383円	278,379,509円
T a dリスクバジェット型マルチ配分 戦略ファンド（ステイブル）＜適格機 関投資家限定＞	— 円	127,780,936円
ステート・ストリート先進国債券イン デックス・オープン	88,152,516円	103,024,464円
ステート・ストリート先進国債券イン デックス・オープン（為替ヘッジあ り）	3,832,211,540円	5,435,093,427円
世界国債タームスプレッド・プレミア 戦略ファンド／為替ヘッジ付＜適格機 関投資家限定＞	3,702,495,339円	3,896,322,199円
世界バランス 4 0 V A ＜適格機関投資 家限定＞	31,267,872円	19,489,997円
世界バランス 6 0 V A ＜適格機関投資 家限定＞	148,264,459円	85,830,664円
グローバルバランス 4 0 V A ＜適格機 関投資家限定＞	2,191,947円	984,013円
グローバルバランス 4 0 V A 2 ＜適格 機関投資家限定＞	1,058,247,755円	990,434,150円
グローバルバランス 4 0 V A 3 ＜適格 機関投資家限定＞	74,604,035円	63,125,976円
グローバルバランス 5 0 V A ＜適格機 関投資家限定＞	16,150,742円	12,858,043円
計	56,125,021,105円	44,829,220,968円
2 受益権の総数	56,125,021,105口	44,829,220,968口

（金融商品に関する注記）

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	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが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。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「（３）附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスクに晒されております。 デリバティブ取引には、保有外貨建資産の売却代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払い目的に関連して利用している為替予約取引があり、為替変動リスク等の市場リスク及びカウンターパーティーリスク等の信用リスクに晒されております。

3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。
------------------	---

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2021年 2月22日現在)	(2022年 2月21日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（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。 (3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左

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。 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
---------------------------	--	---

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	（2021年 2月22日現在）	（2022年 2月21日現在）
	当期間の損益に 含まれた評価差額	当期間の損益に 含まれた評価差額
国債証券	1,483,758,046	6,563,134,191
合 計	1,483,758,046	6,563,134,191

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始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を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

（単位：円）

区 分	種 類	（2021年 2月22日現在）			
		契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	52,850,000	—	52,745,000	105,000
	ユーロ	204,528,000	—	204,656,000	128,000
合 計		257,378,000	—	257,401,000	23,000

（単位：円）

区 分	種 類	（2022年 2月21日現在）			
		契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	333,795,800	—	333,662,110	133,690
	イギリス・ポンド	46,983,000	—	46,965,510	17,490
	ユーロ	287,108,800	—	286,803,440	305,360
	売建				
	アメリカ・ドル	103,428,000	—	103,552,740	124,740
	ユーロ	104,440,000	—	104,289,360	150,640
	合 計	875,755,600	—	875,273,160	430,640

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

(2) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

4. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(2021年 2月22日現在)	(2022年 2月21日現在)
1口当たり純資産額	2.4865円	2.5264円
(1万口当たり純資産額)	(24,865円)	(25,264円)

(3) 附属明細表

第 1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

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	US TREASURY N/B 1.63% 23/05/31	6,300,000	6,329,039.09	
		US TREASURY N/B 2.0% 26/11/15	4,550,000	4,585,191.42	
		US TREASURY N/B 3.75% 43/11/15	1,450,000	1,793,582.02	
		US TREASURY N/B 2.5% 46/05/15	2,000,000	2,051,640.62	
		US TREASURY N/B 4.5% 36/02/15	500,000	654,511.72	
		US TREASURY N/B 6.25% 30/05/15	900,000	1,198,054.69	
		US TREASURY N/B 1.75% 23/01/31	4,900,000	4,931,390.62	
		US TREASURY N/B 2.0% 23/02/15	6,000,000	6,054,140.64	
		US TREASURY N/B 2.63% 23/02/28	8,000,000	8,122,187.52	
		US TREASURY N/B 1.5% 23/03/31	9,000,000	9,032,343.75	
		US TREASURY N/B 1.75% 23/05/15	5,800,000	5,835,796.90	
		US TREASURY N/B 1.38% 23/06/30	2,500,000	2,501,855.47	
		US TREASURY N/B 2.75% 23/07/31	4,000,000	4,080,781.24	
		US TREASURY N/B 6.25% 23/08/15	1,200,000	1,286,812.50	
		US TREASURY N/B 2.5% 23/08/15	5,500,000	5,593,886.70	
		US TREASURY N/B 2.75% 23/08/31	1,300,000	1,326,660.15	
		US TREASURY N/B 1.38% 23/09/30	5,000,000	4,998,046.90	
		US TREASURY N/B 2.88% 23/09/30	5,200,000	5,322,078.11	
		US TREASURY N/B 1.63% 23/10/31	5,000,000	5,015,039.05	
		US TREASURY N/B 2.75% 23/11/15	4,300,000	4,396,078.12	
		US TREASURY N/B 2.13% 23/11/30	4,000,000	4,047,031.24	
		US TREASURY N/B 2.25% 23/12/31	4,500,000	4,563,984.37	
		US TREASURY N/B 2.25% 24/01/31	3,600,000	3,652,875.00	
		US TREASURY N/B 2.75% 24/02/15	6,000,000	6,146,953.14	
		US TREASURY N/B 2.13% 24/02/29	7,000,000	7,087,226.58	
		US TREASURY N/B 2.13% 24/03/31	5,000,000	5,061,132.80	
		US TREASURY N/B 2.0% 24/04/30	4,500,000	4,543,417.98	
		US TREASURY N/B 2.5% 24/05/15	6,000,000	6,123,750.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 24/06/30	3,000,000	3,029,296.86	
		US TREASURY N/B 2.13% 24/07/31	3,000,000	3,038,554.68	
		US TREASURY N/B 2.38% 24/08/15	8,300,000	8,453,679.64	
		US TREASURY N/B 1.88% 24/08/31	3,800,000	3,824,640.64	
		US TREASURY N/B 2.13% 24/09/30	5,200,000	5,265,609.38	
		US TREASURY N/B 2.25% 24/11/15	5,200,000	5,284,296.88	
		US TREASURY N/B 2.25% 24/12/31	2,500,000	2,540,429.70	
		US TREASURY N/B 2.5% 25/01/31	2,500,000	2,558,300.77	
		US TREASURY N/B 2.0% 25/02/15	5,000,000	5,044,726.55	
		US TREASURY N/B 2.75% 25/02/28	3,900,000	4,019,589.83	
		US TREASURY N/B 2.63% 25/03/31	3,500,000	3,596,796.87	
		US TREASURY N/B 2.13% 25/05/15	5,200,000	5,264,187.50	
		US TREASURY N/B 2.75% 25/06/30	2,900,000	2,993,796.87	
		US TREASURY N/B 2.88% 25/07/31	4,600,000	4,770,164.07	
		US TREASURY N/B 2.0% 25/08/15	4,500,000	4,533,925.77	
		US TREASURY N/B 0.25% 25/08/31	3,000,000	2,843,085.93	
		US TREASURY N/B 3.0% 25/09/30	4,300,000	4,483,421.87	
		US TREASURY N/B 2.25% 25/11/15	5,900,000	5,996,335.90	
		US TREASURY N/B 2.88% 25/11/30	4,800,000	4,989,187.48	
		US TREASURY N/B 2.63% 25/12/31	2,500,000	2,577,343.75	

US TREASURY N/B 2.63% 26/01/31	3,500,000	3,607,324.21	
US TREASURY N/B 1.63% 26/02/15	5,000,000	4,964,648.45	
US TREASURY N/B 2.5% 26/02/28	3,000,000	3,078,164.07	
US TREASURY N/B 2.25% 26/03/31	4,500,000	4,574,882.79	
US TREASURY N/B 0.75% 26/03/31	1,200,000	1,149,000.00	
US TREASURY N/B 1.63% 26/05/15	5,200,000	5,158,968.77	
US TREASURY N/B 0.88% 26/06/30	4,000,000	3,840,468.76	
US TREASURY N/B 1.5% 26/08/15	3,500,000	3,451,054.67	
US TREASURY N/B 1.38% 26/08/31	3,500,000	3,431,914.08	
US TREASURY N/B 1.63% 26/09/30	4,000,000	3,964,062.48	
US TREASURY N/B 0.88% 26/09/30	1,800,000	1,723,851.55	
US TREASURY N/B 1.25% 26/11/30	4,000,000	3,895,312.48	
US TREASURY N/B 1.5% 27/01/31	2,000,000	1,969,531.24	
US TREASURY N/B 2.25% 27/02/15	3,500,000	3,569,863.29	
US TREASURY N/B 2.38% 27/05/15	4,200,000	4,310,250.00	
US TREASURY N/B 0.5% 27/06/30	2,000,000	1,862,187.50	
US TREASURY N/B 0.38% 27/07/31	3,500,000	3,232,714.83	
US TREASURY N/B 2.25% 27/08/15	2,000,000	2,040,859.38	
US TREASURY N/B 0.38% 27/09/30	4,200,000	3,866,296.89	
US TREASURY N/B 0.5% 27/10/31	4,900,000	4,536,136.73	
US TREASURY N/B 2.25% 27/11/15	3,400,000	3,467,734.39	
US TREASURY N/B 0.63% 27/11/30	2,000,000	1,862,187.50	
US TREASURY N/B 0.63% 27/12/31	3,300,000	3,068,871.10	
US TREASURY N/B 2.75% 28/02/15	5,000,000	5,241,210.95	
US TREASURY N/B 1.25% 28/03/31	4,700,000	4,522,832.04	
US TREASURY N/B 2.88% 28/05/15	4,200,000	4,438,054.69	
US TREASURY N/B 1.25% 28/05/31	4,700,000	4,516,222.66	
US TREASURY N/B 1.25% 28/06/30	5,000,000	4,800,585.95	
US TREASURY N/B 2.88% 28/08/15	5,000,000	5,291,015.60	
US TREASURY N/B 1.38% 28/10/31	2,000,000	1,931,093.76	
US TREASURY N/B 3.13% 28/11/15	3,200,000	3,442,500.00	
US TREASURY N/B 1.5% 28/11/30	1,850,000	1,799,992.18	
US TREASURY N/B 1.38% 28/12/31	4,500,000	4,342,500.00	
US TREASURY N/B 2.63% 29/02/15	2,500,000	2,615,917.97	
US TREASURY N/B 2.38% 29/05/15	2,500,000	2,578,417.97	
US TREASURY N/B 1.63% 29/08/15	2,500,000	2,452,539.05	
US TREASURY N/B 1.75% 29/11/15	2,100,000	2,077,851.55	
US TREASURY N/B 1.5% 30/02/15	1,500,000	1,454,941.41	
US TREASURY N/B 0.63% 30/05/15	4,200,000	3,788,531.25	
US TREASURY N/B 0.63% 30/08/15	4,000,000	3,595,156.24	
US TREASURY N/B 0.88% 30/11/15	6,500,000	5,954,355.48	
US TREASURY N/B 1.13% 31/02/15	6,000,000	5,604,843.72	
US TREASURY N/B 1.63% 31/05/15	4,500,000	4,383,808.60	
US TREASURY N/B 1.25% 31/08/15	5,100,000	4,798,781.25	
US TREASURY N/B 1.38% 31/11/15	5,000,000	4,750,000.00	
US TREASURY N/B 4.5% 38/05/15	500,000	663,574.22	
US TREASURY N/B 3.5% 39/02/15	600,000	712,312.50	
US TREASURY N/B 4.25% 39/05/15	700,000	908,578.12	

US TREASURY N/B 4.38% 39/11/15	750,000	988,330.08	
US TREASURY N/B 4.38% 40/05/15	1,500,000	1,982,578.12	
US TREASURY N/B 1.13% 40/05/15	2,000,000	1,644,140.62	
US TREASURY N/B 3.88% 40/08/15	900,000	1,117,933.59	
US TREASURY N/B 1.13% 40/08/15	4,550,000	3,725,312.50	
US TREASURY N/B 4.25% 40/11/15	1,000,000	1,300,273.44	
US TREASURY N/B 1.38% 40/11/15	3,000,000	2,562,421.86	
US TREASURY N/B 4.75% 41/02/15	1,800,000	2,488,359.38	
US TREASURY N/B 1.88% 41/02/15	2,300,000	2,138,101.57	
US TREASURY N/B 2.25% 41/05/15	2,050,000	2,022,212.88	
US TREASURY N/B 3.75% 41/08/15	800,000	981,531.24	
US TREASURY N/B 3.13% 41/11/15	950,000	1,071,013.66	
US TREASURY N/B 2.0% 41/11/15	2,000,000	1,895,625.00	
US TREASURY N/B 3.13% 42/02/15	900,000	1,016,964.84	
US TREASURY N/B 2.75% 42/11/15	1,400,000	1,491,656.25	
US TREASURY N/B 3.13% 43/02/15	700,000	789,359.37	
US TREASURY N/B 2.88% 43/05/15	1,700,000	1,845,296.87	
US TREASURY N/B 3.63% 43/08/15	1,400,000	1,699,851.56	
US TREASURY N/B 3.63% 44/02/15	1,500,000	1,826,191.41	
US TREASURY N/B 3.13% 44/08/15	1,000,000	1,132,851.56	
US TREASURY N/B 2.5% 45/02/15	2,000,000	2,045,000.00	
US TREASURY N/B 3.0% 45/05/15	1,400,000	1,558,976.56	
US TREASURY N/B 2.88% 45/08/15	2,000,000	2,186,484.38	
US TREASURY N/B 3.0% 45/11/15	1,000,000	1,117,539.06	
US TREASURY N/B 2.25% 46/08/15	1,200,000	1,175,625.00	
US TREASURY N/B 2.88% 46/11/15	1,400,000	1,538,742.18	
US TREASURY N/B 3.0% 47/02/15	1,000,000	1,125,000.00	
US TREASURY N/B 3.0% 47/05/15	1,400,000	1,579,210.93	
US TREASURY N/B 2.75% 47/08/15	1,500,000	1,622,929.68	
US TREASURY N/B 2.75% 47/11/15	1,900,000	2,056,156.25	
US TREASURY N/B 3.0% 48/02/15	550,000	624,636.71	
US TREASURY N/B 3.13% 48/05/15	2,300,000	2,675,546.87	
US TREASURY N/B 3.0% 48/08/15	2,700,000	3,073,570.32	
US TREASURY N/B 3.38% 48/11/15	2,500,000	3,045,410.15	
US TREASURY N/B 3.0% 49/02/15	2,800,000	3,202,828.13	
US TREASURY N/B 2.88% 49/05/15	3,000,000	3,360,234.36	
US TREASURY N/B 2.25% 49/08/15	1,000,000	992,773.44	
US TREASURY N/B 2.38% 49/11/15	2,900,000	2,958,453.12	
US TREASURY N/B 2.0% 50/02/15	2,840,000	2,672,595.31	
US TREASURY N/B 1.25% 50/05/15	3,600,000	2,819,812.50	
US TREASURY N/B 1.38% 50/08/15	4,500,000	3,637,265.62	
US TREASURY N/B 1.63% 50/11/15	800,000	688,000.00	
US TREASURY N/B 1.88% 51/02/15	4,850,000	4,430,550.75	
US TREASURY N/B 2.38% 51/05/15	4,700,000	4,808,871.08	
US TREASURY N/B 2.0% 51/08/15	600,000	564,843.75	
US TREASURY N/B 1.88% 51/11/15	1,700,000	1,556,562.50	
US TREASURY N/B 4.38% 38/02/15	400,000	523,296.87	
US TREASURY N/B 5.0% 37/05/15	500,000	692,285.15	

		US TREASURY N/B 6.0% 26/02/15	2,000,000	2,325,156.24	
		US TREASURY N/B 5.38% 31/02/15	500,000	644,218.75	
		US TREASURY N/B 6.13% 27/11/15	300,000	369,410.15	
	アメリカ・ドル 小計		466,190,000	470,126,753.21 (54,092,784,224)	
	カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 29/06/01	900,000	1,144,035.00	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND 0.25% 23/05/01	630,000	622,365.03	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/06/01	3,200,000	3,207,689.60	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 24/03/01	1,400,000	1,420,843.20	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.5% 24/06/01	2,600,000	2,655,902.60	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 25/06/01	3,400,000	3,468,853.40	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 26/06/01	1,900,000	1,886,806.40	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.0% 27/06/01	300,000	289,321.80	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 28/06/01	700,000	711,182.50	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 30/06/01	2,000,000	1,915,632.00	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 31/06/01	1,900,000	1,839,390.00	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 45/12/01	600,000	747,078.00	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 48/12/01	700,000	782,802.30	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 51/12/01	2,000,000	1,932,000.00	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 53/12/01	150,000	134,963.70	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 64/12/01	570,000	651,223.29	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/06/01	500,000	687,901.00	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 37/06/01	650,000	891,748.00	
	カナダ・ドル 小計		24,100,000	24,989,737.82 (2,256,823,222)	
	オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 23/04/21	200,000	211,070.71	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 24/04/21	2,000,000	2,065,975.44	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 25/04/21	1,200,000	1,259,211.52	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 26/04/21	1,150,000	1,261,416.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 27/04/21	1,800,000	2,048,185.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 27/11/21	300,000	312,078.81	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 28/05/21	1,000,000	1,011,250.79	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 28/11/21	900,000	937,376.26	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 29/04/21	450,000	483,870.69	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.5% 30/05/21	2,200,000	2,253,569.82	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.0% 30/12/21	2,350,000	2,123,089.17	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.0% 31/11/21	710,000	633,600.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 32/05/21	2,100,000	1,909,218.31	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 33/04/21	1,250,000	1,525,121.48	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 35/06/21	400,000	415,847.47	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 39/06/21	450,000	488,288.05	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 41/05/21	550,000	552,446.53	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 47/03/21	550,000	568,517.19	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 51/06/21	750,000	591,122.79	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 37/04/21	350,000	404,935.90	
	オーストラリア・ドル 小計		20,660,000	21,056,192.33 (1,741,768,229)	

イギリス・ ボンド	UK GILT BOND 4.25% 49/12/07	1,230,000	1,995,589.33	
	UK GILT BOND 4.5% 42/12/07	1,000,000	1,527,273.60	
	UK GILT BOND 4.5% 34/09/07	1,100,000	1,476,769.80	
	UK GILT BOND 4.25% 39/09/07	650,000	923,160.68	
	UK GILT BOND 4.0% 60/01/22	800,000	1,423,304.00	
	UK GILT BOND 5.0% 25/03/07	1,500,000	1,666,565.16	
	UK GILT BOND 2.25% 23/09/07	2,300,000	2,334,897.94	
	UK GILT BOND 2.0% 25/09/07	800,000	820,872.00	
	UK GILT BOND 1.5% 26/07/22	1,200,000	1,214,431.27	
	UK GILT BOND 4.25% 40/12/07	850,000	1,226,336.99	
	UK GILT BOND 3.5% 45/01/22	1,300,000	1,790,135.36	
	UK GILT BOND 3.75% 52/07/22	1,120,000	1,741,047.61	
	UK GILT BOND 4.25% 36/03/07	1,000,000	1,345,682.00	
	UK GILT BOND 4.75% 30/12/07	1,400,000	1,799,810.32	
	UK GILT BOND 6.0% 28/12/07	500,000	654,275.00	
	UK GILT BOND 0.38% 30/10/22	300,000	276,923.10	
	UK GILT BOND 0.88% 29/10/22	900,000	873,724.68	
	UK GILT BOND 1.63% 28/10/22	1,300,000	1,332,685.38	
	UK GILT BOND 1.63% 71/10/22	650,000	743,392.26	
	UK GILT BOND 1.0% 24/04/22	1,050,000	1,044,876.00	
	UK GILT BOND 1.75% 49/01/22	800,000	843,889.60	
	UK GILT BOND 1.75% 57/07/22	1,100,000	1,202,273.49	
	UK GILT BOND 2.5% 65/07/22	780,000	1,086,922.20	
	UK GILT BOND 2.75% 24/09/07	1,200,000	1,244,147.04	
	UK GILT BOND 3.5% 68/07/22	700,000	1,233,890.00	
	UK GILT BOND 4.25% 46/12/07	1,500,000	2,335,878.00	
	UK GILT BOND 4.25% 32/06/07	1,500,000	1,905,825.00	
	UK GILT BOND 4.25% 27/12/07	1,400,000	1,633,981.44	
	UK GILT BOND 4.25% 55/12/07	800,000	1,399,430.40	
	UK GILT BOND 4.75% 38/12/07	700,000	1,035,747.86	
	UK GILT BOND 0.25% 31/07/31	650,000	585,104.52	
	UK GILT BOND 1.75% 37/09/07	950,000	976,087.00	
	UK GILT BOND 1.13% 39/01/31	600,000	561,888.24	
	イギリス・ボンド 小計	33,630,000	42,256,817.27 (6,615,727,311)	
シンガポ ール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 23/07/01	1,000,000	1,022,626.21	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.38% 25/06/01	1,200,000	1,235,520.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.88% 30/09/01	700,000	749,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.38% 33/09/01	350,000	396,025.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.38% 39/07/01	320,000	330,560.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 42/04/01	350,000	385,189.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 46/03/01	360,000	398,880.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 1.88% 50/03/01	400,000	375,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.5% 27/03/01	880,000	951,984.00	
	シンガポール・ドル 小計	5,560,000	5,844,984.21 (500,038,399)	

マレーシア・リンギット		MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 27/05/31	1,000,000	1,003,406.90	
		MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.07% 50/06/15	2,700,000	2,545,884.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.48% 23/03/15	4,200,000	4,266,046.30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.96% 25/09/15	5,000,000	5,158,225.04	
		MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.9% 26/11/30	2,500,000	2,565,636.57	
		MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 30/04/15	1,100,000	1,160,392.83	
		MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.94% 43/09/30	1,500,000	1,615,455.37	
		MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.74% 46/03/15	1,550,000	1,596,450.89	
		MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.92% 48/07/06	720,000	759,745.95	
		マレーシア・リンギット 小計	20,270,000	20,671,244.05 (567,876,282)	
スウェーデン・クローナ		SWEDISH GOVERNMENT BOND 1.0% 26/11/12	5,000,000	5,124,400.00	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/11/13	8,100,000	8,309,725.20	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND 2.5% 25/05/12	250,000	267,682.60	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/05/12	4,200,000	4,257,290.52	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND 0.75% 29/11/12	3,000,000	3,041,310.00	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.5% 39/03/30	3,800,000	5,482,935.64	
		スウェーデン・クローナ 小計	24,350,000	26,483,343.96 (324,156,130)	
ノルウェー・クローネ		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 26/02/19	3,000,000	2,949,708.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 24/03/14	4,000,000	4,103,688.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 27/02/17	3,900,000	3,856,071.18	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 29/09/06	5,300,000	5,188,170.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.38% 30/08/19	2,200,000	2,081,728.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 23/05/24	3,800,000	3,829,963.00	
		ノルウェー・クローネ 小計	22,200,000	22,009,328.18 (282,379,680)	
デンマーク・クローネ		DANISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/11/15	2,000,000	2,065,856.00	
		DANISH GOVERNMENT BOND 1.75% 25/11/15	4,100,000	4,364,417.20	
		DANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 27/11/15	4,000,000	4,064,150.00	
		DANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/11/15	5,200,000	5,267,184.00	
		DANISH GOVERNMENT BOND 4.5% 39/11/15	6,100,000	10,135,485.50	
		DANISH GOVERNMENT BOND 0.25% 52/11/15	1,950,000	1,749,930.00	
		デンマーク・クローネ 小計	23,350,000	27,647,022.70 (484,652,307)	
メキシコ・ペソ		MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 31/05/29	11,000,000	10,964,580.00	
		MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 23/12/07	34,500,000	34,646,530.81	
		MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 24/12/05	15,000,000	15,837,098.85	
		MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.5% 27/06/03	23,600,000	23,355,211.83	
		MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 29/05/31	19,000,000	19,802,888.32	
		MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 34/11/23	7,500,000	7,435,275.00	
		MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 36/11/20	9,000,000	10,646,726.58	
		MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 38/11/18	10,000,000	10,467,566.70	
		MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 42/11/13	8,500,000	8,225,110.00	
		MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 47/11/07	5,000,000	4,956,241.25	
		メキシコ・ペソ 小計	143,100,000	146,337,229.34 (830,932,055)	

	イスラエル・シェケル	ISRAEL FIXED BOND	2,800,000	2,856,280.00	
		ISRAEL FIXED BOND	1,800,000	1,871,100.00	
		ISRAEL FIXED BOND	2,400,000	2,553,960.00	
		ISRAEL FIXED BOND	1,700,000	1,829,200.00	
		ISRAEL FIXED BOND	1,800,000	1,749,600.00	
		ISRAEL FIXED BOND	850,000	1,274,532.50	
		ISRAEL FIXED BOND	1,120,000	1,383,928.00	
	イスラエル・シェケル 小計		12,470,000	13,518,600.50 (485,306,943)	
	ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 4.0% 23/10/25	5,000,000	5,037,250.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND 3.25% 25/07/25	3,400,000	3,347,980.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND 2.5% 26/07/25	3,000,000	2,846,100.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 29/04/25	4,200,000	4,705,890.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND 1.25% 30/10/25	2,400,000	1,955,184.00	
	ポーランド・ズロチ 小計		18,000,000	17,892,404.00 (514,852,135)	
	中国・元	CHINA GOVERNMENT BOND	35,100,000	35,368,515.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	9,200,000	9,331,008.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,500,000	10,583,570.23	
	中国・元 小計		54,800,000	55,283,093.23 (1,006,130,183)	
	ユーロ	ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/01	1,500,000	1,723,350.00	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.65% 71/06/22	160,000	116,006.60	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.25% 23/06/22	600,000	622,082.40	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.6% 24/06/22	1,200,000	1,282,030.80	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 25/06/22	1,270,000	1,309,364.92	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/28	1,000,000	1,188,454.00	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 27/06/22	800,000	827,885.60	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 28/06/22	550,000	569,528.30	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.9% 29/06/22	750,000	779,728.50	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.1% 30/06/22	790,000	766,450.47	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.0% 31/06/22	1,050,000	1,092,598.50	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 32/03/28	700,000	935,773.30	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.25% 33/04/22	280,000	298,739.00	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.0% 34/06/22	450,000	568,845.90	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.45% 37/06/22	400,000	430,301.60	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.9% 38/06/22	400,000	459,332.80	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.4% 40/06/22	240,000	214,789.44	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 41/03/28	850,000	1,322,302.50	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.75% 45/06/22	470,000	725,265.93	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.6% 47/06/22	550,000	599,382.85	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.7% 50/06/22	550,000	609,864.75	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.25% 57/06/22	410,000	517,978.83	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.15% 66/06/22	300,000	379,278.00	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.5% 28/03/28	1,500,000	1,990,770.00	
		BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.0% 35/03/28	1,000,000	1,524,320.00	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 71/10/31	250,000	189,776.00	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 5.4% 23/01/31	1,500,000	1,583,975.53	

SPANISH GOVERNMENT BOND 4.4% 23/10/31	2,000,000	2,159,355.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.8% 24/01/31	1,800,000	1,975,104.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 3.8% 24/04/30	400,000	434,640.62	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.75% 24/10/31	2,600,000	2,795,273.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.6% 25/04/30	1,650,000	1,728,536.70	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.65% 25/07/30	1,600,000	1,842,032.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.3% 26/10/31	2,100,000	2,186,538.90	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.5% 27/04/30	1,900,000	1,993,840.27	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 27/10/31	600,000	628,008.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.4% 28/04/30	1,400,000	1,462,781.60	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.4% 28/07/30	1,400,000	1,461,867.40	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 29/04/30	1,200,000	1,255,131.60	
SPANISH GOVERNMENT BOND 0.6% 29/10/31	1,200,000	1,178,664.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 30/04/30	1,050,000	1,017,802.38	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.95% 30/07/30	1,500,000	1,624,117.50	
SPANISH GOVERNMENT BOND 0.1% 31/04/30	2,000,000	1,834,626.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.35% 33/07/30	1,160,000	1,298,451.03	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.85% 35/07/30	1,300,000	1,374,151.35	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.7% 41/07/30	1,300,000	1,983,976.80	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.0% 42/07/30	250,000	222,816.87	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15% 44/10/31	650,000	1,082,081.65	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.7% 48/10/31	900,000	1,076,622.30	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.0% 50/10/31	820,000	666,496.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/02/01	1,800,000	2,249,011.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 34/08/01	1,200,000	1,610,664.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 7.25% 26/11/01	800,000	1,034,436.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 25/02/15	2,700,000	2,769,360.30	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.0% 25/08/15	2,650,000	2,766,247.55	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 27/02/15	1,400,000	1,424,871.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 27/08/15	1,500,000	1,545,840.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 42/07/04	1,000,000	1,581,135.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 46/08/15	1,550,000	2,332,416.75	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/02/15	350,000	357,578.90	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/05/15	2,300,000	2,360,951.77	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.0% 23/08/15	4,800,000	4,989,763.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 24/05/15	550,000	574,219.25	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.0% 24/08/15	2,150,000	2,225,789.65	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 26/02/15	3,100,000	3,185,746.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 28/08/15	1,200,000	1,220,155.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 29/02/15	1,500,000	1,524,837.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 29/08/15	1,600,000	1,595,100.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 30/02/15	1,200,000	1,193,601.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 30/08/15	1,500,000	1,493,452.12	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 31/02/15	1,300,000	1,284,786.10	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 31/08/15	1,250,000	1,230,402.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 35/05/15	1,500,000	1,439,122.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 44/07/04	1,100,000	1,617,991.30	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.25% 48/08/15	1,300,000	1,573,182.00	

GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 50/08/15	1,900,000	1,673,582.70	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 52/08/15	250,000	216,270.75	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 9.0% 23/11/01	1,700,000	1,958,981.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 39/08/01	1,000,000	1,411,607.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.25% 29/11/01	1,800,000	2,306,727.28	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/02/01	1,200,000	1,671,616.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 6.0% 31/05/01	1,500,000	2,060,471.02	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.95% 23/03/15	1,500,000	1,520,769.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 23/08/01	2,800,000	2,998,842.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.65% 23/10/15	700,000	708,201.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 24/03/01	2,000,000	2,176,024.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.85% 24/05/15	2,250,000	2,330,662.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 24/09/01	1,800,000	1,954,083.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.35% 25/02/01	1,700,000	1,693,200.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 25/03/01	2,000,000	2,269,940.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 25/06/01	2,300,000	2,369,460.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 25/12/01	2,700,000	2,831,525.10	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.6% 26/06/01	2,600,000	2,684,136.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 26/12/01	1,500,000	1,523,331.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.2% 27/06/01	1,700,000	1,800,912.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.05% 27/08/01	300,000	315,128.64	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 28/02/01	3,600,000	3,769,660.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/09/01	1,900,000	2,312,068.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.8% 28/12/01	1,100,000	1,206,130.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 29/08/01	800,000	889,236.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 30/03/01	1,700,000	1,959,280.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.35% 30/04/01	1,000,000	984,929.68	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.65% 30/12/01	1,700,000	1,697,026.70	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.9% 31/04/01	1,050,000	977,366.25	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.6% 31/08/01	1,000,000	900,956.16	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.65% 32/03/01	1,600,000	1,585,139.96	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.45% 33/09/01	1,000,000	1,060,850.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.35% 35/03/01	800,000	925,172.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 36/09/01	1,400,000	1,436,691.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.95% 38/09/01	900,000	1,002,975.30	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 40/09/01	1,400,000	1,996,507.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.8% 41/03/01	970,000	900,354.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 44/09/01	1,350,000	1,931,532.69	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 46/09/01	900,000	1,049,019.30	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.7% 47/03/01	600,000	637,674.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.45% 48/03/01	800,000	962,523.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.85% 49/09/01	750,000	962,820.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.45% 50/09/01	900,000	898,255.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.7% 51/09/01	580,000	490,893.44	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.8% 67/03/01	700,000	710,181.79	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/07/04	1,400,000	1,831,702.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.63% 28/01/04	2,000,000	2,676,698.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/04	1,850,000	2,865,154.20	

GERMAN GOVERNMENT BOND 4.25% 39/07/04	900,000	1,504,683.90	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 34/07/04	1,000,000	1,561,036.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 40/07/04	1,000,000	1,797,564.01	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.5% 31/01/04	1,300,000	1,930,280.30	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.25% 24/01/04	1,450,000	1,637,529.95	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.25% 30/01/04	850,000	1,269,789.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.5% 27/07/04	1,000,000	1,356,841.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 26/08/15	2,200,000	2,215,622.20	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/04/15	190,000	194,565.06	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.0% 24/04/15	280,000	294,791.28	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.0% 24/09/15	400,000	403,240.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 26/04/15	430,000	439,525.36	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 27/09/15	120,000	122,629.80	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.75% 28/07/04	400,000	465,296.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 28/09/15	150,000	152,238.15	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/09/15	220,000	222,675.86	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.0% 30/09/15	300,000	288,187.20	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.75% 31/04/15	280,000	286,820.24	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.13% 31/09/15	150,000	144,281.55	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.13% 34/04/15	300,000	317,284.50	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.13% 36/04/15	280,000	257,038.88	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.25% 40/09/15	150,000	135,817.50	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.63% 42/07/04	265,000	360,128.11	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.38% 47/04/15	160,000	182,149.28	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.13% 52/04/15	155,000	125,316.12	
FINNISH GOVERNMENT BOND 4.0% 25/07/04	600,000	685,332.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.5% 41/04/25	1,800,000	2,916,079.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 60/04/25	1,310,000	2,391,851.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 23/03/25	350,000	352,378.25	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 23/05/25	2,800,000	2,882,272.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 24/03/25	300,000	302,212.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.25% 24/05/25	2,400,000	2,540,575.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 25/05/25	2,900,000	2,959,816.03	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.5% 26/04/25	2,720,000	3,118,180.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 26/05/25	2,800,000	2,854,492.98	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.75% 27/10/25	3,850,000	4,413,755.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/05/25	2,500,000	2,575,895.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/11/25	2,400,000	2,469,820.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/05/25	2,200,000	2,220,680.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 29/11/25	2,300,000	2,223,962.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.5% 30/05/25	2,200,000	2,568,940.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 30/11/25	2,500,000	2,384,140.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 31/11/25	1,300,000	1,222,071.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.25% 34/05/25	1,500,000	1,580,342.17	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.25% 36/05/25	2,350,000	2,469,948.70	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 39/06/25	1,500,000	1,714,780.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 40/05/25	1,100,000	1,011,836.32	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.0% 48/05/25	1,400,000	1,679,183.80	

FRENCH GOVERNMENT BOND 1.5% 50/05/25	1,400,000	1,507,522.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 53/05/25	100,000	86,813.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.75% 35/04/25	1,700,000	2,550,204.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.5% 29/04/25	1,800,000	2,461,426.79	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/10/25	2,100,000	3,213,338.10	
FRENCH GOVERNMENT BOND 6.0% 25/10/25	2,400,000	2,943,331.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 25/11/25	2,300,000	2,389,511.44	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.5% 31/05/25	2,500,000	2,711,675.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.25% 45/05/25	1,800,000	2,606,713.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 38/10/25	800,000	1,189,694.93	
FRENCH GOVERNMENT BOND 8.5% 23/04/25	1,200,000	1,327,917.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 55/04/25	1,400,000	2,456,213.74	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.25% 23/10/25	3,700,000	3,995,001.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 24/11/25	3,000,000	3,166,143.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.25% 26/11/25	2,400,000	2,416,567.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 66/05/25	1,050,000	1,196,698.65	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.55% 41/04/22	70,000	63,988.26	
IRISH GOVERNMENT BOND 5.4% 25/03/13	500,000	585,275.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.7% 37/05/15	300,000	332,277.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 3.9% 23/03/20	120,000	125,665.80	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.0% 31/10/18	100,000	93,440.40	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.4% 35/05/15	300,000	281,087.10	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.9% 28/05/15	520,000	541,122.40	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.0% 26/05/15	900,000	937,002.60	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.1% 29/05/15	500,000	523,903.50	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.3% 33/05/15	350,000	368,708.37	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.35% 31/03/18	650,000	696,416.50	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.5% 50/05/15	380,000	405,530.30	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.0% 45/02/18	420,000	501,061.05	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.4% 30/05/15	800,000	926,060.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 3.4% 24/03/18	300,000	323,248.50	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.15% 25/10/31	1,600,000	1,711,280.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.9% 46/10/31	750,000	927,027.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.75% 42/01/15	800,000	1,288,707.24	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/15	850,000	1,276,472.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 1.75% 23/07/15	900,000	929,937.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.0% 24/07/15	1,400,000	1,480,043.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.25% 25/07/15	800,000	811,779.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.5% 26/07/15	1,500,000	1,536,875.56	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.75% 27/07/15	1,100,000	1,142,031.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.75% 28/07/15	850,000	883,990.22	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.25% 29/07/15	450,000	451,307.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 30/07/15	500,000	488,409.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 31/07/15	650,000	628,695.27	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.5% 33/01/15	800,000	977,285.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 38/01/15	400,000	366,117.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.5% 40/01/15	520,000	518,434.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.75% 47/01/15	900,000	1,366,858.80	

		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 52/01/15	530,000	441,120.59	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 5.5% 28/01/15	900,000	1,187,571.60	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.5% 86/11/02	200,000	223,160.00	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.1% 17/09/20	280,000	375,551.68	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.85% 20/06/30	170,000	124,558.66	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.75% 23/10/20	600,000	622,152.00	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.65% 24/10/21	1,300,000	1,368,315.00	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.2% 25/10/20	950,000	995,823.25	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.85% 26/03/15	450,000	541,620.00	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 26/10/20	1,000,000	1,033,158.00	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 28/02/20	750,000	774,098.25	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.5% 29/02/20	500,000	505,729.50	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.0% 30/02/20	500,000	482,635.00	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.0% 31/02/20	480,000	457,672.48	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.4% 34/05/23	450,000	543,424.95	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.0% 40/10/20	250,000	212,808.75	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.15% 44/06/20	300,000	443,900.70	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.5% 47/02/20	480,000	547,103.96	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 51/03/20	200,000	189,564.60	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.8% 62/01/26	220,000	416,971.50	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.15% 37/03/15	900,000	1,344,275.10	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 6.25% 27/07/15	740,000	988,807.24	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 4.2% 37/01/31	1,400,000	1,930,671.40	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 4.9% 40/07/30	1,400,000	2,165,773.89	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 5.9% 26/07/30	1,800,000	2,238,404.40	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15% 28/10/31	1,100,000	1,418,206.90	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 3.45% 66/07/30	700,000	942,633.30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 6.0% 29/01/31	1,100,000	1,494,193.80	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/07/30	1,100,000	1,601,878.32	
	ユーロ 小計		290,940,000	330,712,503.38 (43,111,681,940)	
国債証券 小計				112,815,109,040 (112,815,109,040)	
合計				112,815,109,040 (112,815,109,040)	

（注）１．通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

２．合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計 額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 147銘柄	100.0%	48.0%
カナダ・ドル	国債証券 18銘柄	100.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券 20銘柄	100.0%	1.5%
イギリス・ポンド	国債証券 33銘柄	100.0%	5.9%
シンガポール・ドル	国債証券 9銘柄	100.0%	0.4%
マレーシア・リンギット	国債証券 9銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.3%

デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	100.0%	0.4%
メキシコ・ペソ	国債証券	10銘柄	100.0%	0.7%
イスラエル・シェケル	国債証券	7銘柄	100.0%	0.4%
ポーランド・ズロチ	国債証券	5銘柄	100.0%	0.5%
中国・元	国債証券	3銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券	248銘柄	100.0%	38.2%

（注）組入債券時価比率は時価の合計額に対する通貨毎の比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

（2022年3月31日現在）

資産総額	4,952,835,237円
負債総額	4,306,756円
純資産総額（ - ）	4,948,528,481円
発行済口数	3,847,699,298口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2861円

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（日本株式インデックス・マザーファンド）

（2022年3月31日現在）

資産総額	86,972,363,961円
負債総額	49,501,100円
純資産総額（ - ）	86,922,862,861円
発行済口数	25,039,291,829口
1口当たり純資産額（ / ）	3.4715円

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（日本債券インデックス・マザーファンド）

（2022年3月31日現在）

資産総額	181,530,832,037円
負債総額	2,087,221,255円
純資産総額（ - ）	179,443,610,782円
発行済口数	141,550,994,092口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2677円

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

（2022年3月31日現在）

資産総額	219,246,336,130円
負債総額	396,186,502円
純資産総額（ - ）	218,850,149,628円
発行済口数	46,973,275,287口
1口当たり純資産額（ / ）	4.6590円

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

（2022年3月31日現在）

資産総額	114,053,879,549円
負債総額	129,534,582円
純資産総額（ - ）	113,924,344,967円
発行済口数	43,867,085,658口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5970円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

受益者が委託会社に対して行う下記の手続きは、販売会社を通じて、委託会社に請求することにより行うことができます。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(1) 受益証券の名義書換等

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。したがって該当事項はありません。

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

(2) 受益者等名簿の閉鎖の時期

該当事項はありません。

(3) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(4) 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容

< 受益権の譲渡 >

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

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記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。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

< 受益権の譲渡の対抗要件 >

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

(5) その他内国投資信託受益証券事務に関し投資者に示すことが必要な事項

< 受益権の再分割 >

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

< 償還金 >

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載また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かか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または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。

< 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて >

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【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（本書提出日現在）

資本金の額

委託会社の資本金の額は金3億1千万円です。

発行する株式の総数

委託会社の発行する株式の総数は6,200株です。

発行済株式の総数

委託会社の発行済株式総数は6,200株です。

最近5年における主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

(2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

取締役会は、委託会社の業務執行の基本方針を決定します。代表取締役社長は、委託会社を代表し、全般の業務執行について指揮統括します。取締役は、委嘱された業務の執行にあたり、また、代表取締役社長に事故があるときにその職務を代行します。監査役は、委託会社の会計監査を行います。各部には、部長をおき、部長は、代表取締役社長または取締役の命を受け、所属員を指揮監督し、部の業務を統括します。

投資運用の意思決定機構

1) 運用基本方針の決定

投資政策委員会で、投資対象地域経済、産業、政治について更に精緻に分析を行い、投資対象企業、債券を様々な面より分析しつつ、基本的な運用方針を決定します。

2) 運用実施計画の作成

ファンド・マネージャーは決定された運用基本方針に基づいて、具体的な銘柄選択と運用実施計画を作成します。

3) 運用の実行

ファンド・マネージャーは運用計画に基づいて、組入有価証券の売買等を指図します。

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、第一種金融商品取引業及び第二種金融商品取引業を行っています。

2022年3月31日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、123本であり、その純資産総額は2,818,554百万円です（親投資信託を除く、公募投資信託および私募投資信託の合計値です。）。

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます）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）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規制」（昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という）ならびに同規則第38条第1項及び第57条第1項の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第24期事業年度（2020年4月1日から2021年3月31日まで）の財務諸表ならびに第25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）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

１．財務諸表

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

期 別 科 目	前事業年度 (2020年3月31日現在)			当事業年度 (2021年3月31日現在)		
	金 額		構成比	金 額		構成比
(資産の部)			%			%
流動資産						
預金		3,114,127			3,455,294	
有価証券		21,254			22,281	
前払金		39,342			59,450	
前払費用		9,920			20,090	
未収入金		902,862			795,709	
未収還付法人税等		-			592	
未収委託者報酬		660,964			651,298	
未収収益		40,244			41,992	
流動資産計		4,788,718	65.6		5,046,710	70.1
固定資産						
有形固定資産		69,492			4,695	
建物附属設備	1	59,016			-	
器具備品	1	10,475			4,695	
無形固定資産		0			0	
ソフトウェア		0			0	
投資その他の資産		2,445,819			2,149,769	
長期差入保証金		69,819			55,283	
繰延税金資産		2,369,725			2,088,211	
その他投資		6,275			6,275	
固定資産計		2,515,312	34.4		2,154,465	29.9
資産合計		7,304,030	100.0		7,201,176	100.0

（単位：千円）

期 別 科 目	前事業年度 (2020年3月31日現在)			当事業年度 (2021年3月31日現在)		
	金 額		構成比	金 額		構成比
(負債の部)			%			%
流動負債						
預り金		137,851			141,855	
未払金		350,943			300,612	
未払手数料	140,557			163,883		
その他未払金	210,386			136,728		
未払費用		11,122			11,026	
未払法人税等		3,635			-	
未払消費税等		72,142			79,008	
賞与引当金		67,981			76,891	
流動負債計		643,675	8.8		609,394	8.5
固定負債						
退職給付引当金		96,989			81,500	
固定負債計		96,989	1.3		81,500	1.1
負債合計		740,665	10.1		690,894	9.6

（純資産の部）			%			%
株主資本		6,563,364	89.9		6,510,281	90.4
資本金	310,000			310,000		
利益剰余金						
利益準備金	77,500			77,500		
その他利益剰余金						
別途積立金	31,620			31,620		
繰越利益剰余金	6,144,244			6,091,161		
純資産合計		6,563,364	89.9		6,510,281	90.4
負債・純資産合計		7,304,030	100.0		7,201,176	100.0

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

期 別 科 目	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	
	金 額	構成比	金 額	構成比
営業収益		%		%
委託者報酬	2,392,782		2,468,063	
投資顧問収入	2,907,674		2,871,928	
その他営業収益	66,452		78,227	
営業収益計	5,366,908	100.0	5,418,219	100.0
営業費用				
支払手数料	520,256		631,100	
広告宣伝費	30,443		28,458	
公告費	1,140		1,140	
調査費	632,099		527,766	
調査費	369,545		268,033	
委託調査費	261,450		259,021	
図書費	1,102		711	
委託計算費	265,563		242,239	
営業雑経費	39,755		38,381	
通信費	4,801		4,038	
印刷費	15,648		11,238	
協会費	16,300		18,183	
諸会費	-		5	
その他	3,005		4,915	
営業費用計	1,489,258	27.7	1,469,086	27.1
一般管理費				
給料	1,322,366		1,307,873	
役員報酬	197,080		235,947	
給料・手当	848,305		800,039	
賞与	253,121		210,310	
賞与引当金繰入額	23,858		61,576	
交際費	10,725		728	
旅費交通費	8,872		801	
租税公課	8,801		6,244	
不動産賃借料	97,021		91,686	
退職給付費用	106,349		71,604	

固定資産減価償却費		22,666			20,149	
福利厚生費		126,755			126,174	
事務手数料		1,057,318			1,306,329	
諸経費		186,258			202,081	
一般管理費計		2,947,135	54.9		3,133,675	57.8
営業利益		930,515	17.3		815,458	15.1
営業外収益						
為替差益		166			123	
有価証券運用益		3,384			1,026	
雑収入		63			36	
営業外収益計		3,614	0.1		1,186	0.0
営業外費用						
為替差損		289			656	
有価証券運用損		4,123			-	
雑損失		490			193	
営業外費用計		4,903	0.1		849	0.0
経常利益		929,225	17.3		815,794	15.1
特別利益						
事業再構築費用戻入		-			102	
特別利益計		-	0.0		102	0.0
特別損失						
事業再構築費用		102,351			-	
事務処理損失		-			8,806	
固定資産除却損		-			45,130	
特別損失計		102,351	1.9		53,937	1.0
税引前当期純利益		826,874	15.4		761,960	14.1
法人税、住民税及び事業税		530	0.0		530	0.0
法人税等調整額		292,691	5.5		281,513	5.2
当期純利益		533,652	9.9		479,916	8.9

（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：千円）

	株 主 資 本						純資産合計
	資本金	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	310,000	77,500	31,620	6,100,591	6,209,711	6,519,711	6,519,711
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	490,000	490,000	490,000	490,000
当期純利益	-	-	-	533,652	533,652	533,652	533,652
当期変動額合計	-	-	-	43,652	43,652	43,652	43,652
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,144,244	6,253,364	6,563,364	6,563,364

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本						純資産合計
	資本金	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	310,000	77,500	31,620	6,144,244	6,253,364	6,563,364	6,563,364
当期変動額							

剰余金の配当	-	-	-	(533,000)	(533,000)	(533,000)	(533,000)
当期純利益	-	-	-	479,916	479,916	479,916	479,916
当期変動額合計	-	-	-	53,083	53,083	53,083	53,083
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,091,161	6,200,281	6,510,281	6,510,281

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	有価証券 売買目的有価証券 決算期末日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定）を採用しております。
2. 固定資産の減価償却方法	(1) 有形固定資産 リース資産以外の有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物附属設備 9～10年 器具備品 3～7年
3. 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処理しております。
4. 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当期に負担すべき金額を計上しております。 (2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、必要額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。 数理計算上の差異 発生の翌事業年度に一括損益処理しております。
5. その他 財務諸表作成のための重要な事項	消費税等の処理方法 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。

表示方法の変更

（会計上の見積りの開示に関する会計基準の適用）

「会計上の見積りの開示に関する会計基準」（企業会計基準第31号 2020年3月31日）を当事業年度の年度末に係る財務諸表から適用し、個別注記表に重要な会計上の見積りに関する注記を記載しております。

会計上の見積りに関する注記

会計上の見積りにより、当事業年度に係る財務諸表にその額を計上した項目であって、翌事業年度に係る財務諸表に重要な影響を及ぼす可能性があるものは、次のとおりです。

繰延税金資産 2,088,211千円

繰延税金資産の認識は、将来の事業計画に基づく課税所得の発生および金額によって見積もっております。

当該見積りは、将来の不確実な経済条件の変動などによって影響を受ける可能性があり、実際に発生した課税所得の時期および金額が見積りと異なった場合や将来の税法の改正等により、翌事業年度の財務諸表において、繰延税金資産の金額に重要な影響を与える可能性があります。

（追加情報）

繰延税金資産の回収可能性については、新型コロナウイルス感染症（COVID-19）の収束時期が不透明であることから、当社が顧客から収受する等顧問料等に一定の影響があるとの仮定を基に今後の業績見通し等を勘案し、繰延税金資産を計上しております。

なお、当該金額は現時点での最善の見積もりではあるものの、新型コロナウイルス感染症の感染拡大の状況や経済への影響等により、翌事業年度以降の財務諸表に影響を及ぼす可能性があります。

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 (2020年3月31日現在)	当事業年度 (2021年3月31日現在)
1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 68,147千円 器具備品 46,953千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 - 千円 器具備品 52,734千円
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左

（損益計算書関係）

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
移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額65,925千円は、損益計算書のその他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額1,057,318千円は、損益計算書の事務手数料に含まれております。	移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額77,977千円は、損益計算書のその他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額1,306,329千円は、損益計算書の事務手数料に含まれております。
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左

（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. 発行済株式の総数に関する事項

	当事業年度期首	当期増加株式数	当期減少株式数	当事業年度末
普通株式	6,200株	-	-	6,200株

2. 当事業年度中に行った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	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2019年6月26日 定時株主総会	普通株式	490,000千円	79,032.25円	2019年3月31日	2019年6月27日

3. 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当事業年度の末日後となるもの

（決議）	株式の種類	配当金の総額	配当の原資	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2020年6月24日 定時株主総会	普通株式	533,000千円	利益剰余金	85,967.74円	2020年3月31日	2020年6月25日

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 発行済株式の総数に関する事項

	当事業年度期首	当期増加株式数	当期減少株式数	当事業年度末
普通株式	6,200株	-	-	6,200株

2. 当事業年度中に行った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	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2020年6月24日 定時株主総会	普通株式	533,000千円	85,967.74円	2020年3月31日	2020年6月25日

3. 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当事業年度の末日後となるもの

（決議）	株式の種類	配当金の総額	配当の原資	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2021年6月24日 定時株主総会	普通株式	479,000千円	利益剰余金	77,258.06円	2021年3月31日	2021年6月25日

（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、投資運用業、投資助言業、第二種金融商品取引業及び第一種金融商品取引業を行っております。これらの事業を行うための資金運用については、短期的な預金等に限定し、資金調達については、現状必要性を想定しておりません。

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社の営業債権である未収委託者報酬は、投資信託及び投資法人に関する法律により、信託銀行において分別管理される信託財産のため、当該報酬は、計理上日々の未払委託者報酬として投資信託財産の負債項目に計上されております。このため、顧客の信用リスクは限定されております。

同じく営業債権である未収投資顧問料は、概ね6か月以内に回収される債権であり、また顧客の業種等も多岐にわたり分散されていることから、顧客の信用リスクは限定されております。

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、次の通りであります。

2020年3月31日現在

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 預金	3,114,127	3,114,127	—
(2) 未収入金	902,862	902,862	—
(3) 未収委託者報酬	660,964	660,964	—
(4) 預り金	137,851	137,851	—
(5) 未払手数料	140,557	140,557	—
(6) その他未払金	210,386	210,386	—

（注1）金融商品の時価の算定方法に関する事項

（1）預金

預金は、すべて満期のない預金であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（2）未収入金、(3)未収委託者報酬、(4)預り金、(5)未払手数料及び(6)その他未払金

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（注2）金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものではありません。

（注3）社債、長期借入金、リース債務およびその他の有利子負債の決算日後の返済予定額

記載すべき事項はありません。

2021年3月31日現在

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)預金	3,455,294	3,455,294	—
(2)未収入金	795,709	795,709	—
(3)未収委託者報酬	651,298	651,298	—
(4)預り金	141,855	141,855	—
(5)未払手数料	163,883	163,883	—
(6)その他未払金	136,728	136,728	—

（注1）金融商品の時価の算定方法に関する事項

（1）預金

預金は、すべて満期のない預金であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（2）未収入金、(3)未収委託者報酬、(4)預り金、(5)未払手数料及び(6)その他未払金

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（注2）金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものではありません。

（注3）社債、長期借入金、リース債務およびその他の有利子負債の決算日後の返済予定額

記載すべき事項はありません。

（有価証券関係）

前事業年度 (2020年3月31日現在)	当事業年度 (2021年3月31日現在)
売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 21,254千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 4,123千円	売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 22,281千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 1,026千円

（デリバティブ取引関係）

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
該当事項はありません。	同左

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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
2011年4月1日に確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）、確定拠出年金制度を導入いたしました。 また、2000年9月29日より退職給付信託を設定しております。	同左

2．退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
退職給付債務の期首残高	502,405
勤務費用	57,391
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	53,802
退職給付の支払額	<u>85,470</u>
退職給付債務の期末残高	420,524

(単位：千円)

	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	420,524
勤務費用	55,967
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	25,944
退職給付の支払額	<u>51,930</u>
退職給付債務の期末残高	450,505

3．年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
年金資産の期首残高	396,905
期待運用収益	2,938
数理計算上の差異の発生額	28,742
事業主からの拠出額	54,241
退職給付の支払額	<u>85,470</u>
年金資産の期末残高	339,872

(単位：千円)

	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
年金資産の期首残高	339,872
期待運用収益	2,511
数理計算上の差異の発生額	25,875
事業主からの拠出額	52,607
退職給付の支払額	51,930
年金資産の期末残高	368,935

4. 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：千円)

	前事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
積立型制度の退職給付債務	420,524
年金資産	399,872
	80,651
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	80,651
未認識数理計算上の差異	25,059
未認識過去勤務費用	8,721
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	96,989

(単位：千円)

	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
積立型制度の退職給付債務	450,505
年金資産	368,935
	81,570
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	81,570
未認識数理計算上の差異	69
未認識過去勤務費用	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	81,500

5. 退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	86,784
(1)勤務費用	57,391

(2)利息費用	-
(3)期待運用収益（減算）	2,938
(4)過去勤務費用の費用処理額	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	20,411
(6)その他	3,198

(単位：千円)

	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	52,417
(1)勤務費用	55,966
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益（減算）	2,510
(4)過去勤務費用の費用処理額	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	25,059
(6)その他	15,300

6．年金資産に関する事項

前事業年度（2020年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 97.7%

その他 2.3%

合計 100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

当事業年度（2021年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 97.9%

その他 2.1%

合計 100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

7．退職給付債務等の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (2020年3月31日現在)
(1)割引率	0.0%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年

	当事業年度 (2021年3月31日現在)
--	-------------------------

(1)割引率	0.0%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年

8. 確定拠出制度

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は19,564千円であります。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は19,186千円であります。

（税効果会計関係）

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. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 （単位：千円） 繰延税金資産 連結納税適用に伴う影響額 612,589 賞与引当金繰入超過額 17,497 退職給付引当金 31,083 繰越欠損金 1,652,186 その他 56,367 繰延税金資産 合計 2,369,725 繰延税金負債との相殺 - 繰延税金資産の純額 2,369,725	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 （単位：千円） 繰延税金資産 連結納税適用に伴う影響額 - 賞与引当金繰入超過額 21,034 退職給付引当金 26,660 (注) 繰越欠損金 1,987,863 その他 52,654 繰延税金資産 合計 2,088,211 繰延税金負債との相殺 - 繰延税金資産の純額 2,088,211

（注）税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

前事業年度（2020年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超 2年以内 (千円)	2年超 3年以内 (千円)	3年超 4年以内 (千円)	4年超 5年以内 (千円)	5年超 (千円)	合計 (千円)
税務上の繰越欠損金 (*1)	-	-	-	-	-	1,652,186	1,652,186
繰延税金資産	-	-	-	-	-	1,652,186	1,652,186

(*1) 税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額であります。

(*2) 税務上の繰越欠損金1,652,186千円（法定実効税率を乗じた金額）について、繰延税金資産1,652,186千円を計上しております。当該税務上の繰越欠損金に係る繰延税金資産については、将来の課税所得の見込等により回収可能と判断しております。

当事業年度（2021年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超 2年以内 (千円)	2年超 3年以内 (千円)	3年超 4年以内 (千円)	4年超 5年以内 (千円)	5年超 (千円)	合計 (千円)
--	--------------	---------------------	---------------------	---------------------	---------------------	-------------	------------

税務上の繰越欠損金 (*1)	-	-	-	-	-	1,987,863	1,987,863
繰延税金資産	-	-	-	-	-	1,987,863	(*2) 1,987,863

(*1) 税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額であります。

(*2) 税務上の繰越欠損金1,987,863千円（法定実効税率を乗じた金額）について、繰延税金資産1,987,863千円を計上しております。当該税務上の繰越欠損金に係る繰延税金資産については、将来の課税所得の見込等により回収可能と判断しております。

前事業年度（2020年3月31日現在）		当事業年度（2021年3月31日現在）	
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳	
法定実効税率	30.6%	法定実効税率	30.6%
交際費等永久に損金に 算入されない項目	5.1%	交際費等永久に損金に 算入されない項目	6.8%
その他	0.3%	その他	0.4%
税効果会計適用後の 法人税等の負担率	35.4%	税効果会計適用後の 法人税等の負担率	37.0%
=====		=====	

（資産除去債務関係）

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

当社は、本社オフィス及びバックアップセンターの不動産賃貸借契約に基づき、退去時における原状回復に係る債務を資産除去債務として認識しておりますが、当該資産除去債務に関しては、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当事業年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を賃貸借契約期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は35,341千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、変動は有りません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

当社は、本社オフィス及びバックアップセンターの不動産賃貸借契約に基づき、退去時における原状回復に係る債務を資産除去債務として認識しておりますが、当該資産除去債務に関しては、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積み、そのうち当事業年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を賃貸借契約期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は35,341千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、変動は有りません。

（セグメント情報）

1. セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

2. セグメント関連情報

1. 商品及びサービスに関する情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客へ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. 地域に関する情報

営業収益

本邦に所在している顧客への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。

なお、委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、集計対象より除外しております。

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. 主要な顧客に関する情報

委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、記載を省略しております。

また、投資顧問料については、顧客との守秘義務契約により、開示が出来ないため、記載を省略しております。

（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。

（関連当事者情報）

関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

該当事項はありません。

(2) 同一の親会社を持つ会社

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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	所在地	資本金 又は 出資金	事業の内容 又は 職業	議決権の 所有(被所 有)割合	関連当事者との関係 役員の 兼任等	事業上の関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
同一の親 会社を持 つ会社	ステート・ス トリート・バ ンク・アド バイザーズ・コ ンパニー	米国 マサチューセツ ツ州ボストン市	29百万 米ドル	銀行、投資 顧問、投資 信託委託業 務、及びそ れらの関連 業務	なし	なし	助言などの投 資顧問サービ スの提供並びに受 入れ	ソフトウェア使 用料の支払	309,576	前払金	694
								投資顧問料の支 払	189,363		
								ソフトウェア の使用契約	129,383	未払金	18,808
								人件費等及び 事務手数料の 支払	65,925		
								事務手数料の支 払	1,057,318		
	ステート・ス トリート信託 銀行株式 会社	東京 都 港 区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理 の事務サービ スの受入れ	投資信託計理業 務委託	37,991	前払金	38,648
								兼職社員の人 件費支払等	138,065		
	ステート・ス トリート・グ ローバル・ア ドバイザーズ・コ ンパニー・キ ングダム	英国 ロンドン	62百万 ポンド	投資顧問、 投資信託委 託業務	なし	なし	投資顧問サービ スの受入れ	投資顧問料の支 払	13,752	-	-
	ステート・ス トリート・グ ローバル・ア ドバイザーズ・シ ンガポール	シンガポール シンガポール 市	136万シ ンガポ ールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービ スの受入れ及び E T F 商品 の紹介	紹介料の受取 投資顧問料の支 払	526 22,050	-	-

(注) 上記の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、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。

取引条件及び取引条件の決定方針等

1. ソフトウェア使用料及び事務手数料については、グループ全体の費用を一定の基準で配分した金額に基づき決定しております。
2. 人件費及び事務所賃借料については、実際支払額を基として支払いを行っております。
3. 役員料については、当社との間で締結された役務提供契約に基づいて支払われております。
4. 投資顧問料については、当社との間で締結された投資顧問契約に記載された料率に基づいて計算されております。
5. ETF商品の紹介料については、当社との間で締結された役務提供契約に基づいて計算されております。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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	所在地	資本金 又は 出資金	事業の内容 又は 職業	議決権の 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 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の関係				
同一の親 会社を持 つ会社	ステート・ス トリート・バ ンク・アン ド・トラ スト・カン パニー	米国 マサチューセツ 州ボストン市	29百万 米ドル	銀行、投資 顧問、投資 信託委託業 務、及びそ れらの関連 業務	なし	なし	助言などの投 資顧問サービ スの提供並び に受入れ	ソフトウェア使 用料の支払	210,494	前払金	170
								投資顧問料の支 払	182,861		
								ソフトウェア の使用契約	178,279	未払金	19,408
								人件費等及び 事務手数料の 支払	77,977		
								事務手数料の支 払	1,306,329		
	ステート・ス トリート信託 銀行株式 会社	東京 都 港 区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理 の事務サービ スの受入れ	投資信託計理業 務委託	38,231	前払金	59,280
								兼職社員の人 件費支払等	122,715		
	ステート・ス トリート・グ ローバル・ア ドバイザー ズ・ユニテ ッド・キング ダム	英国 ロンドン	62百万 ポンド	投資顧問、 投資信託委 託業務	なし	なし	投資顧問サー ビスの受入れ	投資顧問料の支 払	17,282	-	-
	ステート・ス トリート・グ ローバル・ア ドバイザー ズ・シンガ ポール	シンガポール シンガポール 市	136万シ ンガポール ドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サー ビスの受入れ 及びETF商品 の紹介	紹介料の受取 投資顧問料の支 払	249 21,878	- -	- -

(注) 上記の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、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。

取引条件及び取引条件の決定方針等

- ソフトウェア使用料及び事務手数料については、グループ全体の費用を一定の基準で配分した金額に基づき決定しております。
- 人件費及び事務所賃借料については、実際支払額を基として支払いを行っております。
- 役務料については、当社との間で締結された役務提供契約に基づいて支払われております。
- 投資顧問料については、当社との間で締結された投資顧問契約に記載された料率に基づいて計算されております。
- ETF商品の紹介料については、当社との間で締結された役務提供契約に基づいて計算されております。

親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

ステート・ストリート・コーポレーション（ニューヨーク証券取引所に上場）
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インク（非上場）
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インターナショナル・ホールディングス（非上場）
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

(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 1,058,607円22銭	1株当たり純資産 1,050,045円38銭
1株当たり当期純利益 86,073円06銭	1株当たり当期純利益 77,405円89銭
なお、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。	なお、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。

(注) 1株当たり当期純利益の算定基礎は、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 (千円)	533,652	479,916
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式にかかる当期純利益 (千円)	533,652	479,916
期中平均株式数 (株)	6,200	6,200

(重要な後発事象)

前事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

期 別	第25期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)		
科 目	金 額		構成比
(資産の部)			%
流動資産			
預金		3,625,319	
有価証券		22,985	
前払金		85,688	
前払費用		28,325	
未収入金		710,965	
未収委託者報酬		700,370	
未収収益		359,443	
流動資産計		5,533,098	73.1

固定資産				
有形固定資産			621	
建物附属設備	1	0		
器具備品	1	621		
無形固定資産			0	
ソフトウェア		0		
投資その他の資産			2,032,054	
長期差入保証金		73,744		
繰延税金資産		1,952,035		
その他投資		6,275		
固定資産計			2,032,676	26.9
資産合計			7,565,774	100.0
（負債の部）				%
流動負債				
預り金			33,016	
未払金			309,581	
未払手数料		179,583		
その他未払金		129,998		
未払費用			11,202	
未払法人税等			199,687	
未払消費税等	2		49,024	
賞与引当金			243,734	
流動負債計			846,247	11.2
固定負債				
退職給付引当金			83,215	
固定負債計			83,215	1.1
負債合計			929,463	12.3
（純資産の部）				%
株主資本			6,636,311	87.7
資本金		310,000		
利益剰余金		6,326,311		
利益準備金		77,500		
その他利益剰余金				
別途積立金		31,620		
繰越利益剰余金		6,217,191		
純資産合計			6,636,311	87.7
負債・純資産合計			7,565,774	100.0

(2) 中間損益計算書

（単位：千円）

科 目	期 別	第25期中間会計期間	
		自 2021年4月 1日 至 2021年9月30日	
		金 額	構成比
営業収益			%
委託者報酬		1,329,971	
投資顧問収入		1,519,331	
その他営業収益	1	74,653	
営業収益計		2,923,956	100.0
営業費用・一般管理費			
営業費用		937,049	
支払手数料		357,549	
その他営業費用		579,500	

一般管理費	2	1,064,685	
営業費用・一般管理費計		2,001,735	68.5
営業利益		922,221	31.5
営業外収益		748	0.0
営業外費用		470	0.0
経常利益		922,499	31.5
特別損失		2,326	0.1
税引前中間純利益		920,172	31.5
法人税,住民税及び事業税		180,085	6.2
法人税等調整額		135,057	4.6
中間純利益		605,030	20.7

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

（単位：千円）

	株 主 資 本						純資産合計
	資本金	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	310,000	77,500	31,620	6,091,161	6,200,281	6,510,281	6,510,281
当中間期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	-479,000	-479,000	-479,000	-479,000
中間純利益	-	-	-	605,030	605,030	605,030	605,030
当中間期変動額合計	-	-	-	126,030	126,030	126,030	126,030
当中間期末残高	310,000	77,500	31,620	6,217,191	6,326,311	6,636,311	6,636,311

[重要な会計方針]

	第25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 売買目的有価証券 中間決算日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定） を採用しております。
2. 固定資産の減価 償却方法	(1) 有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 器具備品 3～ 7年
3. 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 額は損益として処理しております。

4. 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当中間会計期間に負担すべき金額を計上しております。 (2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。 数理計算上の差異 発生の翌事業年度に一括費用処理しております。
5. 収益の計上方法	(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託約款に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資信託約款毎に、日々の純資産総額に信託報酬率を乗じた金額で収益を認識しております。 (2) 投資顧問収入 投資顧問収入は、投資顧問契約に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資顧問契約毎に、計算基礎額に投資顧問料率を乗じた金額で収益を認識しております。
6. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の処理方法 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。

〔会計方針の変更〕

（収益認識に関する会計基準等の適用）

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 令和2年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）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いたしました。ただし、これによる具体的な会計方針の変更は無く、したがって、収益認識会計基準等の適用にともなう当中間会計期間における中間貸借対照表、中間損益計算書および中間株主資本等変動計算書への影響は有りません。

（時価の算定に関する会計基準等の適用）

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 令和元年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 令和元年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いたしました。ただし、これによる具体的な会計方針の変更は無く、したがって、時価算定会計基準等の適用にともなう当中間会計期間における中間貸借対照表、中間損益計算書および中間株主資本等変動計算書への影響は有りません。

注 記 事 項

（中間貸借対照表関係）

第25期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	
器具備品	30,152千円
2. 消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。	

(中間損益計算書関係)

第25期中間会計期間 自 2021年4月 1日 至 2021年9月30日	
1. 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当中間会計期間に、ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額74,529千円は、損益計算書のその他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額107,178千円は、損益計算書の一般管理費に含まれております。	
2. 減価償却実施額	
有形固定資産	1,952千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

（中間会計期間中の変動計算書関係）

第25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 株式数（株）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 株式数（株）
普通株式	6,200	—	—	6,200

2. 当中間会計期間中に行った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	1株あたりの 配当額	基準日	効力発生日
2021年6月24日 定時株主総会	普通株式	479,000千円	77,258.06円	2021年3月31日	2021年6月25日

(金融商品関係)

第25期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)	
1. 金融商品の時価等に関する事項	
預金、未収入金、未収委託者報酬、未収収益、未払手数料及びその他未払金は、短期間で決済されるため、時価が帳簿価額に近似することから、注記を省略しております。	
2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項	
前項にて注記を省略しているため、記載を省略しております。	

（有価証券関係）

第25期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)	
売買目的の有価証券	
貸借対照表計上額	22,985千円
当中間会計期間の損益に含まれた評価差額	703千円

（資産除去債務関係）

第25期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)	
当中間会計期間において、本社オフィスの一部解約等に伴う原状回復費用の精算が行われたことから、資産除去債務の総額は、期中において20,679千円減少し、14,661千円となりました。	

（デリバティブ取引関係）

第25期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)	
当社はデリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。	

（セグメント情報等）

第25期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)	
-------------------------------	--

（セグメント情報）

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

（セグメント関連情報）

1. 商品およびサービスごとの情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客へ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

本邦に所在している顧客への収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しています。なお、委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、集計対象より除いております。

(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

委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、記載を省略しております。

また、投資顧問料については、顧客との守秘義務契約により、開示が出来ないため、記載を省略しております。

（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。

（収益認識関係）

第25期中間会計期間

自 2021年4月 1日

至 2021年9月30日

当社は、「（セグメント情報等）」に記載のとおり、投資運用業の単一セグメントであり、営業収益のうち委託者報酬と投資顧問収入は、顧客との契約から生じる収益であります。

(1) 収益の分解情報

損益計算書に記載のとおりです。

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

重要な会計方針「5. 収益の計上方法」に記載のとおりです。

(3) 当期及び翌期以降の収益の金額を理解するための情報

重要性が乏しいため、注記を省略しております。

（1株当たり情報）

第25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	1,070,372円81銭										
1株当たり中間純利益	97,585円49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。											
<table> <tr> <td colspan="2"> 第25期中間会計期間 自 2021年4月 1日 至 2021年9月30日 </td></tr> <tr> <td>中間純利益（千円）</td><td>605,030</td></tr> <tr> <td>普通株主に帰属しない金額</td><td>-</td></tr> <tr> <td>普通株式にかかる中間純利益（千円）</td><td>605,030</td></tr> <tr> <td>期中平均株式数（株）</td><td>6,200</td></tr> </table>		第25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（千円）	605,030	普通株主に帰属しない金額	-	普通株式にかかる中間純利益（千円）	605,030	期中平均株式数（株）	6,200
第25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（千円）	605,030										
普通株主に帰属しない金額	-										
普通株式にかかる中間純利益（千円）	605,030										
期中平均株式数（株）	6,200										

（重要な後発事象）

第25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。

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。

自己又はその取締役若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、若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がないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

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、若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がないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

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。以下において同じ。 ）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金融デリバティブ取引を行うこと。

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、運用財産の額若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。

上記 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、若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

委託会社の定款変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

その他、営業譲渡および営業譲受、出資の状況その他の重要な事項は予定されておりません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実は存在しておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称

三井住友信託銀行株式会社

資本金の額

342,037百万円（2021年12月末現在）

事業の内容

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

（参考）再信託受託会社

名 称：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2021年9月末現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）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	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円 (2021年12月末現在)	銀行法に基づく銀行業および金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づく信託業を営むとともに、金融商品取引法に基づく登録を受けて投資信託証券の募集の取扱い等を行っています。
楽天証券株式会社	17,495百万円 (2021年12月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323百万円 (2021年12月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	10,858百万円 (2021年3月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

受託会社は主として、信託財産の保管・管理・計算、受益権の設定に係る振替機関への通知、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行います。

(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。

第3【参考情報】

当計算期間において提出された、ファンドに係る金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる書類は以下の通りです。

書類名	提出年月日
有価証券報告書	2021年 5月20日
有価証券届出書	2021年 5月20日
有価証券届出書の訂正届出書	2021年11月19日
半期報告書	2021年11月19日

独立監査人の監査報告書

2021年6月30日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 雅人
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第24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、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の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役の責任

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。

監査役の責任は、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、監査役に対して、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。

監査人は、監査役に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2022年4月6日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

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AMC/ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）の2021年2月23日から2022年2月21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、AMC/ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）の2022年2月21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、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ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

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ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．上記の監査報告書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24日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 伊藤 雅人

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」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第25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、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の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役の責任

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。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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、監査役に対して、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。

監査人は、監査役に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以 上

（注）上記は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。