【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年10月25日提出
【計算期間】	第12期(自 2021年7月27日至 2022年7月25日)
【ファンド名】	インデックスコレクション（バランス株式３０） インデックスコレクション（バランス株式５０） インデックスコレクション（バランス株式７０）
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田　賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長　民野　誠
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【電話番号】	03-6453-3610
【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】

＜ファンドの目的＞

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

＜信託金限度額＞

各ファンドについて、1兆円を上限とします。

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象 地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型

株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分固定型）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回（隔月） 年12回（毎月） 日々 その他（　）

［単位型投信・追加型投信の区分］

(1)単位型投信…当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。

(2)追加型投信…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

［投資対象地域による区分］

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

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

(3)内外…目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

(1)株式…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2)債券…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)不動産投信(リート)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)その他資産…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。

(5)資産複合…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［独立した区分］

(1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。

(2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。

(3)ETF…投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

［補足分類］

(1)インデックス型…目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

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

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

(1)株式

①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券
①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
③社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。
(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。
(5)資産複合…以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。
①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
②資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

［決算頻度による属性区分］
(1)年1回…目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
(2)年2回…目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
(3)年4回…目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
(4)年6回(隔月)…目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
(5)年12回(毎月)…目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
(6)日々…目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

［投資対象地域による属性区分(重複使用可能)］
(1)グローバル…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
(2)日本…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(3)北米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(4)欧州…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とす

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

［投資形態による属性区分］
(1)ファミリーファンド…目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
(2)ファンド・オブ・ファンズ…「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

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

［インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分］
(1)日経225
(2)TOPIX
(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

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

＜ファンドの特色＞

資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

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

国内外の株式・公社債へ分散投資します。

●日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンド(以下これらを「マザーファンド」という場合があります。)への投資を通じて、国内外の株式・公社債へ分散投資します。
●各マザーファンドは、それぞれの資産の市場全体の動きと連動することを目指すインデックス運用を行います。
●実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。
●基本配分比率は以下の通りとします。

基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設けます。

<投資対象とするマザーファンド>

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

ポートフォリオ構築プロセス

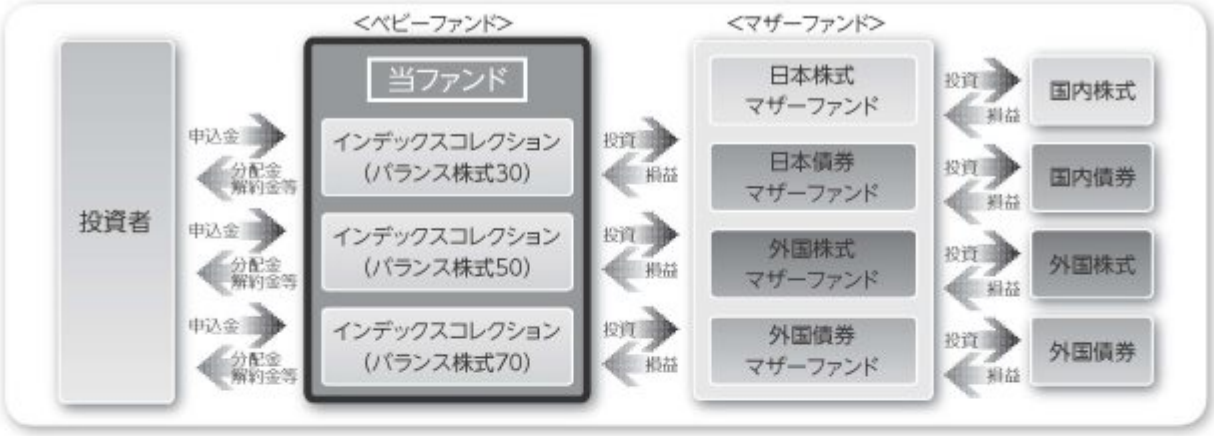
ファンドマネジャーは各ファンドの基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。

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

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

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



分配方針

●年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。
●分配対象額は、経費控除後の配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
●分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
●収益分配金は、自動的にファンドの受益権に再投資されます。
※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●株式への投資割合 … 株式への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

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

●外貨建資産への投資割合 … 外貨建資産への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

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

◆各マザーファンドが対象とする指数は次のとおりです。

日本株式マザーファンド「TOPIX（東証株価指数、配当込み）」

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

日本債券マザーファンド「NOMURA-BPI総合」

「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

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

「MSCIコクサイ・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

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

「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

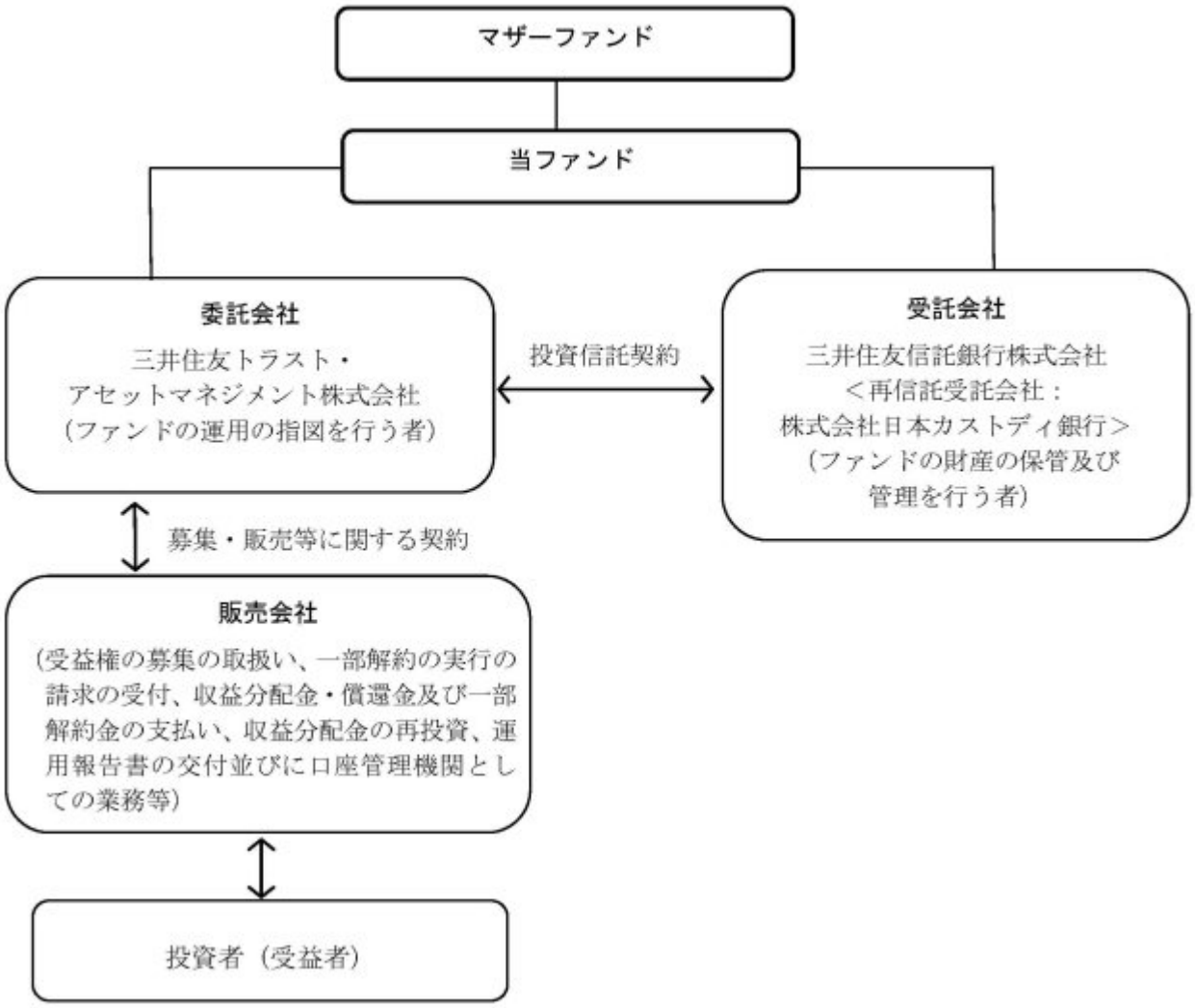
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（２）【ファンドの沿革】

2010年10月20日	信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始
2012年４月１日	当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継 ファンドの名称を中央三井インデックスコレクション（バランス株式３０）からインデックスコレクション（バランス株式３０）、中央三井インデックスコレクション（バランス株式５０）からインデックスコレクション（バランス株式５０）、中央三井インデックスコレクション（バランス株式７０）からインデックスコレクション（バランス株式７０）に変更 当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンドの名称を日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンドの名称を外国株式マザーファンド、中央三井外国債券マザーファンドの名称を外国債券マザーファンドに変更

（３）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2022年 8月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

1986年11月1日：	**住信キャピタルマネジメント株式会社設立**
1987年2月20日：	**投資顧問業の登録**
1987年9月9日：	**投資一任契約に係る業務の認可**
1990年10月1日：	**住信投資顧問株式会社に商号変更**
1999年2月15日：	**住信アセットマネジメント株式会社に商号変更**
1999年3月25日：	**証券投資信託委託業の認可**
2007年9月30日：	**金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）**
2012年4月1日：	**中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更**
2018年10月1日：	**三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継**

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

①　運用方針

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

②　投資態度

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

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

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

C．上記B．の基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設けます。

D．実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、為替予約取引等を活用する場合があります。

E．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引及び債券先物取引等を活用することがあります。このため、株式及び債券の組入総額と株価指数先物取引及び債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

F．ただし、資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。

G．国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

H．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」という場合があります。）を行うことができます。

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

（2）【投資対象】

①　投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

１．有価証券

２．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。）

３．金銭債権（上記１．、２．及び下記４．に掲げるものに該当するものを除きます。）
４．約束手形（上記１．に掲げるものに該当するものを除きます。）

B．次に掲げる特定資産以外の資産
１．為替手形

② 運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「日本株式マザーファンド」、「日本債券マザーファンド」、「外国株式マザーファンド」及び「外国債券マザーファンド」の各受益証券並びに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．株券又は新株引受権証書
２．国債証券
３．地方債証券
４．特別の法律により法人の発行する債券
５．社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
６．資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
８．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証書
９．資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
10．コマーシャル・ペーパー
11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
12．外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記１．から11．までの証券又は証書の性質を有するもの
13．投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。）
14．投資証券又は外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）
15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
16．オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
17．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
18．外国法人が発行する譲渡性預金証書
19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20．抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます。）
21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22．外国の者に対する権利で上記21．の有価証券の性質を有するもの

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

③ 運用指図できる金融商品

A．委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法

第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

１．預金

２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

６．外国の者に対する権利で上記５．の権利の性質を有するもの

Ｂ．金融商品による運用の特例

上記②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記Ａ．に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

２．運用方法

（１）投資対象

わが国の金融商品取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

（２）投資態度

① 株式への投資は、原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

② 株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

③ 運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

④ ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑤ 国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑥ 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

３．投資制限

① 株式への投資割合には制限を設けません。

② 外貨建資産への投資は、行いません。

③ 新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④ 同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑤ 同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７

号及び第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。

⑥　同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。

⑦　投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

⑧　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑨　デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「日本債券マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

２．運用方法

（１）投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

（２）投資態度

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

②　運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③　ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

④　国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑤　信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑥　信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

３．投資制限

①　株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号及び第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②　同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。

③　外貨建資産への投資は、行いません。

④　投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

⑤　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑥　デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国株式マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

（1）投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

（2）投資態度

①　ＭＳＣＩコクサイ・インデックスに採用されている国の株式に投資を行い、同インデックス（配当込み、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

②　株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

③　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

④　運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

⑤　ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑥　国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

⑦　信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑧　信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

3．投資制限

①　外貨建資産への投資には、制限を設けません。

②　株式への投資割合には制限を設けません。

③　新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④　同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑤　同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号及び第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）

への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。

⑥　投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

⑦　同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。

⑧　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑨　デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国債券マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

２．運用方法

（１）投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

（２）投資態度

①　FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

②　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

③　運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

④　ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑤　国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

⑥　信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

３．投資制限

①　株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号及び第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において株

式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

② 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。

③ 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

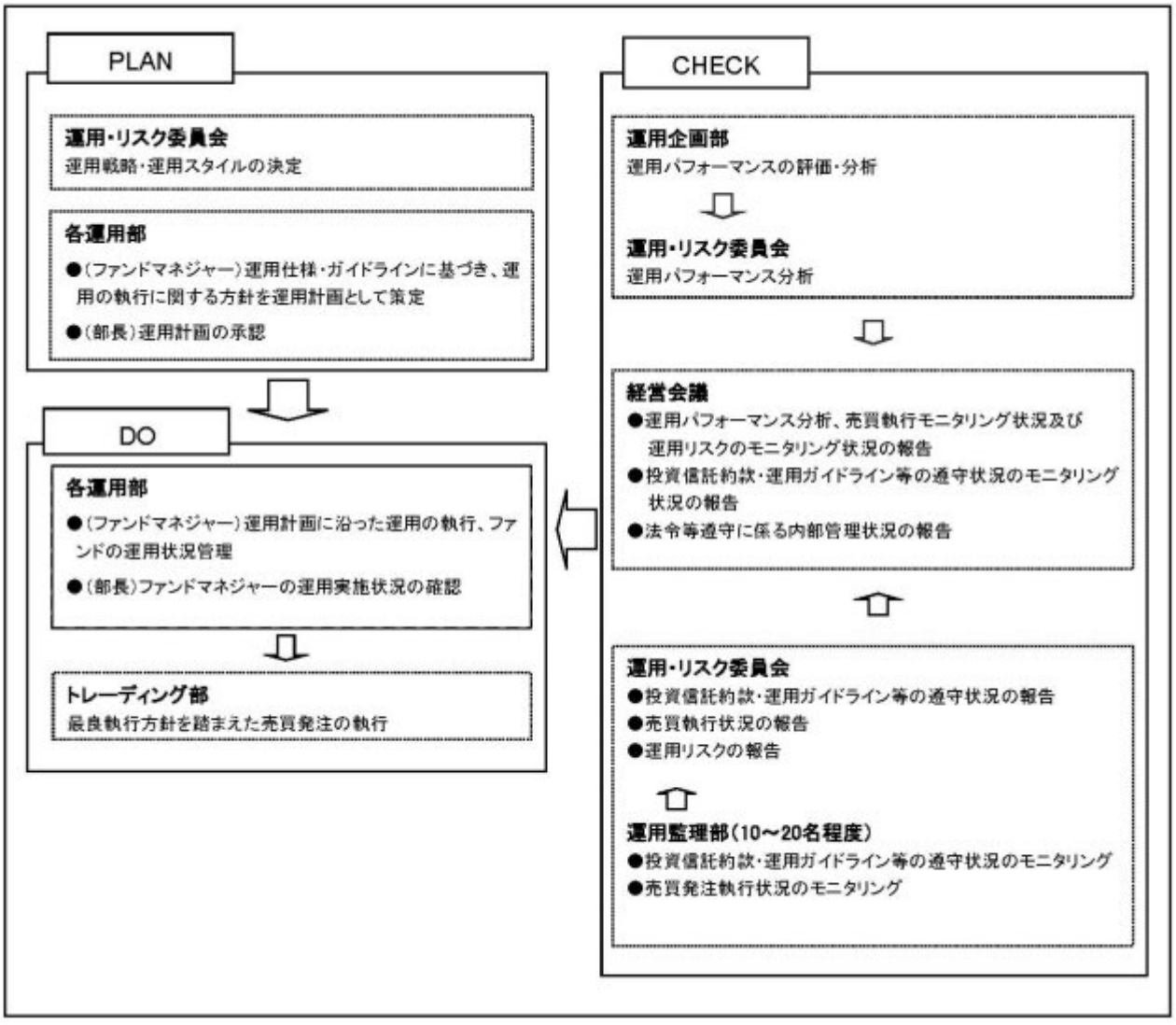
④ 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑥ デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

（３）【運用体制】

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



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行う

に当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

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

（４）【分配方針】

年１回の毎決算時（決算日は７月25日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

①　約款に定める投資制限

Ａ．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

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

Ｂ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

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

Ｃ．新株引受権証券等への投資割合

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

Ｄ．同一銘柄の株式への投資割合

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

Ｅ．同一銘柄の転換社債等への投資割合

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号及び第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。

Ｆ．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

Ｇ．投資信託証券への投資割合

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

Ｈ．投資する株式等の範囲

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第８項第３号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第８項第５号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

Ｉ．信用取引の指図範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

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

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

Ｊ．先物取引等の運用指図

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

ロ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。

ハ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

Ｋ．スワップ取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

L．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引及び為替先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次のａ．及びｂ．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

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

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

ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．ａ．及びｂ．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

N．公社債の空売りの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下記O．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

O．公社債の借入れの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

P．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる

場合には、制約されることがあります。

Q．外国為替予約取引の指図

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

ロ．上記イ．の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

R．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

S．再投資の指図

委託会社は、上記R．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。

T．資金の借入れ

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金、解約代金及び償還金の合計額を限度とします。

ハ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

U．受託会社による資金の立替え

イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。

ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

V．利害関係人等との取引等

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

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

ロ．受託会社は、受託会社が当ファンドの受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託会社又は受託会社の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託会社の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

ハ．委託会社は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託会社、その取締役、執行役及び委託会社の利害関係人等（金融商品取引法第31条の４に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）又は委託会社が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前記（２）に掲げる資産への投資等並びに上記Ｉ．からＯ．まで及びＱ．からＴ．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託会社は、委託会社の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。

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

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

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

＜関連法令に基づく投資制限＞

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（１）ファンドのリスク

●当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①　株価変動リスク

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

② 為替変動リスク

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

③ 金利変動リスク

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

④ 信用リスク

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

⑤ 流動性リスク

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

⑥ カントリーリスク

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

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

① 同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

② 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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

③ ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の６の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

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

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

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

（２）リスクの管理体制

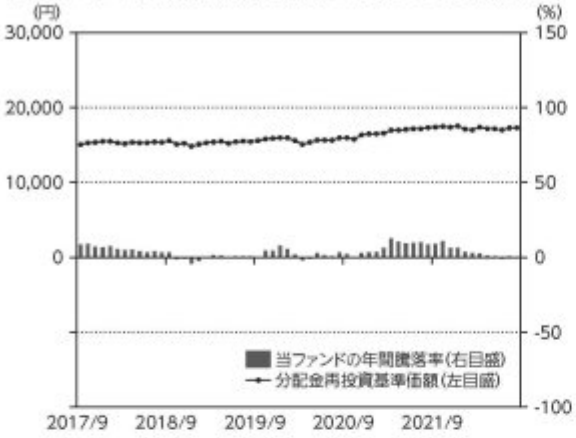
委託会社におけるリスク管理体制

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

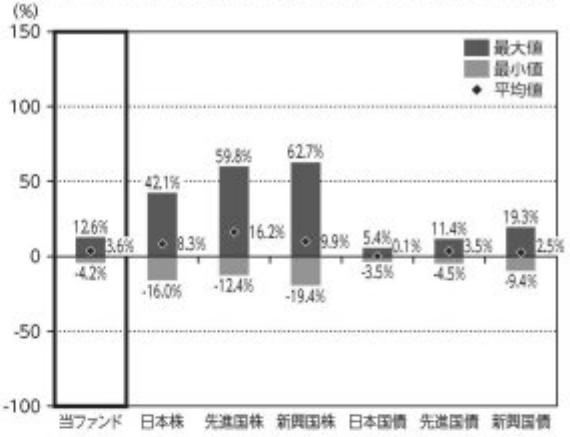
〔参考情報〕

インデックスコレクション(バランス株式30)

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

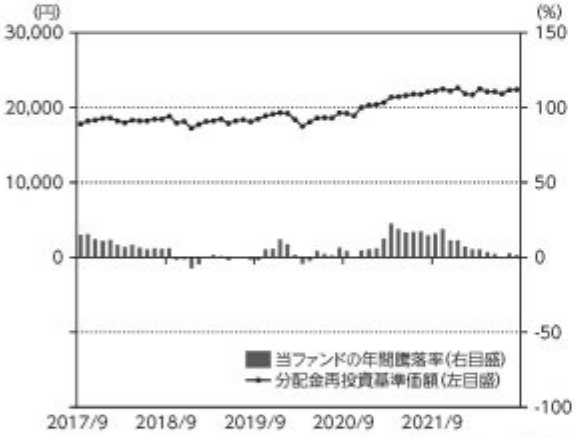


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

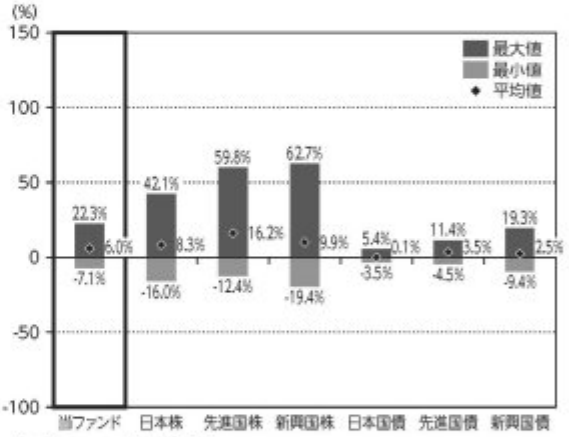


インデックスコレクション(バランス株式50)

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



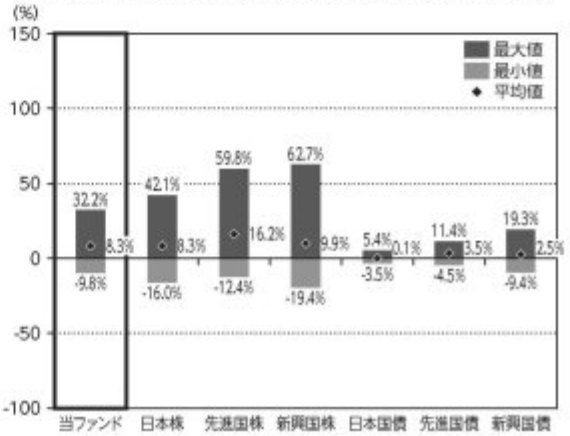
当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



インデックスコレクション(バランス株式70)

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



〔参考情報〕

*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

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

*2017年9月～2022年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・ インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの維持、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（※）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.154%（税抜　0.14%）（※）を乗じて得た額とします（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率　0.099%　　（税抜　0.09%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率　0.033%　　（税抜　0.03%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率　0.022%　　（税抜　0.02%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

（4）【その他の手数料等】

①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、先物取引・オプション取引に要する費用（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料
組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（5）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。
確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。
受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

※上記は、2022年 8月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

５【運用状況】

以下は、2022年8月31日現在の状況について記載してあります。

【インデックスコレクション（バランス株式３０）】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	138,610,148,445	99.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	530,348,513	0.38
合計(純資産総額)		139,140,496,958	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	61,526,104,713	1.3438	82,683,305,519	1.3440	82,691,084,734	59.43
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	12,413,812,250	2.2285	27,664,180,600	2.2522	27,958,387,949	20.09
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	3,222,339,216	4.5481	14,655,520,989	4.6289	14,915,885,996	10.72
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	4,787,781,607	2.7719	13,271,251,837	2.7246	13,044,789,766	9.38

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.62
合計	99.62

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第3期計算期間末 (2013年 7月25日)	3,055,855,651	3,055,855,651	12,198	12,198
第4期計算期間末 (2014年 7月25日)	4,778,573,004	4,778,573,004	12,984	12,984
第5期計算期間末 (2015年 7月27日)	7,218,074,538	7,218,074,538	14,344	14,344
第6期計算期間末 (2016年 7月25日)	26,094,390,333	26,094,390,333	14,066	14,066
第7期計算期間末 (2017年 7月25日)	36,940,752,492	36,940,752,492	14,836	14,836
第8期計算期間末 (2018年 7月25日)	47,046,612,483	47,046,612,483	15,400	15,400
第9期計算期間末 (2019年 7月25日)	58,853,542,284	58,853,542,284	15,526	15,526
第10期計算期間末 (2020年 7月27日)	112,284,528,451	112,284,528,451	15,765	15,765
第11期計算期間末 (2021年 7月26日)	129,179,991,406	129,179,991,406	17,227	17,227
第12期計算期間末 (2022年 7月25日)	137,409,329,672	137,409,329,672	17,240	17,240
2021年 8月末日	131,390,182,213	—	17,313	—
9月末日	132,397,636,915	—	17,372	—
10月末日	133,866,825,909	—	17,476	—
11月末日	133,511,442,738	—	17,347	—
12月末日	134,780,631,015	—	17,526	—
2022年 1月末日	133,116,864,656	—	17,118	—
2月末日	132,067,493,477	—	17,010	—
3月末日	136,441,903,349	—	17,367	—
4月末日	135,625,799,399	—	17,176	—
5月末日	136,299,960,963	—	17,170	—
6月末日	135,845,991,917	—	16,998	—
7月末日	138,547,293,800	—	17,269	—
8月末日	139,140,496,958	—	17,278	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）

第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	0
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	0
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	0
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	0
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	21.8
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	6.4
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	10.5
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	△1.9
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	5.5
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	3.8
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0.8
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	1.5
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	9.3
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	0.1

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	946,841,759	265,501,127	2,505,295,284
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	1,384,516,621	209,546,149	3,680,265,756
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	1,662,961,851	310,939,646	5,032,287,961
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	14,070,621,585	551,965,479	18,550,944,067
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	7,358,731,907	1,010,990,195	24,898,685,779
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	7,713,381,660	2,062,382,166	30,549,685,273
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	8,500,605,703	1,144,421,624	37,905,869,352
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	40,477,320,641	7,158,886,380	71,224,303,613
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	9,629,005,674	5,864,610,694	74,988,698,593
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	8,983,817,540	4,266,776,438	79,705,739,695

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

【インデックスコレクション（バランス株式５０）】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	22,498,340,123	99.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	86,018,872	0.38
合計(純資産総額)		22,584,358,995	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(％)
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	6,658,358,006	1.3439	8,948,648,156	1.3440	8,948,833,160	39.62
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,994,007,836	2.2286	6,672,454,319	2.2522	6,743,104,448	29.86
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	1,000,615,886	4.5482	4,551,001,173	4.6289	4,631,750,874	20.51
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	798,154,460	2.7718	2,212,399,849	2.7246	2,174,651,641	9.63

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.62
合計	99.62

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第3期計算期間末 (2013年 7月25日)	3,298,797,421	3,298,797,421	13,348	13,348
第4期計算期間末 (2014年 7月25日)	4,273,661,874	4,273,661,874	14,552	14,552
第5期計算期間末 (2015年 7月27日)	5,112,201,159	5,112,201,159	16,776	16,776
第6期計算期間末 (2016年 7月25日)	5,810,707,419	5,810,707,419	15,725	15,725
第7期計算期間末 (2017年 7月25日)	6,724,648,904	6,724,648,904	17,405	17,405
第8期計算期間末 (2018年 7月25日)	8,658,183,416	8,658,183,416	18,451	18,451
第9期計算期間末 (2019年 7月25日)	11,669,771,032	11,669,771,032	18,409	18,409
第10期計算期間末 (2020年 7月27日)	13,923,564,557	13,923,564,557	18,866	18,866
第11期計算期間末 (2021年 7月26日)	18,266,192,032	18,266,192,032	21,871	21,871
第12期計算期間末 (2022年 7月25日)	22,060,577,957	22,060,577,957	22,268	22,268
2021年 8月末日	19,117,948,935	—	22,065	—
9月末日	19,507,820,623	—	22,200	—
10月末日	19,884,403,544	—	22,460	—
11月末日	19,835,829,121	—	22,195	—
12月末日	20,412,555,230	—	22,599	—
2022年 1月末日	20,047,320,835	—	21,838	—
2月末日	19,978,458,084	—	21,697	—
3月末日	21,103,529,229	—	22,483	—
4月末日	20,915,721,902	—	22,096	—
5月末日	21,136,851,850	—	22,104	—
6月末日	21,614,726,485	—	21,830	—
7月末日	22,294,614,475	—	22,315	—
8月末日	22,584,358,995	—	22,378	—

②【分配の推移】

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

第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	0
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	35.4
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	9.0
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	15.3
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	△6.3
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	10.7
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	6.0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	△0.2
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	2.5
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	15.9
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	1.8

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	416,815,707	287,930,717	2,471,292,399
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	658,340,834	192,744,346	2,936,888,887
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	449,877,581	339,477,441	3,047,289,027
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	961,565,392	313,575,798	3,695,278,621
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	603,139,592	434,776,876	3,863,641,337
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	1,120,338,164	291,368,383	4,692,611,118
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	2,005,968,696	359,477,733	6,339,102,081
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	1,649,045,263	607,727,034	7,380,420,310
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	1,599,018,504	627,657,001	8,351,781,813
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	2,149,578,883	594,320,528	9,907,040,168

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

【インデックスコレクション（バランス株式７０）】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	15,336,758,688	99.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	59,073,834	0.38
合計(純資産総額)		15,395,832,522	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,753,602,917	2.2283	6,136,082,605	2.2522	6,201,664,489	40.28
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	1,006,786,683	4.5497	4,580,642,157	4.6289	4,660,314,876	30.27
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	2,804,087,724	1.3439	3,768,668,938	1.3440	3,768,693,901	24.48
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	259,151,957	2.7710	718,117,473	2.7246	706,085,422	4.59

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.62
合計	99.62

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第3期計算期間末 (2013年 7月25日)	2,374,954,327	2,374,954,327	14,377	14,377
第4期計算期間末 (2014年 7月25日)	3,063,861,342	3,063,861,342	15,968	15,968
第5期計算期間末 (2015年 7月27日)	3,890,683,336	3,890,683,336	19,106	19,106
第6期計算期間末 (2016年 7月25日)	3,517,186,547	3,517,186,547	17,198	17,198
第7期計算期間末 (2017年 7月25日)	4,084,827,402	4,084,827,402	19,885	19,885
第8期計算期間末 (2018年 7月25日)	5,289,106,724	5,289,106,724	21,519	21,519
第9期計算期間末 (2019年 7月25日)	6,627,304,937	6,627,304,937	21,241	21,241
第10期計算期間末 (2020年 7月27日)	7,965,836,155	7,965,836,155	21,868	21,868
第11期計算期間末 (2021年 7月26日)	11,461,085,557	11,461,085,557	26,791	26,791
第12期計算期間末 (2022年 7月25日)	14,953,795,408	14,953,795,408	27,683	27,683
2021年 8月末日	12,319,876,051	—	27,138	—
9月末日	12,631,009,958	—	27,386	—
10月末日	13,006,962,186	—	27,841	—
11月末日	13,002,192,883	—	27,404	—
12月末日	13,603,828,025	—	28,113	—
2022年 1月末日	13,222,135,353	—	26,887	—
2月末日	13,197,981,533	—	26,727	—
3月末日	14,067,254,989	—	28,066	—
4月末日	13,872,223,880	—	27,412	—
5月末日	14,141,184,361	—	27,451	—
6月末日	14,559,839,851	—	26,995	—
7月末日	15,122,404,519	—	27,765	—
8月末日	15,395,832,522	—	27,923	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	0
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	0
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	0
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	0
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	48.0
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	11.1
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	19.7
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	△10.0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	15.6
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	8.2
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	△1.3
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	3.0
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	22.5
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	3.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	664,273,333	445,609,632	1,651,955,554
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	635,433,541	368,605,971	1,918,783,124
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	672,066,846	554,506,519	2,036,343,451
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	442,910,032	434,101,250	2,045,152,233
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	508,202,695	499,147,088	2,054,207,840
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	778,728,051	375,069,629	2,457,866,262
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	1,031,236,687	369,101,257	3,120,001,692
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	1,230,292,042	707,559,121	3,642,734,613
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	1,243,904,534	608,757,486	4,277,881,661
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	1,822,918,129	698,992,306	5,401,807,484

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

（参考）

日本株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	301,943,311,620	99.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	2,722,919,615	0.89
合計(純資産総額)		304,666,231,235	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	2,727,180,000	0.90

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	5,481,800	2,273.13	12,460,844,034	2,101.50	11,520,002,700	3.78
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	753,300	12,706.75	9,571,994,775	11,135.00	8,387,995,500	2.75
日本	株式	キーエンス	電気機器	109,000	59,071.81	6,438,827,290	52,840.00	5,759,560,000	1.89
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	6,942,000	687.43	4,772,139,060	721.10	5,005,876,200	1.64
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,322,600	3,359.97	4,443,896,322	3,769.00	4,984,879,400	1.64
日本	株式	日立製作所	電気機器	578,300	6,302.25	3,644,591,175	6,996.00	4,045,786,800	1.33
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	707,600	5,348.79	3,784,803,804	5,562.00	3,935,671,200	1.29
日本	株式	任天堂	その他製品	67,900	54,403.84	3,694,020,736	56,990.00	3,869,621,000	1.27
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	823,100	5,904.74	4,860,191,494	4,483.00	3,689,957,300	1.21
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	860,300	3,650.16	3,140,232,648	4,277.00	3,679,503,100	1.21
日本	株式	第一三共	医薬品	872,300	2,622.52	2,287,624,196	4,197.00	3,661,043,100	1.20
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	945,100	3,377.94	3,192,491,094	3,850.00	3,638,635,000	1.19
日本	株式	三菱商事	卸売業	776,500	3,875.60	3,009,403,400	4,564.00	3,543,946,000	1.16
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	76,300	57,824.85	4,412,036,055	44,160.00	3,369,408,000	1.11
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	232,100	14,619.74	3,393,241,654	14,250.00	3,307,425,000	1.09
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	879,100	3,382.05	2,973,160,155	3,724.00	3,273,768,400	1.07
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	769,600	4,163.38	3,204,137,248	4,194.00	3,227,702,400	1.06
日本	株式	ダイキン工業	機械	131,300	24,714.71	3,245,041,423	24,485.00	3,214,880,500	1.06
日本	株式	信越化学工業	化学	186,700	18,675.99	3,486,807,333	16,315.00	3,046,010,500	1.00
日本	株式	三井物産	卸売業	858,500	2,854.30	2,450,416,550	3,266.00	2,803,861,000	0.92
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,787,300	1,450.25	2,592,031,825	1,529.50	2,733,675,350	0.90

日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	710,000	3,685.58	2,616,761,800	3,843.00	2,728,530,000	0.90
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	330,000	6,813.62	2,248,494,600	7,792.00	2,571,360,000	0.84
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	122,200	18,894.29	2,308,882,238	20,850.00	2,547,870,000	0.84
日本	株式	日本電産	電気機器	267,200	10,954.49	2,927,039,728	9,324.00	2,491,372,800	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	328,000	8,557.28	2,806,787,840	7,554.00	2,477,712,000	0.81
日本	株式	ファナック	電気機器	105,500	22,956.52	2,421,912,860	22,535.00	2,377,442,500	0.78
日本	株式	ＳＭＣ	機械	35,200	65,272.65	2,297,597,280	66,600.00	2,344,320,000	0.77
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,422,000	1,583.89	2,252,291,580	1,593.50	2,265,957,000	0.74
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	397,100	5,266.23	2,091,219,933	5,533.00	2,197,154,300	0.72

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.32
		建設業	2.16
		食料品	3.35
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.11
		医薬品	5.28
		石油・石炭製品	0.54
		ゴム製品	0.72
		ガラス・土石製品	0.72
		鉄鋼	0.81
		非鉄金属	0.74
		金属製品	0.60
		機械	5.32
		電気機器	17.33
		輸送用機器	7.98
		精密機器	2.82
		その他製品	2.39
		電気・ガス業	1.26
		陸運業	3.08
		海運業	0.68
		空運業	0.45
		倉庫・運輸関連業	0.16
		情報・通信業	8.97
		卸売業	5.71

		小売業	4.36
		銀行業	5.17
		証券、商品先物取引業	0.72
		保険業	2.19
		その他金融業	1.15
		不動産業	1.92
		サービス業	5.36
		小計	99.11
合計			99.11

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物	買建	139	円	2,725,919,900	2,727,180,000	0.90

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

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

日本債券マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	326,597,425,430	84.12
地方債証券	日本	20,194,482,032	5.20
特殊債券	日本	22,809,207,962	5.88
社債券	日本	16,812,753,000	4.33
	フランス	398,378,000	0.10
	スペイン	199,242,000	0.05
	小計	17,410,373,000	4.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,224,325,576	0.32
合計(純資産総額)		388,235,814,000	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第１４１回利付国債（５年）	3,585,000,000	100.44	3,601,046,100	100.40	3,599,340,000	0.100	2024/9/20	0.93
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	3,560,000,000	100.33	3,571,854,800	100.27	3,569,718,800	0.100	2023/12/20	0.92
日本	国債証券	第３６３回利付国債（１０年）	3,535,000,000	99.90	3,531,465,000	99.00	3,499,862,100	0.100	2031/6/20	0.90
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	3,450,000,000	100.73	3,475,461,000	100.30	3,460,488,000	0.100	2028/3/20	0.89
日本	国債証券	第３３８回利付国債（１０年）	3,410,000,000	101.48	3,460,536,200	101.26	3,453,102,400	0.400	2025/3/20	0.89
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	3,425,000,000	100.69	3,448,838,000	100.54	3,443,700,500	0.100	2027/3/20	0.89
日本	国債証券	第１４９回利付国債（５年）	3,330,000,000	100.20	3,336,660,000	100.24	3,338,091,900	0.005	2026/9/20	0.86
日本	国債証券	第３６５回利付国債（１０年）	3,360,000,000	99.01	3,326,888,800	99.08	3,329,289,600	0.100	2031/12/20	0.86
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	3,320,000,000	100.30	3,329,960,000	99.24	3,294,967,200	0.100	2030/9/20	0.85
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	3,240,000,000	101.70	3,295,144,800	101.49	3,288,567,600	0.400	2025/9/20	0.85
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	3,240,000,000	100.67	3,261,708,000	100.62	3,260,379,600	0.100	2026/9/20	0.84
日本	国債証券	第３４７回利付国債（１０年）	3,205,000,000	100.70	3,227,435,000	100.48	3,220,384,000	0.100	2027/6/20	0.83
日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	3,190,000,000	100.64	3,210,543,600	100.64	3,210,416,000	0.100	2026/3/20	0.83
日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	3,180,000,000	100.63	3,200,151,600	100.58	3,198,475,800	0.100	2026/12/20	0.82
日本	国債証券	第１４５回利付国債（５年）	3,105,000,000	100.60	3,123,630,000	100.58	3,123,040,050	0.100	2025/9/20	0.80
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	3,090,000,000	100.73	3,112,557,000	100.42	3,103,256,100	0.100	2027/9/20	0.80
日本	国債証券	第３３４回利付国債（１０年）	3,010,000,000	101.61	3,058,461,000	101.25	3,047,715,300	0.600	2024/6/20	0.79
日本	国債証券	第１５０回利付国債（５年）	2,960,000,000	99.97	2,959,112,000	100.17	2,965,091,200	0.005	2026/12/20	0.76
日本	国債証券	第３４３回利付国債（１０年）	2,895,000,000	100.66	2,914,107,000	100.64	2,913,730,650	0.100	2026/6/20	0.75
日本	国債証券	第３６１回利付国債（１０年）	2,930,000,000	100.22	2,936,446,000	99.14	2,904,860,600	0.100	2030/12/20	0.75
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	2,870,000,000	100.69	2,889,803,000	100.09	2,872,697,800	0.100	2028/12/20	0.74
日本	国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	2,810,000,000	100.56	2,825,759,300	99.89	2,807,133,800	0.100	2029/6/20	0.72
日本	国債証券	第１４４回利付国債（５年）	2,790,000,000	100.56	2,805,624,000	100.54	2,805,261,300	0.100	2025/6/20	0.72
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	2,780,000,000	100.66	2,798,349,800	100.03	2,780,889,600	0.100	2029/3/20	0.72
日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	2,735,000,000	100.73	2,755,184,300	100.37	2,745,119,500	0.100	2027/12/20	0.71
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	2,730,000,000	100.73	2,749,929,000	100.18	2,734,914,000	0.100	2028/9/20	0.70

日本	国債証券	第１４８回利付国債（５年）	2,720,000,000	100.24	2,726,528,000	100.28	2,727,752,000	0.005	2026/6/20	0.70
日本	国債証券	第３５８回利付国債（１０年）	2,730,000,000	100.34	2,739,476,800	99.40	2,713,729,200	0.100	2030/3/20	0.70
日本	国債証券	第３３９回利付国債（１０年）	2,675,000,000	101.57	2,716,997,500	101.38	2,712,155,750	0.400	2025/6/20	0.70
日本	国債証券	第３３３回利付国債（１０年）	2,680,000,000	101.44	2,718,618,800	101.08	2,709,078,000	0.600	2024/3/20	0.70

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.12
地方債証券	5.20
特殊債券	5.88
社債券	4.48
合計	99.68

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	229,889,636,932	66.31
	イギリス	14,010,800,825	4.04
	カナダ	12,542,225,704	3.62
	スイス	10,677,943,075	3.08
	フランス	9,618,770,495	2.77
	オーストラリア	7,103,285,405	2.05
	ドイツ	6,915,454,570	1.99
	アイルランド	5,702,659,450	1.64
	オランダ	5,596,907,200	1.61

	スウェーデン	2,961,104,727	0.85
	デンマーク	2,547,125,114	0.73
	スペイン	2,261,332,173	0.65
	香港	2,075,963,688	0.60
	イタリア	1,501,868,241	0.43
	フィンランド	1,153,217,645	0.33
	シンガポール	1,084,335,022	0.31
	ジャージー	1,018,720,109	0.29
	ノルウェー	808,639,143	0.23
	イスラエル	775,124,443	0.22
	ベルギー	743,096,041	0.21
	ケイマン	695,706,590	0.20
	バミューダ	472,326,136	0.14
	キュラソー	373,633,319	0.11
	ルクセンブルク	242,982,608	0.07
	ニュージーランド	226,037,418	0.07
	ポルトガル	169,897,218	0.05
	オーストリア	156,240,703	0.05
	リベリア	61,457,526	0.02
	パナマ	57,967,612	0.02
	マン島	55,758,506	0.02
	小計	321,500,217,638	92.74
投資信託受益証券	オーストラリア	102,692,647	0.03
	香港	49,734,092	0.01
	アメリカ	17,938,999	0.01
	小計	170,365,738	0.05
投資証券	アメリカ	6,883,141,261	1.99
	オーストラリア	407,237,390	0.12
	イギリス	160,027,165	0.05
	シンガポール	149,539,399	0.04
	フランス	116,968,419	0.03
	香港	116,890,127	0.03
	カナダ	43,677,516	0.01
	ベルギー	30,699,520	0.01
	小計	7,908,180,797	2.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	17,105,288,360	4.93

合計(純資産総額)	346,684,052,533	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	12,465,349,668	3.60
	買建	カナダ	872,905,572	0.25
	買建	ドイツ	2,778,400,300	0.80
	買建	イギリス	333,324,180	0.10
	買建	オーストラリア	526,542,816	0.15

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	1,022,975,191	0.30
	売建	—	289,863,064	△0.08

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)

アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	809,683	23,854.63	19,314,691,712	22,029.69	17,837,068,160	5.15
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	353,374	42,323.99	14,956,200,134	36,455.53	12,882,436,847	3.72
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	454,960	21,729.82	9,886,201,228	17,845.83	8,119,143,321	2.34
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	130,857	42,265.53	5,530,741,193	38,497.55	5,037,674,031	1.45
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	298,600	19,784.29	5,907,590,817	15,102.35	4,509,562,367	1.30
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	282,060	19,777.12	5,578,336,197	15,236.82	4,297,698,380	1.24
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	46,721	67,007.90	3,130,676,434	72,481.30	3,386,399,247	0.98
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	130,558	23,804.67	3,107,890,911	22,517.67	2,939,862,077	0.85
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	210,256	11,331.38	2,382,491,848	13,351.45	2,807,223,586	0.81
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	124,147	33,572.91	4,167,976,200	21,443.28	2,662,119,925	0.77
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	64,127	43,668.49	2,800,329,692	39,567.77	2,537,362,682	0.73
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	114,468	32,867.78	3,762,309,808	21,787.09	2,493,924,710	0.72
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	146,660	21,088.45	3,092,833,238	15,860.65	2,326,124,146	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	119,071	22,371.09	2,663,748,475	19,433.15	2,313,925,008	0.67
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	82,381	31,624.98	2,605,297,841	27,917.30	2,299,855,866	0.66
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	139,868	16,955.21	2,371,491,731	16,398.78	2,293,665,120	0.66
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	96,745	18,997.87	1,837,949,413	22,266.75	2,154,196,787	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	52,079	49,641.83	2,585,296,942	40,632.45	2,116,097,520	0.61
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	43,362	52,911.01	2,294,327,342	45,444.30	1,970,555,750	0.57
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	279,392	7,347.56	2,052,850,371	6,356.18	1,775,867,379	0.51
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	204,683	8,459.52	1,731,521,678	8,615.85	1,763,518,947	0.51
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	40,232	33,727.05	1,356,906,871	42,564.95	1,712,473,278	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	360,929	6,682.78	2,412,012,067	4,725.89	1,705,713,170	0.49
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	87,899	19,532.24	1,716,864,828	18,791.29	1,651,736,171	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	68,768	23,879.46	1,642,143,037	23,981.60	1,649,166,923	0.48
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	22,048	71,895.70	1,585,156,520	72,661.52	1,602,041,374	0.46

スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	34,930	49,124.59	1,715,922,276	45,055.36	1,573,783,725	0.45
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	125,650	10,920.46	1,372,155,807	12,044.17	1,513,350,513	0.44
アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	19,450	82,338.63	1,601,486,354	76,841.22	1,494,561,781	0.43
イギリス	株式	SHELL PLC-NEW	エネルギー	379,061	3,306.44	1,253,343,281	3,785.31	1,434,863,772	0.41

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	5.28
		素材	3.96
		資本財	5.72
		商業・専門サービス	1.16
		運輸	1.91
		自動車・自動車部品	2.24
		耐久消費財・アパレル	1.53
		消費者サービス	1.69
		メディア・娯楽	5.32
		小売	4.79
		食品・生活必需品小売り	1.50
		食品・飲料・タバコ	4.14
		家庭用品・パーソナル用品	1.69
		ヘルスケア機器・サービス	4.58
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.20
		銀行	5.46
		各種金融	4.45
		保険	2.97
		不動産	0.38
		ソフトウェア・サービス	10.54
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.54
		電気通信サービス	1.43
		公益事業	3.16
		半導体・半導体製造装置	4.10
		小計	92.74
投資信託受益証券	—	—	0.05

投資証券	―	―	2.28
合計			95.07

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	451	アメリカドル	86,191,194.5	11,948,685,293	89,918,125	12,465,349,668	3.60
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	35	カナダドル	8,222,161.5	870,973,568	8,240,400	872,905,572	0.25
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	72	スイスフラン	7,763,214	1,105,481,674	7,845,840	1,117,247,616	0.32
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	336	ユーロ	11,790,829.5	1,639,279,025	11,948,160	1,661,152,684	0.48
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	32	オーストラリアドル	5,314,599	505,630,949	5,534,400	526,542,816	0.15
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	28	イギリスポンド	2,012,385	325,603,893	2,060,100	333,324,180	0.10

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	5,833,100.00	786,918,438	807,680,191	0.23
	ユーロ	買建	1,200,000.00	165,678,000	166,800,000	0.05
	イギリスポンド	買建	300,000.00	48,885,510	48,495,000	0.01
	アメリカドル	売建	1,693,500.00	234,651,106	234,748,048	△0.07
	カナダドル	売建	138,500.00	14,755,111	14,670,016	△0.00
	イギリスポンド	売建	250,000.00	40,445,500	40,445,000	△0.01

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

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

外国債券マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	79,267,938,393	50.53
	フランス	13,268,616,115	8.46
	イタリア	11,855,382,398	7.56
	ドイツ	9,932,400,761	6.33
	スペイン	7,750,388,224	4.94
	イギリス	7,223,703,917	4.61
	中国	3,935,692,298	2.51
	カナダ	3,289,830,510	2.10
	ベルギー	2,943,271,006	1.88
	オランダ	2,445,765,236	1.56
	オーストラリア	2,384,438,229	1.52
	オーストリア	1,854,058,799	1.18
	メキシコ	1,230,160,259	0.78
	アイルランド	996,623,751	0.64
	マレーシア	805,605,306	0.51
	フィンランド	804,522,399	0.51
	シンガポール	657,891,075	0.42
	ポーランド	654,693,437	0.42
	イスラエル	640,724,811	0.41
	デンマーク	564,199,010	0.36
	スウェーデン	391,277,662	0.25
	ノルウェー	319,893,542	0.20
	小計	153,217,077,138	97.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	3,644,545,739	2.32
合計(純資産総額)		156,861,622,877	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
債券先物取引	買建	アメリカ	1,013,557,508	0.65
	買建	ドイツ	897,385,818	0.57

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	2,051,349,600	1.31

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	10,610,000	13,487.72	1,431,047,548	13,094.57	1,389,334,747	0.250	2024/6/15	0.89
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	10,550,000	12,983.99	1,369,811,441	11,938.42	1,259,503,917	1.375	2031/11/15	0.80
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	9,130,000	12,481.03	1,139,518,238	11,431.55	1,043,701,412	0.625	2030/8/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/30/25	8,000,000	12,880.94	1,030,475,606	12,776.70	1,022,136,324	0.375	2025/4/30	0.65
アメリカ	国債証券	T 2.25% 03/31/24	7,300,000	13,805.05	1,007,768,844	13,604.15	993,103,085	2.250	2024/3/31	0.63
アメリカ	国債証券	T 0.125% 08/31/23	7,080,000	13,448.22	952,134,154	13,416.78	949,908,356	0.125	2023/8/31	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	6,900,000	14,429.30	995,622,069	13,348.55	921,050,142	2.625	2029/2/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/25	7,000,000	13,175.26	922,268,572	12,571.46	880,002,665	0.250	2025/9/30	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	7,400,000	12,522.18	926,641,910	11,490.04	850,263,283	0.625	2030/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/30/23	6,000,000	14,260.47	855,628,697	13,768.23	826,094,002	2.875	2023/11/30	0.53
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	14,042.24	849,555,779	13,390.79	810,142,889	2.000	2025/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/29	6,000,000	13,620.12	817,207,215	13,433.03	805,981,828	2.750	2029/5/31	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	6,550,000	13,064.79	855,744,039	11,862.61	777,001,118	1.250	2031/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.125% 01/15/25	5,830,000	13,364.90	779,173,811	13,126.52	765,276,590	1.125	2025/1/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	5,750,000	13,817.51	794,506,941	13,040.42	749,824,486	1.625	2026/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.25% 05/31/28	6,000,000	13,344.22	800,653,236	12,382.47	742,948,499	1.250	2028/5/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	5,460,000	14,178.70	774,157,467	13,586.28	741,810,968	2.375	2024/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	5,500,000	14,147.84	778,131,277	13,351.80	734,349,103	2.250	2025/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/51	6,940,000	13,075.98	907,473,549	10,534.79	731,114,912	2.000	2051/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.375% 08/15/24	5,500,000	13,493.13	742,122,669	13,061.81	718,399,882	0.375	2024/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	6,160,000	12,721.46	783,642,466	11,649.25	717,593,935	0.875	2030/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	5,400,000	13,804.51	745,443,835	13,004.14	702,223,770	1.625	2026/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.25% 12/31/26	5,500,000	13,442.05	739,312,814	12,691.14	698,012,880	1.250	2026/12/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 01/31/24	5,090,000	14,117.24	718,567,780	13,634.74	694,008,669	2.250	2024/1/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	5,260,000	14,173.83	745,543,695	13,168.22	692,648,656	2.250	2027/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/28	5,550,000	13,534.17	751,146,512	12,470.20	692,096,194	1.500	2028/11/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	5,230,000	13,575.45	709,996,088	13,068.58	683,487,000	0.750	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	5,300,000	13,716.78	726,989,802	12,892.04	683,278,571	1.500	2026/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/31/25	5,000,000	14,385.57	719,278,505	13,581.40	679,070,391	2.750	2025/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	5,000,000	14,142.42	707,121,305	13,515.34	675,767,101	2.250	2024/11/15	0.43

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	97.68
合計	97.68

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	25	アメリカドル	2,780,405.88	385,447,667	2,770,507.75	384,075,489	0.24
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	19	アメリカドル	2,234,725.16	309,799,949	2,224,484.47	308,380,282	0.20
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	17	アメリカドル	2,330,610.1	323,092,477	2,316,250	321,101,737	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	11	ユーロ	1,203,783.1	167,361,964	1,195,920	166,268,757	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	15	ユーロ	1,886,011.5	262,212,179	1,850,100	257,219,403	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	23	ユーロ	3,512,348.3	488,321,784	3,408,600	473,897,658	0.30

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	8,420,000.00	1,141,864,343	1,165,875,300	0.74
	カナダドル	買建	770,000.00	80,788,199	81,458,300	0.05
	ユーロ	買建	5,040,000.00	695,476,534	700,560,000	0.45
	イギリスポンド	買建	640,000.00	104,123,289	103,456,000	0.07

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

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

≪参考情報≫

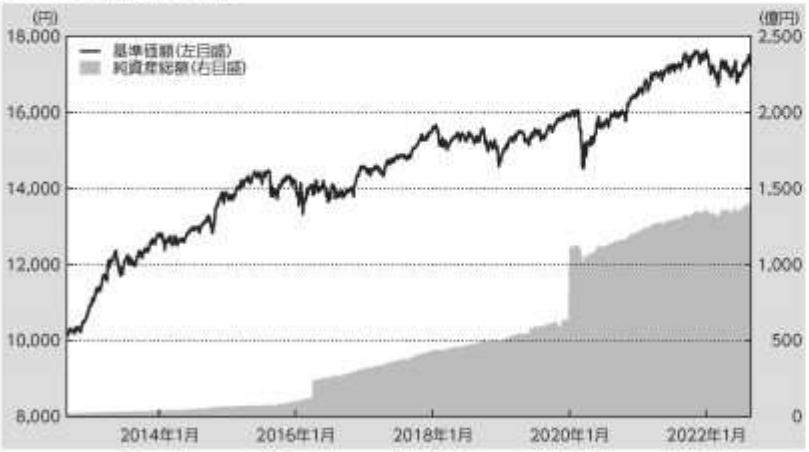
交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2010年10月20日
作成基準日：2022年 8 月31日

インデックスコレクション(バランス株式30)

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	17,278円
純資産総額	1,391.40億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年 7 月	0円
2019年 7 月	0円
2020年 7 月	0円
2021年 7 月	0円
2022年 7 月	0円
設定来分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券マザーファンド	59.4%	第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2024/09/20	0.6%
		第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2023/12/20	0.5%
		第363回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2031/06/20	0.5%
日本株式マザーファンド	20.1%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.8%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.6%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	0.4%
外国株式マザーファンド	10.7%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	0.6%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.4%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.3%
外国債券マザーファンド	9.4%	T 0.25% 06/15/24	アメリカ	国債	-	0.250%	2024/06/15	0.1%
		T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.1%
		T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2022年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

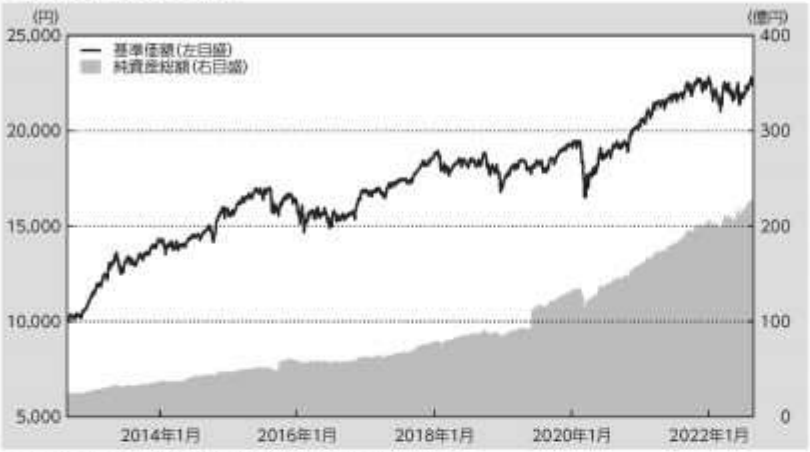
記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

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

当初設定日：2010年10月20日
作成基準日：2022年 8 月31日

インデックスコレクション（バランス株式50）

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	22,378円
純資産総額	225.84億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2018年 7 月	0円
2019年 7 月	0円
2020年 7 月	0円
2021年 7 月	0円
2022年 7 月	0円
設定来分配金合計額	0円

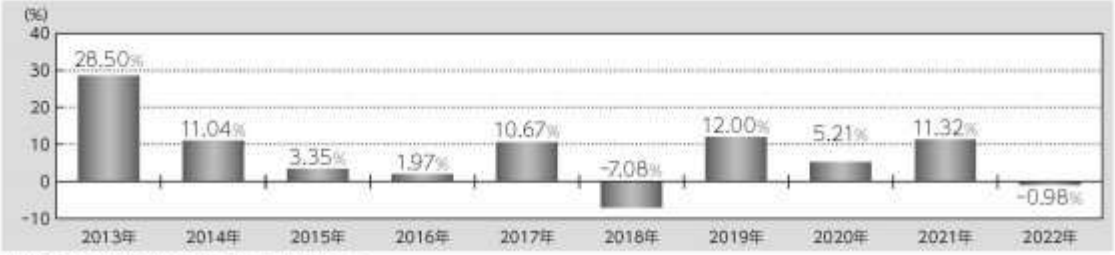
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券マザーファンド	39.6%	第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2024/09/20	0.4%
		第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2023/12/20	0.4%
		第363回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2031/06/20	0.4%
日本株式マザーファンド	29.9%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.1%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.8%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	0.6%
外国株式マザーファンド	20.5%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	1.1%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.8%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.5%
外国債券マザーファンド	9.6%	T 0.25% 06/15/24	アメリカ	国債	-	0.250%	2024/06/15	0.1%
		T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.1%
		T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移（暦年ベース）



※2022年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

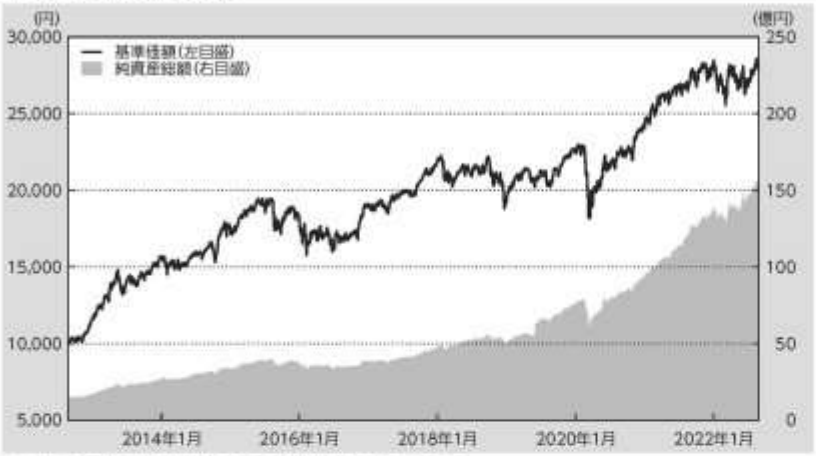
運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページ等でご確認いただけます。

運用実績

当初設定日：2010年10月20日
作成基準日：2022年 8 月31日

インデックスコレクション(バランス株式70)

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	27,923円
純資産総額	153.96億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年 7 月	0円
2019年 7 月	0円
2020年 7 月	0円
2021年 7 月	0円
2022年 7 月	0円
設定来分配金合計額	0円

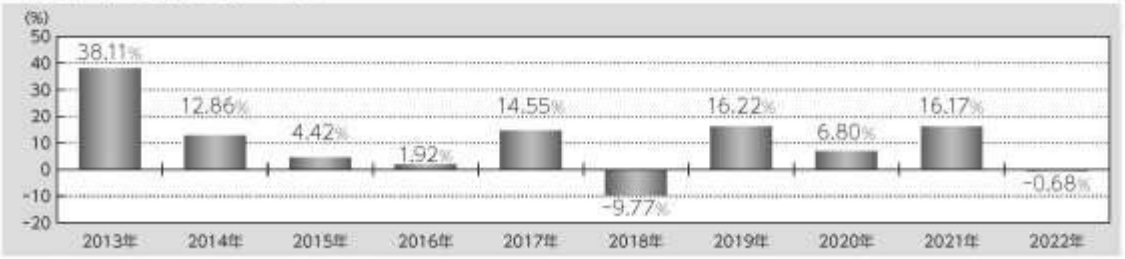
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本株式マザーファンド	40.3%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.5%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	1.1%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	0.8%
外国株式マザーファンド	30.3%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	1.6%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.1%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.7%
日本債券マザーファンド	24.5%	第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2024/09/20	0.2%
		第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2023/12/20	0.2%
		第363回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2031/06/20	0.2%
外国債券マザーファンド	4.6%	T 0.25% 06/15/24	アメリカ	国債	-	0.250%	2024/06/15	0.0%
		T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.0%
		T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2022年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

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

規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。
受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

＜申込コース＞
当ファンドは、「分配金再投資コース」（※）専用ファンドです。
※「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

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

＜申込単位＞
1円以上1円単位とします。

＜申込価額＞
取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。
（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

＜申込手数料＞
ありません。

＜申込代金の支払い＞
販売会社が定める期日までにお支払いください。

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

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

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

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

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

＜一部解約の受付＞

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

＜一部解約単位＞

1口以上1口単位とします。

＜解約価額＞

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（https://www.smtam.jp/）でご覧いただけます。

＜一部解約代金の支払い＞

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

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

＜受付不可日＞

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

ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日

＜一部解約受付の中止等＞

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、及びすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。
一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記＜解約価額＞の規定に準じて計算された価額とします。

＜一部解約の制限＞

当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

＜その他＞

一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

＜問い合わせ先＞

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口当たりに換算した価額で表示することがあります。

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

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

計算日の基準価額で評価します。

B．国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

C．外国上場株式、外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

D．公社債等

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

イ．日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

ロ．金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

ハ．価格情報会社の提供する価額

※　外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2010年10月20日設定）

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

（４）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年７月26日から翌年７月25日までとすることを原則とします。ただし、第１計算期間は2010年10月20日から2011年７月25日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期

間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

・受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合

・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合

・やむを得ない事情が発生した場合

②委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

④上記①から③までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びそ

の内容を監督官庁に届け出ます。
委託会社は、監督官庁の命令に基いて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続に従います。

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約
当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

①信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

②上記①ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

①受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

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

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

④受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

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

有します。

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写を請求することができます。

第３【ファンドの経理状況】

１【財務諸表】

【インデックスコレクション（バランス株式３０）】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期計算期間(2021年7月27日から2022年7月25日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 （2021年 7月26日現在）	第12期 （2022年 7月25日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	681,829,425	620,048,457
親投資信託受益証券	128,612,884,880	136,864,182,708
未収入金	9,433,221	78,936,360
流動資産合計	129,304,147,526	137,563,167,525
資産合計	129,304,147,526	137,563,167,525
負債の部		
流動負債		
未払解約金	27,065,897	50,607,026
未払受託者報酬	13,716,279	14,590,530
未払委託者報酬	82,297,612	87,543,082
未払利息	1,223	252
その他未払費用	1,075,109	1,096,963
流動負債合計	124,156,120	153,837,853
負債合計	124,156,120	153,837,853
純資産の部		
元本等		
元本	74,988,698,593	79,705,739,695
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	54,191,292,813	57,703,589,977
（分配準備積立金）	14,242,034,535	14,980,439,584
元本等合計	129,179,991,406	137,409,329,672
純資産合計	129,179,991,406	137,409,329,672
負債純資産合計	129,304,147,526	137,563,167,525

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期 自　2020年 7月28日 至　2021年 7月26日	第12期 自　2021年 7月27日 至　2022年 7月25日
営業収益		
受取利息	2,612	4,810
有価証券売買等損益	10,929,273,762	307,089,227
営業収益合計	10,929,276,374	307,094,037
営業費用		
支払利息	263,234	247,463
受託者報酬	26,708,609	29,316,606
委託者報酬	160,251,545	175,899,448
その他費用	2,148,391	2,213,589
営業費用合計	189,371,779	207,677,106
営業利益又は営業損失（△）	10,739,904,595	99,416,931
経常利益又は経常損失（△）	10,739,904,595	99,416,931
当期純利益又は当期純損失（△）	10,739,904,595	99,416,931
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（△）	452,184,234	3,050,042
期首剰余金又は期首欠損金（△）	41,060,224,838	54,191,292,813
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,243,617,917	6,500,849,642
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,243,617,917	6,500,849,642
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,400,270,303	3,084,919,367
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,400,270,303	3,084,919,367
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	54,191,292,813	57,703,589,977

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第11期 (2021年 7月26日現在)	第12期 (2022年 7月25日現在)
１． 計算期間の末日における受益権の総数	74,988,698,593口	79,705,739,695口
２． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.7227円 (1万口当たり純資産額) (17,227円)	1口当たり純資産額 1.7240円 (1万口当たり純資産額) (17,240円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第11期
自 2020年 7月28日
至 2021年 7月26日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,480,069,222円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	8,087,265,659円
収益調整金額	C	39,949,258,278円
分配準備積立金額	D	4,674,699,654円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	54,191,292,813円
当ファンドの期末残存口数	F	74,988,698,593口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	7,226円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

第12期
自 2021年 7月27日
至 2022年 7月25日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,503,372,430円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	42,723,150,393円
分配準備積立金額	D	13,477,067,154円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	57,703,589,977円
当ファンドの期末残存口数	F	79,705,739,695口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	7,239円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第12期 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第12期 (2022年 7月25日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	第11期 自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日	第12期 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	71,224,303,613円	74,988,698,593円
期中追加設定元本額	9,629,005,674円	8,983,817,540円
期中一部解約元本額	5,864,610,694円	4,266,776,438円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第11期 (2021年 7月26日現在)	第12期 (2022年 7月25日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	10,165,602,532	395,949,279
合計	10,165,602,532	395,949,279

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	12,360,581,100	27,546,791,039	
	日本債券マザーファンド	60,586,638,973	81,428,442,779	
	外国株式マザーファンド	3,226,454,916	14,675,207,539	
	外国債券マザーファンド	4,766,690,001	13,213,741,351	
合計		80,940,364,990	136,864,182,708	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【インデックスコレクション（バランス株式５０）】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期計算期間(2021年7月27日から2022年7月25日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 （2021年 7月26日現在）	第12期 （2022年 7月25日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	98,735,496	98,540,175
親投資信託受益証券	18,191,206,271	21,972,921,509
未収入金	-	7,071,996
流動資産合計	18,289,941,767	22,078,533,680
資産合計	18,289,941,767	22,078,533,680
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,134,007	1,598,330
未払受託者報酬	1,878,027	2,256,207
未払委託者報酬	11,268,076	13,537,156
未払利息	177	40
その他未払費用	469,448	563,990
流動負債合計	23,749,735	17,955,723
負債合計	23,749,735	17,955,723
純資産の部		
元本等		
元本	8,351,781,813	9,907,040,168
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,914,410,219	12,153,537,789
（分配準備積立金）	4,072,034,139	4,160,105,980
元本等合計	18,266,192,032	22,060,577,957
純資産合計	18,266,192,032	22,060,577,957
負債純資産合計	18,289,941,767	22,078,533,680

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期 自　2020年 7月28日 至　2021年 7月26日	第12期 自　2021年 7月27日 至　2022年 7月25日
営業収益		
受取利息	315	729
有価証券売買等損益	2,384,116,113	389,008,358
営業収益合計	2,384,116,428	389,009,087
営業費用		
支払利息	33,333	36,107
受託者報酬	3,541,482	4,434,624
委託者報酬	21,248,719	26,607,607
その他費用	885,250	1,108,531
営業費用合計	25,708,784	32,186,869
営業利益又は営業損失（△）	2,358,407,644	356,822,218
経常利益又は経常損失（△）	2,358,407,644	356,822,218
当期純利益又は当期純損失（△）	2,358,407,644	356,822,218
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（△）	100,461,959	11,457,912
期首剰余金又は期首欠損金（△）	6,543,144,247	9,914,410,219
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,676,067,116	2,600,830,981
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,676,067,116	2,600,830,981
剰余金減少額又は欠損金増加額	562,746,829	707,067,717
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	562,746,829	707,067,717
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,914,410,219	12,153,537,789

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第11期 (2021年 7月26日現在)	第12期 (2022年 7月25日現在)
１．計算期間の末日における受益権の総数	8,351,781,813口	9,907,040,168口
２．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.1871円 (1万口当たり純資産額) (21,871円)	1口当たり純資産額 2.2268円 (1万口当たり純資産額) (22,268円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第11期
自 2020年 7月28日
至 2021年 7月26日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	231,837,880円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	2,026,107,805円
収益調整金額	C	5,842,376,080円
分配準備積立金額	D	1,814,088,454円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,914,410,219円
当ファンドの期末残存口数	F	8,351,781,813口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	11,871円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

第12期
自 2021年 7月27日
至 2022年 7月25日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	285,583,476円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	59,780,830円
収益調整金額	C	7,993,431,809円
分配準備積立金額	D	3,814,741,674円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	12,153,537,789円
当ファンドの期末残存口数	F	9,907,040,168口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	12,267円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第12期 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第12期 (2022年 7月25日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第11期 自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日	第12期 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	7,380,420,310円	8,351,781,813円
期中追加設定元本額	1,599,018,504円	2,149,578,883円
期中一部解約元本額	627,657,001円	594,320,528円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第11期 (2021年 7月26日現在)	第12期 (2022年 7月25日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	2,231,045,564	402,094,092
合計	2,231,045,564	402,094,092

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,970,071,322	6,619,100,948	
	日本債券マザーファンド	6,428,434,943	8,639,816,563	
	外国株式マザーファンド	993,587,637	4,519,234,008	
	外国債券マザーファンド	791,735,504	2,194,769,990	
合計		11,183,829,406	21,972,921,509	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【インデックスコレクション（バランス株式７０）】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期計算期間(2021年7月27日から2022年7月25日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 （2021年 7月26日現在）	第12期 （2022年 7月25日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	64,491,151	75,547,978
親投資信託受益証券	11,419,045,759	14,894,310,666
未収入金	-	445,484
流動資産合計	11,483,536,910	14,970,304,128
資産合計	11,483,536,910	14,970,304,128
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,132,271	5,616,258
未払受託者報酬	1,147,461	1,502,419
未払委託者報酬	6,884,699	9,014,469
未払利息	115	30
その他未払費用	286,807	375,544
流動負債合計	22,451,353	16,508,720
負債合計	22,451,353	16,508,720
純資産の部		
元本等		
元本	4,277,881,661	5,401,807,484
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,183,203,896	9,551,987,924
（分配準備積立金）	2,581,982,802	2,624,539,959
元本等合計	11,461,085,557	14,953,795,408
純資産合計	11,461,085,557	14,953,795,408
負債純資産合計	11,483,536,910	14,970,304,128

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期 自　2020年 7月28日 至　2021年 7月26日	第12期 自　2021年 7月27日 至　2022年 7月25日
営業収益		
受取利息	211	511
有価証券売買等損益	1,930,580,299	439,610,379
営業収益合計	1,930,580,510	439,610,890
営業費用		
支払利息	18,545	25,136
受託者報酬	2,112,043	2,924,976
委託者報酬	12,672,141	17,549,753
その他費用	527,888	731,127
営業費用合計	15,330,617	21,230,992
営業利益又は営業損失（△）	1,915,249,893	418,379,898
経常利益又は経常損失（△）	1,915,249,893	418,379,898
当期純利益又は当期純損失（△）	1,915,249,893	418,379,898
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（△）	151,130,794	28,205,450
期首剰余金又は期首欠損金（△）	4,323,101,542	7,183,203,896
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,833,564,448	3,158,305,684
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,833,564,448	3,158,305,684
剰余金減少額又は欠損金増加額	737,581,193	1,179,696,104
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	737,581,193	1,179,696,104
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,183,203,896	9,551,987,924

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第11期 (2021年 7月26日現在)	第12期 (2022年 7月25日現在)
１． 計算期間の末日における受益権の総数	4,277,881,661口	5,401,807,484口
２． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.6791円 (1万口当たり純資産額) (26,791円)	1口当たり純資産額 2.7683円 (1万口当たり純資産額) (27,683円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第11期
自 2020年 7月28日
至 2021年 7月26日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	154,103,316円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,610,015,783円
収益調整金額	C	4,601,221,094円
分配準備積立金額	D	817,863,703円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,183,203,896円
当ファンドの期末残存口数	F	4,277,881,661口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	16,791円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

第12期
自 2021年 7月27日
至 2022年 7月25日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	220,281,421円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	169,893,027円
収益調整金額	C	6,927,447,965円
分配準備積立金額	D	2,234,365,511円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,551,987,924円
当ファンドの期末残存口数	F	5,401,807,484口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	17,682円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第12期 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第12期 (2022年 7月25日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	第11期 自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日	第12期 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,642,734,613円	4,277,881,661円
期中追加設定元本額	1,243,904,534円	1,822,918,129円
期中一部解約元本額	608,757,486円	698,992,306円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第11期 (2021年 7月26日現在)	第12期 (2022年 7月25日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,877,289,629	439,324,222
合計	1,877,289,629	439,324,222

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,703,989,973	6,026,112,053	
	日本債券マザーファンド	2,727,929,782	3,666,337,627	
	外国株式マザーファンド	988,800,641	4,497,460,835	
	外国債券マザーファンド	254,103,442	704,400,151	
合計		6,674,823,838	14,894,310,666	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月25日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,374,112,634
株式	299,712,490,320
派生商品評価勘定	42,747,300
未収入金	758,686,887
未収配当金	427,539,309
差入委託証拠金	66,107,300
流動資産合計	302,381,683,750
資産合計	302,381,683,750
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,814,800
前受金	38,951,200
未払金	438,450
未払解約金	491,816,603
未払利息	559
流動負債合計	535,021,612
負債合計	535,021,612
純資産の部	
元本等	
元本	135,440,792,758
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	166,405,869,380

	2022年 7月25日現在
項目	金額（円）
元本等合計	301,846,662,138
純資産合計	301,846,662,138
負債純資産合計	302,381,683,750

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 7月25日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月25日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	135,440,792,758口
2．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.2286円 (1万口当たり純資産額) (22,286円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2022年 7月25日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月25日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 7月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月27日
期首元本額	133,516,172,873円
期中追加設定元本額	10,967,966,860円
期中一部解約元本額	9,043,346,975円
期末元本額	135,440,792,758円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	614,431,733円
ＤＣ日本株式インデックスファンド	289,015,491円
ＤＣ日本株式インデックスファンドＬ	53,888,428,077円
ＤＣ日本株式インデックスファンドＡ	664,326,423円
ＤＣバランスファンド３０	2,433,151,911円
ＤＣバランスファンド５０	3,810,580,363円
ＤＣバランスファンド７０	2,315,813,582円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	576,228,395円
日本株式インデックスｅ	1,454,519,313円
インデックスコレクション（国内株式）	21,376,486,674円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	12,360,581,100円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	2,970,071,322円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	2,703,989,973円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,503,504,901円
日本株式パッシブファンド私募Ａ（適格機関投資家専用）	2,747,031,538円
日本株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	945,544,352円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	47,354,650円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	530,435,125円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	65,889,800円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	130,918,304円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	87,710,306円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	670,764,688円

区分	2022年 7月25日現在
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	416,729,867円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	7,274,523,570円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	696,113,028円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	67,576,872円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	1,188,492,618円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	24,764,450円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	144,874,181円
バランスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	1,900,184,826円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	52,171,958円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	53,497,721円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	20,318,789円
バランスファンドＶＡ２（適格機関投資家専用）	586,145,334円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	261,702,011円
バランスファンドＶＡ３（適格機関投資家専用）	4,326,926,745円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	81,448,785円
国内バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	34,041,302円
国内バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	8,081,091円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	114,113,728円
私募日本株式インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	2,307,861円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,448,030,642
合計	2,448,030,642

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 7月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,846,243,800	－	1,885,195,000	38,951,200
合計		1,846,243,800	－	1,885,195,000	38,951,200

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数（株）	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,300	3,630.00	19,239,000	
日本水産	151,300	595.00	90,023,500	
マルハニチロ	21,600	2,489.00	53,762,400	
雪国まいたけ	11,900	955.00	11,364,500	
カネコ種苗	4,600	1,649.00	7,585,400	
サカタのタネ	17,700	4,930.00	87,261,000	
ホクト	12,400	1,929.00	23,919,600	
ホクリヨウ	2,200	614.00	1,350,800	
住石ホールディングス	28,500	212.00	6,042,000	
日鉄鉱業	3,100	5,360.00	16,616,000	
三井松島ホールディングス	6,800	3,175.00	21,590,000	
ＩＮＰＥＸ	568,200	1,394.00	792,070,800	
石油資源開発	19,200	3,270.00	62,784,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	6,300	1,552.00	9,777,600	
ショーボンドホールディングス	19,000	5,720.00	108,680,000	
ミライト・ワン	52,500	1,683.00	88,357,500	
タマホーム	9,900	2,504.00	24,789,600	
サンヨーホームズ	1,900	711.00	1,350,900	
日本アクア	6,500	604.00	3,926,000	
ファーストコーポレーション	4,000	735.00	2,940,000	
ベステラ	3,300	1,138.00	3,755,400	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	27,200	200.00	5,440,000	
キャンディル	2,400	554.00	1,329,600	
ダイセキ環境ソリューション	3,100	836.00	2,591,600	
第一カッター興業	3,600	1,329.00	4,784,400	
安藤・間	74,200	874.00	64,850,800	
東急建設	43,700	636.00	27,793,200	
コムシスホールディングス	52,500	2,656.00	139,440,000	
ビーアールホールディングス	20,500	348.00	7,134,000	
高松コンストラクショングループ	10,400	2,118.00	22,027,200	
東建コーポレーション	4,500	8,760.00	39,420,000	

ソネック	1,700	1,002.00	1,703,400	
ヤマウラ	7,100	959.00	6,808,900	
オリエンタル白石	54,800	245.00	13,426,000	
大成建設	104,700	4,285.00	448,639,500	
大林組	349,400	982.00	343,110,800	
清水建設	323,100	768.00	248,140,800	
飛島建設	10,100	1,067.00	10,776,700	
長谷工コーポレーション	100,800	1,638.00	165,110,400	
松井建設	12,500	641.00	8,012,500	
錢高組	1,400	3,245.00	4,543,000	
鹿島建設	256,000	1,518.00	388,608,000	
不動テトラ	8,000	1,654.00	13,232,000	
大末建設	4,000	1,565.00	6,260,000	
鉄建建設	7,600	1,833.00	13,930,800	
西松建設	22,800	3,995.00	91,086,000	
三井住友建設	84,800	458.00	38,838,400	
大豊建設	5,500	4,310.00	23,705,000	
佐田建設	8,100	453.00	3,669,300	
ナカノフドー建設	9,000	324.00	2,916,000	
奥村組	18,700	2,975.00	55,632,500	
東鉄工業	14,800	2,372.00	35,105,600	
イチケン	2,700	1,815.00	4,900,500	
富士ピー・エス	4,900	461.00	2,258,900	
淺沼組	4,200	5,420.00	22,764,000	
戸田建設	144,200	719.00	103,679,800	
熊谷組	18,600	2,835.00	52,731,000	
北野建設	2,300	2,133.00	4,905,900	
植木組	3,100	1,368.00	4,240,800	
矢作建設工業	15,000	808.00	12,120,000	
ピーエス三菱	12,400	631.00	7,824,400	
日本ハウスホールディングス	25,300	411.00	10,398,300	
大東建託	38,500	12,470.00	480,095,000	
新日本建設	16,000	743.00	11,888,000	
東亜道路工業	1,900	5,960.00	11,324,000	
日本道路	3,300	6,950.00	22,935,000	
東亜建設工業	8,400	2,602.00	21,856,800	
日本国土開発	29,300	597.00	17,492,100	
若築建設	5,800	2,368.00	13,734,400	
東洋建設	42,200	864.00	36,460,800	
五洋建設	138,500	730.00	101,105,000	
世紀東急工業	18,100	822.00	14,878,200	
福田組	4,000	4,895.00	19,580,000	

住友林業	82,400	2,100.00	173,040,000	
日本基礎技術	9,200	594.00	5,464,800	
巴コーポレーション	13,700	457.00	6,260,900	
大和ハウス工業	297,800	3,287.00	978,868,600	
ライト工業	20,700	1,924.00	39,826,800	
積水ハウス	357,100	2,440.50	871,502,550	
日特建設	7,800	871.00	6,793,800	
北陸電気工事	6,700	805.00	5,393,500	
ユアテック	21,500	742.00	15,953,000	
日本リーテック	7,200	976.00	7,027,200	
四電工	3,600	1,813.00	6,526,800	
中電工	15,200	2,162.00	32,862,400	
関電工	61,200	865.00	52,938,000	
きんでん	76,400	1,620.00	123,768,000	
東京エネシス	11,100	1,056.00	11,721,600	
トーエネック	3,800	3,800.00	14,440,000	
住友電設	9,300	2,678.00	24,905,400	
日本電設工業	16,000	1,836.00	29,376,000	
エクシオグループ	52,200	2,207.00	115,205,400	
新日本空調	8,100	1,912.00	15,487,200	
九電工	23,800	2,780.00	66,164,000	
三機工業	24,400	1,674.00	40,845,600	
日揮ホールディングス	106,300	1,622.00	172,418,600	
中外炉工業	3,500	1,688.00	5,908,000	
ヤマト	9,000	772.00	6,948,000	
太平電業	6,800	3,060.00	20,808,000	
高砂熱学工業	28,800	1,698.00	48,902,400	
三晃金属工業	1,500	2,665.00	3,997,500	
朝日工業社	4,600	1,913.00	8,799,800	
明星工業	18,900	733.00	13,853,700	
大氣社	15,700	3,270.00	51,339,000	
ダイダン	7,100	2,215.00	15,726,500	
日比谷総合設備	10,200	1,994.00	20,338,800	
フィル・カンパニー	1,900	1,227.00	2,331,300	
テスホールディングス	10,500	1,196.00	12,558,000	
インフロニア・ホールディングス	131,000	983.00	128,773,000	
東洋エンジニアリング	15,800	641.00	10,127,800	
レイズネクスト	16,100	1,218.00	19,609,800	
ニップン	29,400	1,631.00	47,951,400	
日清製粉グループ本社	113,400	1,652.00	187,336,800	
日東富士製粉	1,700	4,645.00	7,896,500	
昭和産業	9,500	2,594.00	24,643,000	

鳥越製粉	8,700	661.00	5,750,700	
中部飼料	12,400	1,104.00	13,689,600	
フィード・ワン	14,300	694.00	9,924,200	
東洋精糖	2,000	924.00	1,848,000	
日本甜菜製糖	6,300	1,705.00	10,741,500	
DM三井製糖ホールディングス	9,700	1,919.00	18,614,300	
塩水港精糖	14,300	208.00	2,974,400	
日新製糖	5,700	1,785.00	10,174,500	
森永製菓	24,200	4,340.00	105,028,000	
中村屋	2,400	3,200.00	7,680,000	
江崎グリコ	28,100	3,980.00	111,838,000	
名糖産業	4,300	1,698.00	7,301,400	
井村屋グループ	5,800	2,296.00	13,316,800	
不二家	6,700	2,484.00	16,642,800	
山崎製パン	73,900	1,664.00	122,969,600	
第一屋製パン	2,300	493.00	1,133,900	
モロゾフ	3,600	3,620.00	13,032,000	
亀田製菓	6,200	4,705.00	29,171,000	
寿スピリッツ	10,400	6,580.00	68,432,000	
カルビー	54,900	2,876.00	157,892,400	
森永乳業	20,400	5,120.00	104,448,000	
六甲バター	8,000	1,408.00	11,264,000	
ヤクルト本社	76,500	7,920.00	605,880,000	
明治ホールディングス	66,300	7,040.00	466,752,000	
雪印メグミルク	26,400	1,882.00	49,684,800	
プリマハム	15,100	2,310.00	34,881,000	
日本ハム	42,200	4,160.00	175,552,000	
林兼産業	3,700	476.00	1,761,200	
丸大食品	10,900	1,594.00	17,374,600	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	10,800	3,065.00	33,102,000	
柿安本店	4,200	2,386.00	10,021,200	
伊藤ハム米久ホールディングス	77,500	683.00	52,932,500	
サッポロホールディングス	35,200	2,962.00	104,262,400	
アサヒグループホールディングス	245,500	4,672.00	1,146,976,000	
キリンホールディングス	442,600	2,198.00	972,834,800	
宝ホールディングス	67,000	1,062.00	71,154,000	
オエノンホールディングス	31,800	307.00	9,762,600	
養命酒製造	3,200	1,807.00	5,782,400	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	76,800	1,535.00	117,888,000	
サントリー食品インターナショナル	80,600	5,250.00	423,150,000	
ダイドーグループホールディングス	6,200	5,210.00	32,302,000	
伊藤園	36,600	6,310.00	230,946,000	

キーコーヒー	11,000	2,133.00	23,463,000	
ユニカフェ	3,600	916.00	3,297,600	
ジャパンフーズ	1,700	1,126.00	1,914,200	
日清オイリオグループ	13,800	3,220.00	44,436,000	
不二製油グループ本社	26,100	2,289.00	59,742,900	
かどや製油	1,100	3,585.00	3,943,500	
Ｊ－オイルミルズ	11,200	1,624.00	18,188,800	
キッコーマン	72,200	8,120.00	586,264,000	
味の素	240,000	3,492.00	838,080,000	
ブルドックソース	4,300	1,898.00	8,161,400	
キユーピー	52,700	2,316.00	122,053,200	
ハウス食品グループ本社	37,500	2,979.00	111,712,500	
カゴメ	45,700	3,420.00	156,294,000	
焼津水産化学工業	4,900	920.00	4,508,000	
アリアケジャパン	11,000	5,360.00	58,960,000	
ピエトロ	1,600	1,820.00	2,912,000	
エバラ食品工業	2,600	3,075.00	7,995,000	
やまみ	1,000	1,605.00	1,605,000	
ニチレイ	44,900	2,418.00	108,568,200	
東洋水産	53,700	5,400.00	289,980,000	
イートアンドホールディングス	4,500	2,380.00	10,710,000	
大冷	1,300	1,904.00	2,475,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,200	467.00	2,895,400	
日清食品ホールディングス	38,800	9,650.00	374,420,000	
永谷園ホールディングス	5,300	2,034.00	10,780,200	
一正蒲鉾	4,700	790.00	3,713,000	
フジッコ	11,200	2,003.00	22,433,600	
ロック・フィールド	12,000	1,514.00	18,168,000	
日本たばこ産業	645,700	2,411.00	1,556,782,700	
ケンコーマヨネーズ	6,100	1,500.00	9,150,000	
わらべや日洋ホールディングス	7,200	2,209.00	15,904,800	
なとり	6,700	2,076.00	13,909,200	
イフジ産業	2,100	939.00	1,971,900	
ピックルスコーポレーション	5,700	1,148.00	6,543,600	
ファーマフーズ	15,200	1,423.00	21,629,600	
ユーグレナ	62,100	891.00	55,331,100	
紀文食品	9,400	998.00	9,381,200	
ミヨシ油脂	4,200	1,019.00	4,279,800	
理研ビタミン	8,500	1,773.00	15,070,500	
片倉工業	10,700	2,066.00	22,106,200	
グンゼ	6,900	3,875.00	26,737,500	
東洋紡	46,800	1,019.00	47,689,200	

ユニチカ	33,700	235.00	7,919,500	
富士紡ホールディングス	4,900	3,435.00	16,831,500	
倉敷紡績	8,400	2,108.00	17,707,200	
シキボウ	6,200	901.00	5,586,200	
日本毛織	29,300	1,048.00	30,706,400	
トーア紡コーポレーション	4,300	367.00	1,578,100	
帝国繊維	12,500	1,711.00	21,387,500	
帝人	103,500	1,439.00	148,936,500	
東レ	729,700	733.60	535,307,920	
住江織物	2,000	1,675.00	3,350,000	
日本フエルト	7,400	420.00	3,108,000	
イチカワ	1,600	1,394.00	2,230,400	
日東製網	1,300	1,329.00	1,727,700	
アツギ	8,600	485.00	4,171,000	
ダイニック	3,800	639.00	2,428,200	
セーレン	21,800	2,063.00	44,973,400	
ソトー	4,400	840.00	3,696,000	
東海染工	1,500	1,140.00	1,710,000	
小松マテーレ	17,800	1,074.00	19,117,200	
ワコールホールディングス	24,100	2,225.00	53,622,500	
ホギメディカル	14,600	3,470.00	50,662,000	
ＴＳＩホールディングス	36,100	325.00	11,732,500	
マツオカコーポレーション	3,500	933.00	3,265,500	
ワールド	15,500	1,317.00	20,413,500	
三陽商会	5,200	896.00	4,659,200	
ナイガイ	4,400	273.00	1,201,200	
オンワードホールディングス	65,200	250.00	16,300,000	
ルックホールディングス	3,800	1,668.00	6,338,400	
ゴールドウイン	19,500	8,300.00	161,850,000	
デサント	20,100	2,945.00	59,194,500	
キング	5,800	499.00	2,894,200	
ヤマトインターナショナル	9,200	279.00	2,566,800	
特種東海製紙	6,100	3,190.00	19,459,000	
王子ホールディングス	453,400	566.00	256,624,400	
日本製紙	47,600	986.00	46,933,600	
三菱製紙	15,000	302.00	4,530,000	
北越コーポレーション	70,100	706.00	49,490,600	
中越パルプ工業	4,500	919.00	4,135,500	
巴川製紙所	3,500	688.00	2,408,000	
大王製紙	50,400	1,454.00	73,281,600	
阿波製紙	2,700	300.00	810,000	
レンゴー	90,900	763.00	69,356,700	

トーモク	5,800	1,545.00	8,961,000	
ザ・パック	7,400	2,474.00	18,307,600	
北の達人コーポレーション	42,000	235.00	9,870,000	
クラレ	158,600	1,088.00	172,556,800	
旭化成	726,900	1,084.00	787,959,600	
共和レザー	6,400	571.00	3,654,400	
昭和電工	103,300	2,190.00	226,227,000	
住友化学	801,700	523.00	419,289,100	
住友精化	4,700	2,997.00	14,085,900	
日産化学	52,900	6,810.00	360,249,000	
ラサ工業	4,100	1,875.00	7,687,500	
クレハ	8,500	10,190.00	86,615,000	
多木化学	3,900	4,725.00	18,427,500	
テイカ	6,700	1,229.00	8,234,300	
石原産業	21,100	1,037.00	21,880,700	
片倉コープアグリ	2,600	1,245.00	3,237,000	
日本曹達	12,900	4,255.00	54,889,500	
東ソー	145,300	1,756.00	255,146,800	
トクヤマ	34,900	1,795.00	62,645,500	
セントラル硝子	17,600	3,235.00	56,936,000	
東亞合成	56,000	1,061.00	59,416,000	
大阪ソーダ	9,000	3,360.00	30,240,000	
関東電化工業	21,400	900.00	19,260,000	
デンカ	39,600	3,395.00	134,442,000	
信越化学工業	186,300	16,145.00	3,007,813,500	
日本カーバイド工業	4,200	1,374.00	5,770,800	
堺化学工業	7,600	1,915.00	14,554,000	
第一稀元素化学工業	10,000	1,186.00	11,860,000	
エア・ウォーター	94,100	1,790.00	168,439,000	
日本酸素ホールディングス	96,800	2,190.00	211,992,000	
日本化学工業	3,300	2,001.00	6,603,300	
東邦アセチレン	2,300	1,132.00	2,603,600	
日本パーカライジング	49,400	966.00	47,720,400	
高圧ガス工業	16,600	689.00	11,437,400	
チタン工業	1,400	1,630.00	2,282,000	
四国化成工業	13,600	1,320.00	17,952,000	
戸田工業	2,500	2,361.00	5,902,500	
ステラ　ケミファ	5,900	2,500.00	14,750,000	
保土谷化学工業	3,100	3,460.00	10,726,000	
日本触媒	16,700	5,410.00	90,347,000	
大日精化工業	8,300	1,822.00	15,122,600	
カネカ	25,300	3,550.00	89,815,000	

三菱瓦斯化学	92,500	1,950.00	180,375,000	
三井化学	91,500	2,835.00	259,402,500	
ＪＳＲ	109,500	3,645.00	399,127,500	
東京応化工業	17,500	6,880.00	120,400,000	
大阪有機化学工業	8,300	2,472.00	20,517,600	
三菱ケミカルグループ	729,400	745.40	543,694,760	
ＫＨネオケム	18,000	2,545.00	45,810,000	
ダイセル	158,000	856.00	135,248,000	
住友ベークライト	16,600	4,300.00	71,380,000	
積水化学工業	224,500	1,911.00	429,019,500	
日本ゼオン	88,300	1,434.00	126,622,200	
アイカ工業	27,700	3,015.00	83,515,500	
ＵＢＥ	55,400	2,102.00	116,450,800	
積水樹脂	16,100	1,766.00	28,432,600	
タキロンシーアイ	25,400	561.00	14,249,400	
旭有機材	6,600	2,082.00	13,741,200	
ニチバン	6,200	1,661.00	10,298,200	
リケンテクノス	23,900	463.00	11,065,700	
大倉工業	5,100	1,754.00	8,945,400	
積水化成品工業	14,000	417.00	5,838,000	
群栄化学工業	2,300	2,592.00	5,961,600	
タイガースポリマー	5,600	431.00	2,413,600	
ミライアル	3,800	1,791.00	6,805,800	
ダイキアクシス	4,600	715.00	3,289,000	
ダイキョーニシカワ	24,800	557.00	13,813,600	
竹本容器	4,200	778.00	3,267,600	
森六ホールディングス	5,700	1,880.00	10,716,000	
恵和	3,200	3,525.00	11,280,000	
日本化薬	82,600	1,144.00	94,494,400	
カーリットホールディングス	9,900	670.00	6,633,000	
日本精化	7,600	1,992.00	15,139,200	
扶桑化学工業	9,300	3,450.00	32,085,000	
トリケミカル研究所	12,100	2,186.00	26,450,600	
ＡＤＥＫＡ	46,400	2,400.00	111,360,000	
日油	33,900	5,320.00	180,348,000	
新日本理化	16,700	286.00	4,776,200	
ハリマ化成グループ	7,800	765.00	5,967,000	
花王	247,700	5,793.00	1,434,926,100	
第一工業製薬	4,000	2,497.00	9,988,000	
石原ケミカル	5,500	1,302.00	7,161,000	
日華化学	4,000	818.00	3,272,000	
ニイタカ	2,200	2,370.00	5,214,000	

三洋化成工業	7,000	4,770.00	33,390,000	
有機合成薬品工業	8,200	271.00	2,222,200	
大日本塗料	13,300	732.00	9,735,600	
日本ペイントホールディングス	441,500	1,039.00	458,718,500	
関西ペイント	101,600	1,936.00	196,697,600	
神東塗料	9,200	148.00	1,361,600	
中国塗料	25,400	882.00	22,402,800	
日本特殊塗料	7,000	981.00	6,867,000	
藤倉化成	14,600	490.00	7,154,000	
太陽ホールディングス	17,300	2,867.00	49,599,100	
ＤＩＣ	42,500	2,476.00	105,230,000	
サカタインクス	20,200	988.00	19,957,600	
東洋インキＳＣホールディングス	21,700	1,945.00	42,206,500	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	9,500	870.00	8,265,000	
富士フイルムホールディングス	210,900	7,591.00	1,600,941,900	
資生堂	223,500	5,486.00	1,226,121,000	
ライオン	119,900	1,554.00	186,324,600	
高砂香料工業	6,800	2,639.00	17,945,200	
マンダム	23,400	1,651.00	38,633,400	
ミルボン	14,800	5,250.00	77,700,000	
ファンケル	48,600	2,563.00	124,561,800	
コーセー	22,600	12,050.00	272,330,000	
コタ	8,400	1,622.00	13,624,800	
シーボン	1,600	1,692.00	2,707,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	51,200	1,641.00	84,019,200	
ノエビアホールディングス	8,900	5,960.00	53,044,000	
アジュバンホールディングス	2,700	979.00	2,643,300	
新日本製薬	5,700	1,603.00	9,137,100	
エステー	7,700	1,568.00	12,073,600	
アグロ　カネショウ	4,000	1,363.00	5,452,000	
コニシ	18,200	1,624.00	29,556,800	
長谷川香料	20,700	3,080.00	63,756,000	
星光ＰＭＣ	6,800	540.00	3,672,000	
小林製薬	33,600	9,030.00	303,408,000	
荒川化学工業	8,500	1,027.00	8,729,500	
メック	8,200	2,340.00	19,188,000	
日本高純度化学	2,800	2,397.00	6,711,600	
タカラバイオ	31,400	2,187.00	68,671,800	
ＪＣＵ	12,300	3,575.00	43,972,500	
新田ゼラチン	6,800	620.00	4,216,000	
ＯＡＴアグリオ	4,900	1,600.00	7,840,000	
デクセリアルズ	31,200	3,855.00	120,276,000	

アース製薬	9,900	5,480.00	54,252,000	
北興化学工業	10,100	952.00	9,615,200	
大成ラミック	3,200	2,753.00	8,809,600	
クミアイ化学工業	44,700	1,009.00	45,102,300	
日本農薬	21,400	669.00	14,316,600	
アキレス	7,700	1,410.00	10,857,000	
有沢製作所	16,300	1,018.00	16,593,400	
日東電工	72,500	8,960.00	649,600,000	
レック	14,200	719.00	10,209,800	
三光合成	13,700	393.00	5,384,100	
きもと	18,400	223.00	4,103,200	
藤森工業	9,300	3,625.00	33,712,500	
前澤化成工業	7,000	1,343.00	9,401,000	
未来工業	4,300	1,569.00	6,746,700	
ウェーブロックホールディングス	4,600	626.00	2,879,600	
ＪＳＰ	7,000	1,490.00	10,430,000	
エフピコ	22,100	3,150.00	69,615,000	
天馬	9,400	2,323.00	21,836,200	
信越ポリマー	21,500	1,263.00	27,154,500	
東リ	27,400	210.00	5,754,000	
ニフコ	40,000	3,280.00	131,200,000	
バルカー	9,700	2,715.00	26,335,500	
ユニ・チャーム	231,300	4,891.00	1,131,288,300	
ショーエイコーポレーション	3,200	584.00	1,868,800	
協和キリン	120,700	3,200.00	386,240,000	
武田薬品工業	943,000	4,001.00	3,772,943,000	
アステラス製薬	1,025,800	2,140.00	2,195,212,000	
住友ファーマ	74,100	1,074.00	79,583,400	
塩野義製薬	139,300	6,936.00	966,184,800	
わかもと製薬	11,700	261.00	3,053,700	
日本新薬	26,200	8,260.00	216,412,000	
中外製薬	375,300	3,706.00	1,390,861,800	
科研製薬	17,100	4,020.00	68,742,000	
エーザイ	132,600	6,107.00	809,788,200	
ロート製薬	57,200	4,075.00	233,090,000	
小野薬品工業	231,300	3,860.00	892,818,000	
久光製薬	25,400	3,625.00	92,075,000	
持田製薬	13,500	3,350.00	45,225,000	
参天製薬	209,000	1,103.00	230,527,000	
扶桑薬品工業	3,900	2,176.00	8,486,400	
日本ケミファ	1,300	1,882.00	2,446,600	
ツムラ	34,300	3,235.00	110,960,500	

日医工	34,000	370.00	12,580,000	
キッセイ薬品工業	17,400	3,080.00	53,592,000	
生化学工業	21,200	882.00	18,698,400	
栄研化学	17,800	1,932.00	34,389,600	
日水製薬	4,400	1,713.00	7,537,200	
鳥居薬品	6,400	3,285.00	21,024,000	
ＪＣＲファーマ	33,800	2,712.00	91,665,600	
東和薬品	17,300	2,623.00	45,377,900	
富士製薬工業	6,500	1,013.00	6,584,500	
ゼリア新薬工業	17,800	2,251.00	40,067,800	
第一三共	870,300	3,525.00	3,067,807,500	
キョーリン製薬ホールディングス	21,700	1,884.00	40,882,800	
大幸薬品	18,100	650.00	11,765,000	
ダイト	7,500	2,700.00	20,250,000	
大塚ホールディングス	228,600	4,956.00	1,132,941,600	
大正製薬ホールディングス	22,200	5,480.00	121,656,000	
ペプチドリーム	63,000	1,577.00	99,351,000	
あすか製薬ホールディングス	11,400	1,079.00	12,300,600	
サワイグループホールディングス	23,000	4,470.00	102,810,000	
日本コークス工業	101,400	119.00	12,066,600	
ニチレキ	13,000	1,400.00	18,200,000	
ユシロ化学工業	5,700	914.00	5,209,800	
ビーピー・カストロール	4,300	1,130.00	4,859,000	
富士石油	26,200	311.00	8,148,200	
ＭＯＲＥＳＣＯ	4,000	1,174.00	4,696,000	
出光興産	122,100	3,235.00	394,993,500	
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,804,900	501.30	904,796,370	
コスモエネルギーホールディングス	47,400	3,585.00	169,929,000	
横浜ゴム	56,800	1,988.00	112,918,400	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	57,400	1,818.00	104,353,200	
ブリヂストン	319,000	5,167.00	1,648,273,000	
住友ゴム工業	98,000	1,240.00	121,520,000	
藤倉コンポジット	9,600	865.00	8,304,000	
オカモト	5,500	3,900.00	21,450,000	
フコク	5,200	989.00	5,142,800	
ニッタ	11,300	2,921.00	33,007,300	
住友理工	23,300	623.00	14,515,900	
三ツ星ベルト	14,600	3,045.00	44,457,000	
バンドー化学	19,300	983.00	18,971,900	
日東紡績	14,900	2,321.00	34,582,900	
ＡＧＣ	101,700	4,815.00	489,685,500	
日本板硝子	54,200	392.00	21,246,400	

石塚硝子	1,900	1,608.00	3,055,200	
日本山村硝子	4,300	682.00	2,932,600	
日本電気硝子	44,500	2,640.00	117,480,000	
オハラ	4,800	1,218.00	5,846,400	
住友大阪セメント	17,900	3,560.00	63,724,000	
太平洋セメント	68,200	2,046.00	139,537,200	
日本ヒューム	10,000	670.00	6,700,000	
日本コンクリート工業	21,800	275.00	5,995,000	
三谷セキサン	4,900	4,025.00	19,722,500	
アジアパイルホールディングス	17,200	490.00	8,428,000	
東海カーボン	92,200	1,042.00	96,072,400	
日本カーボン	6,200	4,035.00	25,017,000	
東洋炭素	7,100	2,952.00	20,959,200	
ノリタケカンパニーリミテド	6,100	4,250.00	25,925,000	
ＴＯＴＯ	72,500	4,520.00	327,700,000	
日本碍子	118,200	1,943.00	229,662,600	
日本特殊陶業	83,700	2,639.00	220,884,300	
ＭＡＲＵＷＡ	4,200	15,990.00	67,158,000	
品川リフラクトリーズ	2,800	3,655.00	10,234,000	
黒崎播磨	2,100	4,410.00	9,261,000	
ヨータイ	7,700	1,514.00	11,657,800	
東京窯業	12,100	279.00	3,375,900	
ニッカトー	5,100	461.00	2,351,100	
フジミインコーポレーテッド	9,600	5,660.00	54,336,000	
クニミネ工業	3,900	940.00	3,666,000	
エーアンドエーマテリアル	2,000	857.00	1,714,000	
ニチアス	25,300	2,402.00	60,770,600	
ニチハ	15,300	2,786.00	42,625,800	
日本製鉄	495,600	1,947.50	965,181,000	
神戸製鋼所	206,800	607.00	125,527,600	
中山製鋼所	16,500	435.00	7,177,500	
合同製鐵	5,800	1,446.00	8,386,800	
ＪＦＥホールディングス	274,700	1,468.00	403,259,600	
東京製鐵	34,700	1,390.00	48,233,000	
共英製鋼	11,700	1,419.00	16,602,300	
大和工業	19,400	4,500.00	87,300,000	
東京鐵鋼	4,900	1,301.00	6,374,900	
大阪製鐵	6,300	1,419.00	8,939,700	
淀川製鋼所	13,000	2,370.00	30,810,000	
丸一鋼管	34,400	2,964.00	101,961,600	
モリ工業	2,900	2,570.00	7,453,000	
大同特殊鋼	16,200	3,715.00	60,183,000	

日本高周波鋼業	4,500	323.00	1,453,500	
日本冶金工業	8,100	2,190.00	17,739,000	
山陽特殊製鋼	10,200	1,871.00	19,084,200	
愛知製鋼	6,700	2,143.00	14,358,100	
日立金属	127,800	2,045.00	261,351,000	
日本金属	3,000	1,184.00	3,552,000	
大平洋金属	7,300	2,429.00	17,731,700	
新日本電工	65,800	356.00	23,424,800	
栗本鐵工所	4,900	1,668.00	8,173,200	
虹技	1,500	977.00	1,465,500	
三菱製鋼	7,700	942.00	7,253,400	
日亜鋼業	13,700	263.00	3,603,100	
日本精線	1,900	4,470.00	8,493,000	
エンビプロ・ホールディングス	7,900	762.00	6,019,800	
シンニッタン	14,500	221.00	3,204,500	
新家工業	2,500	1,445.00	3,612,500	
大紀アルミニウム工業所	14,700	1,213.00	17,831,100	
日本軽金属ホールディングス	30,100	1,569.00	47,226,900	
三井金属鉱業	32,000	3,135.00	100,320,000	
東邦亜鉛	6,100	2,124.00	12,956,400	
三菱マテリアル	68,600	1,992.00	136,651,200	
住友金属鉱山	130,000	4,118.00	535,340,000	
ＤＯＷＡホールディングス	27,700	4,780.00	132,406,000	
古河機械金属	18,100	1,240.00	22,444,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,700	2,826.00	38,716,200	
東邦チタニウム	21,300	2,343.00	49,905,900	
ＵＡＣＪ	16,200	2,160.00	34,992,000	
ＣＫサンエツ	2,200	4,220.00	9,284,000	
古河電気工業	34,200	2,291.00	78,352,200	
住友電気工業	414,100	1,503.00	622,392,300	
フジクラ	132,300	787.00	104,120,100	
昭和電線ホールディングス	10,400	1,599.00	16,629,600	
東京特殊電線	1,500	2,297.00	3,445,500	
タツタ電線	21,000	470.00	9,870,000	
カナレ電気	1,800	1,525.00	2,745,000	
平河ヒューテック	6,600	1,093.00	7,213,800	
リョービ	12,200	1,107.00	13,505,400	
アーレスティ	12,800	397.00	5,081,600	
アサヒホールディングス	47,500	2,069.00	98,277,500	
稲葉製作所	6,000	1,391.00	8,346,000	
宮地エンジニアリンググループ	3,400	3,340.00	11,356,000	
トーカロ	30,600	1,283.00	39,259,800	

アルファＣｏ	4,200	1,017.00	4,271,400	
ＳＵＭＣＯ	195,700	1,819.00	355,978,300	
川田テクノロジーズ	2,200	3,725.00	8,195,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	3,900	5,970.00	23,283,000	
ジェイテックコーポレーション	1,500	2,069.00	3,103,500	
信和	7,400	785.00	5,809,000	
東洋製罐グループホールディングス	60,500	1,535.00	92,867,500	
ホッカンホールディングス	5,500	1,254.00	6,897,000	
コロナ	5,700	851.00	4,850,700	
横河ブリッジホールディングス	17,000	2,027.00	34,459,000	
駒井ハルテック	1,900	1,687.00	3,205,300	
高田機工	1,000	2,402.00	2,402,000	
三和ホールディングス	111,900	1,378.00	154,198,200	
文化シヤッター	35,000	1,026.00	35,910,000	
三協立山	14,100	655.00	9,235,500	
アルインコ	7,800	912.00	7,113,600	
東洋シヤッター	2,600	560.00	1,456,000	
ＬＩＸＩＬ	186,700	2,766.00	516,412,200	
日本フイルコン	7,400	493.00	3,648,200	
ノーリツ	18,900	1,504.00	28,425,600	
長府製作所	12,100	1,820.00	22,022,000	
リンナイ	20,500	10,190.00	208,895,000	
ダイニチ工業	5,700	667.00	3,801,900	
日東精工	13,400	513.00	6,874,200	
三洋工業	1,400	1,675.00	2,345,000	
岡部	18,400	620.00	11,408,000	
ジーテクト	13,100	1,370.00	17,947,000	
東プレ	18,100	1,111.00	20,109,100	
高周波熱錬	18,300	679.00	12,425,700	
東京製綱	7,300	917.00	6,694,100	
サンコール	10,100	628.00	6,342,800	
モリテック　スチール	9,200	277.00	2,548,400	
パイオラックス	15,600	2,013.00	31,402,800	
エイチワン	10,600	623.00	6,603,800	
日本発條	100,000	933.00	93,300,000	
中央発條	5,700	747.00	4,257,900	
アドバネクス	1,500	1,097.00	1,645,500	
立川ブラインド工業	4,600	1,105.00	5,083,000	
三益半導体工業	9,300	2,127.00	19,781,100	
日本ドライケミカル	2,700	1,693.00	4,571,100	
日本製鋼所	30,500	3,100.00	94,550,000	
三浦工業	46,700	3,210.00	149,907,000	

タクマ	34,100	1,371.00	46,751,100	
ツガミ	24,400	1,161.00	28,328,400	
オークマ	11,300	5,260.00	59,438,000	
芝浦機械	13,500	2,795.00	37,732,500	
アマダ	187,400	1,065.00	199,581,000	
アイダエンジニアリング	26,100	929.00	24,246,900	
滝澤鉄工所	3,500	1,190.00	4,165,000	
ＦＵＪＩ	47,400	2,043.00	96,838,200	
牧野フライス製作所	12,100	4,665.00	56,446,500	
オーエスジー	51,800	1,720.00	89,096,000	
ダイジェット工業	1,400	917.00	1,283,800	
旭ダイヤモンド工業	29,300	633.00	18,546,900	
ＤＭＧ森精機	65,800	1,729.00	113,768,200	
ソディック	25,900	827.00	21,419,300	
ディスコ	17,500	31,200.00	546,000,000	
日東工器	5,700	1,599.00	9,114,300	
日進工具	9,400	1,289.00	12,116,600	
パンチ工業	10,200	465.00	4,743,000	
冨士ダイス	6,100	657.00	4,007,700	
豊和工業	6,300	871.00	5,487,300	
ニデックオーケーケー	4,500	1,259.00	5,665,500	
東洋機械金属	7,800	576.00	4,492,800	
津田駒工業	2,000	509.00	1,018,000	
エンシュウ	2,800	863.00	2,416,400	
島精機製作所	17,400	2,186.00	38,036,400	
オプトラン	14,900	1,885.00	28,086,500	
ＮＣホールディングス	3,300	2,200.00	7,260,000	
イワキポンプ	7,600	1,010.00	7,676,000	
フリュー	10,600	1,124.00	11,914,400	
ヤマシンフィルタ	18,800	331.00	6,222,800	
日阪製作所	12,300	854.00	10,504,200	
やまびこ	19,800	1,200.00	23,760,000	
野村マイクロ・サイエンス	3,800	3,500.00	13,300,000	
平田機工	5,200	4,525.00	23,530,000	
ペガサスミシン製造	12,100	653.00	7,901,300	
マルマエ	4,900	1,961.00	9,608,900	
タツモ	6,100	1,240.00	7,564,000	
ナブテスコ	63,200	3,135.00	198,132,000	
三井海洋開発	12,700	1,235.00	15,684,500	
レオン自動機	12,700	1,310.00	16,637,000	
ＳＭＣ	35,100	63,410.00	2,225,691,000	
ホソカワミクロン	7,700	2,832.00	21,806,400	

ユニオンツール	4,400	3,295.00	14,498,000	
オイレス工業	15,400	1,621.00	24,963,400	
日精エー・エス・ビー機械	4,600	3,500.00	16,100,000	
サトーホールディングス	15,600	2,012.00	31,387,200	
技研製作所	10,500	3,240.00	34,020,000	
日本エアーテック	5,500	1,053.00	5,791,500	
カワタ	3,600	991.00	3,567,600	
日精樹脂工業	7,600	926.00	7,037,600	
オカダアイヨン	3,800	1,477.00	5,612,600	
ワイエイシイホールディングス	4,700	1,533.00	7,205,100	
小松製作所	543,800	2,949.00	1,603,666,200	
住友重機械工業	64,200	3,030.00	194,526,000	
日立建機	48,100	2,916.00	140,259,600	
日工	15,200	655.00	9,956,000	
巴工業	4,300	2,444.00	10,509,200	
井関農機	9,600	1,207.00	11,587,200	
ＴＯＷＡ	10,300	1,737.00	17,891,100	
丸山製作所	2,000	1,560.00	3,120,000	
北川鉄工所	4,800	1,423.00	6,830,400	
ローツェ	5,900	8,140.00	48,026,000	
タカキタ	3,800	506.00	1,922,800	
クボタ	581,300	2,223.00	1,292,229,900	
荏原実業	5,600	2,307.00	12,919,200	
三菱化工機	3,600	2,060.00	7,416,000	
月島機械	18,900	906.00	17,123,400	
帝国電機製作所	7,700	1,789.00	13,775,300	
新東工業	22,600	723.00	16,339,800	
澁谷工業	9,500	2,479.00	23,550,500	
アイチ　コーポレーション	17,300	878.00	15,189,400	
小森コーポレーション	27,700	823.00	22,797,100	
鶴見製作所	8,500	2,060.00	17,510,000	
住友精密工業	1,800	2,713.00	4,883,400	
日本ギア工業	4,500	304.00	1,368,000	
酒井重工業	2,000	2,932.00	5,864,000	
荏原製作所	48,000	5,110.00	245,280,000	
石井鐵工所	1,500	2,978.00	4,467,000	
酉島製作所	9,900	1,334.00	13,206,600	
北越工業	10,200	927.00	9,455,400	
ダイキン工業	131,000	23,410.00	3,066,710,000	
オルガノ	3,500	8,990.00	31,465,000	
トーヨーカネツ	4,200	2,711.00	11,386,200	
栗田工業	60,600	5,270.00	319,362,000	

椿本チエイン	15,700	3,180.00	49,926,000	
大同工業	5,100	805.00	4,105,500	
木村化工機	9,400	715.00	6,721,000	
アネスト岩田	18,700	960.00	17,952,000	
ダイフク	56,600	8,380.00	474,308,000	
サムコ	3,300	2,807.00	9,263,100	
加藤製作所	5,900	808.00	4,767,200	
油研工業	1,900	1,809.00	3,437,100	
タダノ	58,100	973.00	56,531,300	
フジテック	36,900	2,937.00	108,375,300	
ＣＫＤ	30,400	1,821.00	55,358,400	
キトー	9,400	2,641.00	24,825,400	
平和	33,500	2,070.00	69,345,000	
理想科学工業	10,100	2,418.00	24,421,800	
ＳＡＮＫＹＯ	24,700	4,245.00	104,851,500	
日本金銭機械	12,300	688.00	8,462,400	
マースグループホールディングス	7,700	1,662.00	12,797,400	
フクシマガリレイ	7,400	3,570.00	26,418,000	
オーイズミ	4,400	399.00	1,755,600	
ダイコク電機	5,600	1,263.00	7,072,800	
竹内製作所	18,300	2,492.00	45,603,600	
アマノ	31,400	2,548.00	80,007,200	
ＪＵＫＩ	16,700	752.00	12,558,400	
ジャノメ	10,300	757.00	7,797,100	
マックス	14,200	1,684.00	23,912,800	
グローリー	28,500	2,211.00	63,013,500	
新晃工業	11,200	1,692.00	18,950,400	
大和冷機工業	17,400	1,126.00	19,592,400	
セガサミーホールディングス	107,900	2,282.00	246,227,800	
日本ピストンリング	4,400	1,280.00	5,632,000	
リケン	4,400	2,426.00	10,674,400	
ＴＰＲ	13,100	1,274.00	16,689,400	
ツバキ・ナカシマ	26,400	944.00	24,921,600	
ホシザキ	70,200	3,940.00	276,588,000	
大豊工業	9,900	680.00	6,732,000	
日本精工	205,400	744.00	152,817,600	
ＮＴＮ	218,200	254.00	55,422,800	
ジェイテクト	102,400	1,046.00	107,110,400	
不二越	8,400	3,670.00	30,828,000	
日本トムソン	27,500	522.00	14,355,000	
ＴＨＫ	67,700	2,721.00	184,211,700	
ユーシン精機	9,400	719.00	6,758,600	

前澤給装工業	7,800	911.00	7,105,800	
イーグル工業	13,000	1,026.00	13,338,000	
前澤工業	7,300	629.00	4,591,700	
日本ピラー工業	10,300	2,650.00	27,295,000	
キッツ	33,800	693.00	23,423,400	
マキタ	135,600	3,569.00	483,956,400	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	44,200	349.00	15,425,800	
日立造船	95,300	827.00	78,813,100	
三菱重工業	176,000	4,913.00	864,688,000	
ＩＨＩ	75,000	3,490.00	261,750,000	
スター精密	16,200	1,700.00	27,540,000	
日清紡ホールディングス	69,300	1,061.00	73,527,300	
イビデン	58,000	3,990.00	231,420,000	
コニカミノルタ	245,600	469.00	115,186,400	
ブラザー工業	137,200	2,509.00	344,234,800	
ミネベアミツミ	191,300	2,390.00	457,207,000	
日立製作所	577,100	6,728.00	3,882,728,800	
東芝	209,700	5,363.00	1,124,621,100	
三菱電機	1,119,800	1,475.50	1,652,264,900	
富士電機	66,700	5,600.00	373,520,000	
東洋電機製造	4,000	913.00	3,652,000	
安川電機	119,200	4,375.00	521,500,000	
シンフォニアテクノロジー	12,200	1,435.00	17,507,000	
明電舎	17,000	2,164.00	36,788,000	
オリジン	2,700	1,202.00	3,245,400	
山洋電気	4,500	5,350.00	24,075,000	
デンヨー	8,500	1,626.00	13,821,000	
ＰＨＣホールディングス	19,200	1,549.00	29,740,800	
東芝テック	12,900	4,415.00	56,953,500	
芝浦メカトロニクス	2,200	9,710.00	21,362,000	
マブチモーター	27,800	3,830.00	106,474,000	
日本電産	266,700	9,114.00	2,430,703,800	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,500	448.00	2,912,000	
トレックス・セミコンダクター	5,600	2,653.00	14,856,800	
東光高岳	7,200	1,737.00	12,506,400	
ダイヘン	11,100	4,145.00	46,009,500	
ヤーマン	20,200	1,587.00	32,057,400	
ＪＶＣケンウッド	103,500	175.00	18,112,500	
ミマキエンジニアリング	12,500	568.00	7,100,000	
Ｉ－ＰＥＸ	6,300	1,324.00	8,341,200	
日新電機	28,100	1,519.00	42,683,900	
大崎電気工業	20,200	518.00	10,463,600	

オムロン	99,900	7,409.00	740,159,100	
日東工業	15,100	2,525.00	38,127,500	
ＩＤＥＣ	14,900	2,897.00	43,165,300	
正興電機製作所	4,100	1,186.00	4,862,600	
不二電機工業	3,100	1,147.00	3,555,700	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	36,500	2,342.00	85,483,000	
サクサホールディングス	2,800	1,279.00	3,581,200	
メルコホールディングス	3,600	3,785.00	13,626,000	
テクノメディカ	3,300	1,623.00	5,355,900	
日本電気	142,300	5,390.00	766,997,000	
富士通	108,000	18,980.00	2,049,840,000	
沖電気工業	45,500	764.00	34,762,000	
岩崎通信機	4,900	804.00	3,939,600	
電気興業	5,800	2,516.00	14,592,800	
サンケン電気	10,300	5,000.00	51,500,000	
ナカヨ	2,000	1,121.00	2,242,000	
アイホン	5,400	1,878.00	10,141,200	
ルネサスエレクトロニクス	654,100	1,335.00	873,223,500	
セイコーエプソン	134,000	2,042.00	273,628,000	
ワコム	93,100	898.00	83,603,800	
アルバック	23,900	4,890.00	116,871,000	
アクセル	5,800	882.00	5,115,600	
ＥＩＺＯ	8,200	3,775.00	30,955,000	
日本信号	25,500	991.00	25,270,500	
京三製作所	23,400	448.00	10,483,200	
能美防災	14,200	1,873.00	26,596,600	
ホーチキ	8,300	1,320.00	10,956,000	
星和電機	7,100	466.00	3,308,600	
エレコム	28,100	1,705.00	47,910,500	
パナソニック　ホールディングス	1,279,600	1,128.50	1,444,028,600	
シャープ	114,000	1,069.00	121,866,000	
アンリツ	77,300	1,539.00	118,964,700	
富士通ゼネラル	32,600	2,811.00	91,638,600	
ソニーグループ	751,600	11,705.00	8,797,478,000	
ＴＤＫ	174,000	4,240.00	737,760,000	
帝国通信工業	6,000	1,475.00	8,850,000	
タムラ製作所	43,200	599.00	25,876,800	
アルプスアルパイン	98,800	1,355.00	133,874,000	
池上通信機	3,500	612.00	2,142,000	
日本電波工業	12,900	1,103.00	14,228,700	
鈴木	7,200	800.00	5,760,000	
メイコー	13,300	3,220.00	42,826,000	

日本トリム	2,700	2,486.00	6,712,200	
ローランド　ディー．ジー．	7,400	3,165.00	23,421,000	
フォスター電機	11,200	735.00	8,232,000	
ＳＭＫ	2,800	2,205.00	6,174,000	
ヨコオ	8,500	1,956.00	16,626,000	
ホシデン	27,300	1,308.00	35,708,400	
ヒロセ電機	16,600	18,690.00	310,254,000	
日本航空電子工業	24,100	2,206.00	53,164,600	
ＴＯＡ	12,900	815.00	10,513,500	
マクセル	22,600	1,468.00	33,176,800	
古野電気	15,200	1,132.00	17,206,400	
ユニデンホールディングス	2,600	4,095.00	10,647,000	
スミダコーポレーション	12,500	818.00	10,225,000	
アイコム	3,900	2,592.00	10,108,800	
リオン	4,600	2,340.00	10,764,000	
本多通信工業	11,300	537.00	6,068,100	
横河電機	110,100	2,355.00	259,285,500	
新電元工業	4,200	3,430.00	14,406,000	
アズビル	69,600	3,890.00	270,744,000	
東亜ディーケーケー	7,100	909.00	6,453,900	
日本光電工業	46,600	3,075.00	143,295,000	
チノー	3,800	1,671.00	6,349,800	
共和電業	11,500	333.00	3,829,500	
日本電子材料	5,600	1,675.00	9,380,000	
堀場製作所	20,600	6,510.00	134,106,000	
アドバンテスト	89,200	7,490.00	668,108,000	
小野測器	6,900	427.00	2,946,300	
エスペック	9,400	1,840.00	17,296,000	
キーエンス	108,700	54,800.00	5,956,760,000	
日置電機	5,900	6,320.00	37,288,000	
シスメックス	86,000	9,346.00	803,756,000	
日本マイクロニクス	18,700	1,248.00	23,337,600	
メガチップス	10,900	3,230.00	35,207,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	5,000	3,060.00	15,300,000	
澤藤電機	2,200	1,438.00	3,163,600	
原田工業	6,800	893.00	6,072,400	
コーセル	14,500	882.00	12,789,000	
イリソ電子工業	10,400	3,050.00	31,720,000	
オプテックスグループ	20,200	2,111.00	42,642,200	
千代田インテグレ	5,000	2,049.00	10,245,000	
レーザーテック	49,200	18,045.00	887,814,000	
スタンレー電気	77,800	2,398.00	186,564,400	

岩崎電気	4,200	2,647.00	11,117,400	
ウシオ電機	57,300	1,810.00	103,713,000	
岡谷電機産業	12,800	244.00	3,123,200	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	13,200	340.00	4,488,000	
エノモト	4,000	1,526.00	6,104,000	
日本セラミック	11,600	2,101.00	24,371,600	
遠藤照明	6,800	769.00	5,229,200	
古河電池	9,400	1,241.00	11,665,400	
双信電機	7,800	510.00	3,978,000	
山一電機	8,400	1,690.00	14,196,000	
図研	8,100	3,435.00	27,823,500	
日本電子	23,200	5,820.00	135,024,000	
カシオ計算機	74,200	1,287.00	95,495,400	
ファナック	105,300	21,825.00	2,298,172,500	
日本シイエムケイ	23,400	447.00	10,459,800	
エンプラス	3,300	3,025.00	9,982,500	
大真空	15,900	913.00	14,516,700	
ローム	50,000	9,890.00	494,500,000	
浜松ホトニクス	80,100	6,000.00	480,600,000	
三井ハイテック	10,400	8,310.00	86,424,000	
新光電気工業	35,500	3,420.00	121,410,000	
京セラ	168,900	7,447.00	1,257,798,300	
太陽誘電	53,600	4,785.00	256,476,000	
村田製作所	327,400	7,856.00	2,572,054,400	
双葉電子工業	22,000	699.00	15,378,000	
北陸電気工業	5,400	1,122.00	6,058,800	
ニチコン	32,800	1,242.00	40,737,600	
日本ケミコン	11,900	1,755.00	20,884,500	
ＫＯＡ	17,200	1,691.00	29,085,200	
市光工業	17,000	381.00	6,477,000	
小糸製作所	60,100	4,715.00	283,371,500	
ミツバ	18,700	430.00	8,041,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	18,900	9,450.00	178,605,000	
キヤノン電子	11,700	1,575.00	18,427,500	
キヤノン	596,200	3,243.00	1,933,476,600	
リコー	285,500	1,082.00	308,911,000	
象印マホービン	30,400	1,507.00	45,812,800	
ＭＵＴＯＨホールディングス	2,000	2,035.00	4,070,000	
東京エレクトロン	76,100	45,020.00	3,426,022,000	
トヨタ紡織	41,900	2,088.00	87,487,200	
芦森工業	2,300	1,017.00	2,339,100	
ユニプレス	19,700	871.00	17,158,700	

豊田自動織機	85,000	8,080.00	686,800,000	
モリタホールディングス	19,200	1,393.00	26,745,600	
三櫻工業	16,600	705.00	11,703,000	
デンソー	234,800	7,649.00	1,795,985,200	
東海理化電機製作所	31,600	1,562.00	49,359,200	
川崎重工業	81,300	2,588.00	210,404,400	
名村造船所	30,900	414.00	12,792,600	
日本車輌製造	3,800	2,119.00	8,052,200	
三菱ロジスネクスト	15,900	924.00	14,691,600	
近畿車輛	1,800	1,104.00	1,987,200	
日産自動車	1,415,000	514.10	727,451,500	
いすゞ自動車	347,500	1,501.00	521,597,500	
トヨタ自動車	5,469,700	2,166.00	11,847,370,200	
日野自動車	149,800	732.00	109,653,600	
三菱自動車工業	444,100	442.00	196,292,200	
エフテック	7,700	536.00	4,127,200	
レシップホールディングス	4,800	534.00	2,563,200	
ＧＭＢ	2,200	692.00	1,522,400	
ファルテック	2,100	600.00	1,260,000	
武蔵精密工業	26,800	1,453.00	38,940,400	
日産車体	17,600	625.00	11,000,000	
新明和工業	31,300	1,083.00	33,897,900	
極東開発工業	19,100	1,455.00	27,790,500	
トピー工業	9,000	1,314.00	11,826,000	
ティラド	3,300	2,587.00	8,537,100	
曙ブレーキ工業	65,900	157.00	10,346,300	
タチエス	19,700	1,165.00	22,950,500	
ＮＯＫ	45,100	1,211.00	54,616,100	
フタバ産業	26,700	401.00	10,706,700	
ＫＹＢ	10,600	3,150.00	33,390,000	
大同メタル工業	23,000	552.00	12,696,000	
プレス工業	53,800	418.00	22,488,400	
ミクニ	14,000	356.00	4,984,000	
太平洋工業	22,800	1,120.00	25,536,000	
河西工業	14,700	263.00	3,866,100	
アイシン	87,800	4,235.00	371,833,000	
マツダ	353,000	1,119.00	395,007,000	
今仙電機製作所	7,900	622.00	4,913,800	
本田技研工業	877,200	3,471.00	3,044,761,200	
スズキ	237,800	4,375.00	1,040,375,000	
ＳＵＢＡＲＵ	315,200	2,357.00	742,926,400	
安永	4,800	703.00	3,374,400	

ヤマハ発動機	156,500	2,560.00	400,640,000	
ＴＢＫ	12,100	339.00	4,101,900	
エクセディ	18,100	1,859.00	33,647,900	
豊田合成	33,900	2,249.00	76,241,100	
愛三工業	18,800	709.00	13,329,200	
盟和産業	1,700	1,019.00	1,732,300	
日本プラスト	8,700	464.00	4,036,800	
ヨロズ	9,300	907.00	8,435,100	
エフ・シー・シー	19,600	1,457.00	28,557,200	
シマノ	44,100	23,075.00	1,017,607,500	
テイ・エス　テック	50,700	1,523.00	77,216,100	
ジャムコ	7,000	1,245.00	8,715,000	
テルモ	339,500	4,500.00	1,527,750,000	
クリエートメディック	3,600	989.00	3,560,400	
日機装	30,500	830.00	25,315,000	
日本エム・ディ・エム	6,900	1,692.00	11,674,800	
島津製作所	143,400	4,735.00	678,999,000	
ＪＭＳ	9,300	574.00	5,338,200	
長野計器	8,000	1,163.00	9,304,000	
ブイ・テクノロジー	5,300	3,005.00	15,926,500	
東京計器	7,600	1,315.00	9,994,000	
愛知時計電機	4,300	1,477.00	6,351,100	
インターアクション	6,000	2,035.00	12,210,000	
オーバル	10,800	764.00	8,251,200	
東京精密	18,700	4,620.00	86,394,000	
マニー	43,800	1,586.00	69,466,800	
ニコン	169,100	1,540.00	260,414,000	
トプコン	56,400	1,942.00	109,528,800	
オリンパス	580,800	2,838.00	1,648,310,400	
理研計器	7,900	4,010.00	31,679,000	
タムロン	8,400	2,780.00	23,352,000	
ＨＯＹＡ	231,600	13,295.00	3,079,122,000	
シード	5,600	526.00	2,945,600	
ノーリツ鋼機	10,800	2,378.00	25,682,400	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	13,500	945.00	12,757,500	
朝日インテック	131,500	2,485.00	326,777,500	
シチズン時計	117,100	583.00	68,269,300	
リズム	3,800	1,612.00	6,125,600	
大研医器	9,500	482.00	4,579,000	
メニコン	37,000	3,400.00	125,800,000	
シンシア	1,300	431.00	560,300	
松風	4,000	1,794.00	7,176,000	

セイコーホールディングス	17,000	2,896.00	49,232,000	
ニプロ	83,000	1,183.00	98,189,000	
中本パックス	3,300	1,612.00	5,319,600	
スノーピーク	15,600	2,616.00	40,809,600	
パラマウントベッドホールディングス	23,000	2,479.00	57,017,000	
トランザクション	7,700	1,060.00	8,162,000	
粧美堂	3,000	396.00	1,188,000	
ニホンフラッシュ	9,300	976.00	9,076,800	
前田工繊	10,800	3,075.00	33,210,000	
永大産業	13,100	260.00	3,406,000	
アートネイチャー	10,200	748.00	7,629,600	
バンダイナムコホールディングス	99,200	10,280.00	1,019,776,000	
アイフィスジャパン	3,100	618.00	1,915,800	
共立印刷	16,400	154.00	2,525,600	
ＳＨＯＥＩ	10,500	5,740.00	60,270,000	
フランスベッドホールディングス	15,400	935.00	14,399,000	
パイロットコーポレーション	17,100	5,270.00	90,117,000	
萩原工業	7,200	1,138.00	8,193,600	
フジシールインターナショナル	24,700	1,562.00	38,581,400	
タカラトミー	49,500	1,493.00	73,903,500	
広済堂ホールディングス	7,400	1,070.00	7,918,000	
エステールホールディングス	2,600	629.00	1,635,400	
タカノ	4,100	853.00	3,497,300	
プロネクサス	9,300	1,136.00	10,564,800	
ホクシン	8,500	148.00	1,258,000	
ウッドワン	3,700	1,165.00	4,310,500	
大建工業	6,100	1,974.00	12,041,400	
凸版印刷	156,300	2,302.00	359,802,600	
大日本印刷	130,000	2,956.00	384,280,000	
共同印刷	3,100	2,530.00	7,843,000	
ＮＩＳＳＨＡ	20,800	1,553.00	32,302,400	
光村印刷	900	1,240.00	1,116,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	6,900	1,990.00	13,731,000	
アシックス	91,900	2,595.00	238,480,500	
ツツミ	3,000	2,168.00	6,504,000	
ローランド	8,400	4,250.00	35,700,000	
小松ウオール工業	3,700	1,935.00	7,159,500	
ヤマハ	69,800	5,690.00	397,162,000	
河合楽器製作所	3,000	2,847.00	8,541,000	
クリナップ	11,200	599.00	6,708,800	
ピジョン	72,500	1,938.00	140,505,000	
兼松サステック	800	1,641.00	1,312,800	

キングジム	8,800	914.00	8,043,200	
リンテック	22,800	2,342.00	53,397,600	
イトーキ	22,100	394.00	8,707,400	
任天堂	67,700	60,870.00	4,120,899,000	
三菱鉛筆	16,200	1,541.00	24,964,200	
タカラスタンダード	19,300	1,374.00	26,518,200	
コクヨ	52,800	1,822.00	96,201,600	
ナカバヤシ	9,700	515.00	4,995,500	
グローブライド	8,900	2,290.00	20,381,000	
オカムラ	33,700	1,318.00	44,416,600	
美津濃	9,900	2,537.00	25,116,300	
東京電力ホールディングス	897,900	512.00	459,724,800	
中部電力	338,800	1,360.00	460,768,000	
関西電力	419,600	1,328.00	557,228,800	
中国電力	173,100	867.00	150,077,700	
北陸電力	101,900	540.00	55,026,000	
東北電力	262,300	719.00	188,593,700	
四国電力	99,700	792.00	78,962,400	
九州電力	229,600	878.00	201,588,800	
北海道電力	104,300	507.00	52,880,100	
沖縄電力	25,400	1,310.00	33,274,000	
電源開発	88,600	2,232.00	197,755,200	
エフオン	7,300	550.00	4,015,000	
イーレックス	15,500	2,296.00	35,588,000	
レノバ	23,500	2,271.00	53,368,500	
東京瓦斯	213,600	2,602.00	555,787,200	
大阪瓦斯	201,800	2,380.00	480,284,000	
東邦瓦斯	47,100	3,040.00	143,184,000	
北海道瓦斯	5,900	1,610.00	9,499,000	
広島ガス	21,000	321.00	6,741,000	
西部ガスホールディングス	11,400	1,847.00	21,055,800	
静岡ガス	28,400	961.00	27,292,400	
メタウォーター	12,500	2,039.00	25,487,500	
ＳＢＳホールディングス	8,900	2,818.00	25,080,200	
東武鉄道	109,400	3,120.00	341,328,000	
相鉄ホールディングス	35,600	2,337.00	83,197,200	
東急	279,300	1,617.00	451,628,100	
京浜急行電鉄	133,500	1,441.00	192,373,500	
小田急電鉄	151,000	1,836.00	277,236,000	
京王電鉄	52,700	4,960.00	261,392,000	
京成電鉄	70,600	3,560.00	251,336,000	
富士急行	12,300	4,025.00	49,507,500	

新京成電鉄	2,800	2,899.00	8,117,200	
東日本旅客鉄道	183,000	6,843.00	1,252,269,000	
西日本旅客鉄道	127,200	4,830.00	614,376,000	
東海旅客鉄道	84,400	15,390.00	1,298,916,000	
西武ホールディングス	144,600	1,308.00	189,136,800	
鴻池運輸	17,000	1,296.00	22,032,000	
西日本鉄道	28,800	2,887.00	83,145,600	
ハマキョウレックス	7,800	3,155.00	24,609,000	
サカイ引越センター	5,500	4,915.00	27,032,500	
近鉄グループホールディングス	106,500	4,265.00	454,222,500	
阪急阪神ホールディングス	132,600	3,775.00	500,565,000	
南海電気鉄道	47,500	2,554.00	121,315,000	
京阪ホールディングス	44,300	3,265.00	144,639,500	
神戸電鉄	2,700	3,370.00	9,099,000	
名古屋鉄道	109,900	2,094.00	230,130,600	
山陽電気鉄道	8,100	2,230.00	18,063,000	
アルプス物流	7,900	1,142.00	9,021,800	
ヤマトホールディングス	159,200	2,353.00	374,597,600	
山九	27,600	4,180.00	115,368,000	
丸運	5,400	233.00	1,258,200	
丸全昭和運輸	7,700	3,220.00	24,794,000	
センコーグループホールディングス	52,700	926.00	48,800,200	
トナミホールディングス	2,200	3,680.00	8,096,000	
ニッコンホールディングス	34,300	2,417.00	82,903,100	
日本石油輸送	1,200	2,458.00	2,949,600	
福山通運	14,500	3,150.00	45,675,000	
セイノーホールディングス	61,900	1,131.00	70,008,900	
エスライン	3,100	857.00	2,656,700	
神奈川中央交通	2,800	3,555.00	9,954,000	
日立物流	21,900	8,700.00	190,530,000	
丸和運輸機関	19,200	1,497.00	28,742,400	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	9,600	1,152.00	11,059,200	
九州旅客鉄道	76,200	2,785.00	212,217,000	
ＳＧホールディングス	190,800	2,584.00	493,027,200	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	33,700	7,830.00	263,871,000	
日本郵船	95,200	10,320.00	982,464,000	
商船三井	175,700	3,505.00	615,828,500	
川崎汽船	35,100	9,840.00	345,384,000	
ＮＳユナイテッド海運	5,700	3,980.00	22,686,000	
飯野海運	46,700	706.00	32,970,200	
共栄タンカー	3,500	974.00	3,409,000	
乾汽船	6,800	1,806.00	12,280,800	

日本航空	244,300	2,280.00	557,004,000	
ＡＮＡホールディングス	270,600	2,456.50	664,728,900	
パスコ	2,100	1,342.00	2,818,200	
トランコム	3,200	7,320.00	23,424,000	
日新	8,300	1,657.00	13,753,100	
三菱倉庫	27,500	3,470.00	95,425,000	
三井倉庫ホールディングス	11,100	3,070.00	34,077,000	
住友倉庫	33,400	2,072.00	69,204,800	
澁澤倉庫	5,700	2,200.00	12,540,000	
東陽倉庫	16,100	296.00	4,765,600	
日本トランスシティ	20,000	503.00	10,060,000	
ケイヒン	1,900	1,363.00	2,589,700	
中央倉庫	5,900	981.00	5,787,900	
川西倉庫	2,100	1,039.00	2,181,900	
安田倉庫	7,600	943.00	7,166,800	
ファイズホールディングス	2,400	738.00	1,771,200	
東洋埠頭	3,200	1,296.00	4,147,200	
上組	54,000	2,747.00	148,338,000	
サンリツ	2,900	712.00	2,064,800	
キムラユニティー	5,900	811.00	4,784,900	
キユーソー流通システム	5,700	1,262.00	7,193,400	
東海運	6,500	285.00	1,852,500	
エーアイテイー	7,100	1,834.00	13,021,400	
内外トランスライン	4,400	2,038.00	8,967,200	
日本コンセプト	3,600	1,568.00	5,644,800	
ＮＥＣネッツエスアイ	39,000	1,980.00	77,220,000	
クロスキャット	6,500	971.00	6,311,500	
システナ	168,200	481.00	80,904,200	
デジタルアーツ	6,300	6,260.00	39,438,000	
日鉄ソリューションズ	20,500	3,935.00	80,667,500	
キューブシステム	6,100	1,058.00	6,453,800	
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	1,800	1,021.00	1,837,800	
コア	5,100	1,509.00	7,695,900	
手間いらず	1,700	5,190.00	8,823,000	
ラクーンホールディングス	10,100	1,467.00	14,816,700	
ソリトンシステムズ	6,000	1,318.00	7,908,000	
ソフトクリエイトホールディングス	5,200	4,235.00	22,022,000	
ＴＩＳ	103,000	3,800.00	391,400,000	
ＪＮＳホールディングス	5,400	394.00	2,127,600	
グリー	53,700	833.00	44,732,100	
ＧＭＯペパボ	1,300	1,990.00	2,587,000	
コーエーテクモホールディングス	37,600	4,895.00	184,052,000	

三菱総合研究所	4,900	4,375.00	21,437,500	
電算	1,400	2,208.00	3,091,200	
ＡＧＳ	4,800	764.00	3,667,200	
ファインデックス	10,100	673.00	6,797,300	
ブレインパッド	10,100	1,206.00	12,180,600	
ＫＬａｂ	20,100	480.00	9,648,000	
ポールトゥウィンホールディングス	17,200	1,015.00	17,458,000	
ネクソン	268,600	3,045.00	817,887,000	
アイスタイル	30,900	284.00	8,775,600	
エムアップホールディングス	13,700	1,451.00	19,878,700	
エイチーム	7,500	749.00	5,617,500	
エニグモ	13,000	539.00	7,007,000	
テクノスジャパン	9,400	483.00	4,540,200	
コロプラ	38,900	677.00	26,335,300	
ブロードリーフ	58,700	458.00	26,884,600	
クロス・マーケティンググループ	4,600	728.00	3,348,800	
デジタルハーツホールディングス	5,400	1,874.00	10,119,600	
システム情報	9,000	964.00	8,676,000	
メディアドゥ	4,100	2,096.00	8,593,600	
じげん	33,700	333.00	11,222,100	
ブイキューブ	12,100	1,226.00	14,834,600	
エンカレッジ・テクノロジ	2,800	530.00	1,484,000	
サイバーリンクス	4,100	1,113.00	4,563,300	
フィックスターズ	11,400	1,160.00	13,224,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,900	1,911.00	9,363,900	
オプティム	8,400	820.00	6,888,000	
セレス	4,500	1,219.00	5,485,500	
ＳＨＩＦＴ	7,300	19,110.00	139,503,000	
ティーガイア	10,500	1,681.00	17,650,500	
セック	1,800	2,459.00	4,426,200	
テクマトリックス	20,000	1,838.00	36,760,000	
プロシップ	4,000	1,615.00	6,460,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	30,600	2,593.00	79,345,800	
GMOペイメントゲートウェイ	22,800	10,490.00	239,172,000	
ザッパラス	4,400	346.00	1,522,400	
システムリサーチ	3,500	2,069.00	7,241,500	
インターネットイニシアティブ	31,400	5,240.00	164,536,000	
さくらインターネット	12,900	572.00	7,378,800	
ヴィンクス	3,400	1,463.00	4,974,200	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,600	5,680.00	14,768,000	
ＳＲＡホールディングス	5,700	2,973.00	16,946,100	
システムインテグレータ	4,000	462.00	1,848,000	

朝日ネット	11,000	595.00	6,545,000	
ｅＢＡＳＥ	14,300	568.00	8,122,400	
アバント	12,700	1,389.00	17,640,300	
アドソル日進	4,300	1,702.00	7,318,600	
ＯＤＫソリューションズ	2,700	595.00	1,606,500	
フリービット	6,300	848.00	5,342,400	
コムチュア	13,300	2,917.00	38,796,100	
サイバーコム	1,900	1,378.00	2,618,200	
アステリア	8,600	875.00	7,525,000	
アイル	5,700	1,606.00	9,154,200	
マークラインズ	6,000	2,251.00	13,506,000	
メディカル・データ・ビジョン	15,000	1,245.00	18,675,000	
ｇｕｍｉ	16,500	615.00	10,147,500	
ショーケース	2,900	423.00	1,226,700	
モバイルファクトリー	2,800	1,001.00	2,802,800	
テラスカイ	4,400	1,689.00	7,431,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,300	1,436.00	7,610,800	
ＰＣＩホールディングス	4,800	963.00	4,622,400	
パイプドＨＤ	2,200	2,798.00	6,155,600	
アイビーシー	2,000	423.00	846,000	
ネオジャパン	3,400	1,150.00	3,910,000	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	2,600	2,252.00	5,855,200	
ラクス	54,100	1,695.00	91,699,500	
ランドコンピュータ	2,800	880.00	2,464,000	
ダブルスタンダード	3,600	1,982.00	7,135,200	
オープンドア	7,100	1,687.00	11,977,700	
マイネット	4,200	516.00	2,167,200	
アカツキ	5,300	2,678.00	14,193,400	
ベネフィットジャパン	1,000	1,917.00	1,917,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	3,100	2,725.00	8,447,500	
カナミックネットワーク	14,600	591.00	8,628,600	
ノムラシステムコーポレーション	13,100	128.00	1,676,800	
チェンジ	24,500	2,049.00	50,200,500	
シンクロ・フード	6,400	380.00	2,432,000	
オークネット	6,300	2,280.00	14,364,000	
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	635.00	1,460,500	
セグエグループ	3,300	536.00	1,768,800	
エイトレッド	1,700	1,919.00	3,262,300	
マクロミル	22,800	939.00	21,409,200	
ビーグリー	2,900	1,277.00	3,703,300	
オロ	3,700	1,603.00	5,931,100	
ユーザーローカル	3,700	1,623.00	6,005,100	

テモナ	2,500	324.00	810,000	
ニーズウェル	3,600	649.00	2,336,400	
マネーフォワード	24,000	3,255.00	78,120,000	
サインポスト	3,800	881.00	3,347,800	
電算システムホールディングス	4,900	2,442.00	11,965,800	
ソルクシーズ	10,400	377.00	3,920,800	
フェイス	3,300	581.00	1,917,300	
プロトコーポレーション	12,600	1,101.00	13,872,600	
ハイマックス	3,200	1,491.00	4,771,200	
野村総合研究所	204,800	3,985.00	816,128,000	
サイバネットシステム	8,500	964.00	8,194,000	
ＣＥホールディングス	6,000	509.00	3,054,000	
日本システム技術	2,100	2,686.00	5,640,600	
インテージホールディングス	13,600	1,394.00	18,958,400	
東邦システムサイエンス	3,200	933.00	2,985,600	
ソースネクスト	51,300	227.00	11,645,100	
インフォコム	12,900	2,200.00	28,380,000	
シンプレクス・ホールディングス	18,700	1,783.00	33,342,100	
ＨＥＲＯＺ	3,500	965.00	3,377,500	
ラクスル	14,100	2,127.00	29,990,700	
ＩＰＳ	3,300	2,412.00	7,959,600	
ＦＩＧ	13,200	317.00	4,184,400	
システムサポート	4,400	1,394.00	6,133,600	
イーソル	7,400	656.00	4,854,400	
アルテリア・ネットワークス	11,300	1,277.00	14,430,100	
東海ソフト	2,000	940.00	1,880,000	
ウイングアーク１ｓｔ	9,000	1,859.00	16,731,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,700	1,634.00	4,411,800	
サーバーワークス	2,100	2,503.00	5,256,300	
東名	900	1,095.00	985,500	
ヴィッツ	1,200	1,050.00	1,260,000	
トビラシステムズ	2,500	946.00	2,365,000	
Ｓａｎｓａｎ	37,300	1,196.00	44,610,800	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	2,300	653.00	1,501,900	
ギフティ	9,800	1,213.00	11,887,400	
ベース	2,000	5,880.00	11,760,000	
ＪＭＤＣ	14,800	6,420.00	95,016,000	
フォーカスシステムズ	7,400	925.00	6,845,000	
クレスコ	8,600	2,140.00	18,404,000	
フジ・メディア・ホールディングス	104,800	1,222.00	128,065,600	
オービック	37,100	21,480.00	796,908,000	
ジャストシステム	16,800	4,015.00	67,452,000	

ＴＤＣソフト	9,500	1,166.00	11,077,000	
Ｚホールディングス	1,698,100	436.70	741,560,270	
トレンドマイクロ	57,700	7,560.00	436,212,000	
ＩＤホールディングス	7,600	867.00	6,589,200	
日本オラクル	19,100	8,380.00	160,058,000	
アルファシステムズ	3,200	4,580.00	14,656,000	
フューチャー	24,900	1,656.00	41,234,400	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	6,200	1,422.00	8,816,400	
ＳＢテクノロジー	5,100	2,448.00	12,484,800	
トーセ	3,100	751.00	2,328,100	
オービックビジネスコンサルタント	11,300	4,435.00	50,115,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	53,700	3,630.00	194,931,000	
アイティフォー	14,400	825.00	11,880,000	
東計電算	1,400	6,170.00	8,638,000	
エックスネット	2,000	1,011.00	2,022,000	
大塚商会	63,700	4,155.00	264,673,500	
サイボウズ	15,800	1,159.00	18,312,200	
電通国際情報サービス	14,600	4,350.00	63,510,000	
ＡＣＣＥＳＳ	13,500	825.00	11,137,500	
デジタルガレージ	19,500	3,970.00	77,415,000	
ＥＭシステムズ	19,600	1,015.00	19,894,000	
ウェザーニューズ	3,500	7,670.00	26,845,000	
ＣＩＪ	9,300	745.00	6,928,500	
ビジネスエンジニアリング	2,700	2,653.00	7,163,100	
日本エンタープライズ	12,300	159.00	1,955,700	
ＷＯＷＯＷ	4,900	1,503.00	7,364,700	
スカラ	10,100	750.00	7,575,000	
インテリジェント　ウェイブ	6,100	778.00	4,745,800	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	8,500	823.00	6,995,500	
ネットワンシステムズ	43,500	3,115.00	135,502,500	
システムソフト	36,000	105.00	3,780,000	
アルゴグラフィックス	9,200	3,420.00	31,464,000	
マーベラス	18,700	696.00	13,015,200	
エイベックス	20,400	1,544.00	31,497,600	
ＢＩＰＲＯＧＹ	36,800	2,830.00	104,144,000	
兼松エレクトロニクス	6,400	4,135.00	26,464,000	
都築電気	5,400	1,351.00	7,295,400	
ＴＢＳホールディングス	57,600	1,786.00	102,873,600	
日本テレビホールディングス	98,400	1,325.00	130,380,000	
朝日放送グループホールディングス	9,600	668.00	6,412,800	
テレビ朝日ホールディングス	28,400	1,577.00	44,786,800	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	100,000	562.00	56,200,000	

テレビ東京ホールディングス	7,300	2,018.00	14,731,400	
日本ＢＳ放送	4,100	1,067.00	4,374,700	
ビジョン	18,900	1,105.00	20,884,500	
スマートバリュー	2,900	471.00	1,365,900	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	9,000	2,089.00	18,801,000	
ワイヤレスゲート	5,300	279.00	1,478,700	
コネクシオ	8,400	1,342.00	11,272,800	
クロップス	2,300	933.00	2,145,900	
日本電信電話	1,319,700	3,887.00	5,129,673,900	
ＫＤＤＩ	858,300	4,436.00	3,807,418,800	
ソフトバンク	1,783,300	1,541.50	2,748,956,950	
光通信	13,600	14,750.00	200,600,000	
エムティーアイ	9,400	542.00	5,094,800	
GMOインターネット	41,300	2,586.00	106,801,800	
ファイバーゲート	5,500	872.00	4,796,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	3,000	293.00	879,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	63,400	3,255.00	206,367,000	
学研ホールディングス	16,800	946.00	15,892,800	
ゼンリン	19,400	957.00	18,565,800	
昭文社ホールディングス	5,100	336.00	1,713,600	
インプレスホールディングス	9,800	217.00	2,126,600	
アイネット	5,600	1,300.00	7,280,000	
松竹	6,800	12,690.00	86,292,000	
東宝	69,500	5,320.00	369,740,000	
東映	3,300	19,960.00	65,868,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	313,500	1,989.00	623,551,500	
ピー・シー・エー	7,000	1,246.00	8,722,000	
ビジネスブレイン太田昭和	4,000	1,488.00	5,952,000	
ＤＴＳ	22,000	3,395.00	74,690,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	54,800	6,280.00	344,144,000	
シーイーシー	12,700	1,232.00	15,646,400	
カプコン	111,000	3,830.00	425,130,000	
アイ・エス・ビー	5,600	1,037.00	5,807,200	
ジャステック	6,900	1,205.00	8,314,500	
ＳＣＳＫ	81,600	2,384.00	194,534,400	
日本システムウエア	4,500	2,440.00	10,980,000	
アイネス	10,200	1,626.00	16,585,200	
ＴＫＣ	18,000	3,495.00	62,910,000	
富士ソフト	11,300	8,400.00	94,920,000	
ＮＳＤ	36,900	2,539.00	93,689,100	
コナミグループ	42,800	7,690.00	329,132,000	
福井コンピュータホールディングス	5,400	3,515.00	18,981,000	

ＪＢＣＣホールディングス	8,000	1,675.00	13,400,000	
ミロク情報サービス	10,500	1,373.00	14,416,500	
ソフトバンクグループ	706,000	5,505.00	3,886,530,000	
高千穂交易	4,200	2,009.00	8,437,800	
オルバヘルスケアホールディングス	1,900	1,613.00	3,064,700	
伊藤忠食品	2,400	4,970.00	11,928,000	
エレマテック	9,500	1,289.00	12,245,500	
あらた	8,700	4,200.00	36,540,000	
トーメンデバイス	1,800	5,660.00	10,188,000	
東京エレクトロン　デバイス	3,500	5,230.00	18,305,000	
フィールズ	10,400	970.00	10,088,000	
双日	121,200	2,008.00	243,369,600	
アルフレッサ　ホールディングス	122,600	1,866.00	228,771,600	
横浜冷凍	28,700	921.00	26,432,700	
ラサ商事	5,400	965.00	5,211,000	
アルコニックス	15,000	1,307.00	19,605,000	
神戸物産	81,500	3,525.00	287,287,500	
ハイパー	3,000	444.00	1,332,000	
あい　ホールディングス	16,900	1,663.00	28,104,700	
ディーブイエックス	4,000	1,049.00	4,196,000	
ダイワボウホールディングス	50,300	1,899.00	95,519,700	
マクニカ・富士エレホールディングス	28,200	2,677.00	75,491,400	
ラクト・ジャパン	4,100	2,557.00	10,483,700	
グリムス	5,300	1,538.00	8,151,400	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,900	718.00	13,570,200	
八洲電機	8,500	1,039.00	8,831,500	
メディアスホールディングス	6,800	1,006.00	6,840,800	
レスターホールディングス	11,200	1,952.00	21,862,400	
ジューテックホールディングス	2,300	1,066.00	2,451,800	
大光	5,000	703.00	3,515,000	
ＯＣＨＩホールディングス	2,700	1,226.00	3,310,200	
ＴＯＫＡＩホールディングス	57,300	900.00	51,570,000	
黒谷	3,200	610.00	1,952,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,100	718.00	1,507,800	
三洋貿易	10,800	1,015.00	10,962,000	
ビューティガレージ	1,900	2,633.00	5,002,700	
ウイン・パートナーズ	8,500	1,041.00	8,848,500	
ミタチ産業	3,000	763.00	2,289,000	
シップヘルスケアホールディングス	34,100	2,581.00	88,012,100	
明治電機工業	3,600	1,105.00	3,978,000	
デリカフーズホールディングス	4,600	510.00	2,346,000	
スターティアホールディングス	2,700	828.00	2,235,600	

コメダホールディングス	25,800	2,264.00	58,411,200	
ピーバンドットコム	1,700	511.00	868,700	
アセンテック	4,100	646.00	2,648,600	
富士興産	3,000	1,120.00	3,360,000	
協栄産業	1,200	1,391.00	1,669,200	
フルサト・マルカホールディングス	10,500	2,852.00	29,946,000	
ヤマエグループホールディングス	6,600	1,358.00	8,962,800	
小野建	10,600	1,404.00	14,882,400	
南陽	2,200	1,812.00	3,986,400	
佐鳥電機	7,400	1,078.00	7,977,200	
エコートレーディング	2,500	568.00	1,420,000	
伯東	6,900	2,603.00	17,960,700	
コンドーテック	8,900	1,043.00	9,282,700	
中山福	6,300	316.00	1,990,800	
ナガイレーベン	14,300	2,025.00	28,957,500	
三菱食品	11,400	3,565.00	40,641,000	
松田産業	8,600	2,045.00	17,587,000	
第一興商	22,400	3,810.00	85,344,000	
メディパルホールディングス	109,300	2,050.00	224,065,000	
ＳＰＫ	4,700	1,373.00	6,453,100	
萩原電気ホールディングス	4,000	2,028.00	8,112,000	
アズワン	17,000	6,370.00	108,290,000	
スズデン	3,700	2,025.00	7,492,500	
尾家産業	2,800	820.00	2,296,000	
シモジマ	7,300	1,016.00	7,416,800	
ドウシシャ	11,200	1,601.00	17,931,200	
小津産業	2,600	1,883.00	4,895,800	
高速	6,300	1,507.00	9,494,100	
たけびし	4,000	1,503.00	6,012,000	
リックス	2,400	2,045.00	4,908,000	
丸文	9,400	771.00	7,247,400	
ハピネット	9,000	1,643.00	14,787,000	
橋本総業ホールディングス	2,100	2,012.00	4,225,200	
日本ライフライン	35,000	988.00	34,580,000	
タカショー	9,200	726.00	6,679,200	
ＩＤＯＭ	35,900	759.00	27,248,100	
進和	7,000	2,318.00	16,226,000	
エスケイジャパン	2,900	463.00	1,342,700	
ダイトロン	4,600	1,872.00	8,611,200	
シークス	15,000	964.00	14,460,000	
田中商事	3,700	578.00	2,138,600	
オーハシテクニカ	5,800	1,382.00	8,015,600	

白銅	3,800	2,454.00	9,325,200	
ダイコー通産	1,400	1,085.00	1,519,000	
伊藤忠商事	708,500	3,867.00	2,739,769,500	
丸紅	1,023,700	1,226.00	1,255,056,200	
高島	1,700	2,619.00	4,452,300	
長瀬産業	54,100	2,019.00	109,227,900	
蝶理	6,600	1,978.00	13,054,800	
豊田通商	105,500	4,550.00	480,025,000	
三共生興	15,200	514.00	7,812,800	
兼松	40,900	1,391.00	56,891,900	
ツカモトコーポレーション	2,000	1,095.00	2,190,000	
三井物産	856,500	2,919.50	2,500,551,750	
日本紙パルプ商事	5,600	4,100.00	22,960,000	
カメイ	12,600	1,085.00	13,671,000	
東都水産	600	4,795.00	2,877,000	
ＯＵＧホールディングス	1,700	2,834.00	4,817,800	
スターゼン	8,000	2,067.00	16,536,000	
山善	42,600	1,011.00	43,068,600	
椿本興業	1,900	3,835.00	7,286,500	
住友商事	699,200	1,875.00	1,311,000,000	
内田洋行	4,700	4,950.00	23,265,000	
三菱商事	774,800	3,949.00	3,059,685,200	
第一実業	4,600	3,335.00	15,341,000	
キヤノンマーケティングジャパン	29,300	2,938.00	86,083,400	
西華産業	5,100	1,682.00	8,578,200	
佐藤商事	8,100	1,123.00	9,096,300	
菱洋エレクトロ	7,000	2,334.00	16,338,000	
東京産業	9,600	727.00	6,979,200	
ユアサ商事	9,500	3,625.00	34,437,500	
神鋼商事	2,600	3,820.00	9,932,000	
トルク	6,400	202.00	1,292,800	
阪和興業	20,500	2,841.00	58,240,500	
正栄食品工業	7,700	3,875.00	29,837,500	
カナデン	9,600	1,056.00	10,137,600	
菱電商事	9,400	1,648.00	15,491,200	
岩谷産業	26,200	5,560.00	145,672,000	
ナイス	3,600	1,710.00	6,156,000	
ニチモウ	1,400	2,390.00	3,346,000	
極東貿易	3,400	2,646.00	8,996,400	
アステナホールディングス	15,200	439.00	6,672,800	
三愛オブリ	26,500	1,048.00	27,772,000	
稲畑産業	23,700	2,364.00	56,026,800	

ＧＳＩクレオス	5,700	1,459.00	8,316,300	
明和産業	10,900	743.00	8,098,700	
クワザワホールディングス	4,300	453.00	1,947,900	
ワキタ	21,300	1,113.00	23,706,900	
東邦ホールディングス	32,100	2,143.00	68,790,300	
サンゲツ	28,700	1,621.00	46,522,700	
ミツウロコグループホールディングス	13,600	939.00	12,770,400	
シナネンホールディングス	3,900	3,555.00	13,864,500	
伊藤忠エネクス	26,100	1,076.00	28,083,600	
サンリオ	33,200	3,035.00	100,762,000	
サンワテクノス	6,000	1,383.00	8,298,000	
リョーサン	12,100	2,219.00	26,849,900	
新光商事	15,600	909.00	14,180,400	
トーホー	4,500	1,246.00	5,607,000	
三信電気	4,900	1,544.00	7,565,600	
東陽テクニカ	11,700	1,198.00	14,016,600	
モスフードサービス	15,500	3,390.00	52,545,000	
加賀電子	9,600	3,185.00	30,576,000	
ソーダニッカ	9,500	580.00	5,510,000	
立花エレテック	7,700	1,565.00	12,050,500	
フォーバル	4,200	870.00	3,654,000	
ＰＡＬＴＡＣ	16,600	4,415.00	73,289,000	
三谷産業	18,500	314.00	5,809,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,700	3,935.00	10,624,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	1,692.00	1,861,200	
コーア商事ホールディングス	7,400	728.00	5,387,200	
国際紙パルプ商事	21,900	487.00	10,665,300	
ヤマタネ	5,100	1,590.00	8,109,000	
丸紅建材リース	1,000	1,947.00	1,947,000	
日鉄物産	7,200	5,120.00	36,864,000	
泉州電業	2,900	5,070.00	14,703,000	
トラスコ中山	24,600	1,919.00	47,207,400	
オートバックスセブン	36,700	1,440.00	52,848,000	
モリト	8,600	767.00	6,596,200	
加藤産業	12,800	3,395.00	43,456,000	
北恵	3,000	797.00	2,391,000	
イノテック	7,200	1,334.00	9,604,800	
イエローハット	18,600	1,783.00	33,163,800	
ＪＫホールディングス	8,300	995.00	8,258,500	
日伝	8,000	1,982.00	15,856,000	
北沢産業	6,300	201.00	1,266,300	
杉本商事	5,500	2,105.00	11,577,500	

因幡電機産業	29,400	2,805.00	82,467,000	
東テク	3,500	3,475.00	12,162,500	
ミスミグループ本社	148,400	3,235.00	480,074,000	
アルテック	7,300	286.00	2,087,800	
タキヒヨー	3,200	825.00	2,640,000	
蔵王産業	2,300	1,878.00	4,319,400	
スズケン	42,400	3,880.00	164,512,000	
ジェコス	8,200	835.00	6,847,000	
グローセル	12,900	402.00	5,185,800	
ローソン	26,200	4,765.00	124,843,000	
サンエー	8,100	4,305.00	34,870,500	
カワチ薬品	9,300	2,182.00	20,292,600	
エービーシー・マート	18,500	5,780.00	106,930,000	
ハードオフコーポレーション	5,400	1,008.00	5,443,200	
アスクル	25,600	1,714.00	43,878,400	
ゲオホールディングス	14,400	1,409.00	20,289,600	
アダストリア	12,800	2,002.00	25,625,600	
くら寿司	12,400	3,210.00	39,804,000	
キャンドゥ	4,500	2,214.00	9,963,000	
アイケイ	4,200	447.00	1,877,400	
パルグループホールディングス	10,400	2,267.00	23,576,800	
エディオン	54,400	1,329.00	72,297,600	
サーラコーポレーション	24,300	727.00	17,666,100	
ワッツ	6,000	743.00	4,458,000	
ハローズ	5,500	3,130.00	17,215,000	
フジオフードグループ本社	8,800	1,347.00	11,853,600	
あみやき亭	2,900	2,964.00	8,595,600	
大黒天物産	3,800	5,710.00	21,698,000	
ハニーズホールディングス	9,500	1,296.00	12,312,000	
ファーマライズホールディングス	2,800	698.00	1,954,400	
アルペン	8,800	2,118.00	18,638,400	
ハブ	4,200	529.00	2,221,800	
クオールホールディングス	14,600	1,468.00	21,432,800	
ジンズホールディングス	6,300	3,685.00	23,215,500	
ビックカメラ	70,300	1,226.00	86,187,800	
ＤＣＭホールディングス	70,400	1,073.00	75,539,200	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	149,500	2,286.00	341,757,000	
東京一番フーズ	3,000	588.00	1,764,000	
きちりホールディングス	3,100	357.00	1,106,700	
アークランドサービスホールディングス	8,700	2,152.00	18,722,400	
Ｊ．フロント　リテイリング	131,200	1,090.00	143,008,000	
ドトール・日レスホールディングス	18,800	1,674.00	31,471,200	

マツキヨココカラ&カンパニー	69,300	4,935.00	341,995,500	
ブロンコビリー	6,300	2,446.00	15,409,800	
ＺＯＺＯ	81,300	2,903.00	236,013,900	
トレジャー・ファクトリー	3,600	1,581.00	5,691,600	
物語コーポレーション	5,900	5,640.00	33,276,000	
三越伊勢丹ホールディングス	177,600	1,058.00	187,900,800	
Ｈａｍｅｅ	4,500	1,016.00	4,572,000	
マーケットエンタープライズ	1,400	1,045.00	1,463,000	
ウエルシアホールディングス	62,500	3,035.00	189,687,500	
クリエイトＳＤホールディングス	17,500	3,125.00	54,687,500	
丸善ＣＨＩホールディングス	13,800	378.00	5,216,400	
ミサワ	2,700	603.00	1,628,100	
ティーライフ	1,700	1,400.00	2,380,000	
チムニー	3,600	1,226.00	4,413,600	
シュッピン	10,000	1,369.00	13,690,000	
オイシックス・ラ・大地	17,100	1,735.00	29,668,500	
ネクステージ	24,100	2,799.00	67,455,900	
ジョイフル本田	34,000	1,669.00	56,746,000	
鳥貴族ホールディングス	4,000	2,159.00	8,636,000	
ホットランド	9,000	1,335.00	12,015,000	
すかいらーくホールディングス	144,200	1,599.00	230,575,800	
ＳＦＰホールディングス	5,800	1,716.00	9,952,800	
綿半ホールディングス	8,300	1,465.00	12,159,500	
ヨシックスホールディングス	2,400	2,245.00	5,388,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	34,500	1,144.00	39,468,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,300	1,714.00	10,798,200	
ＢＥＥＮＯＳ	6,000	2,497.00	14,982,000	
あさひ	9,900	1,319.00	13,058,100	
日本調剤	7,300	1,420.00	10,366,000	
コスモス薬品	11,900	14,240.00	169,456,000	
トーエル	5,400	922.00	4,978,800	
セブン&アイ・ホールディングス	396,300	5,357.00	2,122,979,100	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	79,300	984.00	78,031,200	
ツルハホールディングス	25,800	7,770.00	200,466,000	
サンマルクホールディングス	9,500	1,625.00	15,437,500	
フェリシモ	2,800	1,104.00	3,091,200	
トリドールホールディングス	29,500	2,548.00	75,166,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	11,500	324.00	3,726,000	
ウイルプラスホールディングス	2,400	907.00	2,176,800	
ＪＭホールディングス	9,100	1,642.00	14,942,200	
サツドラホールディングス	5,600	651.00	3,645,600	

アレンザホールディングス	8,100	1,057.00	8,561,700	
串カツ田中ホールディングス	3,300	1,879.00	6,200,700	
バロックジャパンリミテッド	8,500	828.00	7,038,000	
クスリのアオキホールディングス	10,600	5,660.00	59,996,000	
力の源ホールディングス	6,000	666.00	3,996,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	60,600	2,505.00	151,803,000	
メディカルシステムネットワーク	10,800	441.00	4,762,800	
はるやまホールディングス	6,000	437.00	2,622,000	
ノジマ	19,200	3,035.00	58,272,000	
カッパ・クリエイト	16,600	1,480.00	24,568,000	
ライトオン	8,800	748.00	6,582,400	
良品計画	136,100	1,382.00	188,090,200	
パリミキホールディングス	15,400	268.00	4,127,200	
アドヴァングループ	10,300	807.00	8,312,100	
アルビス	3,500	2,307.00	8,074,500	
コナカ	12,800	341.00	4,364,800	
ハウス　オブ　ローゼ	1,600	1,655.00	2,648,000	
Ｇ－７ホールディングス	13,300	1,507.00	20,043,100	
イオン北海道	15,700	1,066.00	16,736,200	
コジマ	20,600	688.00	14,172,800	
ヒマラヤ	3,900	990.00	3,861,000	
コーナン商事	16,900	3,880.00	65,572,000	
エコス	4,000	2,027.00	8,108,000	
ワタミ	14,300	921.00	13,170,300	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	236,400	2,130.00	503,532,000	
西松屋チェーン	23,500	1,678.00	39,433,000	
ゼンショーホールディングス	57,800	3,485.00	201,433,000	
幸楽苑ホールディングス	6,900	1,296.00	8,942,400	
ハークスレイ	5,300	557.00	2,952,100	
サイゼリヤ	17,600	2,765.00	48,664,000	
ＶＴホールディングス	44,900	493.00	22,135,700	
魚力	3,400	2,497.00	8,489,800	
フジ・コーポレーション	6,400	1,265.00	8,096,000	
ユナイテッドアローズ	12,500	1,814.00	22,675,000	
ハイデイ日高	17,200	2,172.00	37,358,400	
ＹＵ－ＷＡ　Ｃｒｅａｔｉｏｎ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	7,900	203.00	1,603,700	
コロワイド	48,600	1,933.00	93,943,800	
ピーシーデポコーポレーション	14,400	306.00	4,406,400	
壱番屋	8,400	4,725.00	39,690,000	
ＰＬＡＮＴ	3,000	658.00	1,974,000	

スギホールディングス	23,600	6,060.00	143,016,000	
薬王堂ホールディングス	6,000	2,082.00	12,492,000	
スクロール	18,400	935.00	17,204,000	
ヨンドシーホールディングス	10,100	1,814.00	18,321,400	
木曽路	15,800	2,255.00	35,629,000	
ＳＲＳホールディングス	17,200	881.00	15,153,200	
千趣会	21,900	388.00	8,497,200	
リテールパートナーズ	15,800	1,275.00	20,145,000	
ケーヨー	22,000	988.00	21,736,000	
上新電機	11,600	2,080.00	24,128,000	
日本瓦斯	56,600	1,986.00	112,407,600	
ロイヤルホールディングス	18,300	2,137.00	39,107,100	
いなげや	11,800	1,290.00	15,222,000	
チヨダ	10,300	846.00	8,713,800	
ライフコーポレーション	9,300	2,656.00	24,700,800	
リンガーハット	13,600	2,352.00	31,987,200	
ＭｒＭａｘＨＤ	15,100	638.00	9,633,800	
ＡＯＫＩホールディングス	23,200	681.00	15,799,200	
オークワ	17,000	875.00	14,875,000	
コメリ	18,300	2,789.00	51,038,700	
青山商事	22,800	905.00	20,634,000	
しまむら	13,800	13,130.00	181,194,000	
はせがわ	7,100	253.00	1,796,300	
高島屋	79,500	1,432.00	113,844,000	
松屋	20,000	926.00	18,520,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	51,400	1,002.00	51,502,800	
近鉄百貨店	3,500	2,341.00	8,193,500	
丸井グループ	85,600	2,392.00	204,755,200	
アクシアル　リテイリング	7,900	3,510.00	27,729,000	
イオン	389,800	2,689.50	1,048,367,100	
イズミ	18,700	3,265.00	61,055,500	
平和堂	17,700	2,062.00	36,497,400	
フジ	25,900	2,174.00	56,306,600	
ヤオコー	13,400	6,500.00	87,100,000	
ゼビオホールディングス	16,300	943.00	15,370,900	
ケーズホールディングス	100,700	1,417.00	142,691,900	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	5,600	608.00	3,404,800	
日産東京販売ホールディングス	18,200	272.00	4,950,400	
シルバーライフ	2,600	1,300.00	3,380,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	5,300	3,540.00	18,762,000	
ナルミヤ・インターナショナル	2,900	880.00	2,552,000	
ブックオフグループホールディングス	6,900	994.00	6,858,600	

ギフトホールディングス	1,900	2,597.00	4,934,300	
アインホールディングス	14,500	7,420.00	107,590,000	
元気寿司	3,400	2,587.00	8,795,800	
ヤマダホールディングス	418,500	499.00	208,831,500	
アークランドサカモト	18,600	1,605.00	29,853,000	
ニトリホールディングス	46,900	14,465.00	678,408,500	
グルメ杵屋	9,600	1,047.00	10,051,200	
愛眼	8,600	178.00	1,530,800	
ケーユーホールディングス	6,400	1,186.00	7,590,400	
吉野家ホールディングス	41,300	2,550.00	105,315,000	
松屋フーズホールディングス	5,700	4,125.00	23,512,500	
サガミホールディングス	17,100	1,182.00	20,212,200	
関西フードマーケット	9,700	1,280.00	12,416,000	
王将フードサービス	7,800	6,930.00	54,054,000	
プレナス	13,300	2,003.00	26,639,900	
ミニストップ	8,800	1,470.00	12,936,000	
アークス	21,000	2,174.00	45,654,000	
バローホールディングス	24,200	1,935.00	46,827,000	
ベルク	5,300	5,450.00	28,885,000	
大庄	6,500	1,171.00	7,611,500	
ファーストリテイリング	15,800	79,780.00	1,260,524,000	
サンドラッグ	44,500	3,140.00	139,730,000	
サックスバー　ホールディングス	11,500	607.00	6,980,500	
ヤマザワ	2,600	1,431.00	3,720,600	
やまや	2,400	2,634.00	6,321,600	
ベルーナ	25,600	826.00	21,145,600	
島根銀行	3,800	491.00	1,865,800	
じもとホールディングス	7,800	573.00	4,469,400	
めぶきフィナンシャルグループ	486,800	269.00	130,949,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,700	2,187.00	29,961,900	
九州フィナンシャルグループ	207,100	386.00	79,940,600	
ゆうちょ銀行	279,300	1,070.00	298,851,000	
富山第一銀行	26,300	430.00	11,309,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	585,800	450.00	263,610,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	62,100	743.00	46,140,300	
三十三フィナンシャルグループ	9,500	1,406.00	13,357,000	
第四北越フィナンシャルグループ	16,700	2,544.00	42,484,800	
ひろぎんホールディングス	151,300	614.00	92,898,200	
おきなわフィナンシャルグループ	10,000	2,233.00	22,330,000	
十六フィナンシャルグループ	13,800	2,461.00	33,961,800	
北國フィナンシャルホールディングス	9,800	4,550.00	44,590,000	
プロクレアホールディングス	12,000	2,041.00	24,492,000	

新生銀行	77,200	1,988.00	153,473,600	
あおぞら銀行	66,100	2,788.00	184,286,800	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	6,926,600	735.70	5,095,899,620	
りそなホールディングス	1,252,100	510.00	638,571,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	195,700	4,264.00	834,464,800	
三井住友フィナンシャルグループ	767,900	4,116.00	3,160,676,400	
千葉銀行	334,200	731.00	244,300,200	
群馬銀行	190,400	379.00	72,161,600	
武蔵野銀行	15,100	1,779.00	26,862,900	
千葉興業銀行	25,500	258.00	6,579,000	
筑波銀行	46,100	196.00	9,035,600	
七十七銀行	31,400	1,759.00	55,232,600	
秋田銀行	7,100	1,672.00	11,871,200	
山形銀行	10,900	909.00	9,908,100	
岩手銀行	7,200	1,982.00	14,270,400	
東邦銀行	84,700	209.00	17,702,300	
東北銀行	5,300	965.00	5,114,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	85,400	2,325.00	198,555,000	
静岡銀行	243,900	809.00	197,315,100	
スルガ銀行	103,800	375.00	38,925,000	
八十二銀行	219,500	498.00	109,311,000	
山梨中央銀行	11,900	1,133.00	13,482,700	
大垣共立銀行	20,300	1,743.00	35,382,900	
福井銀行	9,400	1,387.00	13,037,800	
清水銀行	4,200	1,464.00	6,148,800	
富山銀行	1,800	1,817.00	3,270,600	
滋賀銀行	19,300	2,732.00	52,727,600	
南都銀行	16,000	2,010.00	32,160,000	
百五銀行	99,400	324.00	32,205,600	
京都銀行	36,700	5,570.00	204,419,000	
紀陽銀行	35,100	1,424.00	49,982,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	67,200	850.00	57,120,000	
山陰合同銀行	65,800	674.00	44,349,200	
中国銀行	83,300	968.00	80,634,400	
鳥取銀行	3,800	1,145.00	4,351,000	
伊予銀行	132,700	639.00	84,795,300	
百十四銀行	10,900	1,711.00	18,649,900	
四国銀行	15,600	846.00	13,197,600	
阿波銀行	15,700	2,020.00	31,714,000	
大分銀行	6,400	1,922.00	12,300,800	
宮崎銀行	6,400	2,091.00	13,382,400	
佐賀銀行	6,200	1,470.00	9,114,000	

琉球銀行	25,700	806.00	20,714,200	
セブン銀行	351,400	267.00	93,823,800	
みずほフィナンシャルグループ	1,418,800	1,580.50	2,242,413,400	
高知銀行	3,700	694.00	2,567,800	
山口フィナンシャルグループ	118,200	751.00	88,768,200	
長野銀行	3,600	1,301.00	4,683,600	
名古屋銀行	7,200	3,025.00	21,780,000	
北洋銀行	148,700	227.00	33,754,900	
愛知銀行	3,700	5,180.00	19,166,000	
中京銀行	3,700	1,671.00	6,182,700	
大光銀行	3,500	1,334.00	4,669,000	
愛媛銀行	15,400	878.00	13,521,200	
トマト銀行	3,600	1,005.00	3,618,000	
京葉銀行	49,400	470.00	23,218,000	
栃木銀行	53,100	275.00	14,602,500	
北日本銀行	3,400	1,661.00	5,647,400	
東和銀行	19,400	523.00	10,146,200	
福島銀行	12,500	216.00	2,700,000	
大東銀行	5,200	648.00	3,369,600	
トモニホールディングス	85,400	312.00	26,644,800	
フィデアホールディングス	10,800	1,292.00	13,953,600	
池田泉州ホールディングス	125,600	205.00	25,748,000	
ＦＰＧ	40,000	1,012.00	40,480,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	9,300	1,442.00	13,410,600	
マーキュリアホールディングス	6,600	596.00	3,933,600	
ＳＢＩホールディングス	146,200	2,663.00	389,330,600	
ジャフコ　グループ	41,000	1,805.00	74,005,000	
大和証券グループ本社	760,200	615.30	467,751,060	
野村ホールディングス	1,807,100	506.10	914,573,310	
岡三証券グループ	85,800	351.00	30,115,800	
丸三証券	35,500	487.00	17,288,500	
東洋証券	36,500	235.00	8,577,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	116,900	381.00	44,538,900	
光世証券	2,800	455.00	1,274,000	
水戸証券	29,500	269.00	7,935,500	
いちよし証券	19,800	640.00	12,672,000	
松井証券	58,100	802.00	46,596,200	
マネックスグループ	100,000	462.00	46,200,000	
極東証券	13,700	707.00	9,685,900	
岩井コスモホールディングス	11,300	1,277.00	14,430,100	
アイザワ証券グループ	16,200	711.00	11,518,200	
マネーパートナーズグループ	13,200	253.00	3,339,600	

スパークス・グループ	55,200	301.00	16,615,200	
かんぽ生命保険	119,100	2,167.00	258,089,700	
ＳＯＭＰＯホールディングス	168,400	5,936.00	999,622,400	
アニコム　ホールディングス	36,300	688.00	24,974,400	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	243,200	4,339.00	1,055,244,800	
第一生命ホールディングス	576,300	2,300.00	1,325,490,000	
東京海上ホールディングス	329,300	7,784.00	2,563,271,200	
Ｔ＆Ｄホールディングス	263,300	1,509.00	397,319,700	
アドバンスクリエイト	5,700	994.00	5,665,800	
全国保証	28,300	4,505.00	127,491,500	
あんしん保証	5,900	265.00	1,563,500	
イントラスト	5,500	585.00	3,217,500	
日本モーゲージサービス	6,900	991.00	6,837,900	
Ｃａｓａ	4,500	904.00	4,068,000	
アルヒ	17,800	1,049.00	18,672,200	
プレミアグループ	6,100	4,500.00	27,450,000	
ネットプロテクションズホールディングス	36,400	610.00	22,204,000	
クレディセゾン	69,300	1,696.00	117,532,800	
芙蓉総合リース	10,200	8,180.00	83,436,000	
みずほリース	14,700	3,280.00	48,216,000	
東京センチュリー	18,400	4,760.00	87,584,000	
日本証券金融	46,900	859.00	40,287,100	
アイフル	199,400	388.00	77,367,200	
リコーリース	10,600	3,645.00	38,637,000	
イオンフィナンシャルサービス	64,600	1,419.00	91,667,400	
アコム	234,400	344.00	80,633,600	
ジャックス	11,800	3,635.00	42,893,000	
オリエントコーポレーション	322,400	135.00	43,524,000	
オリックス	703,200	2,301.50	1,618,414,800	
三菱ＨＣキャピタル	383,000	638.00	244,354,000	
九州リースサービス	5,600	575.00	3,220,000	
日本取引所グループ	275,800	2,188.50	603,588,300	
イー・ギャランティ	17,700	2,276.00	40,285,200	
アサックス	6,700	612.00	4,100,400	
ＮＥＣキャピタルソリューション	5,000	2,101.00	10,505,000	
いちご	135,500	299.00	40,514,500	
日本駐車場開発	123,200	171.00	21,067,200	
スター・マイカ・ホールディングス	7,100	1,488.00	10,564,800	
ＳＲＥホールディングス	3,400	2,427.00	8,251,800	
ＡＤワークスグループ	21,100	154.00	3,249,400	
ヒューリック	258,500	1,054.00	272,459,000	
三栄建築設計	5,400	1,629.00	8,796,600	

野村不動産ホールディングス	61,600	3,225.00	198,660,000	
三重交通グループホールディングス	26,200	486.00	12,733,200	
サムティ	17,900	2,050.00	36,695,000	
ディア・ライフ	16,300	615.00	10,024,500	
地主	8,000	2,025.00	16,200,000	
プレサンスコーポレーション	13,600	1,596.00	21,705,600	
ハウスコム	3,200	903.00	2,889,600	
ＪＰＭＣ	6,800	1,011.00	6,874,800	
サンセイランディック	4,700	849.00	3,990,300	
フージャースホールディングス	15,100	809.00	12,215,900	
オープンハウスグループ	37,800	5,780.00	218,484,000	
東急不動産ホールディングス	323,300	709.00	229,219,700	
飯田グループホールディングス	99,200	2,194.00	217,644,800	
イーグランド	2,400	1,427.00	3,424,800	
ムゲンエステート	9,500	478.00	4,541,000	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	5,800	830.00	4,814,000	
シーアールイー	5,100	1,688.00	8,608,800	
ケイアイスター不動産	5,500	4,795.00	26,372,500	
グッドコムアセット	6,000	1,232.00	7,392,000	
ジェイ・エス・ビー	2,700	3,195.00	8,626,500	
ロードスターキャピタル	3,500	1,906.00	6,671,000	
テンポイノベーション	4,500	897.00	4,036,500	
フェイスネットワーク	2,300	1,360.00	3,128,000	
パーク２４	70,700	1,849.00	130,724,300	
パラカ	4,000	1,867.00	7,468,000	
三井不動産	462,200	2,905.00	1,342,691,000	
三菱地所	674,400	1,957.00	1,319,800,800	
平和不動産	19,100	3,965.00	75,731,500	
東京建物	101,900	1,903.00	193,915,700	
京阪神ビルディング	16,300	1,293.00	21,075,900	
住友不動産	213,100	3,617.00	770,782,700	
テーオーシー	19,100	790.00	15,089,000	
東京楽天地	2,000	4,025.00	8,050,000	
スターツコーポレーション	16,500	2,868.00	47,322,000	
フジ住宅	15,400	671.00	10,333,400	
空港施設	13,800	549.00	7,576,200	
明和地所	7,300	626.00	4,569,800	
ゴールドクレスト	10,000	1,748.00	17,480,000	
エスリード	5,200	1,721.00	8,949,200	
日神グループホールディングス	21,800	439.00	9,570,200	
日本エスコン	22,000	765.00	16,830,000	
タカラレーベン	49,600	369.00	18,302,400	

ＡＶＡＮＴＩＡ	6,900	829.00	5,720,100	
イオンモール	60,000	1,681.00	100,860,000	
毎日コムネット	5,800	621.00	3,601,800	
ファースト住建	5,400	1,122.00	6,058,800	
カチタス	29,600	3,280.00	97,088,000	
トーセイ	17,200	1,264.00	21,740,800	
穴吹興産	3,100	2,117.00	6,562,700	
サンフロンティア不動産	17,300	1,104.00	19,099,200	
ＦＪネクストホールディングス	12,600	1,082.00	13,633,200	
インテリックス	2,700	545.00	1,471,500	
ランドビジネス	4,000	231.00	924,000	
サンネクスタグループ	4,800	1,021.00	4,900,800	
グランディハウス	10,000	551.00	5,510,000	
日本空港ビルデング	38,400	5,150.00	197,760,000	
明豊ファシリティワークス	5,600	656.00	3,673,600	
日本工営	7,400	3,440.00	25,456,000	
ＬＩＦＵＬＬ	36,200	175.00	6,335,000	
ミクシィ	26,300	2,280.00	59,964,000	
ジェイエイシーリクルートメント	9,400	1,947.00	18,301,800	
日本M&Aセンターホールディングス	188,200	1,723.00	324,268,600	
メンバーズ	3,100	2,776.00	8,605,600	
中広	2,400	398.00	955,200	
ＵＴグループ	16,600	2,530.00	41,998,000	
アイティメディア	5,600	1,622.00	9,083,200	
Ｅ・Ｊホールディングス	6,700	1,327.00	8,890,900	
夢真ビーネックスグループ	37,500	1,589.00	59,587,500	
コシダカホールディングス	31,000	685.00	21,235,000	
アルトナー	3,000	921.00	2,763,000	
パソナグループ	12,500	1,951.00	24,387,500	
ＣＤＳ	2,900	1,843.00	5,344,700	
リンクアンドモチベーション	25,300	555.00	14,041,500	
エス・エム・エス	39,000	3,095.00	120,705,000	
サニーサイドアップグループ	4,300	679.00	2,919,700	
パーソルホールディングス	114,700	2,718.00	311,754,600	
リニカル	6,700	820.00	5,494,000	
クックパッド	37,000	205.00	7,585,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	5,900	589.00	3,475,100	
学情	4,800	1,057.00	5,073,600	
スタジオアリス	5,200	2,262.00	11,762,400	
シミックホールディングス	5,800	1,519.00	8,810,200	
エプコ	2,700	680.00	1,836,000	
ＮＪＳ	2,600	1,973.00	5,129,800	

綜合警備保障	41,900	4,015.00	168,228,500	
カカクコム	84,200	2,566.00	216,057,200	
アイロムグループ	4,100	1,946.00	7,978,600	
セントケア・ホールディング	7,700	897.00	6,906,900	
サイネックス	2,300	594.00	1,366,200	
ルネサンス	8,200	956.00	7,839,200	
ディップ	20,200	3,570.00	72,114,000	
デジタルホールディングス	8,100	1,303.00	10,554,300	
新日本科学	14,100	1,942.00	27,382,200	
キャリアデザインセンター	2,500	1,167.00	2,917,500	
ベネフィット・ワン	41,800	1,993.00	83,307,400	
エムスリー	202,400	3,926.00	794,622,400	
ツカダ・グローバルホールディング	7,300	316.00	2,306,800	
アウトソーシング	65,900	1,141.00	75,191,900	
ウェルネット	10,600	452.00	4,791,200	
ワールドホールディングス	4,700	2,330.00	10,951,000	
ディー・エヌ・エー	43,800	1,955.00	85,629,000	
博報堂ＤＹホールディングス	145,300	1,375.00	199,787,500	
ぐるなび	17,300	374.00	6,470,200	
タカミヤ	14,400	383.00	5,515,200	
ジャパンベストレスキューシステム	6,500	763.00	4,959,500	
ファンコミュニケーションズ	26,300	391.00	10,283,300	
ライク	3,900	2,150.00	8,385,000	
ビジネス・ブレークスルー	4,700	422.00	1,983,400	
エスプール	32,600	1,027.00	33,480,200	
ＷＤＢホールディングス	5,300	2,549.00	13,509,700	
ティア	7,200	433.00	3,117,600	
ＣＤＧ	1,400	1,283.00	1,796,200	
アドウェイズ	17,500	701.00	12,267,500	
バリューコマース	9,100	3,130.00	28,483,000	
インフォマート	126,100	450.00	56,745,000	
ＪＰホールディングス	30,300	259.00	7,847,700	
エコナックホールディングス	22,000	90.00	1,980,000	
ＣＬホールディングス	2,600	934.00	2,428,400	
プレステージ・インターナショナル	43,300	682.00	29,530,600	
アミューズ	6,300	2,020.00	12,726,000	
ドリームインキュベータ	3,600	2,034.00	7,322,400	
クイック	7,300	1,464.00	10,687,200	
ＴＡＣ	7,200	214.00	1,540,800	
電通グループ	107,500	4,555.00	489,662,500	
イオンファンタジー	4,500	2,854.00	12,843,000	
シーティーエス	13,200	840.00	11,088,000	

ネクシィーズグループ	3,900	590.00	2,301,000	
H．U．グループホールディングス	30,000	3,220.00	96,600,000	
アルプス技研	9,800	1,896.00	18,580,800	
ダイオーズ	2,400	1,091.00	2,618,400	
日本空調サービス	12,300	797.00	9,803,100	
オリエンタルランド	121,900	19,270.00	2,349,013,000	
ダスキン	24,800	3,045.00	75,516,000	
明光ネットワークジャパン	13,800	612.00	8,445,600	
ファルコホールディングス	5,200	1,971.00	10,249,200	
ラウンドワン	32,100	1,450.00	46,545,000	
リゾートトラスト	48,600	2,109.00	102,497,400	
ビー・エム・エル	14,600	3,930.00	57,378,000	
りらいあコミュニケーションズ	17,100	1,119.00	19,134,900	
リソー教育	53,100	303.00	16,089,300	
早稲田アカデミー	6,500	1,175.00	7,637,500	
ユー・エス・エス	128,400	2,648.00	340,003,200	
東京個別指導学院	10,500	599.00	6,289,500	
サイバーエージェント	245,000	1,356.00	332,220,000	
楽天グループ	532,400	653.00	347,657,200	
クリーク・アンド・リバー社	6,100	2,326.00	14,188,600	
モーニングスター	20,400	517.00	10,546,800	
テー・オー・ダブリュー	22,500	320.00	7,200,000	
山田コンサルティンググループ	6,100	1,198.00	7,307,800	
セントラルスポーツ	4,400	2,557.00	11,250,800	
フルキャストホールディングス	9,900	2,260.00	22,374,000	
エン・ジャパン	20,500	2,037.00	41,758,500	
リソルホールディングス	1,300	4,800.00	6,240,000	
テクノプロ・ホールディングス	68,700	3,045.00	209,191,500	
アトラグループ	2,500	192.00	480,000	
インターワークス	3,900	368.00	1,435,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	5,400	2,164.00	11,685,600	
ＫｅｅＰｅｒ技研	7,400	3,465.00	25,641,000	
ファーストロジック	2,000	774.00	1,548,000	
三機サービス	2,200	994.00	2,186,800	
Ｇｕｎｏｓｙ	6,600	805.00	5,313,000	
デザインワン・ジャパン	4,500	180.00	810,000	
イー・ガーディアン	3,900	3,155.00	12,304,500	
リブセンス	7,500	169.00	1,267,500	
ジャパンマテリアル	35,400	1,869.00	66,162,600	
ベクトル	16,200	1,210.00	19,602,000	
ウチヤマホールディングス	6,300	309.00	1,946,700	
チャーム・ケア・コーポレーション	8,700	1,179.00	10,257,300	

キャリアリンク	4,300	2,163.00	9,300,900	
ＩＢＪ	9,700	708.00	6,867,600	
アサンテ	5,200	1,575.00	8,190,000	
バリューＨＲ	10,100	1,363.00	13,766,300	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	9,500	3,530.00	33,535,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,600	1,299.00	5,975,400	
ＥＲＩホールディングス	3,400	1,053.00	3,580,200	
アビスト	1,800	2,991.00	5,383,800	
シグマクシス・ホールディングス	14,000	1,200.00	16,800,000	
ウィルグループ	8,700	1,224.00	10,648,800	
エスクロー・エージェント・ジャパン	13,200	161.00	2,125,200	
メドピア	8,100	2,072.00	16,783,200	
レアジョブ	2,500	552.00	1,380,000	
リクルートホールディングス	821,300	4,700.00	3,860,110,000	
エラン	16,000	1,097.00	17,552,000	
土木管理総合試験所	5,900	327.00	1,929,300	
ネットマーケティング	6,000	598.00	3,588,000	
日本郵政	1,252,800	965.20	1,209,202,560	
ベルシステム２４ホールディングス	16,600	1,499.00	24,883,400	
鎌倉新書	13,400	584.00	7,825,600	
ＳＭＮ	2,900	579.00	1,679,100	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	2,000	727.00	1,454,000	
エアトリ	6,700	2,378.00	15,932,600	
アトラエ	8,200	1,780.00	14,596,000	
ストライク	5,100	3,785.00	19,303,500	
ソラスト	28,400	844.00	23,969,600	
セラク	3,800	1,210.00	4,598,000	
インソース	12,800	2,300.00	29,440,000	
ベイカレント・コンサルティング	8,100	36,700.00	297,270,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,300	2,646.00	6,085,800	
アイモバイル	5,900	1,335.00	7,876,500	
キャリアインデックス	4,300	548.00	2,356,400	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,900	871.00	4,267,900	
船場	2,600	708.00	1,840,800	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	36,500	1,588.00	57,962,000	
フルテック	1,800	1,326.00	2,386,800	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	3,900	463.00	1,805,700	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	2,000	639.00	1,278,000	
ウェルビー	7,800	763.00	5,951,400	
エル・ティー・エス	1,500	3,565.00	5,347,500	
ミダックホールディングス	5,200	2,848.00	14,809,600	
日総工産	9,300	586.00	5,449,800	

キュービーネットホールディングス	5,500	1,342.00	7,381,000	
ＲＰＡホールディングス	16,800	313.00	5,258,400	
スプリックス	4,100	1,013.00	4,153,300	
マネジメントソリューションズ	5,700	2,850.00	16,245,000	
プロレド・パートナーズ	2,900	489.00	1,418,100	
テノ．ホールディングス	1,700	635.00	1,079,500	
フロンティア・マネジメント	3,100	1,318.00	4,085,800	
ピアラ	2,100	696.00	1,461,600	
コプロ・ホールディングス	2,500	847.00	2,117,500	
ギークス	2,200	1,017.00	2,237,400	
カーブスホールディングス	31,800	682.00	21,687,600	
フォーラムエンジニアリング	7,200	959.00	6,904,800	
Ｆａｓｔ　Ｆｉｔｎｅｓｓ　Ｊａｐａｎ	2,200	1,420.00	3,124,000	
ダイレクトマーケティングミックス	11,700	2,001.00	23,411,700	
ポピンズ	2,800	1,879.00	5,261,200	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	9,400	2,439.00	22,926,600	
アドバンテッジリスクマネジメント	6,200	510.00	3,162,000	
リログループ	62,800	2,120.00	133,136,000	
東祥	8,700	1,333.00	11,597,100	
ビーウィズ	3,200	1,450.00	4,640,000	
ＴＲＥホールディングス	21,700	1,546.00	33,548,200	
人・夢・技術グループ	4,600	2,599.00	11,955,400	
エイチ・アイ・エス	23,900	1,975.00	47,202,500	
ラックランド	3,500	2,976.00	10,416,000	
共立メンテナンス	20,500	4,985.00	102,192,500	
イチネンホールディングス	11,900	1,268.00	15,089,200	
建設技術研究所	5,900	2,693.00	15,888,700	
スペース	7,700	898.00	6,914,600	
燦ホールディングス	5,100	1,876.00	9,567,600	
スバル興業	700	8,960.00	6,272,000	
東京テアトル	4,200	1,224.00	5,140,800	
タナベ経営	4,700	692.00	3,252,400	
ナガワ	3,200	8,000.00	25,600,000	
東京都競馬	8,600	4,165.00	35,819,000	
カナモト	18,900	2,054.00	38,820,600	
西尾レントオール	9,600	2,850.00	27,360,000	
トランス・コスモス	14,600	3,800.00	55,480,000	
乃村工藝社	49,400	890.00	43,966,000	
藤田観光	5,000	2,637.00	13,185,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	7,100	1,494.00	10,607,400	
日本管財	12,300	2,673.00	32,877,900	
トーカイ	9,200	1,807.00	16,624,400	

セコム	113,000	8,942.00	1,010,446,000	
セントラル警備保障	5,600	2,554.00	14,302,400	
丹青社	21,900	822.00	18,001,800	
メイテック	40,900	2,389.00	97,710,100	
応用地質	11,000	1,741.00	19,151,000	
船井総研ホールディングス	21,600	2,322.00	50,155,200	
進学会ホールディングス	4,300	327.00	1,406,100	
オオバ	7,500	723.00	5,422,500	
いであ	2,900	1,723.00	4,996,700	
学究社	3,800	1,576.00	5,988,800	
ベネッセホールディングス	38,300	2,333.00	89,353,900	
イオンディライト	13,300	2,944.00	39,155,200	
ナック	5,600	966.00	5,409,600	
ダイセキ	21,000	3,810.00	80,010,000	
ステップ	4,300	1,758.00	7,559,400	
合　計	122,130,000		299,712,490,320	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月25日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	376,728,757
国債証券	323,896,121,710
地方債証券	20,162,650,370
特殊債券	23,357,306,449
社債券	17,251,336,000
未収利息	680,714,829
前払費用	17,892,949
流動資産合計	385,742,751,064

	2022年 7月25日現在
項目	金額（円）
資産合計	385,742,751,064
負債の部	
流動負債	
未払解約金	100,661,061
未払利息	153
流動負債合計	100,661,214
負債合計	100,661,214
純資産の部	
元本等	
元本	286,937,109,481
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	98,704,980,369
元本等合計	385,642,089,850
純資産合計	385,642,089,850
負債純資産合計	385,742,751,064

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 7月25日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 7月25日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		286,937,109,481口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。	
	有価証券	100,423,000円
3.	1口当たり純資産額	1.3440円

	2022年 7月25日現在
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額) (13,440円)

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

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2022年 7月25日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月25日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

	2022年 7月25日現在

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 7月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月27日
期首元本額	277,547,967,709円
期中追加設定元本額	24,042,104,512円
期中一部解約元本額	14,652,962,740円
期末元本額	286,937,109,481円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	799,529,142円
ＤＣ日本債券インデックスファンド	1,985,071,127円
ＤＣ日本債券インデックスファンドＬ	44,220,411,251円
ＤＣバランスファンド３０	11,865,055,437円
ＤＣバランスファンド５０	8,236,338,576円
ＤＣバランスファンド７０	2,320,383,962円
日本債券インデックスｅ	1,144,728,695円
インデックスコレクション（国内債券）	37,318,192,268円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	60,586,638,973円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	6,428,434,943円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	2,727,929,782円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	50,866,027,890円
日本債券パッシブファンド私募Ａ（適格機関投資家専用）	4,464,734,795円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	179,554,646円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	844,556,828円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	125,085,958円

区分	2022年 7月25日現在
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	81,449,125円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	216,152,398円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	2,903,309,226円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	988,930,985円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	11,292,552,623円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	141,307,157円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	276,629,144円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	2,918,808,490円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	162,307,797円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	342,366,818円
バランスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	3,037,754,111円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	341,698,739円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	788,325,775円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	66,603,248円
バランスファンドＶＡ２（適格機関投資家専用）	3,150,122,581円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	1,432,279,049円
バランスファンドＶＡ３（適格機関投資家専用）	23,511,156,346円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	442,580,340円
国内バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	127,871,059円
国内バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	38,179,872円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	560,943,131円
私募日本債券インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	3,107,194円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△8,258,337,590
地方債証券	△272,316,838
特殊債券	△277,300,724
社債券	△313,599,000
合計	△9,121,554,152

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第４２７回利付国債（２年）	740,000,000	741,124,800	
	第４２８回利付国債（２年）	110,000,000	110,174,900	
	第４２９回利付国債（２年）	540,000,000	540,864,000	
	第４３０回利付国債（２年）	1,300,000,000	1,302,145,000	
	第４３１回利付国債（２年）	310,000,000	310,523,900	
	第４３２回利付国債（２年）	180,000,000	180,309,600	
	第４３３回利付国債（２年）	1,690,000,000	1,692,822,300	
	第４３４回利付国債（２年）	935,000,000	936,561,450	
	第４３５回利付国債（２年）	200,000,000	200,336,000	
	第４３６回利付国債（２年）	1,220,000,000	1,222,037,400	
	第４３８回利付国債（２年）	405,000,000	405,664,200	
	第１３７回利付国債（５年）	2,580,000,000	2,586,837,000	
	第１３８回利付国債（５年）	3,560,000,000	3,570,751,200	
	第１３９回利付国債（５年）	2,220,000,000	2,227,148,400	
	第１４０回利付国債（５年）	2,520,000,000	2,528,870,400	
	第１４１回利付国債（５年）	3,975,000,000	3,990,860,250	
	第１４２回利付国債（５年）	2,010,000,000	2,018,944,500	
	第１４３回利付国債（５年）	1,890,000,000	1,899,279,900	
	第１４４回利付国債（５年）	2,890,000,000	2,905,548,200	
	第１４５回利付国債（５年）	3,515,000,000	3,535,527,600	
	第１４６回利付国債（５年）	1,070,000,000	1,076,569,800	
	第１４７回利付国債（５年）	2,560,000,000	2,567,475,200	
	第１４８回利付国債（５年）	2,720,000,000	2,727,425,600	
	第１４９回利付国債（５年）	3,430,000,000	3,438,540,700	
	第１５０回利付国債（５年）	2,960,000,000	2,965,860,800	
	第１５１回利付国債（５年）	2,120,000,000	2,122,946,800	
	第１５２回利付国債（５年）	1,330,000,000	1,337,727,300	
	第１回利付国債（４０年）	230,000,000	296,941,500	
	第２回利付国債（４０年）	350,000,000	434,714,000	
	第３回利付国債（４０年）	380,000,000	474,658,000	
	第４回利付国債（４０年）	665,000,000	827,958,250	
	第５回利付国債（４０年）	455,000,000	545,331,150	

第６回利付国債（４０年）	570,000,000	666,877,200	
第７回利付国債（４０年）	1,220,000,000	1,366,180,400	
第８回利付国債（４０年）	940,000,000	977,224,000	
第９回利付国債（４０年）	940,000,000	719,222,200	
第１０回利付国債（４０年）	1,390,000,000	1,249,707,300	
第１１回利付国債（４０年）	1,080,000,000	935,906,400	
第１２回利付国債（４０年）	640,000,000	495,680,000	
第１３回利付国債（４０年）	1,220,000,000	937,728,600	
第１４回利付国債（４０年）	1,325,000,000	1,089,653,500	
第１５回利付国債（４０年）	360,000,000	322,462,800	
第３３０回利付国債（１０年）	3,130,000,000	3,163,616,200	
第３３１回利付国債（１０年）	880,000,000	887,418,400	
第３３２回利付国債（１０年）	2,630,000,000	2,656,405,200	
第３３３回利付国債（１０年）	2,680,000,000	2,710,766,400	
第３３４回利付国債（１０年）	3,010,000,000	3,049,250,400	
第３３５回利付国債（１０年）	2,255,000,000	2,283,458,100	
第３３６回利付国債（１０年）	1,060,000,000	1,074,924,800	
第３３７回利付国債（１０年）	1,670,000,000	1,685,464,200	
第３３８回利付国債（１０年）	3,410,000,000	3,453,886,700	
第３３９回利付国債（１０年）	3,175,000,000	3,219,767,500	
第３４０回利付国債（１０年）	3,240,000,000	3,289,669,200	
第３４１回利付国債（１０年）	2,050,000,000	2,076,568,000	
第３４２回利付国債（１０年）	3,190,000,000	3,210,416,000	
第３４３回利付国債（１０年）	2,895,000,000	2,913,672,750	
第３４４回利付国債（１０年）	3,240,000,000	3,260,898,000	
第３４５回利付国債（１０年）	3,180,000,000	3,199,620,600	
第３４６回利付国債（１０年）	3,425,000,000	3,444,899,250	
第３４７回利付国債（１０年）	3,205,000,000	3,221,473,700	
第３４８回利付国債（１０年）	3,190,000,000	3,205,599,100	
第３４９回利付国債（１０年）	2,735,000,000	2,747,526,300	
第３５０回利付国債（１０年）	3,450,000,000	3,464,593,500	代用有価証券 100,000,000円
第３５１回利付国債（１０年）	1,840,000,000	1,847,028,800	
第３５２回利付国債（１０年）	2,730,000,000	2,740,046,400	
第３５３回利付国債（１０年）	2,870,000,000	2,880,073,700	
第３５４回利付国債（１０年）	2,780,000,000	2,789,201,800	
第３５５回利付国債（１０年）	2,810,000,000	2,816,744,000	
第３５６回利付国債（１０年）	2,930,000,000	2,934,160,600	
第３５７回利付国債（１０年）	2,560,000,000	2,560,000,000	
第３５８回利付国債（１０年）	2,730,000,000	2,726,887,800	
第３５９回利付国債（１０年）	2,215,000,000	2,210,658,600	
第３６０回利付国債（１０年）	3,320,000,000	3,310,604,400	
第３６１回利付国債（１０年）	2,930,000,000	2,919,041,800	

第３６２回利付国債（１０年）	2,680,000,000	2,667,404,000	
第３６３回利付国債（１０年）	3,635,000,000	3,614,244,150	
第３６４回利付国債（１０年）	2,675,000,000	2,659,297,750	
第３６５回利付国債（１０年）	3,690,000,000	3,666,088,800	
第３６６回利付国債（１０年）	2,038,000,000	2,056,484,660	
第１回利付国債（３０年）	50,000,000	59,694,500	
第２回利付国債（３０年）	100,000,000	117,242,000	
第３回利付国債（３０年）	140,000,000	163,696,400	
第４回利付国債（３０年）	190,000,000	233,321,900	
第５回利付国債（３０年）	180,000,000	212,106,600	
第６回利付国債（３０年）	20,000,000	24,103,000	
第７回利付国債（３０年）	790,000,000	951,088,900	
第９回利付国債（３０年）	180,000,000	200,986,200	
第１０回利付国債（３０年）	170,000,000	184,604,700	
第１１回利付国債（３０年）	430,000,000	494,590,300	
第１２回利付国債（３０年）	430,000,000	514,086,500	
第１３回利付国債（３０年）	330,000,000	391,419,600	
第１４回利付国債（３０年）	350,000,000	431,756,500	
第１５回利付国債（３０年）	370,000,000	461,415,900	
第１６回利付国債（３０年）	165,000,000	206,353,950	
第１７回利付国債（３０年）	420,000,000	521,102,400	
第１８回利付国債（３０年）	340,000,000	418,533,200	
第１９回利付国債（３０年）	280,000,000	345,265,200	
第２０回利付国債（３０年）	400,000,000	504,332,000	
第２１回利付国債（３０年）	910,000,000	1,126,352,500	
第２２回利付国債（３０年）	380,000,000	480,791,200	
第２３回利付国債（３０年）	170,000,000	215,452,900	
第２４回利付国債（３０年）	75,000,000	95,267,250	
第２５回利付国債（３０年）	185,000,000	230,356,450	
第２６回利付国債（３０年）	1,470,000,000	1,852,494,000	
第２７回利付国債（３０年）	890,000,000	1,136,725,800	
第２８回利付国債（３０年）	1,050,000,000	1,344,052,500	
第２９回利付国債（３０年）	880,000,000	1,115,725,600	
第３０回利付国債（３０年）	555,000,000	695,709,150	
第３１回利付国債（３０年）	570,000,000	705,802,500	
第３２回利付国債（３０年）	955,000,000	1,198,792,400	
第３３回利付国債（３０年）	1,150,000,000	1,387,440,500	
第３４回利付国債（３０年）	1,070,000,000	1,327,088,900	
第３５回利付国債（３０年）	1,350,000,000	1,629,882,000	
第３６回利付国債（３０年）	1,300,000,000	1,571,557,000	
第３７回利付国債（３０年）	1,355,000,000	1,613,669,500	
第３８回利付国債（３０年）	855,000,000	1,002,077,100	

第３９回利付国債（３０年）	925,000,000	1,101,286,500	
第４０回利付国債（３０年）	765,000,000	896,105,700	
第４１回利付国債（３０年）	625,000,000	719,893,750	
第４２回利付国債（３０年）	820,000,000	943,984,000	
第４３回利付国債（３０年）	845,000,000	972,231,650	
第４４回利付国債（３０年）	780,000,000	896,906,400	
第４５回利付国債（３０年）	890,000,000	986,796,400	
第４６回利付国債（３０年）	1,055,000,000	1,168,591,850	
第４７回利付国債（３０年）	1,055,000,000	1,188,446,950	
第４８回利付国債（３０年）	920,000,000	996,672,800	
第４９回利付国債（３０年）	1,030,000,000	1,114,470,300	
第５０回利付国債（３０年）	1,030,000,000	983,073,200	
第５１回利付国債（３０年）	1,095,000,000	925,702,050	
第５２回利付国債（３０年）	1,090,000,000	964,268,500	
第５３回利付国債（３０年）	930,000,000	839,724,900	
第５４回利付国債（３０年）	885,000,000	835,130,250	
第５５回利付国債（３０年）	920,000,000	866,042,000	
第５６回利付国債（３０年）	605,000,000	568,119,200	
第５７回利付国債（３０年）	1,085,000,000	1,015,332,150	
第５８回利付国債（３０年）	1,350,000,000	1,260,144,000	
第５９回利付国債（３０年）	530,000,000	481,441,400	
第６０回利付国債（３０年）	1,250,000,000	1,188,362,500	
第６１回利付国債（３０年）	910,000,000	820,410,500	
第６２回利付国債（３０年）	790,000,000	673,569,800	
第６３回利付国債（３０年）	1,030,000,000	850,316,500	
第６４回利付国債（３０年）	1,090,000,000	896,710,300	
第６５回利付国債（３０年）	760,000,000	626,224,800	
第６６回利付国債（３０年）	720,000,000	593,632,800	
第６７回利付国債（３０年）	1,090,000,000	941,487,500	
第６８回利付国債（３０年）	1,130,000,000	973,992,200	
第６９回利付国債（３０年）	920,000,000	813,933,200	
第７０回利付国債（３０年）	1,155,000,000	1,017,762,900	
第７１回利付国債（３０年）	785,000,000	690,399,650	
第７２回利付国債（３０年）	705,000,000	618,841,950	
第７３回利付国債（３０年）	1,370,000,000	1,201,531,100	
第７４回利付国債（３０年）	1,255,000,000	1,190,982,450	
第６４回利付国債（２０年）	410,000,000	419,610,400	
第６５回利付国債（２０年）	370,000,000	380,474,700	
第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	338,877,000	
第６７回利付国債（２０年）	310,000,000	320,214,500	
第６８回利付国債（２０年）	230,000,000	238,719,300	
第６９回利付国債（２０年）	530,000,000	549,212,500	
第７０回利付国債（２０年）	490,000,000	513,186,800	

第７１回利付国債（２０年）	400,000,000	417,404,000	
第７２回利付国債（２０年）	710,000,000	743,462,300	
第７３回利付国債（２０年）	540,000,000	567,102,600	
第７４回利付国債（２０年）	310,000,000	326,306,000	
第７５回利付国債（２０年）	360,000,000	380,883,600	
第７６回利付国債（２０年）	340,000,000	357,918,000	
第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	306,054,400	
第７８回利付国債（２０年）	520,000,000	550,019,600	
第７９回利付国債（２０年）	100,000,000	106,064,000	
第８０回利付国債（２０年）	250,000,000	265,887,500	
第８１回利付国債（２０年）	180,000,000	191,865,600	
第８２回利付国債（２０年）	485,000,000	518,503,800	
第８３回利付国債（２０年）	1,490,000,000	1,600,826,200	
第８４回利付国債（２０年）	190,000,000	203,484,300	
第８５回利付国債（２０年）	360,000,000	388,652,400	
第８６回利付国債（２０年）	240,000,000	260,856,000	
第８７回利付国債（２０年）	170,000,000	184,150,800	
第８８回利付国債（２０年）	340,000,000	371,450,000	
第８９回利付国債（２０年）	320,000,000	348,348,800	
第９０回利付国債（２０年）	420,000,000	459,425,400	
第９１回利付国債（２０年）	310,000,000	340,389,300	
第９２回利付国債（２０年）	790,000,000	864,560,200	
第９３回利付国債（２０年）	260,000,000	284,505,000	
第９４回利付国債（２０年）	445,000,000	489,014,950	
第９５回利付国債（２０年）	950,000,000	1,057,350,000	
第９６回利付国債（２０年）	200,000,000	220,638,000	
第９７回利付国債（２０年）	210,000,000	233,746,800	
第９８回利付国債（２０年）	370,000,000	409,934,100	
第９９回利付国債（２０年）	660,000,000	734,283,000	
第１００回利付国債（２０年）	760,000,000	853,244,400	
第１０１回利付国債（２０年）	360,000,000	408,232,800	
第１０２回利付国債（２０年）	1,070,000,000	1,219,018,900	
第１０３回利付国債（２０年）	1,335,000,000	1,513,075,650	
第１０４回利付国債（２０年）	260,000,000	291,618,600	
第１０５回利付国債（２０年）	730,000,000	822,301,200	
第１０６回利付国債（２０年）	270,000,000	305,796,600	
第１０７回利付国債（２０年）	500,000,000	565,775,000	
第１０８回利付国債（２０年）	975,000,000	1,090,810,500	
第１０９回利付国債（２０年）	290,000,000	325,661,300	
第１１０回利付国債（２０年）	515,000,000	585,158,450	
第１１１回利付国債（２０年）	450,000,000	516,186,000	
第１１２回利付国債（２０年）	950,000,000	1,083,190,000	

第１１３回利付国債（２０年）	905,000,000	1,035,392,400	
第１１４回利付国債（２０年）	610,000,000	699,901,800	
第１１５回利付国債（２０年）	370,000,000	427,250,100	
第１１６回利付国債（２０年）	260,000,000	301,332,200	
第１１７回利付国債（２０年）	240,000,000	276,331,200	
第１１８回利付国債（２０年）	450,000,000	516,217,500	
第１１９回利付国債（２０年）	320,000,000	362,076,800	
第１２０回利付国債（２０年）	1,330,000,000	1,484,067,200	
第１２１回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,166,125,200	
第１２２回利付国債（２０年）	490,000,000	556,243,100	
第１２３回利付国債（２０年）	900,000,000	1,046,934,000	
第１２４回利付国債（２０年）	820,000,000	947,059,000	
第１２５回利付国債（２０年）	500,000,000	587,770,000	
第１２６回利付国債（２０年）	450,000,000	521,302,500	
第１２７回利付国債（２０年）	400,000,000	459,964,000	
第１２８回利付国債（２０年）	750,000,000	864,907,500	
第１２９回利付国債（２０年）	260,000,000	297,551,800	
第１３０回利付国債（２０年）	890,000,000	1,022,129,400	
第１３１回利付国債（２０年）	1,030,000,000	1,173,623,200	
第１３２回利付国債（２０年）	600,000,000	684,324,000	
第１３３回利付国債（２０年）	620,000,000	712,863,600	
第１３４回利付国債（２０年）	940,000,000	1,084,938,600	
第１３５回利付国債（２０年）	715,000,000	818,460,500	
第１３６回利付国債（２０年）	450,000,000	510,844,500	
第１３７回利付国債（２０年）	210,000,000	240,466,800	
第１３８回利付国債（２０年）	460,000,000	517,808,200	
第１３９回利付国債（２０年）	800,000,000	908,296,000	
第１４０回利付国債（２０年）	1,205,000,000	1,381,424,050	
第１４１回利付国債（２０年）	950,000,000	1,090,210,500	
第１４２回利付国債（２０年）	890,000,000	1,030,388,600	
第１４３回利付国債（２０年）	830,000,000	944,755,800	
第１４４回利付国債（２０年）	960,000,000	1,082,784,000	
第１４５回利付国債（２０年）	1,210,000,000	1,391,754,100	
第１４６回利付国債（２０年）	1,340,000,000	1,543,291,400	
第１４７回利付国債（２０年）	1,170,000,000	1,335,484,800	
第１４８回利付国債（２０年）	1,240,000,000	1,401,956,400	
第１４９回利付国債（２０年）	1,940,000,000	2,193,635,600	
第１５０回利付国債（２０年）	1,905,000,000	2,133,199,950	
第１５１回利付国債（２０年）	1,690,000,000	1,851,935,800	
第１５２回利付国債（２０年）	1,835,000,000	2,010,536,100	
第１５３回利付国債（２０年）	1,760,000,000	1,949,534,400	
第１５４回利付国債（２０年）	1,715,000,000	1,878,216,550	
第１５５回利付国債（２０年）	1,060,000,000	1,132,970,400	

	第１５６回利付国債（２０年）	1,370,000,000	1,354,217,600	
	第１５７回利付国債（２０年）	1,840,000,000	1,764,799,200	
	第１５８回利付国債（２０年）	1,800,000,000	1,795,248,000	
	第１５９回利付国債（２０年）	1,730,000,000	1,746,192,800	
	第１６０回利付国債（２０年）	420,000,000	428,828,400	
	第１６１回利付国債（２０年）	1,625,000,000	1,632,816,250	
	第１６２回利付国債（２０年）	1,100,000,000	1,102,288,000	
	第１６３回利付国債（２０年）	1,445,000,000	1,445,000,000	
	第１６４回利付国債（２０年）	1,210,000,000	1,188,437,800	
	第１６５回利付国債（２０年）	1,390,000,000	1,361,908,100	
	第１６６回利付国債（２０年）	1,360,000,000	1,369,928,000	
	第１６７回利付国債（２０年）	1,300,000,000	1,265,459,000	
	第１６８回利付国債（２０年）	1,850,000,000	1,765,917,500	
	第１６９回利付国債（２０年）	1,060,000,000	992,170,600	
	第１７０回利付国債（２０年）	1,550,000,000	1,445,080,500	
	第１７１回利付国債（２０年）	1,180,000,000	1,095,724,400	
	第１７２回利付国債（２０年）	1,170,000,000	1,101,870,900	
	第１７３回利付国債（２０年）	1,390,000,000	1,304,973,700	
	第１７４回利付国債（２０年）	1,560,000,000	1,459,926,000	
	第１７５回利付国債（２０年）	1,320,000,000	1,253,458,800	
	第１７６回利付国債（２０年）	1,490,000,000	1,410,583,000	
	第１７７回利付国債（２０年）	1,200,000,000	1,112,052,000	
	第１７８回利付国債（２０年）	1,380,000,000	1,299,366,600	
	第１７９回利付国債（２０年）	1,760,000,000	1,653,256,000	
	第１８０回利付国債（２０年）	1,370,000,000	1,358,464,600	
国債証券合計		314,278,000,000	323,896,121,710	
地方債証券	第１回東京都公募公債（東京グリーンボンド（３０年））	100,000,000	95,970,000	
	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	103,714,000	
	第７回東京都公募公債（３０年）	200,000,000	254,352,000	
	第１１回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	219,974,000	
	第１６回東京都公募公債（２０年）	150,000,000	167,691,000	
	第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	112,301,000	
	第１８回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	227,236,000	
	第２０回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	113,482,000	
	第２１回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	114,498,000	
	第７２９回東京都公募公債	150,000,000	151,684,500	
	第７４０回東京都公募公債	100,000,000	101,064,000	
	第７８６回東京都公募公債	200,000,000	200,244,000	
	第８００回東京都公募公債	300,000,000	297,357,000	
	平成２７年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	100,677,000	
	令和４年度第１回北海道公募公債	100,000,000	100,134,000	

第３回神奈川県公募公債（３０年）	100,000,000	127,797,000	
第１１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	113,150,000	
第１５回神奈川県公募公債（２０年）	300,000,000	341,601,000	
第１６回神奈川県公募公債（２０年）	600,000,000	692,082,000	
第２１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	113,550,000	
第２４３回神奈川県公募公債	100,000,000	99,083,000	
第２回大阪府公募公債（２０年）	300,000,000	343,908,000	
第３７６回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	100,930,000	
第３８６回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,137,000	
第４０３回大阪府公募公債（１０年）	300,000,000	304,428,000	
第４１７回大阪府公募公債（１０年）	108,000,000	108,880,200	
第４２３回大阪府公募公債（１０年）	300,000,000	301,212,000	
平成２５年度第２回京都府公募公債（１５年）	100,000,000	105,257,000	
平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	101,560,000	
平成２７年度第１３回京都府公募公債	105,860,000	106,186,048	
令和元年度第３回京都府公募公債	100,000,000	99,990,000	
令和２年度第１回京都府公募公債（１０年）	100,000,000	99,395,000	
第３回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	111,311,000	
第４回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	106,431,000	
第８回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	106,220,000	
第１１回兵庫県公募公債（１５年）	200,000,000	207,544,000	
平成２６年度第２回兵庫県公募公債	100,000,000	101,119,000	
平成２８年度第３０回兵庫県公募公債	100,000,000	100,695,000	
令和３年度第９回兵庫県公募公債（５年）	100,000,000	99,770,000	
第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	91,954,000	
第１５回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	113,495,000	
平成２６年度第１０回静岡県公募公債	100,000,000	101,167,000	
平成２７年度第１回静岡県公募公債	100,000,000	101,122,000	
平成２７年度第６回静岡県公募公債	100,000,000	101,390,000	
平成２２年度第１４回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	115,166,000	
平成２５年度第８回愛知県公募公債（３０年）	110,000,000	131,887,800	
平成２５年度第２１回愛知県公募公債（１０年）	400,000,000	404,644,000	
平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	202,504,000	
平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,620,000	
平成２９年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,773,000	
平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	200,684,000	
令和元年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	99,107,000	

令和２年度第７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	99,334,000	
令和３年度第６回愛知県公募公債（３０年）	200,000,000	172,996,000	
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	113,463,000	
平成２７年度第２回広島県公募公債	162,000,000	164,847,960	
平成２９年度第７回広島県公募公債	131,440,000	131,993,362	
令和２年度第７回広島県公募公債	100,000,000	99,656,000	
第５回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	112,498,000	
第７回埼玉県公募公債（１５年）	400,000,000	390,724,000	
第８回埼玉県公募公債（１５年）	100,000,000	97,417,000	
第９回埼玉県公募公債（３０年）	100,000,000	92,491,000	
第１８回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	193,430,000	
平成２９年度第５回埼玉県公募公債	100,000,000	100,619,000	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	128,136,000	
平成２０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	200,000,000	247,270,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	106,224,000	
平成２６年度第８回福岡県公募公債	100,000,000	101,029,000	
平成２９年度第８回福岡県公募公債	200,000,000	201,220,000	
令和３年度第２回福岡県公募公債	100,000,000	99,096,000	
令和３年度第５回福岡県公募公債	100,000,000	99,770,000	
令和３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	200,000,000	192,494,000	
第６回千葉県公募公債（２０年）	200,000,000	228,048,000	
第８回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	114,933,000	
第９回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	112,919,000	
平成２６年度第９回千葉県公募公債	100,000,000	101,199,000	
平成２８年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	100,153,000	
平成２９年度第５回千葉県公募公債	120,000,000	120,645,600	
令和元年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	99,030,000	
平成２７年度第３回新潟県公募公債	200,000,000	200,658,000	
令和３年度第１回長野県公募公債（１０年）	200,000,000	198,898,000	
第１２５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,740,000	
第１３０回共同発行市場公募地方債	350,000,000	353,951,500	
第１３３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,190,000	
第１３４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,206,000	
第１３６回共同発行市場公募地方債	600,000,000	607,146,000	
第１３７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,145,000	
第１３９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,358,000	
第１４０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,132,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,075,000	
第１５３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,517,000	
第１６１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,174,000	

第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,824,000	
第１７５回共同発行市場公募地方債	150,000,000	150,861,000	
第１８１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,314,000	
第１９４回共同発行市場公募地方債	160,000,000	159,460,800	
第２０９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,170,000	
第２２８回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,202,000	
第２３１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,578,000	
令和元年度第２回奈良県公募公債（５年）	100,000,000	99,966,000	
第７回大阪市公募公債（３０年）	100,000,000	95,704,000	
第１０回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	114,871,000	
令和３年度第２回大阪市公募公債	100,000,000	99,142,000	
第３回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	126,469,000	
第１３回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	95,781,000	
第４８８回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	101,256,000	
第４９５回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	100,309,000	
第２回京都市公募公債（２０年）	100,000,000	106,618,000	
第６回京都市公募公債（２０年）	100,000,000	111,645,000	
平成２７年度第５回京都市公募公債	200,000,000	201,280,000	
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	113,060,000	
平成２４年度第１２回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	113,949,000	
平成２６年度第３回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	111,913,000	
令和２年度第９回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	86,121,000	
第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	106,255,000	
第５回横浜市公募公債（３０年）	100,000,000	128,067,000	
第７回横浜市公募公債（３０年）	100,000,000	127,474,000	
平成２５年度第６回横浜市公募公債	100,000,000	100,999,000	
第２５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	113,452,000	
第２６回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	114,694,000	
第５５回横浜市公募公債（５年）	100,000,000	99,865,000	
令和３年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	99,141,000	
第８回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	114,259,000	
第１１回川崎市公募公債（２０年）	150,000,000	169,422,000	
第８８回川崎市公募公債	100,000,000	101,509,000	
平成２５年度第６回福岡市公募公債（２０年）	400,000,000	448,644,000	
平成２９年度第１２回福岡市公募公債	130,000,000	130,548,600	
平成３０年度第９回福岡市公募公債（１０年）	100,000,000	100,939,000	
平成２７年度第２回広島市公募公債	100,000,000	101,500,000	
平成２６年度第１回千葉市公募公債	200,000,000	202,344,000	
平成２７年度第１回三重県公募公債	100,000,000	101,500,000	
令和３年度第２回三重県公募公債	100,000,000	100,180,000	

	平成２５年度第１回徳島県公募公債	100,000,000	100,859,000	
	平成２７年度第１回山梨県公募公債（１０年）	100,000,000	101,550,000	
地方債証券合計		19,277,300,000	20,162,650,370	
特殊債券	第３回政府保証新関西国際空港債券	200,000,000	202,550,000	
	第５２回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,026,000	
	第１２９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	75,756,000	
	第１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	137,243,000	
	第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	163,081,500	
	第２１回道路債券	100,000,000	124,483,000	
	第２２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	262,304,000	
	第２７回道路債券	100,000,000	103,965,000	
	第２７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,409,000	
	第２８回道路債券	300,000,000	378,096,000	
	第３３回道路債券	100,000,000	127,501,000	
	第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,083,000	
	第３８回道路債券	100,000,000	104,805,000	
	第３９回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,260,000	
	第４２回道路債券	100,000,000	105,809,000	
	第４３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,661,000	
	第４９回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,672,000	
	第８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,009,000	
	第９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,919,000	
	第９９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,095,000	
	第１０１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,571,000	
	第１０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,904,000	
	第１１１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,206,000	
	第１１３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,885,000	
	第１２３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,277,000	
	第１２３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,106,000	
	第１２８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,396,000	

第１７８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,760,000	
第１８３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,313,000	
第１９５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,938,000	
第１９７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	116,000,000	117,081,120	
第２００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,959,000	
第２０４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,928,000	
第２３５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,991,000	
第２４７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,431,000	
第２６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,169,000	
第２７３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,112,000	
第２８８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,983,000	
第３００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	301,224,000	
第３３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	243,000,000	244,487,160	
第３６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,724,000	
第２回地方公営企業等金融機構債券（２０年）	100,000,000	114,074,000	
第４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	113,739,000	
第５回公営企業債券（２０年）	100,000,000	102,405,000	
第５回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	229,520,000	
第７回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	114,918,000	
第９回公営企業債券（２０年）	100,000,000	104,993,000	
第１１回政府保証地方公共団体金融機構債券（４年）	500,000,000	500,110,000	
第１１回公営企業債券（２０年）	100,000,000	105,549,000	
第１２回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	114,944,000	
第１５回公営企業債券（２０年）	100,000,000	106,674,000	
第１５回地方公共団体金融機構債券（２０年）	300,000,000	345,189,000	
第１７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	108,555,000	
第１７回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	113,944,000	
第１９回公営企業債券（２０年）	100,000,000	110,043,000	
第２２回公営企業債券（２０年）	200,000,000	221,520,000	
第２３回地方公共団体金融機構債券（２０年）	300,000,000	338,982,000	

第２４回公営企業債券（２０年）	100,000,000	112,070,000	
第３０回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	114,890,000	
第３４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	400,000,000	451,900,000	
第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,893,000	
第５２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,927,000	
第５３回政府保証地方公共団体金融機構債券	121,000,000	122,050,280	
第５６回政府保証地方公共団体金融機構債券	193,000,000	195,202,130	
第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,192,000	
第５８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,091,000	
第５９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,183,000	
第６０回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,239,000	
第６２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,226,000	
第７０回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,306,000	
第７３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,425,000	
第７５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,510,000	
Ｆ７６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,567,000	
第７７回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,554,000	
第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	421,000,000	426,540,360	
第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,250,000	
第８３回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,224,000	
第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,289,000	
第９６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,453,000	
第１０７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,170,000	
第１１０回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	150,280,500	
第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,714,000	
Ｆ１９０回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,724,000	
Ｆ２０２回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,678,000	
第２９回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,851,000	
第８７回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,970,000	
第８８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,970,000	
第８９回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,999,000	
第１５９回都市再生債券	100,000,000	71,652,000	
第１６１回都市再生債券	100,000,000	78,982,000	
第１６９回都市再生債券	100,000,000	83,514,000	
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,090,000	50,280,342	
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	20,864,000	21,074,935	
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	10,553,000	10,681,957	
第５回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	178,494,000	176,875,059	

第６回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,388,000	
第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	66,172,000	65,554,615	
第８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,688,000	21,961,919	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	10,008,000	10,044,429	
第９回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	76,916,000	75,994,546	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	10,278,000	10,366,082	
第１２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,706,000	13,120,977	
第１８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,451,000	
第２３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,659,000	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,776,000	16,597,614	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,616,000	18,660,452	
第２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,366,000	34,037,703	
第２８回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,845,000	10,949,762	
第３２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,358,000	32,642,750	
第３４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,082,000	12,353,482	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,717,000	24,007,325	
第３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,135,000	22,333,777	
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,264,000	10,384,704	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,629,000	21,694,900	
第３７回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,878,000	11,006,034	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,386,000	31,686,364	
第３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,268,000	46,221,546	
第４０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,940,000	24,501,632	
第４１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,220,000	11,426,335	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,061,000	10,102,753	
第４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,495,000	27,694,428	
第４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,098,000	27,462,142	
第４３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,094,000	
第４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,561,000	79,777,303	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,724,000	87,978,016	
第４７回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,447,000	10,572,990	
第４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,726,000	20,664,957	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,568,000	21,474,637	
第５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,624,000	30,722,609	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,808,000	22,801,572	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,001,000	11,192,197	
第５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,352,000	25,438,829	
第５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,971,000	27,168,782	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,787,000	30,098,535	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,824,000	29,095,835	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,386,000	39,789,776	

第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,390,000	41,207,454	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,421,000	35,889,744	
第７１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,830,000	33,966,574	
第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,757,000	34,945,921	
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,320,000	41,171,972	
第８５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,746,000	
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,089,000	
第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,366,000	63,860,289	
第１０９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,560,000	140,740,367	
第１１１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,581,000	71,397,929	
第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,321,000	73,922,639	
第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,945,000	73,374,144	
第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,288,000	74,025,763	
第１１５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,146,000	
第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,774,000	74,821,855	
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,206,000	75,121,769	
第１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,962,000	74,970,995	
第１２１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,132,000	75,940,147	
第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,046,000	77,761,132	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,101,000	78,630,349	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,186,000	77,849,018	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,566,000	80,176,060	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,541,000	80,976,736	
第１３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,997,000	81,697,710	
第１３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,276,000	82,037,399	
第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,183,000	81,508,277	
第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,244,000	83,191,792	
第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,490,000	84,280,316	
第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,716,000	84,868,949	
	267,855,000	262,773,790	

第１５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第１５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	267,768,000	264,123,677	
第１５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,466,000	88,274,312	
第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,880,000	176,989,328	
第１５７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,073,000	
第１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,462,000	91,661,279	
第１６１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,803,000	91,855,481	
第１６３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,619,000	92,615,404	
第１６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,323,000	93,129,814	
第１６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,441,000	93,860,187	
第１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,149,000	94,439,188	
第１６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,100,000	189,468,006	
第１７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,267,000	95,842,038	
第１７５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,057,000	96,881,296	
第１７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,468,000	197,049,367	
第１８１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,807,000	99,636,330	
第２４３回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	300,036,000	
第６５回日本学生支援債券	100,000,000	99,970,000	
第２４回沖縄振興開発金融公庫債券	500,000,000	500,615,000	
い第８２９号商工債	100,000,000	100,144,000	
い第８３２号商工債	300,000,000	300,030,000	
い第８３５号商工債	200,000,000	199,924,000	
い第８４５号商工債	200,000,000	200,128,000	
い第８５３号商工債	100,000,000	99,767,000	
第３７６回信金中金債（５年）	200,000,000	199,816,000	
第３７９回信金中金債（５年）	100,000,000	99,767,000	
第３８６回信金中金債（５年）	100,000,000	99,711,000	
第６７回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,260,000	
第７４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,830,000	
第８７回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,305,000	
第８８回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,698,000	
第２９回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,682,000	
第５４回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,854,000	
第６３回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,951,000	

	第６６回西日本高速道路株式会社社債	600,000,000	600,054,000	
	第６６回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	105,871,000	
特殊債券合計		22,482,346,000	23,357,306,449	
社債券	第２４回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	99,864,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	99,568,000	
	第８回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,149,000	
	第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,930,000	
	第１回バンコ・サンタンデール・エセ・アー円貨社債	200,000,000	199,346,000	
	第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,069,000	
	第１２回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,109,000	
	第５回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,020,000	
	第２４回大和ハウス工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,664,000	
	第３回高砂熱学工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,652,000	
	第９回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,863,000	
	第１３回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,776,000	
	第１９回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,355,000	
	第２回株式会社伊藤園無担保社債	100,000,000	99,886,000	
	第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,065,000	
	第１０回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,563,000	
	第２５回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,477,000	
	第１４回株式会社セブン＆アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	99,869,000	
	第３０回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	100,217,000	
	第１１回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,926,000	
	第２２回三菱瓦斯化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,035,000	
	第２２回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,138,000	
	第３２回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,636,000	
	第３５回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,117,000	
	第４０回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,526,000	
	第４２回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	93,654,000	
	第７回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,855,000	
	第６回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,187,000	
	第１６回武田薬品工業株式会社無担保社債	200,000,000	195,774,000	

第１回株式会社ツムラ無担保社債	100,000,000	99,991,000	
第１３回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	97,153,000	
第１８回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	95,516,000	
第４回ＥＮＥＯＳホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,382,000	
第１４回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,213,000	
第９回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	100,316,000	
第１１回日本電気硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,100,000	
第９回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	99,943,000	
第３４回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,210,000	
第１０回株式会社荏原製作所無担保社債	100,000,000	99,891,000	
第１６回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	100,993,000	
第２０回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,410,000	
第１６回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,227,000	
第２０回パナソニック株式会社無担保社債	300,000,000	299,817,000	
第２３回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	98,837,000	
第８回ＴＤＫ株式会社無担保社債	100,000,000	99,604,000	
第１９回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,754,000	
第１回株式会社東海理化電機製作所無担保社債	100,000,000	99,364,000	
第３０回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,811,000	
第１回明治安田生命２０１８基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,055,000	
第７回楽天カード株式会社無担保社債	100,000,000	96,927,000	
第１回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,058,000	
第６回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	92,719,000	
第６９回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	113,878,000	
第６０回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,505,000	
第８７回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	98,830,000	
第２２回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	99,816,000	
第９回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	106,776,000	
第１回三井住友ＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	101,072,000	
第２５回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	106,788,000	
第２３回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,327,000	
第４回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,640,000	
第１６回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,886,000	
第１８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,566,000	
第３４回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	98,290,000	
	100,000,000	100,024,000	

第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債			
第６４回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,928,000	
第６５回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,035,000	
第９４回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,064,000	
第１６回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,428,000	
第１７回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,180,000	
第３０回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,417,000	
第３５回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,923,000	
第５０回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,145,000	
第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,369,000	
第８７回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,825,000	
第２１回三井住友ファイナンス＆リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,046,000	
第3回三菱ＨＣキャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	97,338,000	
第６９回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,478,000	
第８２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,366,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	500,000,000	500,065,000	
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,462,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	100,000,000	99,970,000	
第４７回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	113,940,000	
第７８回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	95,459,000	
第８３回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	110,944,000	
第１３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	94,617,000	
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,317,000	
第3回東急株式会社無担保社債	100,000,000	99,046,000	
第４５回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	94,456,000	
第４６回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,870,000	
第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	94,228,000	
第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,963,000	
第４２回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	95,102,000	
第４９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,283,000	
第６７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,936,000	
第１２９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	92,570,000	
	100,000,000	90,800,000	

	第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債			
	第１６５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	92,536,000	
	第１７６回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	80,826,000	
	第１１回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,336,000	
	第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	86,419,000	
	第５１回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	94,283,000	
	第５１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,813,000	
	第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,406,000	
	第８３回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	199,750,000	
	第８回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	111,251,000	
	第１０回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	114,332,000	
	第１３回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	112,993,000	
	第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	90,372,000	
	第５６回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	92,999,000	
	第４５回西日本鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	202,590,000	
	第５８回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,523,000	
	第４回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,558,000	
	第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	200,000,000	200,326,000	
	第１１回ソフトバンク株式会社無担保社債	200,000,000	198,570,000	
	第１７回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	98,434,000	
	第３１回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	94,322,000	
	第３７回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	93,147,000	
	第５００回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,296,000	
	第５３５回中部電力株式会社社債	200,000,000	194,460,000	
	第５０９回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,761,000	
	第５１０回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,705,000	
	第５３６回関西電力株式会社社債	100,000,000	97,253,000	
	第５４１回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,386,000	
	第３７７回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,092,000	
	第３９３回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,280,000	
	第４２５回中国電力株式会社社債	100,000,000	97,570,000	
	第４２６回中国電力株式会社社債	100,000,000	97,207,000	
	第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,785,000	
	第３２１回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,534,000	
	第５０８回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,871,000	
	第５２１回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,080,000	
	第５３５回東北電力株式会社社債	200,000,000	195,052,000	
	第４６８回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,821,000	

	第５０７回九州電力株式会社社債	200,000,000	197,698,000	
	第３２３回北海道電力株式会社社債	100,000,000	104,673,000	
	第３５７回北海道電力株式会社社債	100,000,000	98,794,000	
	第１３回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,284,000	
	第３８回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,278,000	
	第５６回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,922,000	
	第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,817,000	
	第３１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,959,000	
	第３８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	200,066,000	
	第３９回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,037,000	
	第４１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,847,000	
	第４２回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,622,000	
	第４８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	189,556,000	
	第３８回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	116,605,000	
	第４１回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	98,804,000	
	第４２回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	92,541,000	
	第７回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,345,000	
社債券合計		17,300,000,000	17,251,336,000	
合計			384,667,414,529	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月25日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	11,713,050,257
コール・ローン	1,202,851,169
株式	316,506,290,789

	2022年 7月25日現在
項目	金額（円）
投資信託受益証券	155,312,858
投資証券	7,898,160,473
派生商品評価勘定	658,129,920
未収入金	900,597
未収配当金	257,487,435
差入委託証拠金	2,597,719,090
流動資産合計	340,989,902,588
資産合計	340,989,902,588
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	23,506,136
前受金	633,624,147
未払金	75,787,731
未払解約金	316,756,134
未払利息	489
流動負債合計	1,049,674,637
負債合計	1,049,674,637
純資産の部	
元本等	
元本	74,737,903,542
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	265,202,324,409
元本等合計	339,940,227,951
純資産合計	339,940,227,951
負債純資産合計	340,989,902,588

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 7月25日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。

	2022年 7月25日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月25日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	74,737,903,542口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　4.5484円 (1万口当たり純資産額)　(45,484円)

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	2022年 7月25日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月25日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2022年 7月25日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 7月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月27日
期首元本額	71,393,866,315円
期中追加設定元本額	10,254,343,464円
期中一部解約元本額	6,910,306,237円
期末元本額	74,737,903,542円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,501,737,362円
ＤＣ外国株式インデックスファンド	4,930,068,182円
ＤＣ外国株式インデックスファンドＬ	26,567,544,991円
ＤＣバランスファンド３０	624,049,609円
ＤＣバランスファンド５０	1,273,774,419円
ＤＣバランスファンド７０	848,922,838円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	280,613,499円
外国株式インデックスｅ	4,643,197,789円
インデックスコレクション（外国株式）	15,497,740,156円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	3,226,454,916円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	993,587,637円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	988,800,641円

区分	2022年 7月25日現在
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,159,235,680円
外国株式パッシブファンド私募Ａ（適格機関投資家専用）	1,454,871,125円
私募外国株式パッシブファンド２（適格機関投資家専用）	121,218,009円
外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	411,378,539円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	24,271,476円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	253,567,627円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	32,198,407円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	63,987,171円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	214,525,728円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	226,390,032円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	179,029,005円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	3,505,753,100円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	397,490,537円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	99,067,016円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	580,776,846円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	12,100,023円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	71,004,389円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	76,482,382円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	235,274,348円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	9,926,313円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	60,401,569円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	167,291,998円
私募外国株式インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	5,170,183円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△41,026,029,546
投資信託受益証券	8,048,363
投資証券	△763,971,592
合計	△41,781,952,775

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 7月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	14,868,459,527	－	15,502,083,674	633,624,147
合計		14,868,459,527	－	15,502,083,674	633,624,147

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2022年 7月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,107,570,907	－	1,108,084,884	513,977
	アメリカドル	780,642,352	－	778,835,422	△1,806,930
	ユーロ	164,905,560	－	166,975,800	2,070,240
	イギリスポンド	162,022,995	－	162,273,662	250,667
	売建	96,119,660	－	95,634,000	485,660
	アメリカドル	96,119,660	－	95,634,000	485,660
合計		1,203,690,567	－	1,203,718,884	999,637

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	17,739	32.41	574,920.99	
	BAKER HUGHES CO	47,945	24.08	1,154,515.60	
	CHENIERE ENERGY INC	11,266	134.10	1,510,770.60	

CHEVRON CORP	96,745	144.19	13,949,661.55	
CONOCOPHILLIPS	64,539	88.13	5,687,822.07	
COTERRA ENERGY INC	41,058	27.71	1,137,717.18	
DEVON ENERGY CORPORATION	31,794	55.19	1,754,710.86	
DIAMONDBACK ENERGY INC	8,090	113.43	917,648.70	
EOG RESOURCES INC	28,920	101.00	2,920,920.00	
EQT CORPORATION	17,321	42.23	731,465.83	
EXXON MOBIL	210,256	87.08	18,309,092.48	
HALLIBURTON CO	44,379	27.46	1,218,647.34	
HESS CORP	13,850	101.39	1,404,251.50	
KINDER MORGAN INC	100,765	17.65	1,778,502.25	
MARATHON OIL CORP	36,460	21.75	793,005.00	
MARATHON PETROLEUM CORP	27,282	85.65	2,336,703.30	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	46,140	61.06	2,817,308.40	
ONEOK INC	22,489	57.99	1,304,137.11	
PHILLIPS 66	24,061	84.53	2,033,876.33	
PIONEER NATURAL RESOURCES	11,583	209.80	2,430,113.40	
SCHLUMBERGER	69,679	35.07	2,443,642.53	
TARGA RESOURCES CORP	11,099	61.71	684,919.29	
VALERO ENERGY CORP	20,210	104.02	2,102,244.20	
WILLIAMS COS	60,051	32.34	1,942,049.34	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	10,917	234.56	2,560,691.52	
ALBEMARLE CORP	5,885	221.46	1,303,292.10	
ALCOA CORP	9,533	45.80	436,611.40	
AMCOR PLC	72,748	12.60	916,624.80	
AVERY DENNISON CORP	4,144	175.30	726,443.20	
BALL CORP	15,147	70.71	1,071,044.37	
CELANESE CORP-SERIES A	5,419	113.34	614,189.46	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	84.81	880,242.99	
CLEVELAND-CLIFFS INC	27,048	15.62	422,489.76	
CORTEVA INC	36,448	54.01	1,968,556.48	
CROWN HOLDINGS INC	6,218	94.93	590,274.74	
DOW INC	36,681	50.85	1,865,228.85	
DUPONT DE NEMOURS INC	25,064	57.26	1,435,164.64	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,266	93.07	583,176.62	
ECOLAB INC	12,620	162.99	2,056,933.80	
FMC CORP	5,984	105.90	633,705.60	
FREEPORT-MCMORAN INC	72,123	27.76	2,002,134.48	
INT'L PAPER CO	17,345	43.19	749,130.55	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	12,588	122.26	1,539,008.88	
LINDE PLC	25,501	285.54	7,281,555.54	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,234	86.80	1,148,711.20	

MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,168	326.21	1,033,433.28	
MOSAIC CO/THE	18,682	47.64	890,010.48	
NEWMONT CORPORATION	40,062	51.39	2,058,786.18	
NUCOR CORP	13,230	119.86	1,585,747.80	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,374	141.60	619,358.40	
PPG INDUSTRIES INC	11,826	127.73	1,510,534.98	
RPM INTERNATIONAL INC	5,987	86.11	515,540.57	
SEALED AIR CORP	7,368	59.11	435,522.48	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	12,375	259.01	3,205,248.75	
STEEL DYNAMICS INC	9,667	66.60	643,822.20	
VULCAN MATERIALS CO	6,735	155.65	1,048,302.75	
WESTLAKE CORP	2,096	91.81	192,433.76	
WESTROCK CO	12,132	41.33	501,415.56	
3 M COMPANY	28,021	134.12	3,758,176.52	
AERCAP HOLDINGS NV	7,161	42.98	307,779.78	
ALLEGION PLC	4,638	103.39	479,522.82	
AMETEK INC	11,723	115.33	1,352,013.59	
BOEING CO	27,320	158.16	4,320,931.20	
CARRIER GLOBAL CORP	41,014	38.50	1,579,039.00	
CATERPILLAR	26,471	178.62	4,728,250.02	
CUMMINS INC	6,913	205.20	1,418,547.60	
DEERE&CO	14,394	312.26	4,494,670.44	
DOVER CORP	7,491	128.64	963,642.24	
EATON CORP	19,500	136.65	2,664,675.00	
EMERSON ELECTRIC CO	29,379	83.10	2,441,394.90	
FASTENAL CO	29,312	48.46	1,420,459.52	
FORTIVE CORP	16,407	58.42	958,496.94	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,412	68.41	438,644.92	
GENERAC HOLDINGS INC	2,918	239.93	700,115.74	
GENERAL DYNAMICS CORP	11,819	216.76	2,561,886.44	
GENERAL ELECTRIC CO	54,947	68.19	3,746,835.93	
GRAINGER (WW) INC	2,333	473.88	1,105,562.04	
HEICO CORP	2,252	143.20	322,486.40	
HEICO CORP-CLASS A	3,318	115.12	381,968.16	
HONEYWELL INTL INC	34,145	181.47	6,196,293.15	
HOWMET AEROSPACE INC	18,227	34.36	626,279.72	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	208.73	415,998.89	
IDEX CORP	3,505	192.77	675,658.85	
ILLINOIS TOOL WORKS	15,483	191.56	2,965,923.48	
INGERSOLL-RAND INC	20,847	44.54	928,525.38	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,600	55.30	530,880.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	33,831	50.78	1,717,938.18	

KORNIT DIGITAL LTD	2,600	26.19	68,094.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	9,818	225.13	2,210,326.34	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,584	227.66	360,613.44	
LOCKHEED MARTIN CORP	12,232	394.74	4,828,459.68	
MASCO CORP	12,110	56.31	681,914.10	
NORDSON CORP	2,536	219.67	557,083.12	
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,408	451.85	3,347,304.80	
OTIS WORLDWIDE CORP	21,403	71.90	1,538,875.70	
OWENS CORNING	4,965	84.04	417,258.60	
PACCAR INC	17,559	84.73	1,487,774.07	
PARKER HANNIFIN CORP	6,517	267.87	1,745,708.79	
PENTAIR PLC	7,637	46.99	358,862.63	
PLUG POWER INC	23,605	17.64	416,392.20	
QUANTA SERVICES INC	7,500	133.06	997,950.00	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	74,482	94.21	7,016,949.22	
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,882	221.60	1,303,451.20	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,602	44.29	336,692.58	
SMITH (A.O.) CORP	6,846	59.00	403,914.00	
SNAP-ON INC	2,772	213.27	591,184.44	
STANLEY BLACK&DECKER	8,223	115.70	951,401.10	
TEXTRON	10,911	63.83	696,449.13	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	11,217	139.22	1,561,630.74	
TRANSDIGM GROUP INC	2,661	581.12	1,546,360.32	
UNITED RENTALS INC	3,678	274.29	1,008,838.62	
WABTEC CORP	8,356	85.91	717,863.96	
XYLEM INC	8,363	84.34	705,335.42	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	6,342	94.27	597,860.34	
CINTAS CORP	4,794	396.73	1,901,923.62	
CLARIVATE PLC	15,370	14.40	221,328.00	
COPART INC	10,801	121.97	1,317,397.97	
COSTAR GROUP INC	20,002	61.81	1,236,323.62	
EQUIFAX INC	6,176	200.85	1,240,449.60	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,004	129.52	777,638.08	
LEIDOS HOLDINGS	6,238	101.45	632,845.10	
REPUBLIC SERVICES INC	11,169	131.02	1,463,362.38	
ROBERT HALF INTL INC	5,212	77.05	401,584.60	
ROLLINS INC	10,710	36.47	390,593.70	
TRANSUNION	8,818	88.46	780,040.28	
VERISK ANALYTICS INC	8,140	184.78	1,504,109.20	
WASTE CONNECTIONS INC	12,957	126.26	1,635,950.82	
WASTE MANAGEMENT INC	20,741	154.93	3,213,403.13	
AMERCO	564	496.57	280,065.48	

C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,274	101.99	639,885.26	
CSX CORP	107,460	30.89	3,319,439.40	
DELTA AIR LINES INC	7,841	31.35	245,815.35	
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,850	101.17	794,184.50	
FEDEX CORP	12,306	227.30	2,797,153.80	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	54,628	2.73	149,134.44	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,907	173.75	678,841.25	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,000	51.17	358,190.00	
LYFT INC-A	11,829	13.54	160,164.66	
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,893	243.10	2,891,188.30	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,619	278.96	1,288,516.24	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,754	40.24	271,780.96	
UBER TECHNOLOGIES INC	71,603	23.30	1,668,349.90	
UNION PACIFIC CORP	31,614	213.40	6,746,427.60	
UNITED PARCEL SERVICE B	36,774	187.98	6,912,776.52	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	5,000	45.39	226,950.00	
APTIV PLC	13,457	97.63	1,313,806.91	
BORGWARNER INC	11,533	36.41	419,916.53	
FORD MOTOR COMPANY	192,833	12.82	2,472,119.06	
GENERAL MOTORS CO	69,921	34.67	2,424,161.07	
LEAR CORP	2,989	141.17	421,957.13	
LUCID GROUP INC	20,820	19.68	409,737.60	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	8,920	32.48	289,721.60	
TESLA INC	43,619	816.73	35,624,945.87	
DR HORTON INC	16,141	77.39	1,249,151.99	
GARMIN LTD	7,784	104.95	816,930.80	
HASBRO INC	6,002	81.13	486,942.26	
LENNAR CORP-CL A	12,818	83.08	1,064,919.44	
LULULEMON ATHLETICA INC	5,782	304.50	1,760,619.00	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,830	134.82	381,540.60	
NEWELL BRANDS INC	17,598	20.19	355,303.62	
NIKE B	63,624	109.12	6,942,650.88	
NVR INC	164	4,552.61	746,628.04	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	12,862	9.77	125,661.74	
PULTE GROUP INC	12,386	45.91	568,641.26	
VF CORP	16,318	47.46	774,452.28	
WHIRLPOOL CORP	3,060	167.77	513,376.20	
AIRBNB INC-CLASS A	17,083	103.97	1,776,119.51	
ARAMARK	11,643	31.97	372,226.71	
BOOKING HOLDINGS INC	2,039	1,809.88	3,690,345.32	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	9,663	42.65	412,126.95	
CARNIVAL CORPORATION	42,799	9.26	396,318.74	

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,390	1,347.33	1,872,788.70	
DARDEN RESTAURANTS INC	6,041	121.35	733,075.35	
DOMINO'S PIZZA INC	1,797	399.27	717,488.19	
EXPEDIA GROUP INC	7,394	99.38	734,815.72	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	13,745	120.83	1,660,808.35	
LAS VEGAS SANDS CORP	15,969	38.99	622,631.31	
MARRIOTT INTL A	13,789	150.91	2,080,897.99	
MCDONALD'S CORP	36,983	253.99	9,393,312.17	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	18,299	30.94	566,171.06	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,621	34.87	370,354.27	
STARBUCKS CORP	56,825	83.59	4,750,001.75	
VAIL RESORTS INC	1,853	230.69	427,468.57	
WYNN RESORTS LTD	5,210	61.73	321,613.30	
YUM BRANDS INC	14,073	119.45	1,681,019.85	
ACTIVISION BLIZZARD INC	38,655	79.23	3,062,635.65	
ALPHABET INC-CL A	298,600	107.90	32,218,940.00	
ALPHABET INC-CL C	282,060	108.36	30,564,021.60	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	24,885	15.50	385,717.50	
CABLE ONE INC	247	1,435.31	354,521.57	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	6,158	485.70	2,990,940.60	
COMCAST CORP-CL A	224,950	42.60	9,582,870.00	
DISH NETWORK CORPORATION-A	12,603	18.70	235,676.10	
ELECTRONIC ARTS INC	13,548	130.16	1,763,407.68	
FOX CORP - CLASS A	15,560	35.16	547,089.60	
FOX CORP- CLASS B	6,975	32.57	227,175.75	
IAC/INTERACTIVECORP	3,853	74.32	286,354.96	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	17,946	29.49	529,227.54	
LIBERTY BROADBAND-C	7,402	123.32	912,814.64	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,885	63.53	627,994.05	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,928	39.44	312,680.32	
LIBERTY SIRIUSXM-A	3,171	39.64	125,698.44	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	8,618	91.58	789,236.44	
MATCH GROUP INC	14,456	72.21	1,043,867.76	
META PLATFORMS INC-CLASS A	114,468	169.27	19,375,998.36	
NETFLIX INC	22,149	220.44	4,882,525.56	
NEWS CORP-CLASS A	17,936	16.88	302,759.68	
OMNICOM GROUP	9,954	68.96	686,427.84	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	30,808	25.27	778,518.16	
PINTEREST INC- CLASS A	27,343	18.11	495,181.73	
ROBLOX CORP -CLASS A	18,226	39.40	718,104.40	
ROKU INC	5,586	88.84	496,260.24	
SEA LTD-ADR	18,067	77.32	1,396,940.44	

SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,096	6.46	304,240.16	
SNAP INC - A	52,578	9.96	523,676.88	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	8,203	130.41	1,069,753.23	
THE WALT DISNEY CO	90,541	102.72	9,300,371.52	
TWITTER INC	40,330	39.84	1,606,747.20	
WARNER BROS DISCOVERY INC	111,814	14.65	1,638,075.10	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	14,227	37.64	535,504.28	
ADVANCE AUTO PARTS	3,129	191.23	598,358.67	
AMAZON.COM	454,960	122.42	55,696,203.20	
AUTOZONE INC	1,035	2,147.62	2,222,786.70	
BATH & BODY WORKS INC	13,789	33.47	461,517.83	
BEST BUY COMPANY INC	10,832	76.80	831,897.60	
BURLINGTON STORES INC	3,076	156.39	481,055.64	
CARMAX INC	7,628	94.35	719,701.80	
CARVANA CO	3,698	25.38	93,855.24	
CHEWY INC - CLASS A	3,947	42.52	167,826.44	
DOLLAR GENERAL CORP	11,647	247.81	2,886,243.07	
DOLLAR TREE INC	10,956	172.01	1,884,541.56	
DOORDASH INC - A	10,462	73.45	768,433.90	
EBAY	29,667	46.68	1,384,855.56	
ETSY INC	5,869	97.11	569,938.59	
GENUINE PARTS CO	6,685	144.49	965,915.65	
HOME DEPOT	52,079	306.59	15,966,900.61	
LKQ CORP	13,325	53.09	707,424.25	
LOWES COMPANIES	32,939	195.58	6,442,209.62	
MERCADOLIBRE INC	2,180	763.92	1,665,345.60	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,383	688.20	2,328,180.60	
POOL CORP	1,855	363.11	673,569.05	
ROSS STORES INC	17,806	83.24	1,482,171.44	
TARGET (DAYTON HUDSON)	23,475	157.74	3,702,946.50	
TJX COMPANIES INC	58,528	63.76	3,731,745.28	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,411	194.89	1,054,549.79	
ULTA BEAUTY INC	2,749	406.40	1,117,193.60	
WAYFAIR INC- CLASS A	3,788	51.75	196,029.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	22,048	529.72	11,679,266.56	
KROGER CO	33,615	46.24	1,554,357.60	
SYSCO CORP	25,975	86.86	2,256,188.50	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	36,389	38.66	1,406,798.74	
WALMART INC	75,871	132.21	10,030,904.91	
ALTRIA GROUP INC	90,586	43.09	3,903,350.74	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	28,451	73.84	2,100,821.84	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,737	71.22	1,120,789.14	

BUNGE LIMITED	7,221	91.02	657,255.42	
CAMPBELL SOUP CO (US)	9,742	47.85	466,154.70	
COCA-COLA CO	204,683	61.59	12,606,425.97	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	9,216	51.50	474,624.00	
CONAGRA BRANDS INC	22,663	33.63	762,156.69	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,917	242.38	1,918,922.46	
GENERAL MILLS INC	30,271	73.63	2,228,853.73	
HERSHEY FOODS CORPORATION	7,340	215.92	1,584,852.80	
HORMEL FOODS CORP	13,714	47.59	652,649.26	
JM SMUCKER CO	5,275	130.19	686,752.25	
KELLOGG CO	11,938	71.14	849,269.32	
KEURIG DR PEPPER INC	39,374	36.43	1,434,394.82	
KRAFT HEINZ CO/THE	37,077	38.32	1,420,790.64	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	12,652	84.11	1,064,159.72	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	8,727	57.91	505,380.57	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	69,256	61.99	4,293,179.44	
MONSTER BEVERAGE CORP	19,643	95.07	1,867,460.01	
PEPSICO INC	68,768	169.61	11,663,740.48	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	77,103	95.93	7,396,490.79	
TYSON FOODS INC	14,778	82.08	1,212,978.24	
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,548	94.06	1,086,204.88	
CLOROX COMPANY	5,866	147.85	867,288.10	
COLGATE-PALMOLIVE CO	39,331	77.47	3,046,972.57	
ESTEE LAUDER CO-CL A	11,283	260.10	2,934,708.30	
KIMBERLY-CLARK CORP	16,900	132.40	2,237,560.00	
PROCTER & GAMBLE CO	119,071	143.02	17,029,534.42	
ABBOTT LABORATORIES	87,688	109.20	9,575,529.60	
ABIOMED INC	2,088	281.70	588,189.60	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,719	265.88	988,807.72	
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,784	142.50	1,109,220.00	
BAXTER INTERNATIONAL	25,237	66.16	1,669,679.92	
BECTON DICKINSON & CO	14,222	242.13	3,443,572.86	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	70,019	38.12	2,669,124.28	
CARDINAL HEALTH	13,608	56.99	775,519.92	
CENTENE CORP	29,043	90.94	2,641,170.42	
CIGNA CORP	16,011	269.20	4,310,161.20	
CVS HEALTH CORP	65,355	94.06	6,147,291.30	
DAVITA INC	3,582	87.10	311,992.20	
DENTSPLY SIRONA INC	10,094	35.96	362,980.24	
DEXCOM INC	19,120	83.78	1,601,873.60	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	30,691	102.58	3,148,282.78	
ELEVANCE HEALTH INC	11,878	459.60	5,459,128.80	

HCA HEALTHCARE INC	12,224	202.03	2,469,614.72	
HENRY SCHEIN INC	6,547	77.04	504,380.88	
HOLOGIC INC	11,926	70.54	841,260.04	
HUMANA INC	6,360	488.97	3,109,849.20	
IDEXX LABORATORIES INC	4,215	393.51	1,658,644.65	
INSULET CORP	3,546	240.64	853,309.44	
INTUITIVE SURGICAL INC	17,481	211.85	3,703,349.85	
LABORATORY CRP OF AMER	4,533	246.34	1,116,659.22	
MASIMO CORP	2,735	138.92	379,946.20	
MCKESSON CORP	7,488	330.44	2,474,334.72	
MEDTRONIC PLC	66,841	90.72	6,063,815.52	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,739	301.67	826,274.13	
NOVOCURE LTD	4,504	71.80	323,387.20	
QUEST DIAGNOSTICS	6,246	131.03	818,413.38	
RESMED INC	7,208	231.75	1,670,454.00	
STERIS PLC	5,122	217.53	1,114,188.66	
STRYKER CORP	16,646	199.42	3,319,545.32	
TELADOC HEALTH INC	6,270	41.18	258,198.60	
TELEFLEX INC	2,162	265.18	573,319.16	
THE COOPER COS INC	2,279	313.44	714,329.76	
UNITEDHEALTH GROUP INC	46,721	521.41	24,360,796.61	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	110.99	432,639.02	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,903	213.77	1,475,654.31	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,564	107.00	1,130,348.00	
ABBVIE INC	87,899	148.47	13,050,364.53	
AGILENT TECHNOLOGIES	15,096	125.04	1,887,603.84	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,156	143.21	881,600.76	
AMGEN	27,728	245.95	6,819,701.60	
AVANTOR INC	31,022	30.97	960,751.34	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,027	524.62	538,784.74	
BIO-TECHNE CORP	1,796	363.25	652,397.00	
BIOGEN INC	7,191	206.25	1,483,143.75	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,381	85.23	714,312.63	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	107,603	72.95	7,849,638.85	
CATALENT INC	8,308	107.61	894,023.88	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,324	237.01	550,811.24	
DANAHER CORP	33,807	273.84	9,257,708.88	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,778	20.65	429,065.70	
EXACT SCIENCES CORP	9,063	45.39	411,369.57	
GILEAD SCIENCES INC	61,511	60.80	3,739,868.80	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	10,243	82.93	849,451.99	
ILLUMINA INC	7,888	201.69	1,590,930.72	

INCYTE CORP	8,608	80.90	696,387.20	
IQVIA HOLDINGS INC	9,501	221.74	2,106,751.74	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,663	157.53	419,502.39	
JOHNSON & JOHNSON	130,558	172.12	22,471,642.96	
LILLY (ELI) & CO	40,232	328.75	13,226,270.00	
MERCK & CO	125,650	90.11	11,322,321.50	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,109	1,224.14	1,357,571.26	
MODERNA INC	17,165	163.52	2,806,820.80	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,708	95.29	448,625.32	
PERKINELMER INC	6,426	146.67	942,501.42	
PFIZER	279,392	51.23	14,313,252.16	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,329	586.11	3,123,380.19	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,093	43.23	782,160.39	
SEAGEN INC	7,007	171.62	1,202,541.34	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56,857	7.01	398,567.57	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	19,450	561.54	10,921,953.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,718	280.29	3,564,728.22	
VIATRIS INC	57,073	9.55	545,047.15	
WATERS CORP	2,876	345.68	994,175.68	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,764	313.64	1,180,540.96	
ZOETIS INC	23,191	178.18	4,132,172.38	
BANK OF AMERICA CORP	360,929	33.43	12,065,856.47	
CITIGROUP	97,674	51.91	5,070,257.34	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	25,193	37.17	936,423.81	
FIFTH THIRD BANCORP	33,182	33.63	1,115,910.66	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	578	703.54	406,646.12	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,838	158.66	1,402,237.08	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	69,030	13.02	898,770.60	
JPMORGAN CHASE & CO	146,660	114.76	16,830,701.60	
KEY CORP	44,974	18.04	811,330.96	
M & T BANK CORP	8,756	168.96	1,479,413.76	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	20,656	161.76	3,341,314.56	
REGIONS FINL CORP	46,064	20.65	951,221.60	
SIGNATURE BANK	3,120	175.89	548,776.80	
SVB FINANCIAL GROUP	2,803	361.36	1,012,892.08	
TRUIST FINANCIAL CORP	65,536	48.14	3,154,903.04	
US BANCORP	69,143	47.71	3,298,812.53	
WEBSTER FINANCIAL CORP	8,680	45.06	391,120.80	
WELLS FARGO & CO	189,752	43.17	8,191,593.84	
ALLY FINANCIAL INC	18,129	33.48	606,958.92	
AMERICAN EXPRESS	32,007	153.01	4,897,391.07	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,496	245.06	1,346,849.76	

APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	20,242	53.94	1,091,853.48	
BANK NEW YORK CO	38,892	42.72	1,661,466.24	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	64,127	285.93	18,335,833.11	
BLACKROCK INC	7,579	633.64	4,802,357.56	
BLACKSTONE INC	34,948	96.43	3,370,035.64	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,406	108.93	2,222,825.58	
CARLYLE GROUP INC/THE	10,351	35.00	362,285.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,962	123.73	613,948.26	
CME GROUP INC	17,634	204.48	3,605,800.32	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	6,291	70.82	445,528.62	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,285	100.00	1,428,500.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	18,461	26.54	489,954.94	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,750	408.03	714,052.50	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	25.30	373,124.40	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,286	44.65	102,069.90	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,837	323.93	5,454,009.41	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	27,704	99.11	2,745,743.44	
INVESCO LTD	19,405	17.11	332,019.55	
KKR & CO INC	28,014	51.33	1,437,958.62	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,096	192.39	788,029.44	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,762	270.84	477,220.08	
MOODY'S CORP	8,230	295.46	2,431,635.80	
MORGAN STANLEY	65,965	82.43	5,437,494.95	
MSCI INC	4,065	439.90	1,788,193.50	
NASDAQ INC	5,320	172.60	918,232.00	
NORTHERN TRUST CORP	10,018	97.40	975,753.20	
PRICE T ROWE GROUP INC	11,505	121.08	1,393,025.40	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,521	95.73	911,445.33	
S&P GLOBAL INC	17,638	361.94	6,383,897.72	
SCHWAB (CHARLES) CORP	72,232	62.99	4,549,893.68	
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	54.39	342,058.71	
STATE STREET CORP	18,501	68.16	1,261,028.16	
SYNCHRONY FINANCIAL	27,139	32.68	886,902.52	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,522	70.97	320,926.34	
UPSTART HOLDINGS INC	2,178	26.03	56,693.34	
AFLAC	31,141	55.28	1,721,474.48	
ALLEGHANY CORP	647	837.15	541,636.05	
ALLSTATE CORP	14,193	116.20	1,649,226.60	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,803	131.91	501,653.73	
AMERICAN INT'L GROUP	40,246	51.33	2,065,827.18	
AON PLC	10,695	279.49	2,989,145.55	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	18,793	43.67	820,690.31	

ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,383	168.23	1,746,732.09	
ASSURANT INC	2,684	169.74	455,582.16	
BROWN & BROWN INC	11,065	61.97	685,698.05	
CHUBB LTD	21,140	184.13	3,892,508.20	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,751	110.83	859,043.33	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,444	191.81	276,973.64	
EVEREST RE GROUP LTD	1,834	271.94	498,737.96	
FNF GROUP	12,836	37.89	486,356.04	
GLOBE LIFE INC	4,559	100.67	458,954.53	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	16,673	63.78	1,063,403.94	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,416	49.64	417,770.24	
LOEWS CORP	10,482	57.05	597,998.10	
MARKEL CORP	639	1,262.68	806,852.52	
MARSH & MCLENNAN COS	24,739	156.84	3,880,064.76	
METLIFE INC	35,762	60.85	2,176,117.70	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,725	63.91	813,254.75	
PROGRESSIVE CORP	28,960	111.19	3,220,062.40	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,486	95.51	1,765,597.86	
TRAVELERS COS INC/THE	11,830	156.42	1,850,448.60	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,009	202.18	1,214,899.62	
WR BERKLEY CORP	9,829	62.65	615,786.85	
CBRE GROUP INC-A	16,391	82.26	1,348,323.66	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	64,300	4.90	315,070.00	
WEYERHAEUSER CO	36,674	35.51	1,302,293.74	
ZILLOW GROUP INC-C	7,537	36.21	272,914.77	
ACCENTURE PLC-CL A	31,433	288.01	9,053,018.33	
ADOBE INC	23,458	401.90	9,427,770.20	
AFFIRM HOLDINGS INC	8,787	26.77	235,227.99	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	7,539	94.13	709,646.07	
ANSYS INC	4,382	260.17	1,140,064.94	
APPLOVIN CORP-CLASS A	6,563	36.16	237,318.08	
AUTODESK INC	10,882	195.95	2,132,327.90	
AUTOMATIC DATA PROCESS	20,657	220.34	4,551,563.38	
AVALARA INC	4,011	89.37	358,463.07	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,879	36.69	289,080.51	
BILL.COM HOLDINGS INC	4,833	129.57	626,211.81	
BLACK KNIGHT INC	8,009	65.03	520,825.27	
BLOCK INC	24,992	71.80	1,794,425.60	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	5,961	156.19	931,048.59	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	13,920	167.71	2,334,523.20	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,963	54.20	377,394.60	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,676	128.85	731,352.60	

CITRIX SYSTEMS INC	6,470	101.48	656,575.60	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	12,921	51.65	667,369.65	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	26,353	69.10	1,820,992.30	
COUPA SOFTWARE INC	3,189	66.93	213,439.77	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,967	183.53	1,829,243.51	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,100	139.72	293,412.00	
DATADOG INC - CLASS A	10,804	93.79	1,013,307.16	
DOCUSIGN INC	9,538	64.45	614,724.10	
DROPBOX INC-CLASS A	16,505	22.69	374,498.45	
DYNATRACE INC	8,780	37.12	325,913.60	
EPAM SYSTEMS INC	2,842	323.30	918,818.60	
FAIR ISAAC CORP	1,345	467.65	628,989.25	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	30,439	99.02	3,014,069.78	
FISERV INC	30,979	99.87	3,093,872.73	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,879	218.79	848,686.41	
FORTINET INC	34,510	61.23	2,113,047.30	
GARTNER INC	4,134	253.74	1,048,961.16	
GLOBAL PAYMENTS INC	14,011	118.71	1,663,245.81	
GODADDY INC - CLASS A	8,747	74.02	647,452.94	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3,640	76.07	276,894.80	
HUBSPOT INC	2,233	300.50	671,016.50	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	44,787	128.25	5,743,932.75	
INTUIT INC	13,404	434.74	5,827,254.96	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,514	199.69	701,710.66	
MASTERCARD INC-CLASS A	43,362	343.88	14,911,324.56	
MICROSOFT CORP	353,374	260.36	92,004,454.64	
MONGODB INC	3,415	301.61	1,029,998.15	
NORTONLIFELOCK INC	29,838	25.43	758,780.34	
OKTA INC	7,338	101.95	748,109.10	
ORACLE CORP	78,820	74.90	5,903,618.00	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	74,206	9.84	730,187.04	
PALO ALTO NETWORKS INC	4,839	511.17	2,473,551.63	
PAYCHEX INC	16,029	122.44	1,962,590.76	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,625	324.53	851,891.25	
PAYPAL HOLDINGS INC	54,270	81.05	4,398,583.50	
PTC INC	5,381	111.18	598,259.58	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,503	55.18	193,295.54	
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,201	410.92	2,137,194.92	
SALESFORCE INC	49,010	182.47	8,942,854.70	
SERVICENOW INC	9,974	446.77	4,456,083.98	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	10,361	142.99	1,481,519.39	
SPLUNK INC	7,452	105.23	784,173.96	

SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,662	62.79	669,466.98	
SYNOPSYS INC	7,555	338.04	2,553,892.20	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	21,590	47.27	1,020,559.30	
TWILIO INC - A	7,960	87.33	695,146.80	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,028	367.31	744,904.68	
UNITY SOFTWARE INC	10,116	36.47	368,930.52	
VERISIGN INC	4,769	185.30	883,695.70	
VISA INC-CLASS A SHARES	82,381	213.70	17,604,819.70	
VMWARE INC-CLASS A	10,056	113.60	1,142,361.60	
WESTERN UNION CO	20,387	16.73	341,074.51	
WIX.COM LTD	2,353	63.20	148,709.60	
WORKDAY INC-CLASS A	9,867	148.00	1,460,316.00	
ZENDESK INC	5,395	75.25	405,973.75	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	10,363	106.55	1,104,177.65	
ZSCALER INC	4,184	159.93	669,147.12	
AMPHENOL CORPORATION	29,472	69.82	2,057,735.04	
APPLE INC	809,683	154.09	124,764,053.47	
ARISTA NETWORKS INC	12,447	102.38	1,274,323.86	
ARROW ELECTRONICS INC	3,851	119.61	460,618.11	
CDW CORP/DE	6,651	170.10	1,131,335.10	
CISCO SYSTEMS	205,941	44.46	9,156,136.86	
COGNEX CORP	8,069	48.76	393,444.44	
CORNING	40,515	34.37	1,392,500.55	
DELL TECHNOLOGIES -C	14,009	43.34	607,150.06	
F5 INC	2,841	153.91	437,258.31	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	66,144	13.77	910,802.88	
HP INC	52,913	32.47	1,718,085.11	
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	28.61	466,571.88	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,238	150.58	1,391,058.04	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,455	221.16	1,869,907.80	
NETAPP INC	10,843	69.26	750,986.18	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,880	76.83	759,080.40	
TE CONNECTIVITY LTD	16,345	123.05	2,011,252.25	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,404	400.93	963,835.72	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	11,609	63.15	733,108.35	
WESTERN DIGITAL CORP	15,203	47.22	717,885.66	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,482	326.68	810,819.76	
AT&T INC	355,457	18.40	6,540,408.80	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,831	21.77	170,480.87	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,877	22.68	428,130.36	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	42,975	10.55	453,386.25	
T-MOBILE US INC	31,168	132.48	4,129,136.64	

VERIZON COMMUNICATIONS	208,706	44.45	9,276,981.70	
AES CORP	30,838	19.73	608,433.74	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	12,663	57.43	727,236.09	
AMEREN CORPORATION	13,199	87.43	1,153,988.57	
AMERICAN ELECTRIC POWER	24,953	94.35	2,354,315.55	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,178	148.22	1,360,363.16	
ATMOS ENERGY CORP	6,926	113.35	785,062.10	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,584	29.70	938,044.80	
CMS ENERGY CORP	14,716	65.18	959,188.88	
CONSOLIDATED EDISON INC	17,915	92.44	1,656,062.60	
CONSTELLATION ENERGY	16,151	54.00	872,154.00	
DOMINION ENERGY INC	39,780	77.35	3,076,983.00	
DTE ENERGY COMPANY	9,793	123.75	1,211,883.75	
DUKE ENERGY CORP	38,378	104.98	4,028,922.44	
EDISON INTL	19,236	61.33	1,179,743.88	
ENTERGY CORP	10,274	109.37	1,123,667.38	
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,385	48.68	554,221.80	
EVERGY INC	11,724	64.31	753,970.44	
EVERSOURCE ENERGY	17,349	84.06	1,458,356.94	
EXELON CORP	48,454	44.02	2,132,945.08	
FIRSTENERGY CORP	27,438	38.32	1,051,424.16	
NEXTERA ENERGY INC	97,684	80.25	7,839,141.00	
NISOURCE INC	20,005	28.44	568,942.20	
NRG ENERGY INC	12,298	35.63	438,177.74	
PG&E CORP	68,966	10.63	733,108.58	
PPL CORPORATION	35,742	27.33	976,828.86	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	25,028	60.10	1,504,182.80	
SEMPRA ENERGY	15,948	154.24	2,459,819.52	
SOUTHERN CO	52,914	71.94	3,806,633.16	
UGI CORP	9,579	41.23	394,942.17	
VISTRA CORP	23,603	23.00	542,869.00	
WEC ENERGY GROUP INC	15,877	97.86	1,553,723.22	
XCEL ENERGY INC	26,807	68.67	1,840,836.69	
ADVANCED MICRO DEVICES	81,339	88.10	7,165,965.90	
ANALOG DEVICES	26,323	163.27	4,297,756.21	
APPLIED MATERIALS	44,314	101.67	4,505,404.38	
BROADCOM INC	20,363	512.52	10,436,444.76	
ENPHASE ENERGY INC	6,604	211.54	1,397,010.16	
ENTEGRIS INC	6,990	102.27	714,867.30	
INTEL CORP	202,547	39.20	7,939,842.40	
KLA CORP	7,545	354.02	2,671,080.90	
LAM RESEARCH CORP	6,968	463.99	3,233,082.32	

	MARVELL TECHNOLOGY INC	42,282	52.02	2,199,509.64	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	27,084	64.72	1,752,876.48	
	MICRON TECHNOLOGY	54,679	61.29	3,351,275.91	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,249	436.44	981,553.56	
	NVIDIA CORP	124,147	173.19	21,501,018.93	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	13,089	175.14	2,292,407.46	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	21,863	59.42	1,299,099.46	
	QORVO INC	5,297	104.34	552,688.98	
	QUALCOMM	56,084	153.70	8,620,110.80	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,742	106.07	821,193.94	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	2,629	288.93	759,596.97	
	TERADYNE INC	7,707	100.46	774,245.22	
	TEXAS INSTRUMENTS	45,951	163.90	7,531,368.90	
アメリカドル 小計		16,897,831		1,708,938,677.68 (233,492,291,531)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	36,244	15.77	571,567.88	
	CAMECO CORP	19,186	29.07	557,737.02	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	58,757	64.33	3,779,837.81	
	CENOVUS ENERGY INC	70,732	21.81	1,542,664.92	
	ENBRIDGE	101,209	55.41	5,607,990.69	
	IMPERIAL OIL	11,645	55.78	649,558.10	
	KEYERA CORP	10,963	30.99	339,743.37	
	PARKLAND CORP	8,544	34.89	298,100.16	
	PEMBINA PIPELINE CORP	28,103	46.31	1,301,449.93	
	SUNCOR ENERGY	70,924	39.78	2,821,356.72	
	TC ENERGY CORP	48,340	68.63	3,317,574.20	
	TOURMALINE OIL CORP	14,710	68.77	1,011,606.70	
	AGNICO EAGLE MINES	22,981	52.00	1,195,012.00	
	BARRICK GOLD CORP	88,471	19.80	1,751,725.80	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	63.78	465,721.56	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	30,312	19.89	602,905.68	
	FRANCO-NEVADA CORP	9,313	160.99	1,499,299.87	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	26,291	6.86	180,356.26	
	KINROSS GOLD CORP	56,706	4.20	238,165.20	
	LUNDIN MINING CORP	30,173	7.35	221,771.55	
	NUTRIEN LTD	27,681	101.17	2,800,486.77	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	9,343	24.26	226,661.18	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	24,191	33.59	812,575.69	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,500	126.18	567,810.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	23,120	41.97	970,346.40	
	CAE INC	16,864	33.11	558,367.04	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,269	106.28	453,709.32	

WSP GLOBAL INC	5,400	151.18	816,372.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	10,920	35.15	383,838.00	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,665	89.40	506,451.00	
THOMSON REUTERS CORP	7,995	140.10	1,120,099.50	
AIR CANADA	6,737	16.91	113,922.67	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	29,791	149.27	4,446,902.57	
CP RAILWAY LIMITED	46,278	95.60	4,424,176.80	
TFI INTERNATIONAL INC	4,630	116.45	539,163.50	
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,682	78.88	1,158,116.16	
BRP INC/CA- SUB VOTING	2,814	90.93	255,877.02	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	37.13	371,300.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,221	67.27	1,023,916.67	
QUEBECOR INC -CL B	5,999	28.71	172,231.29	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	24,782	34.80	862,413.60	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,586	170.83	441,766.38	
DOLLARAMA INC	13,514	77.00	1,040,578.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	42,716	53.71	2,294,276.36	
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	39.56	289,974.80	
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	119.38	1,082,537.84	
METRO INC	11,419	69.65	795,333.35	
WESTON (GEORGE) LTD	3,705	155.15	574,830.75	
SAPUTO INC	11,041	31.47	347,460.27	
BAUSCH HEALTH COS INC	14,544	11.33	164,783.52	
BANK MONTREAL	31,608	125.29	3,960,166.32	
BANK NOVA SCOTIA	60,770	75.09	4,563,219.30	
CANADIAN IMPERIAL BANK	44,598	62.96	2,807,890.08	
NATIONAL BANK OF CANADA	16,160	88.96	1,437,593.60	
ROYAL BANK OF CANADA	69,804	123.62	8,629,170.48	
TORONTO-DOMINION BANK	90,808	82.03	7,448,980.24	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	69,288	61.98	4,294,470.24	
IGM FINANCIAL INC	3,890	36.31	141,245.90	
ONEX CORP	3,361	66.31	222,867.91	
TMX GROUP LTD	2,508	125.70	315,255.60	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,198	680.26	814,951.48	
GREAT-WEST LIFECO INC	12,491	30.63	382,599.33	
IA FINANCIAL CORP INC	5,415	64.24	347,859.60	
INTACT FINANCIAL CORP	8,967	178.30	1,598,816.10	
MANULIFE FINANCIAL CORP	96,584	22.47	2,170,242.48	
POWER CORP OF CANADA	25,684	34.18	877,879.12	
SUN LIFE FINANCIAL INC	29,314	57.25	1,678,226.50	
FIRSTSERVICE CORP	2,028	170.22	345,206.16	
BLACKBERRY LIMITED	25,075	7.68	192,576.00	

	CGI INC - CL A	11,043	108.93	1,202,913.99	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,007	2,058.76	2,073,171.32	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	5,859	26.19	153,447.21	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,153	45.70	98,392.10	
	OPEN TEXT CORP	12,469	52.37	653,001.53	
	SHOPIFY INC - CLASS A	55,990	48.24	2,700,957.60	
	BCE INC	3,102	63.39	196,635.78	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	18,199	60.39	1,099,037.61	
	TELUS CORP	23,120	28.90	668,168.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	37,267	17.28	643,973.76	
	ALTAGAS INCOME LTD	14,516	27.51	399,335.16	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,264	49.06	307,311.84	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	39.68	237,207.04	
	EMERA INC	13,595	60.22	818,690.90	
	FORTIS INC	22,342	60.10	1,342,754.20	
	HYDRO ONE LTD	14,776	34.86	515,091.36	
	NORTHLAND POWER INC	9,907	40.48	401,035.36	
カナダドル 小計		2,024,849		113,310,765.07 (11,964,483,683)	
ユーロ	ENI	126,764	10.97	1,390,601.08	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	23,722	9.74	231,052.28	
	NESTE OIL OYJ	21,882	45.75	1,001,101.50	
	OMV AG	7,462	41.38	308,777.56	
	REPSOL SA	68,089	12.03	819,110.67	
	TENARIS SA	27,420	12.49	342,475.80	
	TOTALENERGIES SE	122,539	48.54	5,948,043.06	
	AIR LIQUIDE	26,132	129.34	3,379,912.88	
	AKZO NOBEL	9,224	65.74	606,385.76	
	ARCELORMITTAL	32,320	23.04	744,652.80	
	ARKEMA	2,799	90.44	253,141.56	
	BASF SE	44,781	43.14	1,931,852.34	
	COVESTRO AG	10,438	33.44	349,046.72	
	CRH PLC	39,369	35.27	1,388,741.47	
	EVONIK INDUSTRIES AG	9,603	20.21	194,076.63	
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,738	48.55	327,129.90	
	KONINKLIJKE DSM NV	8,702	151.25	1,316,177.50	
	OCI NV	5,799	31.08	180,232.92	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,335	32.26	365,667.10	
	SOLVAY SA	3,676	80.62	296,359.12	
	STORA ENSO OYJ R	26,361	14.79	389,879.19	
	SYMRISE AG	7,051	111.05	783,013.55	
	UMICORE	9,946	33.43	332,494.78	

UPM KYMMENE OYJ	27,619	29.05	802,331.95	
VOESTALPINE AG	5,948	21.00	124,908.00	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	10,930	22.22	242,864.60	
ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	10,930	1.40	15,394.90	
AIRBUS SE	29,872	105.58	3,153,885.76	
ALSTOM	16,908	22.86	386,516.88	
BOUYGUES ORD	11,344	28.83	327,047.52	
BRENNTAG SE	6,989	66.20	462,671.80	
CNH INDUSTRIAL NV	46,753	11.53	539,295.85	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	20,876	25.61	534,738.74	
DASSAULT AVIATION SA	1,210	141.30	170,973.00	
EIFFAGE	3,659	87.18	318,991.62	
FERROVIAL SA	22,380	26.25	587,475.00	
GEA GROUP AG	7,649	34.86	266,644.14	
IMCD NV	3,050	146.75	447,587.50	
KINGSPAN GROUP PLC	7,694	61.10	470,103.40	
KION GROUP AG	3,430	44.69	153,286.70	
KNORR-BREMSE AG	3,221	56.14	180,826.94	
KONE OYJ-B	15,737	43.91	691,011.67	
LEGRAND SA	13,075	78.46	1,025,864.50	
MTU AERO ENGINES AG	2,396	192.50	461,230.00	
PRYSMIAN SPA	11,275	28.38	319,984.50	
RATIONAL AG	268	650.50	174,334.00	
RHEINMETALL AG	2,442	181.50	443,223.00	
SAFRAN SA	17,120	103.50	1,771,920.00	
SAINT-GOBAIN	25,279	43.32	1,095,086.28	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	27,347	125.58	3,434,236.26	
SIEMENS	38,409	105.42	4,049,076.78	
SIEMENS ENERGY AG	24,753	15.28	378,349.60	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	12,322	17.91	220,687.02	
THALES SA	5,540	119.85	663,969.00	
VINCI S.A.	26,015	89.57	2,330,163.55	
WARTSILA OYJ	18,738	8.77	164,407.21	
BUREAU VERITAS SA	12,892	26.29	338,930.68	
RANDSTAD NV	5,866	50.36	295,411.76	
TELEPERFORMANCE	3,110	330.10	1,026,611.00	
WOLTERS KLUWER	13,534	102.40	1,385,881.60	
ADP	1,532	126.05	193,108.60	
AENA SME SA	3,518	125.50	441,509.00	
ATLANTIA SPA	26,089	22.54	588,046.06	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	38,499	6.04	232,533.96	
DEUTSCHE POST AG-REG	48,367	37.97	1,836,736.82	

GETLINK	18,993	19.05	361,816.65	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	16,643	77.10	1,283,175.30	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,582	72.65	187,582.30	
CONTINENTAL AG	4,993	70.54	352,206.22	
FERRARI NV	6,331	197.45	1,250,055.95	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	40,641	54.69	2,222,656.29	
MICHELIN	33,216	28.24	938,019.84	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	6,979	68.98	481,411.42	
RENAULT SA	8,441	25.83	218,031.03	
STELLANTIS NV	113,390	12.64	1,434,156.72	
VALEO SA	10,032	19.96	200,288.88	
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,112	134.32	1,223,923.84	
VOLKSWAGEN STAMM	1,657	190.50	315,658.50	
ADIDAS AG	8,492	176.62	1,499,857.04	
ESSILORLUXOTTICA	14,035	154.90	2,174,021.50	
HERMES INTERNATIONAL	1,565	1,205.00	1,885,825.00	
KERING	3,703	531.30	1,967,403.90	
LVMH	13,872	634.70	8,804,558.40	
MONCLER SPA	9,963	43.61	434,486.43	
PUMA SE	4,644	70.40	326,937.60	
SEB SA	1,310	83.70	109,647.00	
ACCOR	7,911	27.98	221,349.78	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8,339	97.02	809,049.78	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,332	33.94	180,968.08	
SODEXO	3,888	75.06	291,833.28	
BOLLORE SE	37,200	4.74	176,625.60	
PUBLICIS GROUPE	11,624	50.26	584,222.24	
SCOUT24 SE	4,128	54.72	225,884.16	
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,969	41.10	204,225.90	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	36,953	21.42	791,533.26	
VIVENDI SE	33,016	10.01	330,490.16	
D'IETEREN GROUP	1,703	154.70	263,454.10	
DELIVERY HERO SE	7,305	43.66	318,936.30	
INDITEX	54,582	24.56	1,340,533.92	
JUST EAT TAKEAWAY	8,459	18.57	157,100.54	
PROSUS	41,585	68.59	2,852,315.15	
ZALANDO SE	11,285	29.76	335,841.60	
CARREFOUR	30,831	16.86	519,810.66	
HELLOFRESH SE	7,756	26.67	206,852.52	
JERONIMO MARTINS	13,062	21.20	276,914.40	
KESKO OYJ-B SHS	14,326	24.13	345,686.38	
KONINKLIJKE AHOLD NV	50,995	26.45	1,349,072.72	

ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	42,993	53.07	2,281,638.51	
DANONE (GROUPE)	32,878	53.74	1,766,863.72	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	26,648	10.48	279,271.04	
HEINEKEN HOLDING NV	5,127	75.00	384,525.00	
HEINEKEN NV	12,980	95.08	1,234,138.40	
JDE PEET'S BV	4,123	27.82	114,701.86	
KERRY GROUP PLC-A	7,323	99.96	732,007.08	
PERNOD-RICARD	10,396	185.50	1,928,458.00	
REMY COINTREAU	1,020	182.50	186,150.00	
BEIERSDORF AG	4,515	99.92	451,138.80	
HENKEL AG & CO KGAA	4,647	60.70	282,072.90	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	8,553	61.28	524,127.84	
LOREAL	12,190	353.60	4,310,384.00	
AMPLIFON SPA	6,606	31.16	205,842.96	
BIOMERIEUX	2,374	104.75	248,676.50	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,091	139.25	291,171.75	
DIASORIN ITALIA SPA	1,418	140.90	199,796.20	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	9,705	44.69	433,716.45	
FRESENIUS SE&CO KGAA	20,026	27.30	546,709.80	
KONINKLIJKE PHILIPS	45,856	21.74	997,138.72	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,216	418.50	508,896.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,577	49.28	718,354.56	
ARGENX SE	2,207	353.70	780,615.90	
BAYER	48,711	56.79	2,766,297.69	
EUROFINS SCIENTIFIC	6,490	83.10	539,319.00	
GRIFOLS SA	14,240	16.43	234,034.40	
IPSEN	1,866	91.75	171,205.50	
MERCK KGAA	6,723	178.05	1,197,030.15	
ORION OYJ-CLASS B	5,393	45.90	247,538.70	
QIAGEN N.V.	11,006	46.89	516,071.34	
RECORDATI SPA	5,195	42.90	222,865.50	
SANOFI	56,690	97.36	5,519,338.40	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,235	376.30	464,730.50	
UCB (GROUPE)	6,718	80.36	539,858.48	
ABN AMRO BANK NV-CVA	19,718	9.70	191,304.03	
BANCO BILBAO VIZCAYA	328,517	4.14	1,362,688.51	
BANCO SANTANDER SA	847,548	2.43	2,062,084.28	
BNP PARIBAS	54,846	43.81	2,403,077.49	
CAIXABANK	219,234	2.82	619,116.81	
COMMERZBANK AG	46,222	6.33	292,862.59	
CREDIT AGRICOLE SA	64,475	8.51	548,875.67	
ERSTE GROUP BANK AG	18,119	23.88	432,681.72	

FINECOBANK SPA	27,362	11.23	307,412.07	
ING GROEP NV-CVA	193,144	9.04	1,747,566.91	
INTESA SANPAOLO	823,869	1.66	1,367,622.54	
KBC GROEP NV	12,855	49.75	639,536.25	
MEDIOBANCA	29,447	8.03	236,518.30	
SOCIETE GENERALE	38,744	20.44	791,927.36	
UNICREDIT SPA	103,949	8.50	883,566.50	
AMUNDI SA	2,812	52.85	148,614.20	
DEUTSCHE BANK NAMEN	101,640	8.26	839,749.68	
DEUTSCHE BOERSE	9,759	161.15	1,572,662.85	
EURAZEO SA	2,340	66.40	155,376.00	
EURONEXT NV	4,500	77.46	348,570.00	
EXOR NV	4,845	63.84	309,304.80	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,582	84.20	470,004.40	
SOFINA	752	211.20	158,822.40	
WENDEL	1,047	86.70	90,774.90	
AEGON	79,881	4.06	324,556.50	
AGEAS	8,621	40.90	352,598.90	
ALLIANZ SE-REG	19,980	174.12	3,478,917.60	
ASSICURAZIONI GENERALI	58,531	14.29	836,700.64	
AXA SA	95,834	21.21	2,032,639.14	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,976	138.30	411,580.80	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	6,875	219.20	1,507,000.00	
NN GROUP NV	13,557	43.95	595,830.15	
POSTE ITALIANE SPA	25,777	8.09	208,639.03	
SAMPO OYJ-A SHS	25,899	40.85	1,057,974.15	
AROUNDTOWN SA	52,418	3.11	163,386.90	
LEG IMMOBILIEN SE	3,774	87.18	329,017.32	
VONOVIA SE	36,313	31.92	1,159,110.96	
ADYEN NV	1,088	1,622.00	1,764,736.00	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	22,519	56.00	1,261,064.00	
BECHTLE AG	4,296	40.08	172,183.68	
CAPGEMINI SA	7,986	171.10	1,366,404.60	
DASSAULT SYSTEMES SA	33,230	39.48	1,311,920.40	
EDENRED	12,673	47.33	599,813.09	
NEMETSCHEK SE	3,320	61.20	203,184.00	
NEXI SPA	26,598	8.29	220,497.42	
SAP SE	52,396	92.06	4,823,575.76	
WORLDLINE SA	10,832	36.59	396,342.88	
NOKIA OYJ	272,288	5.01	1,364,979.74	
CELLNEX TELECOM SA	27,196	42.40	1,153,110.40	
DEUTSCHE TELEKOM	158,666	18.16	2,882,009.22	

	ELISA A	6,367	52.90	336,814.30	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,877	9.94	147,996.39	
	KPN (KON.)	173,861	3.28	571,481.10	
	ORANGE	97,536	10.11	986,869.24	
	PROXIMUS	7,531	13.34	100,463.54	
	TELECOM ITALIA ORD	489,749	0.21	105,687.83	
	TELEFONICA	260,074	4.38	1,140,424.49	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	2.66	108,901.65	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,889	25.79	151,877.31	
	ACCIONA SA	1,278	184.70	236,046.60	
	E.ON SE	109,829	8.45	928,714.02	
	EDP RENOVAVEIS SA	15,418	24.00	370,032.00	
	ELECTRICITE DE FRANCE	21,082	11.77	248,135.14	
	ELIA GROUP SA/NV	1,604	143.80	230,655.20	
	ENAGAS	11,944	18.74	223,830.56	
	ENDESA	17,138	17.77	304,542.26	
	ENEL	398,046	4.72	1,880,369.30	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	139,324	4.74	661,231.70	
	ENGIE	91,232	11.41	1,041,504.51	
	FORTUM OYJ	20,155	11.35	228,860.02	
	IBERDROLA SA	284,072	9.99	2,838,447.42	
	IBERDROLA SA-RTS	284,072	0.26	76,358.55	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	9,726	28.22	274,467.72	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,296	18.32	426,782.72	
	RWE STAMM	31,648	37.52	1,187,432.96	
	SNAM SPA	90,959	4.81	437,785.66	
	TERNA SPA	63,339	7.19	455,914.12	
	UNIPER SE	4,137	7.46	30,882.70	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	31,290	23.77	743,763.30	
	VERBUND AG	3,100	106.40	329,840.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	2,248	274.15	616,289.20	
	ASML HOLDING NV	20,078	522.50	10,490,755.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES	64,521	24.82	1,601,733.82	
	STMICROELECTRONICS	34,099	33.93	1,156,979.07	
ユーロ 小計		9,351,564		205,537,252.25 (28,602,564,023)	
イギリスポンド	BP PLC	975,033	3.83	3,737,301.48	
	SHELL PLC-NEW	379,061	20.39	7,730,949.09	
	ANGLO AMERICAN PLC	63,630	26.65	1,696,057.65	
	ANTOFAGASTA PLC	17,358	10.76	186,772.08	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,013	70.50	494,416.50	
	GLENCORE PLC	495,828	4.22	2,093,385.81	

JOHNSON MATTHEY PLC	8,824	21.18	186,892.32	
MONDI PLC	22,378	14.16	316,984.37	
RIO TINTO PLC REG	56,429	47.72	2,692,791.88	
ASHTEAD GROUP PLC	22,405	41.89	938,545.45	
BAE SYSTEMS PLC	156,168	7.80	1,218,110.40	
BUNZL PLC	15,472	30.43	470,812.96	
DCC PLC	4,499	52.56	236,467.44	
FERGUSON PLC	11,566	99.76	1,153,824.16	
MELROSE INDUSTRIES PLC	215,001	1.63	352,171.63	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	385,471	0.92	356,946.14	
SMITHS GROUP PLC	20,046	14.95	299,687.70	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,672	113.35	416,221.20	
EXPERIAN PLC	46,007	28.34	1,303,838.38	
INTERTEK GROUP PLC	7,435	45.17	335,838.95	
RELX PLC	95,541	23.58	2,252,856.78	
RENTOKIL INITIAL PLC	85,410	5.15	440,203.14	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	4.99	254,788.04	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,048	41.73	252,383.04	
BURBERRY GROUP PLC	18,587	17.25	320,718.68	
PERSIMMON PLC	14,327	18.57	266,124.02	
TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.26	209,552.57	
COMPASS GROUP PLC	90,247	18.54	1,673,179.38	
ENTAIN PLC	26,944	11.80	317,939.20	
INTERCONTINENTAL HOTELS	10,141	47.62	482,914.42	
WHITBREAD PLC	10,170	26.90	273,573.00	
AUTO TRADER GROUP PLC	43,890	6.12	268,782.36	
INFORMA PLC	69,112	5.88	406,931.45	
PEARSON	34,302	7.91	271,397.42	
WPP PLC	56,693	8.71	494,136.18	
JD SPORTS FASHION PLC	114,330	1.41	162,234.27	
KINGFISHER PLC	96,593	2.65	256,357.82	
NEXT PLC	6,143	66.86	410,720.98	
OCADO GROUP PLC	23,500	7.91	186,026.00	
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.20	180,767.67	
TESCO PLC	393,967	2.59	1,021,950.39	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	15,871	16.99	269,648.29	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	109,104	34.20	3,731,902.32	
COCA-COLA HBC AG-CDI	9,115	19.45	177,332.32	
DIAGEO	115,944	37.20	4,313,116.80	
IMPERIAL BRANDS PLC	45,617	18.55	846,195.35	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	35,301	62.68	2,212,666.68	
UNILEVER PLC	126,231	39.11	4,937,525.56	

	SMITH & NEPHEW PLC	42,096	11.90	501,152.88	
	ASTRAZENECA	77,234	107.66	8,315,012.44	
	GSK PLC	203,541	17.43	3,548,126.71	
	HALEON PLC	254,427	3.16	805,261.45	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	8,586	17.11	146,906.46	
	BARCLAYS	811,088	1.57	1,280,221.29	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,012,138	5.15	5,214,534.97	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,573,042	0.43	1,544,626.05	
	NATWEST GROUP PLC	302,525	2.25	680,983.77	
	STANDARD CHARTERED PLC	124,429	5.72	712,729.31	
	3I GROUP PLC	45,010	12.37	556,773.70	
	ABRDN PLC	100,722	1.61	162,766.75	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,246	8.56	156,331.72	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	16,399	78.52	1,287,649.48	
	M&G PLC	118,170	2.15	254,420.01	
	SCHRODERS PLC	5,525	27.66	152,821.50	
	ST JAMES'S PLACE PLC	26,728	11.85	316,726.80	
	ADMIRAL GROUP PLC	9,872	17.35	171,328.56	
	AVIVA PLC	138,721	3.91	543,370.15	
	LEGAL & GENERAL GROUP	289,782	2.56	743,870.39	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	43,255	6.06	262,125.30	
	PRUDENTIAL	138,731	10.02	1,390,778.27	
	AVEVA GROUP PLC	4,523	23.93	108,235.39	
	SAGE GROUP PLC	48,541	7.00	339,981.16	
	HALMA PLC	17,484	22.82	398,984.88	
	BT GROUP PLC	323,026	1.77	572,402.07	
	VODAFONE GROUP PLC	1,374,547	1.29	1,773,440.53	
	NATIONAL GRID PLC	179,691	11.03	1,982,890.18	
	SEVERN TRENT PLC	11,927	29.31	349,580.37	
	SSE PLC	50,382	17.27	870,349.05	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	10.77	374,064.90	
イギリスポンド 小計		14,270,572		88,628,386.21 (14,488,968,577)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	8,748	17.60	153,964.80	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	310	730.00	226,300.00	
	GIVAUDAN-REG	454	3,269.00	1,484,126.00	
	HOLCIM LTD	28,055	41.83	1,173,540.65	
	SIKA AG-BR	7,320	228.10	1,669,692.00	
	ABB LTD	79,686	27.55	2,195,349.30	
	GEBERIT AG-REG	1,777	493.40	876,771.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	911	170.80	155,598.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,021	175.00	353,675.00	

	VAT GROUP AG	1,440	261.80	376,992.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,959	33.53	233,335.27	
	SGS SA	347	2,302.00	798,794.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,730	246.00	671,580.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	25,653	106.75	2,738,457.75	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,285	246.00	316,110.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	46.24	138,904.96	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	189	2,108.00	398,412.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	102,700.00	513,500.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	55	9,840.00	541,200.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	139,868	116.24	16,258,256.32	
	ALCON INC	24,786	71.84	1,780,626.24	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,490	339.90	846,351.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,767	125.25	722,316.75	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,950	63.75	124,312.50	
	LONZA GROUP AG-REG	3,643	551.20	2,008,021.60	
	NOVARTIS	108,984	82.95	9,040,222.80	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,394	394.60	550,072.40	
	ROCHE HOLDING GENUSS	34,930	325.20	11,359,236.00	
	VIFOR PHARMA AG/NEW	2,126	166.05	353,022.30	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	129,034	5.33	688,267.35	
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,425	45.35	472,773.75	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,152	957.40	1,102,924.80	
	UBS GROUP AG	175,968	15.92	2,802,290.40	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	150.70	351,733.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,612	485.00	781,820.00	
	SWISS RE LTD	15,298	71.54	1,094,418.92	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,419	408.80	3,032,887.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,622	87.65	317,468.30	
	TEMENOS AG - REG	3,520	76.66	269,843.20	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,298	53.24	441,785.52	
	SWISSCOM	1,331	513.60	683,601.60	
スイスフラン 小計		856,900		70,098,557.08 (9,932,264,552)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	13,081	311.85	4,079,309.85	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,106	413.20	2,109,799.20	
	SCA SV CELLULOSA B	26,880	147.60	3,967,488.00	
	ALFA LAVAL AB	14,260	298.90	4,262,314.00	
	ASSA ABLOY AB-B	50,678	232.20	11,767,431.60	
	ATLAS COPCO A	132,288	110.22	14,580,783.36	
	ATLAS COPCO B	71,092	98.57	7,007,538.44	
	EPIROC AB-A	29,649	169.90	5,037,365.10	

	EPIROC AB-B	17,442	151.60	2,644,207.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	81.50	1,780,041.50	
	INDUTRADE AB	14,669	228.70	3,354,800.30	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,081	238.70	1,928,934.70	
	LIFCO AB-B SHS	13,590	188.50	2,561,715.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	80,939	93.66	7,580,746.74	
	SANDVIK AB	56,973	176.00	10,027,248.00	
	SKANSKA B	14,869	171.55	2,550,776.95	
	SKF AB-B	18,340	169.75	3,113,215.00	
	VOLVO AB-A SHS	8,748	183.30	1,603,508.40	
	VOLVO B	71,980	176.94	12,736,141.20	
	SECURITAS B	15,577	92.00	1,433,084.00	
	VOLVO CAR AB-B	35,544	78.00	2,772,432.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	12,053	144.12	1,737,078.36	
	EVOLUTION AB	9,622	939.70	9,041,793.40	
	EMBRACER GROUP AB	34,541	79.28	2,738,410.48	
	HENNES & MAURITZ B	33,524	134.46	4,507,637.04	
	SWEDISH MATCH AB	74,128	106.00	7,857,568.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	31,655	254.70	8,062,528.50	
	GETINGE AB-B SHS	12,650	230.70	2,918,355.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	9,481	218.70	2,073,494.70	
	NORDEA BANK ABP	161,977	96.40	15,614,582.80	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	82,855	107.60	8,915,198.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	70,420	88.78	6,251,887.60	
	SWEDBANK AB-A	40,897	137.00	5,602,889.00	
	EQT AB	15,478	252.90	3,914,386.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,848	252.30	1,727,750.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	249.10	2,149,982.10	
	INVESTOR AB-A SHS	23,000	199.85	4,596,550.00	
	INVESTOR AB-B SHS	90,842	183.06	16,629,536.52	
	KINNEVIK AB - B	10,757	177.65	1,910,981.05	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,093	461.40	1,888,510.20	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	32,478	63.94	2,076,643.32	
	SAGAX AB-B	9,400	254.20	2,389,480.00	
	SINCH AB	27,717	27.40	759,445.80	
	ERICSSON (LM) B	145,922	75.74	11,052,132.28	
	HEXAGON AB-B SHS	98,582	116.90	11,524,235.80	
	TELE2 AB-B SHS	24,520	114.45	2,806,314.00	
	TELIA CO AB	138,487	37.14	5,143,407.18	
スウェーデンクローナ 小計		1,932,185		250,789,658.27 (3,340,518,248)	
	AKER BP ASA	13,206	315.00	4,159,890.00	

ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	47,036	342.90	16,128,644.40	
	NORSK HYDRO	61,358	59.60	3,656,936.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,719	407.60	3,146,264.40	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,500	339.60	1,528,200.00	
	ADEVINTA ASA	16,857	71.20	1,200,218.40	
	MOWI ASA	23,314	219.70	5,122,085.80	
	ORKLA	39,803	81.72	3,252,701.16	
	SALMAR ASA	2,953	683.00	2,016,899.00	
	DNB BANK ASA	46,261	186.25	8,616,111.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	202.40	2,257,367.20	
	TELENOR ASA	30,180	116.40	3,512,952.00	
ノルウェークローネ 小計		304,340		54,598,270.41 (748,542,287)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,314	469.90	2,497,048.60	
	NOVOZYMES A/S	10,786	447.90	4,831,049.40	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	428	1,763.50	754,778.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	48,316	174.96	8,453,367.36	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	152	18,040.00	2,742,080.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	251	18,195.00	4,566,945.00	
	DSV A/S	9,463	1,149.00	10,872,987.00	
	PANDORA A/S	4,249	517.20	2,197,582.80	
	CARLSBERG AS-B	4,526	940.20	4,255,345.20	
	COLOPLAST-B	6,218	867.20	5,392,249.60	
	DEMANT A/S	4,463	285.90	1,275,971.70	
	GN STORE NORD A/S	6,740	254.70	1,716,678.00	
	GENMAB A/S	3,223	2,606.00	8,399,138.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	83,884	840.40	70,496,113.60	
	DANSKE BANK A/S	31,666	98.62	3,122,900.92	
	TRYG A/S	16,972	163.10	2,768,133.20	
	ORSTED A/S	9,594	822.00	7,886,268.00	
デンマーククローネ 小計		246,245		142,228,636.38 (2,659,675,500)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	12,821	32.57	417,579.97	
	SANTOS	153,046	7.03	1,075,913.38	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,345	24.75	256,038.75	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	92,816	30.97	2,874,511.52	
	BHP GROUP LTD	251,852	36.75	9,255,561.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	16.30	351,248.70	
	EVOLUTION MINING LTD	88,310	2.34	206,645.40	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	85,584	17.83	1,525,962.72	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	20,170	34.89	703,731.30	
	MINERAL RESOURCES LTD	10,000	46.82	468,200.00	

	NEWCREST MINING LIMITED	45,440	19.26	875,174.40	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	58,122	7.12	413,828.64	
	ORICA LTD	19,570	16.46	322,122.20	
	RIO TINTO LTD	18,796	96.26	1,809,302.96	
	SOUTH32 LTD	217,613	3.53	768,173.89	
	REECE LTD	12,870	14.65	188,545.50	
	BRAMBLES LTD	66,936	11.47	767,755.92	
	AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	3.87	362,247.48	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	39,948	4.51	180,165.48	
	TRANSURBAN GROUP	153,930	14.04	2,161,177.20	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	31,473	36.12	1,136,804.76	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,685	71.17	191,091.45	
	IDP EDUCATION LTD	12,550	26.53	332,951.50	
	LOTTERY CORP LTD/THE	98,817	4.44	438,747.48	
	REA GROUP LTD	3,000	122.75	368,250.00	
	SEEK LTD	17,113	22.48	384,700.24	
	WESFARMERS LTD	56,329	47.53	2,677,317.37	
	COLES GROUP LTD	68,071	18.86	1,283,819.06	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	58,785	7.97	468,516.45	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	63,525	37.25	2,366,306.25	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	11.84	408,243.20	
	COCHLEAR LIMITED	3,460	214.00	740,440.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,641	71.18	686,246.38	
	SONIC HEALTHCARE LTD	20,560	34.75	714,460.00	
	CSL LIMITED	24,011	293.47	7,046,508.17	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	140,921	22.59	3,183,405.39	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND -RTS	9,394	3.65	34,288.10	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	84,943	97.80	8,307,425.40	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	161,135	29.88	4,814,713.80	
	WESTPAC BANKING	178,990	21.07	3,771,319.30	
	ASX LTD	8,713	86.50	753,674.50	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	18,256	174.24	3,180,925.44	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	114,505	4.21	482,066.05	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	129,252	3.42	442,041.84	
	QBE INSURANCE GROUP	78,253	11.40	892,084.20	
	SUNCORP GROUP LIMITED	57,398	11.01	631,951.98	
	COMPUTERSHARE LIMITED	28,589	26.10	746,172.90	
	WISETECH GLOBAL LTD	6,445	49.21	317,158.45	
	XERO LTD	7,073	91.22	645,199.06	
	TELSTRA CORP	199,810	3.96	791,247.60	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	87,883	5.62	493,902.46	
		3,289,382		73,715,865.19	

オーストラリアドル 小計				(6,933,714,279)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	64,661	7.30	472,025.30	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	24,554	21.82	535,768.28	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	104,543	4.96	518,533.28	
	MERCURY NZ LTD	19,343	5.85	113,156.55	
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	4.82	308,643.88	
ニュージーランドドル 小計		277,135		1,948,127.29	
				(165,590,819)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	139,448	52.10	7,265,240.80	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	69,000	90.85	6,268,650.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	102,000	16.02	1,634,040.00	
	MTR CORP	82,500	40.85	3,370,125.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	81,000	27.35	2,215,350.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	97,000	44.90	4,355,300.00	
	SANDS CHINA LTD	127,000	17.86	2,268,220.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	89,600	15.48	1,387,008.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	83,000	22.80	1,892,400.00	
	WH GROUP LTD	446,619	5.90	2,635,052.10	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	191,500	28.35	5,429,025.00	
	HANG SENG BANK	39,600	128.20	5,076,720.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	58,600	351.60	20,603,760.00	
	AIA GROUP LTD	599,400	79.50	47,652,300.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	98,448	55.30	5,444,174.40	
	ESR GROUP LTD	92,400	19.44	1,796,256.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	115,000	14.12	1,623,800.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	79,761	27.10	2,161,523.10	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	76,250	26.15	1,993,937.50	
	SINO LAND CO	116,600	11.38	1,326,908.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	71,500	91.00	6,506,500.00	
	SWIRE PACIFIC A	20,000	44.85	897,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,000	18.54	1,279,260.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	81,000	33.80	2,737,800.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	48.45	1,550,400.00	
	CLP HOLDINGS	81,000	65.70	5,321,700.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	519,990	8.21	4,269,117.90	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	51.30	3,770,550.00	
香港ドル 小計		3,732,716		152,732,117.80	
				(2,659,066,170)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	80,200	6.57	526,914.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	4.10	306,680.00	
	SINGAPORE AIRLINES	54,650	5.38	294,017.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	0.81	258,957.00	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	81,700	3.99	325,983.00	
	DBS GROUP	89,600	31.26	2,800,896.00	
	OCBC BANK	171,350	11.48	1,967,098.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	57,900	27.46	1,589,934.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.77	415,225.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	118,900	3.85	457,765.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	7.75	170,500.00	
	UOL GROUP LIMITED	24,800	7.34	182,032.00	
	VENTURE CORP LTD	14,300	17.33	247,819.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	420,880	2.65	1,115,332.00	
シンガポールドル 小計		1,573,280		10,659,152.00 (1,047,901,233)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	28,484	31.48	896,676.32	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,248	776.50	969,072.00	
	BANK HAPOALIM BM	63,371	32.17	2,038,645.07	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,692	32.69	2,310,921.48	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,227	19.73	1,267,198.71	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,272	126.60	794,035.20	
	AZRIELI GROUP	1,471	271.00	398,641.00	
	NICE LTD	3,165	722.10	2,285,446.50	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	5,624	158.40	890,841.60	
イスラエルシェケル 小計		244,554		11,851,477.88 (470,709,887)	
合　計		55,001,553		316,506,290,789 (316,506,290,789)	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	63,405	748,179.00	
		LENDLEASE GROUP	36,448	359,741.76	
	オーストラリアドル 小計		99,853	1,107,920.76 (104,211,026)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000	911,300.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	2,023,900.00	
	香港ドル 小計		315,000	2,935,200.00 (51,101,832)	
投資信託受益証券合計			414,853	155,312,858 (155,312,858)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,686	1,154,590.92	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	16,172	588,175.64	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	22,709	5,895,256.40	

		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	71,103	457,903.32	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,916	1,371,097.00	
		BOSTON PROPERTIES	6,840	605,682.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,093	691,833.12	
		CROWN CASTLE INTL CORP	21,569	3,728,417.34	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,046	1,789,741.32	
		DUKE REALTY CORP	19,458	1,161,448.02	
		EQUINIX INC	4,536	2,965,546.08	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,979	644,692.20	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	17,656	1,294,361.36	
		ESSEX PROPERTY TRUST	3,024	828,001.44	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,789	1,207,830.99	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	19,000	462,840.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	24,947	668,579.60	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,496	549,832.32	
		INVITATION HOMES INC	30,792	1,122,368.40	
		IRON MOUNTAIN INC	13,240	627,178.80	
		KIMCO REALTY CORP	31,093	666,944.85	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	27,097	448,455.35	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,856	1,019,236.80	
		PROLOGIS INC	36,906	4,683,371.40	
		PUBLIC STORAGE	7,808	2,493,328.64	
		REALTY INCOME CORP	29,689	2,118,310.15	
		REGENCY CENTERS CORP	7,026	441,373.32	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	5,468	1,754,189.08	
		SIMON PROPERTY GROUP	16,262	1,686,044.16	
		SUN COMMUNITIES INC	5,410	868,413.20	
		UDR INC	14,820	684,239.40	
		VENTAS INC	20,307	1,051,496.46	
		VICI PROPERTIES INC	46,821	1,547,902.26	
		VORNADO REALTY TRUST	7,639	226,343.57	
		WELLTOWER INC	22,461	1,860,444.63	
		WP CAREY INC	8,887	740,820.32	
	アメリカドル 小計		646,601	50,106,289.86 (6,846,022,383)	
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,069	238,395.07	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	181,494.05	
	カナダドル 小計		14,014	419,889.12 (44,336,092)	
	ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	—	
		COVIVIO(FP)	3,076	180,407.40	
		GECINA SA	1,966	194,240.80	

		KLEPIERRE	8,356	176,395.16	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,185	321,743.70	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,235	231,954.10	
	ユーロ 小計		1,632,402	1,104,741.16 (153,735,779)	
	イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	39,175	191,604.92	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	235,399.03	
		SEGRO PLC	63,208	682,646.40	
	イギリスポンド 小計		134,515	1,109,650.35 (181,405,639)	
	オーストラリアドル	DEXUS	49,283	460,303.22	
		GOODMAN GROUP	83,969	1,614,723.87	
		GPT GROUP	85,529	384,880.50	
		MIRVAC GROUP	176,235	373,618.20	
		SCENTRE GROUP	234,255	665,284.20	
		STOCKLAND	121,481	464,057.42	
		VICINITY CENTERS	163,023	326,046.00	
	オーストラリアドル 小計		913,775	4,288,913.41 (403,415,195)	
	香港ドル	LINK REIT	107,800	6,883,030.00	
	香港ドル 小計		107,800	6,883,030.00 (119,833,552)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	135,809	395,204.19	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	276,190	577,237.10	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	132,200	243,248.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	174,778	304,113.72	
	シンガポールドル 小計		718,977	1,519,803.01 (149,411,833)	
投資証券合計			4,168,084	7,898,160,473 (7,898,160,473)	
合計				8,053,473,331 (8,053,473,331)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率

アメリカドル	株式　604銘柄	97.2%	—	—	71.9%
	投資証券　36銘柄	—	—	2.8%	2.1%
カナダドル	株式　86銘柄	99.6%	—	—	3.7%
	投資証券　2銘柄	—	—	0.4%	0.0%
ユーロ	株式　225銘柄	99.5%	—	—	8.8%
	投資証券　6銘柄	—	—	0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式　79銘柄	98.8%	—	—	4.5%
	投資証券　3銘柄	—	—	1.2%	0.1%
スイスフラン	株式　41銘柄	100.0%	—	—	3.1%
スウェーデンクローナ	株式　47銘柄	100.0%	—	—	1.0%
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　17銘柄	100.0%	—	—	0.8%
オーストラリアドル	株式　51銘柄	93.2%	—	—	2.1%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.4%	—	0.0%
	投資証券　7銘柄	—	—	5.4%	0.1%
ニュージーランドドル	株式　5銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式　28銘柄	94.0%	—	—	0.8%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.8%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	4.2%	0.0%
シンガポールドル	株式　14銘柄	87.5%	—	—	0.3%
	投資証券　4銘柄	—	—	12.5%	0.0%
イスラエルシェケル	株式　9銘柄	100.0%	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月25日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	117,918,963

	2022年 7月25日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	1,751,983,948
国債証券	156,246,711,979
派生商品評価勘定	64,209,351
未収入金	2,176,479
未収利息	985,137,864
前払費用	41,317,358
差入委託証拠金	241,372,924
流動資産合計	159,450,828,866
資産合計	159,450,828,866
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,514,613
前受金	56,894,790
未払解約金	73,273,826
未払利息	713
流動負債合計	133,683,942
負債合計	133,683,942
純資産の部	
元本等	
元本	57,470,888,861
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	101,846,256,063
元本等合計	159,317,144,924
純資産合計	159,317,144,924
負債純資産合計	159,450,828,866

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 7月25日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。

	2022年 7月25日現在
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月25日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	57,470,888,861口
2．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.7721円 (1万口当たり純資産額) (27,721円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2022年 7月25日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2022年 7月25日現在
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月25日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 7月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月27日
期首元本額	55,642,880,509円
期中追加設定元本額	7,409,369,641円
期中一部解約元本額	5,581,361,289円
期末元本額	57,470,888,861円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	1,979,934,299円
ＤＣ外国債券インデックスファンド	1,898,508,796円
ＤＣ外国債券インデックスファンドＬ	14,320,047,297円
ＤＣバランスファンド３０	952,285,070円
ＤＣバランスファンド５０	979,507,541円
ＤＣバランスファンド７０	229,395,513円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	474,249,559円
外国債券インデックスｅ	1,046,709,854円
インデックスコレクション（外国債券）	8,896,113,158円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	4,766,690,001円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	791,735,504円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	254,103,442円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,014,720,410円
外国債券パッシブファンド私募Ａ（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	2,757,514,395円
外国債券インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	427,492,724円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	94,096,916円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	427,941,153円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	254,281,787円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	168,470,439円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	176,668,243円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	1,274,751,403円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	550,504,534円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	5,850,080,314円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	319,241,338円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	190,278,138円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	1,433,894,719円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	79,737,579円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	175,129,152円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	83,943,507円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	43,035,029円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	65,426,236円

区分	2022年 7月25日現在
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	222,873,166円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	65,848,257円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	1,194,218,962円
私募外国債券インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	11,460,426円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△11,704,461,983
合計	△11,704,461,983

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2022年 7月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,632,176,161	－	1,689,070,951	56,894,790
合計		1,632,176,161	－	1,689,070,951	56,894,790

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2022年 7月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,704,824,511	－	1,708,624,459	3,799,948
	アメリカドル	946,966,297	－	944,026,400	△2,939,897
	カナダドル	68,244,003	－	68,523,390	279,387

	ユーロ	593,655,513	－	599,721,415	6,065,902
	イギリスポンド	95,958,698	－	96,353,254	394,556
合計		1,704,824,511	－	1,708,624,459	3,799,948

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	5,000,000.00	4,791,699.20	
		T 0.125% 06/30/23	6,630,000.00	6,456,480.50	
		T 0.125% 10/15/23	2,530,000.00	2,442,932.42	
		T 0.25% 03/15/24	4,500,000.00	4,301,191.39	
		T 0.25% 05/15/24	5,070,000.00	4,825,709.19	
		T 0.25% 05/31/25	1,180,000.00	1,093,067.19	
		T 0.25% 06/15/24	10,610,000.00	10,076,598.80	
		T 0.25% 06/30/25	4,310,000.00	3,985,571.47	
		T 0.25% 07/31/25	2,200,000.00	2,029,671.88	
		T 0.25% 09/30/25	7,000,000.00	6,430,976.58	
		T 0.375% 01/31/26	1,700,000.00	1,555,500.00	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,452,500.00	
		T 0.375% 07/31/27	4,000,000.00	3,538,125.00	
		T 0.375% 08/15/24	5,500,000.00	5,214,042.95	
		T 0.375% 09/15/24	4,600,000.00	4,351,492.17	
		T 0.375% 09/30/27	4,000,000.00	3,519,687.52	
		T 0.375% 11/30/25	3,770,000.00	3,463,982.05	
		T 0.5% 02/28/26	3,500,000.00	3,211,660.16	
		T 0.5% 03/31/25	4,000,000.00	3,746,875.00	
		T 0.5% 05/31/27	5,500,000.00	4,911,328.12	
		T 0.5% 06/30/27	2,500,000.00	2,228,222.65	
		T 0.5% 08/31/27	1,100,000.00	976,550.78	

		T 0.5% 10/31/27	3,580,000.00	3,164,524.20	
		T 0.625% 03/31/27	3,400,000.00	3,066,906.25	
		T 0.625% 05/15/30	7,400,000.00	6,287,109.41	
		T 0.625% 07/31/26	4,000,000.00	3,656,406.24	
		T 0.625% 08/15/30	9,130,000.00	7,721,982.81	
		T 0.625% 10/15/24	3,250,000.00	3,086,992.18	
		T 0.625% 11/30/27	3,700,000.00	3,287,074.22	
		T 0.625% 12/31/27	3,000,000.00	2,660,390.64	
		T 0.75% 01/31/28	3,500,000.00	3,119,648.45	
		T 0.75% 03/31/26	2,750,000.00	2,542,783.21	
		T 0.75% 04/30/26	3,500,000.00	3,231,074.21	
		T 0.75% 08/31/26	3,000,000.00	2,752,265.64	
		T 0.75% 11/15/24	5,230,000.00	4,971,768.75	
		T 0.875% 09/30/26	5,000,000.00	4,604,492.20	
		T 0.875% 11/15/30	6,160,000.00	5,307,225.00	
		T 1.125% 01/15/25	5,830,000.00	5,574,482.06	
		T 1.125% 02/15/31	5,600,000.00	4,912,687.52	
		T 1.125% 05/15/40	1,550,000.00	1,114,910.16	
		T 1.125% 08/15/40	4,000,000.00	2,854,375.00	
		T 1.125% 08/31/28	4,000,000.00	3,609,218.76	
		T 1.125% 10/31/26	2,700,000.00	2,509,312.50	
		T 1.25% 03/31/28	5,300,000.00	4,845,980.48	
		T 1.25% 05/15/50	5,120,000.00	3,393,600.00	
		T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,472,421.86	
		T 1.25% 06/30/28	1,000,000.00	911,015.63	
		T 1.25% 07/31/23	3,950,000.00	3,880,489.24	
		T 1.25% 08/15/31	6,550,000.00	5,765,023.43	
		T 1.25% 09/30/28	3,800,000.00	3,451,320.32	
		T 1.25% 11/30/26	3,000,000.00	2,801,484.39	
		T 1.25% 12/31/26	5,500,000.00	5,128,535.17	
		T 1.375% 08/15/50	2,300,000.00	1,576,039.07	
		T 1.375% 08/31/23	3,450,000.00	3,388,479.49	
		T 1.375% 09/30/23	3,550,000.00	3,483,229.50	
		T 1.375% 10/31/28	1,700,000.00	1,553,906.25	
		T 1.375% 11/15/31	10,550,000.00	9,354,882.80	
		T 1.375% 11/15/40	4,650,000.00	3,450,445.31	
		T 1.5% 02/15/30	1,820,000.00	1,662,456.25	
		T 1.5% 08/15/26	5,300,000.00	5,013,882.83	
		T 1.5% 09/30/24	3,000,000.00	2,906,718.75	
		T 1.5% 11/30/28	5,550,000.00	5,109,035.18	
		T 1.625% 02/15/26	5,750,000.00	5,498,886.74	
		T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	5,150,460.92	

		T 1.625% 05/15/31	4,690,000.00	4,278,525.80	
		T 1.625% 08/15/29	2,260,000.00	2,091,559.37	
		T 1.625% 09/30/26	2,150,000.00	2,043,843.75	
		T 1.625% 11/15/50	5,400,000.00	3,947,906.25	
		T 1.625% 11/30/26	3,030,000.00	2,874,830.85	
		T 1.75% 01/31/29	2,500,000.00	2,337,109.37	
		T 1.75% 06/30/24	2,000,000.00	1,954,101.56	
		T 1.75% 08/15/41	4,800,000.00	3,766,125.02	
		T 1.75% 11/15/29	3,220,000.00	3,004,410.95	
		T 1.75% 12/31/26	4,300,000.00	4,100,789.08	
		T 1.875% 02/15/32	3,500,000.00	3,240,507.83	
		T 1.875% 02/15/41	4,750,000.00	3,840,820.31	
		T 1.875% 02/15/51	4,500,000.00	3,506,484.37	
		T 1.875% 02/28/27	3,000,000.00	2,873,320.32	
		T 1.875% 06/30/26	3,980,000.00	3,830,439.08	
		T 1.875% 07/31/26	1,800,000.00	1,730,953.13	
		T 1.875% 11/15/51	3,400,000.00	2,649,875.00	
		T 1% 07/31/28	2,000,000.00	1,792,421.88	
		T 1% 12/15/24	3,070,000.00	2,931,730.08	
		T 2.125% 02/29/24	1,400,000.00	1,380,312.50	
		T 2.125% 03/31/24	1,200,000.00	1,182,304.69	
		T 2.125% 05/15/25	3,850,000.00	3,764,126.94	
		T 2.125% 07/31/24	1,500,000.00	1,474,687.50	
		T 2.125% 09/30/24	2,200,000.00	2,161,328.13	
		T 2.125% 11/30/23	2,700,000.00	2,667,832.03	
		T 2.125% 11/30/24	1,400,000.00	1,372,984.38	
		T 2.25% 01/31/24	5,090,000.00	5,031,146.87	
		T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	3,792,445.33	
		T 2.25% 02/15/52	1,600,000.00	1,366,250.00	
		T 2.25% 03/31/24	7,300,000.00	7,206,183.61	
		T 2.25% 03/31/26	1,500,000.00	1,465,664.07	
		T 2.25% 04/30/24	2,600,000.00	2,566,839.83	
		T 2.25% 05/15/41	1,600,000.00	1,375,000.00	
		T 2.25% 08/15/27	2,320,000.00	2,250,943.76	
		T 2.25% 08/15/46	2,180,000.00	1,814,850.00	
		T 2.25% 08/15/49	4,110,000.00	3,498,637.50	
		T 2.25% 10/31/24	2,500,000.00	2,460,351.57	
		T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	4,920,117.20	
		T 2.25% 11/15/25	5,500,000.00	5,380,976.59	
		T 2.25% 11/15/27	5,260,000.00	5,093,570.33	
		T 2.25% 12/31/23	3,500,000.00	3,461,445.33	
		T 2.25% 12/31/24	2,900,000.00	2,851,062.50	
		T 2.375% 02/15/42	1,350,000.00	1,178,507.81	

		T 2.375% 02/29/24	4,280,000.00	4,237,534.39	
		T 2.375% 04/30/26	1,820,000.00	1,786,159.37	
		T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,517,031.26	
		T 2.375% 05/15/29	3,890,000.00	3,779,378.12	
		T 2.375% 05/15/51	1,600,000.00	1,400,875.00	
		T 2.375% 08/15/24	5,460,000.00	5,392,389.85	
		T 2.375% 11/15/49	2,010,000.00	1,760,163.29	
		T 2.5% 01/31/25	4,000,000.00	3,953,593.76	
		T 2.5% 02/15/45	2,150,000.00	1,879,066.41	
		T 2.5% 02/15/46	2,250,000.00	1,969,804.68	
		T 2.5% 02/28/26	650,000.00	640,656.25	
		T 2.5% 05/15/24	3,700,000.00	3,667,552.73	
		T 2.5% 05/15/46	1,810,000.00	1,583,750.00	
		T 2.5% 08/15/23	3,450,000.00	3,430,930.67	
		T 2.625% 01/31/26	1,350,000.00	1,336,869.14	
		T 2.625% 02/15/29	6,900,000.00	6,805,664.09	
		T 2.625% 03/31/25	2,500,000.00	2,478,906.25	
		T 2.625% 06/30/23	6,000,000.00	5,979,609.36	
		T 2.75% 02/15/24	3,900,000.00	3,884,003.91	
		T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	4,636,799.24	
		T 2.75% 05/31/29	6,000,000.00	5,962,968.78	
		T 2.75% 06/30/25	2,000,000.00	1,990,000.00	
		T 2.75% 07/31/23	4,000,000.00	3,990,468.76	
		T 2.75% 08/15/42	850,000.00	784,789.06	
		T 2.75% 08/15/47	2,450,000.00	2,259,742.18	
		T 2.75% 08/31/25	5,000,000.00	4,970,703.15	
		T 2.75% 11/15/23	4,450,000.00	4,436,093.75	
		T 2.75% 11/15/42	1,040,000.00	958,425.00	
		T 2.75% 11/15/47	2,500,000.00	2,312,109.37	
		T 2.875% 04/30/25	2,300,000.00	2,294,250.00	
		T 2.875% 05/15/28	4,460,000.00	4,457,560.95	
		T 2.875% 05/15/43	1,050,000.00	984,867.18	
		T 2.875% 05/15/49	4,400,000.00	4,246,687.50	
		T 2.875% 05/15/52	1,500,000.00	1,469,179.69	
		T 2.875% 07/31/25	500,000.00	499,082.03	
		T 2.875% 08/15/28	4,200,000.00	4,197,703.14	
		T 2.875% 08/15/45	1,480,000.00	1,384,725.00	
		T 2.875% 09/30/23	1,650,000.00	1,647,744.13	
		T 2.875% 11/30/23	6,000,000.00	5,988,046.86	
		T 2% 02/15/25	6,050,000.00	5,906,548.81	
		T 2% 02/15/50	3,370,000.00	2,711,533.61	
		T 2% 04/30/24	3,000,000.00	2,948,613.27	

		T 2% 05/31/24	1,500,000.00	1,473,310.54	
		T 2% 06/30/24	1,000,000.00	981,777.34	
		T 2% 08/15/25	3,750,000.00	3,646,582.05	
		T 2% 08/15/51	6,940,000.00	5,570,976.59	
		T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,601,281.25	
		T 2% 11/15/41	4,140,000.00	3,389,948.45	
		T 3.125% 02/15/42	1,000,000.00	986,171.88	
		T 3.125% 02/15/43	1,100,000.00	1,074,476.56	
		T 3.125% 05/15/48	1,400,000.00	1,398,578.13	
		T 3.125% 08/15/44	1,550,000.00	1,511,128.91	
		T 3.125% 11/15/28	3,960,000.00	4,016,151.57	
		T 3.125% 11/15/41	870,000.00	860,280.47	
		T 3.375% 05/15/44	1,700,000.00	1,726,828.12	
		T 3.375% 11/15/48	1,000,000.00	1,050,156.25	
		T 3.5% 02/15/39	900,000.00	970,523.44	
		T 3.625% 02/15/44	1,600,000.00	1,687,875.00	
		T 3.625% 08/15/43	1,600,000.00	1,688,125.00	
		T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,191,351.56	
		T 3.75% 11/15/43	900,000.00	966,937.50	
		T 3.875% 08/15/40	680,000.00	756,075.00	
		T 3% 02/15/47	2,400,000.00	2,310,000.00	
		T 3% 02/15/48	3,100,000.00	3,015,960.95	
		T 3% 02/15/49	1,940,000.00	1,911,960.94	
		T 3% 05/15/42	1,100,000.00	1,061,929.69	
		T 3% 05/15/45	600,000.00	572,812.50	
		T 3% 05/15/47	1,300,000.00	1,252,773.44	
		T 3% 08/15/48	3,060,000.00	2,988,281.24	
		T 3% 09/30/25	3,660,000.00	3,668,006.25	
		T 3% 10/31/25	1,000,000.00	1,001,718.75	
		T 3% 11/15/44	1,550,000.00	1,478,675.78	
		T 4.25% 05/15/39	850,000.00	999,546.87	
		T 4.25% 11/15/40	900,000.00	1,047,726.56	
		T 4.375% 02/15/38	500,000.00	599,609.37	
		T 4.375% 05/15/40	750,000.00	891,152.34	
		T 4.375% 05/15/41	550,000.00	649,687.50	
		T 4.375% 11/15/39	650,000.00	773,601.56	
		T 4.5% 02/15/36	600,000.00	723,937.50	
		T 4.5% 05/15/38	970,000.00	1,178,474.22	
		T 4.5% 08/15/39	750,000.00	908,144.53	
		T 4.625% 02/15/40	700,000.00	858,593.75	
		T 4.75% 02/15/41	750,000.00	931,699.22	
		T 5.0% 05/15/37	650,000.00	825,906.25	
		T 5.25% 11/15/28	900,000.00	1,022,765.62	

	T 5.375% 02/15/31	750,000.00	897,363.28	
	T 6.0% 02/15/26	600,000.00	661,570.31	
	T 6.125% 11/15/27	1,050,000.00	1,215,826.17	
	T 6.25% 05/15/30	720,000.00	893,756.25	
	T 6.25% 08/15/23	1,350,000.00	1,397,434.57	
アメリカドル 小計		624,860,000.00	584,761,141.52 (79,895,914,765)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	890,000.00	809,935.60	
	CAN 0.25% 04/01/24	990,000.00	945,212.40	
	CAN 0.25% 08/01/23	640,000.00	621,574.40	
	CAN 0.5% 09/01/25	1,330,000.00	1,233,867.60	
	CAN 0.5% 11/01/23	530,000.00	512,865.10	
	CAN 0.5% 12/01/30	2,320,000.00	1,917,294.40	
	CAN 0.75% 02/01/24	430,000.00	415,337.00	
	CAN 1.25% 03/01/25	500,000.00	478,155.00	
	CAN 1.25% 03/01/27	640,000.00	596,435.20	
	CAN 1.25% 06/01/30	1,940,000.00	1,725,649.40	
	CAN 1.5% 05/01/24	1,850,000.00	1,800,697.50	
	CAN 1.5% 06/01/26	840,000.00	798,193.20	
	CAN 1.5% 06/01/31	2,010,000.00	1,799,754.00	
	CAN 1.5% 09/01/24	660,000.00	639,850.20	
	CAN 1.5% 12/01/31	1,230,000.00	1,096,212.90	
	CAN 1.75% 12/01/53	1,270,000.00	989,660.20	
	CAN 1% 06/01/27	880,000.00	808,244.80	
	CAN 1% 09/01/26	1,220,000.00	1,132,770.00	
	CAN 2.25% 03/01/24	670,000.00	661,852.80	
	CAN 2.25% 06/01/25	670,000.00	657,270.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	390,000.00	376,802.40	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,780,000.00	1,763,517.20	
	CAN 2.75% 12/01/48	510,000.00	501,289.20	
	CAN 2.75% 12/01/64	350,000.00	343,703.50	
	CAN 2% 06/01/28	500,000.00	478,500.00	
	CAN 2% 06/01/32	1,190,000.00	1,105,533.80	
	CAN 2% 09/01/23	1,180,000.00	1,164,907.80	
	CAN 2% 12/01/51	2,510,000.00	2,099,389.10	
	CAN 3.5% 12/01/45	490,000.00	541,734.20	
	CAN 4.0% 06/01/41	490,000.00	567,322.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	960,000.00	1,135,536.00	
	CAN 5.75% 06/01/33	480,000.00	608,155.20	
	CAN 5% 06/01/37	390,000.00	487,254.30	
カナダドル 小計		32,730,000.00	30,814,476.40 (3,253,700,563)	

メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	6,940,480.00	
	MBONO 10% 12/05/24	20,780,000.00	20,998,190.00	
	MBONO 5.5% 03/04/27	2,240,000.00	1,944,835.20	
	MBONO 5.75% 03/05/26	20,860,000.00	18,722,684.40	
	MBONO 7.5% 06/03/27	21,620,000.00	20,416,198.40	
	MBONO 7.75% 05/29/31	17,390,000.00	16,229,391.40	
	MBONO 7.75% 11/13/42	13,980,000.00	12,243,264.60	
	MBONO 7.75% 11/23/34	4,970,000.00	4,548,146.40	
	MBONO 8.5% 05/31/29	20,740,000.00	20,332,044.20	
	MBONO 8.5% 11/18/38	12,980,000.00	12,343,720.40	
	MBONO 8% 09/05/24	18,940,000.00	18,380,701.80	
	MBONO 8% 11/07/47	14,310,000.00	12,805,875.90	
	MBONO 8% 12/07/23	13,220,000.00	12,939,603.80	
メキシコペソ 小計		188,430,000.00	178,845,136.50 (1,188,068,241)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	730,000.00	661,745.00	
	BGB 0.2% 10/22/23	640,000.00	638,809.60	
	BGB 0.35% 06/22/32	700,000.00	617,379.00	
	BGB 0.4% 06/22/40	400,000.00	295,148.00	
	BGB 0.5% 10/22/24	490,000.00	489,593.30	
	BGB 0.65% 06/22/71	300,000.00	162,630.00	
	BGB 0.8% 06/22/25	1,100,000.00	1,103,971.00	
	BGB 0.8% 06/22/27	750,000.00	743,865.00	
	BGB 0.8% 06/22/28	810,000.00	796,173.30	
	BGB 0.9% 06/22/29	1,280,000.00	1,251,494.40	
	BGB 0% 10/22/27	600,000.00	568,758.00	
	BGB 0% 10/22/31	730,000.00	634,749.60	
	BGB 1.25% 04/22/33	550,000.00	530,189.00	
	BGB 1.4% 06/22/53	380,000.00	300,610.40	
	BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	369,272.00	
	BGB 1.6% 06/22/47	640,000.00	555,961.60	
	BGB 1.7% 06/22/50	710,000.00	619,936.50	
	BGB 1.9% 06/22/38	510,000.00	498,621.90	
	BGB 1% 06/22/26	1,080,000.00	1,085,097.60	
	BGB 1% 06/22/31	910,000.00	874,801.20	
	BGB 2.15% 06/22/66	470,000.00	452,422.00	
	BGB 2.25% 06/22/57	380,000.00	373,897.20	
	BGB 2.6% 06/22/24	1,000,000.00	1,039,020.00	
	BGB 3.75% 06/22/45	580,000.00	731,090.00	
	BGB 3% 06/22/34	350,000.00	393,232.00	
	BGB 4.25% 03/28/41	1,110,000.00	1,449,371.40	
	BGB 4.5% 03/28/26	750,000.00	849,967.50	
	BGB 4% 03/28/32	620,000.00	759,047.40	

		BGB 5.5% 03/28/28	1,190,000.00	1,485,453.20	
		BGB 5% 03/28/35	1,270,000.00	1,714,754.00	
		BKO 0% 09/15/23	700,000.00	698,208.00	
		BKO 0% 12/15/23	1,250,000.00	1,246,587.50	
		BTPS 0.25% 03/15/28	1,250,000.00	1,088,875.00	
		BTPS 0.3% 08/15/23	1,100,000.00	1,091,431.00	
		BTPS 0.35% 02/01/25	900,000.00	866,124.00	
		BTPS 0.45% 02/15/29	1,510,000.00	1,291,729.50	
		BTPS 0.5% 02/01/26	1,500,000.00	1,413,885.00	
		BTPS 0.5% 07/15/28	730,000.00	639,523.80	
		BTPS 0.6% 08/01/31	1,500,000.00	1,195,635.00	
		BTPS 0.65% 10/15/23	1,130,000.00	1,123,016.60	
		BTPS 0.85% 01/15/27	1,100,000.00	1,026,520.00	
		BTPS 0.9% 04/01/31	1,300,000.00	1,076,634.00	
		BTPS 0.95% 03/01/37	600,000.00	432,240.00	
		BTPS 0.95% 06/01/32	880,000.00	708,602.40	
		BTPS 0.95% 08/01/30	1,330,000.00	1,127,707.00	
		BTPS 0.95% 09/15/27	1,000,000.00	922,210.00	
		BTPS 0.95% 12/01/31	1,120,000.00	914,894.40	
		BTPS 0% 01/15/24	300,000.00	294,264.00	
		BTPS 0% 04/01/26	2,700,000.00	2,483,676.00	
		BTPS 0% 04/15/24	980,000.00	955,950.80	
		BTPS 0% 08/01/26	1,330,000.00	1,209,874.40	
		BTPS 0% 08/15/24	1,610,000.00	1,556,548.00	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,170,000.00	1,115,829.00	
		BTPS 1.35% 04/01/30	750,000.00	665,257.50	
		BTPS 1.45% 03/01/36	1,130,000.00	894,971.30	
		BTPS 1.45% 05/15/25	1,070,000.00	1,052,847.90	
		BTPS 1.45% 11/15/24	1,520,000.00	1,507,019.20	
		BTPS 1.5% 04/30/45	710,000.00	495,090.10	
		BTPS 1.5% 06/01/25	1,500,000.00	1,478,310.00	
		BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,318,234.50	
		BTPS 1.65% 03/01/32	1,340,000.00	1,168,681.00	
		BTPS 1.65% 12/01/30	1,830,000.00	1,633,915.50	
		BTPS 1.7% 09/01/51	750,000.00	513,217.50	
		BTPS 1.75% 07/01/24	1,840,000.00	1,843,772.00	
		BTPS 1.8% 03/01/41	790,000.00	609,279.60	
		BTPS 1.85% 05/15/24	750,000.00	754,072.50	
		BTPS 1.85% 07/01/25	820,000.00	814,260.00	
		BTPS 2.05% 08/01/27	1,040,000.00	1,015,549.60	
		BTPS 2.1% 07/15/26	1,470,000.00	1,458,563.40	
		BTPS 2.15% 03/01/72	310,000.00	218,652.30	

		BTPS 2.15% 09/01/52	510,000.00	379,751.10	
		BTPS 2.2% 06/01/27	1,110,000.00	1,093,527.60	
		BTPS 2.25% 09/01/36	1,190,000.00	1,038,310.70	
		BTPS 2.45% 09/01/33	990,000.00	908,414.10	
		BTPS 2.45% 09/01/50	970,000.00	786,980.40	
		BTPS 2.45% 10/01/23	870,000.00	882,562.80	
		BTPS 2.5% 11/15/25	660,000.00	667,062.00	
		BTPS 2.5% 12/01/24	1,300,000.00	1,319,279.00	
		BTPS 2.7% 03/01/47	940,000.00	824,539.80	
		BTPS 2.8% 03/01/67	600,000.00	493,896.00	
		BTPS 2.8% 12/01/28	1,260,000.00	1,261,587.60	
		BTPS 2.95% 09/01/38	850,000.00	799,756.50	
		BTPS 2% 02/01/28	930,000.00	899,449.50	
		BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,045,170.00	
		BTPS 3.1% 03/01/40	670,000.00	637,565.30	
		BTPS 3.25% 09/01/46	980,000.00	949,188.80	
		BTPS 3.35% 03/01/35	1,100,000.00	1,095,083.00	
		BTPS 3.45% 03/01/48	1,120,000.00	1,112,384.00	
		BTPS 3.5% 03/01/30	1,950,000.00	2,026,264.50	
		BTPS 3.75% 09/01/24	1,040,000.00	1,084,200.00	
		BTPS 3.85% 09/01/49	840,000.00	885,906.00	
		BTPS 3% 08/01/29	1,210,000.00	1,217,405.20	
		BTPS 4.5% 03/01/24	1,130,000.00	1,186,059.30	
		BTPS 4.5% 03/01/26	930,000.00	1,005,906.60	
		BTPS 4.75% 08/01/23	1,610,000.00	1,670,423.30	
		BTPS 4.75% 09/01/28	1,810,000.00	2,007,452.90	
		BTPS 4.75% 09/01/44	1,180,000.00	1,406,406.60	
		BTPS 4% 02/01/37	1,800,000.00	1,925,550.00	
		BTPS 5.0% 08/01/39	1,440,000.00	1,724,616.00	
		BTPS 5.25% 11/01/29	1,770,000.00	2,049,394.50	
		BTPS 5.75% 02/01/33	1,320,000.00	1,610,096.40	
		BTPS 5% 03/01/25	1,290,000.00	1,391,432.70	
		BTPS 5% 08/01/34	1,260,000.00	1,467,446.40	
		BTPS 5% 09/01/40	1,600,000.00	1,924,944.00	
		BTPS 6.5% 11/01/27	2,070,000.00	2,483,296.20	
		BTPS 6% 05/01/31	1,600,000.00	1,961,024.00	
		BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	421,491.00	
		BTPS 9% 11/01/23	1,800,000.00	1,973,682.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	1,230,000.00	1,209,508.20	
		DBR 0.25% 02/15/29	1,160,000.00	1,120,432.40	
		DBR 0.25% 08/15/28	1,300,000.00	1,259,115.00	
		DBR 0.5% 02/15/25	2,090,000.00	2,093,657.50	
		DBR 0.5% 02/15/26	2,300,000.00	2,297,148.00	

		DBR 0.5% 02/15/28	1,510,000.00	1,489,735.80	
		DBR 0.5% 08/15/27	940,000.00	930,600.00	
		DBR 0% 02/15/30	1,660,000.00	1,559,586.60	
		DBR 0% 02/15/31	1,240,000.00	1,149,628.80	
		DBR 0% 02/15/32	1,230,000.00	1,121,145.00	
		DBR 0% 05/15/35	1,280,000.00	1,101,222.40	
		DBR 0% 05/15/36	1,320,000.00	1,118,211.60	
		DBR 0% 08/15/26	1,620,000.00	1,582,853.40	
		DBR 0% 08/15/29	2,430,000.00	2,296,082.70	
		DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,380,026.00	
		DBR 0% 08/15/31	2,310,000.00	2,125,223.10	
		DBR 0% 08/15/50	2,120,000.00	1,490,529.60	
		DBR 0% 08/15/52	1,140,000.00	778,164.00	
		DBR 0% 11/15/27	1,580,000.00	1,520,386.60	
		DBR 0% 11/15/28	1,510,000.00	1,438,259.90	
		DBR 1.25% 08/15/48	1,880,000.00	1,871,145.20	
		DBR 1.5% 05/15/24	1,020,000.00	1,041,420.00	
		DBR 1.75% 02/15/24	1,250,000.00	1,279,462.50	
		DBR 1% 05/15/38	220,000.00	211,926.00	
		DBR 1% 08/15/24	1,610,000.00	1,629,239.50	
		DBR 1% 08/15/25	1,880,000.00	1,909,572.40	
		DBR 2.5% 07/04/44	1,670,000.00	2,067,977.70	
		DBR 2.5% 08/15/46	1,830,000.00	2,299,742.70	
		DBR 2% 08/15/23	1,080,000.00	1,099,267.20	
		DBR 3.25% 07/04/42	1,160,000.00	1,569,050.80	
		DBR 4.0% 01/04/37	1,670,000.00	2,281,637.50	
		DBR 4.25% 07/04/39	1,090,000.00	1,585,579.40	
		DBR 4.75% 07/04/28	700,000.00	861,742.00	
		DBR 4.75% 07/04/34	1,440,000.00	2,032,819.20	
		DBR 4.75% 07/04/40	1,250,000.00	1,943,300.00	
		DBR 5.5% 01/04/31	1,640,000.00	2,256,984.40	
		DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	1,893,300.00	
		DBR 6.25% 01/04/24	1,370,000.00	1,490,984.70	
		DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	848,467.30	
		DBR 6.5% 07/04/27	1,270,000.00	1,627,428.80	
		FRTR 0.25% 11/25/26	2,050,000.00	1,990,119.50	
		FRTR 0.5% 05/25/25	3,160,000.00	3,139,997.20	
		FRTR 0.5% 05/25/26	2,930,000.00	2,890,034.80	
		FRTR 0.5% 05/25/29	2,830,000.00	2,698,942.70	
		FRTR 0.5% 05/25/40	1,260,000.00	968,410.80	
		FRTR 0.5% 05/25/72	390,000.00	201,392.10	
		FRTR 0.5% 06/25/44	790,000.00	565,031.70	

		FRTR 0.75% 02/25/28	980,000.00	959,331.80	
		FRTR 0.75% 05/25/28	2,960,000.00	2,898,136.00	
		FRTR 0.75% 05/25/52	1,930,000.00	1,330,078.80	
		FRTR 0.75% 05/25/53	920,000.00	619,923.60	
		FRTR 0.75% 11/25/28	2,990,000.00	2,917,253.30	
		FRTR 0% 02/25/24	1,850,000.00	1,838,548.50	
		FRTR 0% 02/25/26	2,220,000.00	2,156,041.80	
		FRTR 0% 02/25/27	2,320,000.00	2,219,520.80	
		FRTR 0% 03/25/24	2,240,000.00	2,225,932.80	
		FRTR 0% 03/25/25	3,280,000.00	3,217,122.40	
		FRTR 0% 05/25/32	1,990,000.00	1,712,753.20	
		FRTR 0% 11/25/29	2,760,000.00	2,516,623.20	
		FRTR 0% 11/25/30	3,330,000.00	2,969,261.10	
		FRTR 0% 11/25/31	2,460,000.00	2,146,891.20	
		FRTR 1.25% 05/25/34	2,400,000.00	2,269,704.00	
		FRTR 1.25% 05/25/36	2,660,000.00	2,458,824.20	
		FRTR 1.5% 05/25/31	3,230,000.00	3,261,395.60	
		FRTR 1.5% 05/25/50	1,960,000.00	1,690,578.40	
		FRTR 1.75% 05/25/66	850,000.00	745,458.50	
		FRTR 1.75% 06/25/39	1,910,000.00	1,859,824.30	
		FRTR 1.75% 11/25/24	2,020,000.00	2,072,661.40	
		FRTR 1% 05/25/27	2,180,000.00	2,180,021.80	
		FRTR 1% 11/25/25	2,240,000.00	2,255,433.60	
		FRTR 2.25% 05/25/24	2,290,000.00	2,363,463.20	
		FRTR 2.5% 05/25/30	2,900,000.00	3,167,032.00	
		FRTR 2.75% 10/25/27	3,280,000.00	3,565,983.20	
		FRTR 2% 05/25/48	1,890,000.00	1,831,258.80	
		FRTR 3.25% 05/25/45	1,800,000.00	2,162,970.00	
		FRTR 3.5% 04/25/26	3,120,000.00	3,423,638.40	
		FRTR 4.25% 10/25/23	2,870,000.00	3,006,985.10	
		FRTR 4.5% 04/25/41	2,340,000.00	3,207,157.20	
		FRTR 4.75% 04/25/35	1,340,000.00	1,792,062.40	
		FRTR 4% 04/25/55	1,070,000.00	1,496,041.90	
		FRTR 4% 04/25/60	1,080,000.00	1,543,784.40	
		FRTR 4% 10/25/38	1,600,000.00	2,049,680.00	
		FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	3,196,575.00	
		FRTR 5.75% 10/25/32	2,150,000.00	3,002,217.00	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	1,692,918.50	
		IRISH 0.2% 05/15/27	430,000.00	413,350.40	
		IRISH 0.2% 10/18/30	470,000.00	425,434.60	
		IRISH 0.35% 10/18/32	170,000.00	149,392.60	
		IRISH 0.4% 05/15/35	280,000.00	233,343.60	
		IRISH 0.55% 04/22/41	220,000.00	168,467.20	

		IRISH 0.9% 05/15/28	440,000.00	433,276.80	
		IRISH 0% 10/18/31	440,000.00	382,074.00	
		IRISH 1.1% 05/15/29	550,000.00	544,830.00	
		IRISH 1.3% 05/15/33	380,000.00	365,856.40	
		IRISH 1.35% 03/18/31	420,000.00	418,215.00	
		IRISH 1.5% 05/15/50	400,000.00	341,888.00	
		IRISH 1.7% 05/15/37	440,000.00	429,818.40	
		IRISH 1% 05/15/26	730,000.00	734,504.10	
		IRISH 2.4% 05/15/30	660,000.00	714,337.80	
		IRISH 2% 02/18/45	620,000.00	606,967.60	
		IRISH 3.4% 03/18/24	380,000.00	398,308.40	
		IRISH 5.4% 03/13/25	700,000.00	785,575.00	
		NETHER 0.25% 07/15/25	1,050,000.00	1,038,240.00	
		NETHER 0.25% 07/15/29	760,000.00	715,973.20	
		NETHER 0.5% 01/15/40	910,000.00	758,494.10	
		NETHER 0.5% 07/15/26	1,260,000.00	1,246,014.00	
		NETHER 0.5% 07/15/32	320,000.00	294,899.20	
		NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	892,980.00	
		NETHER 0.75% 07/15/28	1,090,000.00	1,072,658.10	
		NETHER 0% 01/15/24	1,080,000.00	1,075,107.60	
		NETHER 0% 01/15/26	640,000.00	623,641.60	
		NETHER 0% 01/15/27	750,000.00	721,260.00	
		NETHER 0% 01/15/29	450,000.00	418,747.50	
		NETHER 0% 01/15/38	530,000.00	414,820.40	
		NETHER 0% 01/15/52	740,000.00	465,563.60	
		NETHER 0% 07/15/30	850,000.00	775,200.00	
		NETHER 0% 07/15/31	700,000.00	628,138.00	
		NETHER 1.75% 07/15/23	820,000.00	831,758.80	
		NETHER 2.5% 01/15/33	920,000.00	1,020,510.00	
		NETHER 2.75% 01/15/47	1,210,000.00	1,498,706.00	
		NETHER 2% 07/15/24	1,110,000.00	1,143,533.10	
		NETHER 3.75% 01/15/42	1,150,000.00	1,567,634.00	
		NETHER 4% 01/15/37	1,070,000.00	1,405,487.80	
		NETHER 5.5% 01/15/28	650,000.00	806,481.00	
		OBL 0% 04/05/24	1,880,000.00	1,870,976.00	
		OBL 0% 04/10/26	1,500,000.00	1,470,195.00	
		OBL 0% 04/11/25	1,420,000.00	1,402,306.80	
		OBL 0% 04/16/27	1,100,000.00	1,065,691.00	
		OBL 0% 10/09/26	630,000.00	613,223.10	
		OBL 0% 10/10/25	2,770,000.00	2,729,031.70	
		OBL 0% 10/18/24	1,390,000.00	1,377,170.30	
		RAGB 0.25% 10/20/36	360,000.00	288,086.40	

		RAGB 0.5% 02/20/29	810,000.00	774,230.40	
		RAGB 0.5% 04/20/27	650,000.00	636,590.50	
		RAGB 0.7% 04/20/71	200,000.00	119,868.00	
		RAGB 0.75% 02/20/28	830,000.00	814,122.10	
		RAGB 0.75% 03/20/51	360,000.00	266,230.80	
		RAGB 0.75% 10/20/26	900,000.00	897,894.00	
		RAGB 0.85% 06/30/20	200,000.00	107,938.00	
		RAGB 0.9% 02/20/32	370,000.00	348,277.30	
		RAGB 0% 02/20/30	660,000.00	597,643.20	
		RAGB 0% 02/20/31	720,000.00	636,278.40	
		RAGB 0% 04/20/25	370,000.00	363,606.40	
		RAGB 0% 07/15/23	650,000.00	647,562.50	
		RAGB 0% 07/15/24	660,000.00	654,660.60	
		RAGB 0% 10/20/40	330,000.00	230,722.80	
		RAGB 1.2% 10/20/25	640,000.00	650,726.40	
		RAGB 1.5% 02/20/47	490,000.00	451,427.20	
		RAGB 1.5% 11/02/86	200,000.00	161,000.00	
		RAGB 1.65% 10/21/24	560,000.00	573,468.00	
		RAGB 1.75% 10/20/23	750,000.00	763,425.00	
		RAGB 1.85% 05/23/49	220,000.00	215,534.00	
		RAGB 2.1% 09/20/17	360,000.00	350,308.80	
		RAGB 2.4% 05/23/34	530,000.00	571,350.60	
		RAGB 3.15% 06/20/44	420,000.00	513,622.20	
		RAGB 3.8% 01/26/62	220,000.00	321,774.20	
		RAGB 4.15% 03/15/37	920,000.00	1,187,508.40	
		RAGB 4.85% 03/15/26	590,000.00	676,830.30	
		RAGB 6.25% 07/15/27	540,000.00	681,269.40	
		RFGB 0.125% 04/15/36	270,000.00	216,051.30	
		RFGB 0.125% 04/15/52	210,000.00	127,738.80	
		RFGB 0.125% 09/15/31	370,000.00	328,497.10	
		RFGB 0.25% 09/15/40	210,000.00	156,741.90	
		RFGB 0.5% 04/15/26	600,000.00	592,068.00	
		RFGB 0.5% 04/15/43	180,000.00	134,953.20	
		RFGB 0.5% 09/15/27	380,000.00	369,987.00	
		RFGB 0.5% 09/15/28	290,000.00	278,481.20	
		RFGB 0.5% 09/15/29	290,000.00	275,244.80	
		RFGB 0.75% 04/15/31	270,000.00	256,540.50	
		RFGB 0.875% 09/15/25	300,000.00	301,233.00	
		RFGB 0% 09/15/23	150,000.00	149,302.50	
		RFGB 0% 09/15/24	360,000.00	356,162.40	
		RFGB 0% 09/15/30	400,000.00	358,296.00	
		RFGB 1.125% 04/15/34	270,000.00	254,234.70	
		RFGB 1.375% 04/15/47	250,000.00	226,202.50	

		RFGB 1.5% 09/15/32	180,000.00	179,143.20	
		RFGB 2.625% 07/04/42	380,000.00	421,651.80	
		RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	415,712.40	
		RFGB 2% 04/15/24	310,000.00	318,835.00	
		RFGB 4% 07/04/25	320,000.00	351,446.40	
		SPGB 0.1% 04/30/31	1,570,000.00	1,331,155.90	
		SPGB 0.25% 07/30/24	1,000,000.00	988,680.00	
		SPGB 0.35% 07/30/23	640,000.00	638,208.00	
		SPGB 0.5% 04/30/30	1,780,000.00	1,610,116.80	
		SPGB 0.5% 10/31/31	1,180,000.00	1,024,275.40	
		SPGB 0.6% 10/31/29	1,200,000.00	1,105,584.00	
		SPGB 0.7% 04/30/32	1,140,000.00	995,550.60	
		SPGB 0.8% 07/30/27	590,000.00	571,049.20	
		SPGB 0.85% 07/30/37	640,000.00	504,659.20	
		SPGB 0% 01/31/25	1,040,000.00	1,014,915.20	
		SPGB 0% 01/31/26	1,070,000.00	1,023,765.30	
		SPGB 0% 01/31/27	800,000.00	750,008.00	
		SPGB 0% 01/31/28	1,080,000.00	991,429.20	
		SPGB 0% 05/31/24	1,480,000.00	1,458,984.00	
		SPGB 0% 05/31/25	120,000.00	116,254.80	
		SPGB 1.2% 10/31/40	950,000.00	750,395.50	
		SPGB 1.25% 10/31/30	1,200,000.00	1,140,036.00	
		SPGB 1.3% 10/31/26	1,460,000.00	1,460,379.60	
		SPGB 1.4% 04/30/28	1,920,000.00	1,901,587.20	
		SPGB 1.4% 07/30/28	780,000.00	770,702.40	
		SPGB 1.45% 04/30/29	750,000.00	737,895.00	
		SPGB 1.45% 10/31/27	1,330,000.00	1,326,448.90	
		SPGB 1.45% 10/31/71	260,000.00	158,532.40	
		SPGB 1.5% 04/30/27	1,460,000.00	1,466,000.60	
		SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,270,625.00	
		SPGB 1.85% 07/30/35	1,290,000.00	1,214,470.50	
		SPGB 1.9% 10/31/52	420,000.00	338,087.40	
		SPGB 1.95% 04/30/26	1,340,000.00	1,373,741.20	
		SPGB 1.95% 07/30/30	1,720,000.00	1,731,059.60	
		SPGB 1% 07/30/42	340,000.00	254,517.20	
		SPGB 1% 10/31/50	1,040,000.00	684,954.40	
		SPGB 2.15% 10/31/25	1,760,000.00	1,820,438.40	
		SPGB 2.35% 07/30/33	1,090,000.00	1,104,649.60	
		SPGB 2.55% 10/31/32	500,000.00	513,740.00	
		SPGB 2.7% 10/31/48	1,060,000.00	1,057,413.60	
		SPGB 2.75% 10/31/24	1,560,000.00	1,627,407.60	
		SPGB 2.9% 10/31/46	1,100,000.00	1,141,646.00	

		SPGB 3.45% 07/30/66	900,000.00	1,000,845.00	
		SPGB 3.8% 04/30/24	1,500,000.00	1,580,070.00	
		SPGB 4.2% 01/31/37	1,310,000.00	1,592,606.30	
		SPGB 4.4% 10/31/23	1,320,000.00	1,380,772.80	
		SPGB 4.65% 07/30/25	1,410,000.00	1,561,405.80	
		SPGB 4.7% 07/30/41	1,300,000.00	1,716,468.00	
		SPGB 4.8% 01/31/24	1,150,000.00	1,220,518.00	
		SPGB 4.9% 07/30/40	1,180,000.00	1,580,692.60	
		SPGB 5.15% 10/31/28	1,100,000.00	1,329,174.00	
		SPGB 5.15% 10/31/44	950,000.00	1,349,693.50	
		SPGB 5.75% 07/30/32	1,450,000.00	1,929,863.00	
		SPGB 5.9% 07/30/26	1,360,000.00	1,607,887.20	
		SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	2,985,510.50	
	ユーロ 小計		382,300,000.00	387,791,238.10 (53,965,028,693)	
	イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	780,000.00	738,738.00	
		UKT 0.125% 01/31/24	980,000.00	952,315.00	
		UKT 0.125% 01/31/28	1,320,000.00	1,210,888.80	
		UKT 0.25% 01/31/25	710,000.00	681,372.80	
		UKT 0.25% 07/31/31	1,890,000.00	1,631,032.20	
		UKT 0.375% 10/22/26	1,170,000.00	1,103,064.30	
		UKT 0.375% 10/22/30	1,090,000.00	969,718.50	
		UKT 0.5% 01/31/29	480,000.00	441,763.20	
		UKT 0.5% 10/22/61	730,000.00	393,959.10	
		UKT 0.625% 06/07/25	1,160,000.00	1,124,886.80	
		UKT 0.625% 07/31/35	1,390,000.00	1,122,647.40	
		UKT 0.625% 10/22/50	670,000.00	425,316.00	
		UKT 0.75% 07/22/23	860,000.00	849,740.20	
		UKT 0.875% 01/31/46	400,000.00	285,824.00	
		UKT 0.875% 07/31/33	580,000.00	510,719.00	
		UKT 0.875% 10/22/29	820,000.00	770,078.40	
		UKT 1.125% 01/31/39	500,000.00	409,525.00	
		UKT 1.125% 10/22/73	480,000.00	319,603.20	
		UKT 1.25% 07/22/27	740,000.00	724,282.40	
		UKT 1.25% 07/31/51	500,000.00	376,780.00	
		UKT 1.25% 10/22/41	1,440,000.00	1,171,296.00	
		UKT 1.5% 07/22/26	440,000.00	436,053.20	
		UKT 1.5% 07/22/47	1,010,000.00	824,856.90	
		UKT 1.5% 07/31/53	260,000.00	207,511.20	
		UKT 1.625% 10/22/28	480,000.00	477,984.00	
		UKT 1.625% 10/22/54	720,000.00	591,220.80	
		UKT 1.625% 10/22/71	710,000.00	576,058.50	
		UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	517,158.00	

	UKT 1.75% 07/22/57	1,050,000.00	895,377.00	
	UKT 1.75% 09/07/37	1,110,000.00	1,014,329.10	
	UKT 1% 04/22/24	1,450,000.00	1,429,555.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	1,160,000.00	1,163,236.40	
	UKT 2.5% 07/22/65	860,000.00	905,244.60	
	UKT 2.75% 09/07/24	980,000.00	998,698.40	
	UKT 2% 09/07/25	1,090,000.00	1,097,815.30	
	UKT 3.25% 01/22/44	1,240,000.00	1,392,296.80	
	UKT 3.5% 01/22/45	1,230,000.00	1,437,058.20	
	UKT 3.5% 07/22/68	910,000.00	1,215,223.10	
	UKT 3.75% 07/22/52	800,000.00	1,020,896.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	790,000.00	964,708.50	
	UKT 4.25% 06/07/32	1,070,000.00	1,292,185.50	
	UKT 4.25% 09/07/39	670,000.00	837,741.20	
	UKT 4.25% 12/07/27	750,000.00	843,442.50	
	UKT 4.25% 12/07/40	790,000.00	995,502.70	
	UKT 4.25% 12/07/46	910,000.00	1,197,105.00	
	UKT 4.25% 12/07/49	810,000.00	1,089,838.80	
	UKT 4.25% 12/07/55	990,000.00	1,407,255.30	
	UKT 4.5% 09/07/34	780,000.00	970,905.00	
	UKT 4.5% 12/07/42	1,120,000.00	1,476,294.40	
	UKT 4.75% 12/07/30	850,000.00	1,046,018.50	
	UKT 4.75% 12/07/38	880,000.00	1,155,202.40	
	UKT 4% 01/22/60	780,000.00	1,101,570.60	
	UKT 5% 03/07/25	600,000.00	648,912.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	570,000.00	715,754.70	
イギリスポンド 小計		47,150,000.00	48,156,559.90 (7,872,634,412)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	3,010,000.00	2,677,094.00	
	SGB 0.75% 05/12/28	3,590,000.00	3,429,562.90	
	SGB 0.75% 11/12/29	3,840,000.00	3,639,360.00	
	SGB 1.5% 11/13/23	6,100,000.00	6,082,310.00	
	SGB 1% 11/12/26	4,940,000.00	4,812,202.20	
	SGB 2.25% 06/01/32	2,560,000.00	2,751,564.80	
	SGB 2.5% 05/12/25	4,430,000.00	4,507,525.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	2,610,000.00	3,399,655.50	
スウェーデンクローナ 小計		31,080,000.00	31,299,274.40 (416,906,335)	
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	2,320,000.00	2,022,436.80	
	NGB 1.375% 08/19/30	3,280,000.00	2,941,471.20	
	NGB 1.5% 02/19/26	3,110,000.00	2,974,310.70	
	NGB 1.75% 02/17/27	2,790,000.00	2,669,193.00	

	NGB 1.75% 03/13/25	3,120,000.00	3,038,380.80	
	NGB 1.75% 09/06/29	2,470,000.00	2,303,077.40	
	NGB 2.125% 05/18/32	1,520,000.00	1,427,872.80	
	NGB 2% 04/26/28	2,510,000.00	2,405,734.60	
	NGB 3% 03/14/24	3,630,000.00	3,647,097.30	
ノルウェークローネ 小計		24,750,000.00	23,429,574.60 (321,219,467)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	2,920,000.00	1,966,152.80	
	DGB 0.5% 11/15/27	4,350,000.00	4,231,636.50	
	DGB 0.5% 11/15/29	5,650,000.00	5,380,664.50	
	DGB 0% 11/15/24	740,000.00	728,137.80	
	DGB 0% 11/15/31	3,170,000.00	2,808,588.30	
	DGB 1.5% 11/15/23	4,010,000.00	4,070,310.40	
	DGB 1.75% 11/15/25	2,610,000.00	2,693,467.80	
	DGB 4.5% 11/15/39	6,700,000.00	9,582,943.00	
デンマーククローネ 小計		30,150,000.00	31,461,901.10 (588,337,550)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,430,000.00	1,119,475.50	
	POLGB 0.75% 04/25/25	720,000.00	620,373.60	
	POLGB 0% 07/25/24	300,000.00	262,755.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	1,760,000.00	1,248,931.20	
	POLGB 1.75% 04/25/32	900,000.00	630,360.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	2,470,000.00	2,246,465.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	1,880,000.00	1,753,682.80	
	POLGB 2.5% 07/25/26	3,600,000.00	3,132,072.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	2,010,000.00	1,702,329.30	
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,190,000.00	1,857,908.40	
	POLGB 2.75% 10/25/29	3,410,000.00	2,797,257.10	
	POLGB 3.25% 07/25/25	2,470,000.00	2,264,249.00	
	POLGB 4% 10/25/23	1,890,000.00	1,829,217.60	
	POLGB 5.75% 04/25/29	900,000.00	892,728.00	
ポーランドズロチ 小計		25,930,000.00	22,357,804.50 (656,246,277)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	1,520,000.00	1,432,615.20	
	ACGB 0.25% 11/21/25	1,340,000.00	1,223,004.60	
	ACGB 0.5% 09/21/26	780,000.00	701,906.40	
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,140,000.00	944,706.60	
	ACGB 1.5% 06/21/31	1,190,000.00	1,026,517.80	
	ACGB 1.75% 06/21/51	990,000.00	670,675.50	
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,380,000.00	1,191,009.00	
	ACGB 1% 11/21/31	1,810,000.00	1,478,426.10	
	ACGB 1% 12/21/30	1,480,000.00	1,233,698.40	
	ACGB 2.25% 05/21/28	630,000.00	599,778.90	

	ACGB 2.5% 05/21/30	1,320,000.00	1,252,587.60	
	ACGB 2.75% 04/21/24	680,000.00	681,407.60	
	ACGB 2.75% 05/21/41	810,000.00	719,895.60	
	ACGB 2.75% 06/21/35	630,000.00	585,774.00	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,160,000.00	1,138,400.80	
	ACGB 2.75% 11/21/28	770,000.00	751,458.40	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,230,000.00	1,192,509.60	
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,250,000.00	1,259,687.50	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,180,000.00	1,184,012.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	650,000.00	626,892.50	
	ACGB 3.75% 04/21/37	660,000.00	681,529.20	
	ACGB 3% 03/21/47	730,000.00	662,569.90	
	ACGB 3% 11/21/33	810,000.00	782,314.20	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,200,000.00	1,250,040.00	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,040,000.00	1,148,149.60	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,080,000.00	1,158,073.20	
オーストラリアドル 小計		27,460,000.00	25,577,640.20 (2,405,832,837)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	210,000.00	195,323.10	
	SIGB 1.25% 11/01/26	90,000.00	84,690.90	
	SIGB 1.625% 07/01/31	200,000.00	181,936.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	390,000.00	310,814.40	
	SIGB 1.875% 10/01/51	150,000.00	120,385.50	
	SIGB 2.125% 06/01/26	670,000.00	655,199.70	
	SIGB 2.25% 08/01/36	440,000.00	409,666.40	
	SIGB 2.375% 06/01/25	610,000.00	603,686.50	
	SIGB 2.375% 07/01/39	230,000.00	214,157.60	
	SIGB 2.625% 05/01/28	280,000.00	278,742.80	
	SIGB 2.75% 03/01/46	420,000.00	402,985.80	
	SIGB 2.75% 04/01/42	300,000.00	291,312.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	540,000.00	539,465.40	
	SIGB 2.875% 07/01/29	560,000.00	564,855.20	
	SIGB 2.875% 09/01/30	460,000.00	463,992.80	
	SIGB 2% 02/01/24	270,000.00	266,635.80	
	SIGB 3.375% 09/01/33	420,000.00	442,226.40	
	SIGB 3.5% 03/01/27	530,000.00	547,786.80	
	SIGB 3% 09/01/24	510,000.00	512,009.40	
シンガポールドル 小計		7,280,000.00	7,085,872.50 (696,612,125)	
マレーシアリンギット	MGS 3.478% 06/14/24	200,000.00	200,670.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	920,000.00	908,012.40	
	MGS 3.733% 06/15/28	560,000.00	554,663.20	
	MGS 3.757% 05/22/40	1,110,000.00	999,122.10	

	MGS 3.8% 08/17/23	550,000.00	554,702.50	
	MGS 3.828% 07/05/34	250,000.00	238,487.50	
	MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	833,813.00	
	MGS 3.882% 03/14/25	690,000.00	696,285.90	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,890,000.00	1,873,216.80	
	MGS 3.892% 03/15/27	300,000.00	301,083.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,960,000.00	1,972,054.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	1,140,000.00	1,148,219.40	
	MGS 3.906% 07/15/26	750,000.00	754,912.50	
	MGS 3.955% 09/15/25	1,030,000.00	1,040,351.50	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,060,000.00	1,075,317.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	740,000.00	667,835.20	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,180,000.00	1,198,502.40	
	MGS 4.232% 06/30/31	850,000.00	856,324.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,270,000.00	1,251,140.50	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,160,000.00	1,188,048.80	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,260,000.00	1,296,162.00	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,160,000.00	1,198,767.20	
	MGS 4.736% 03/15/46	640,000.00	638,662.40	
	MGS 4.762% 04/07/37	1,160,000.00	1,213,986.40	
	MGS 4.893% 06/08/38	1,240,000.00	1,282,445.20	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,450,000.00	1,482,146.50	
	MGS 4.935% 09/30/43	530,000.00	546,202.10	
マレーシアリンギット 小計		25,910,000.00	25,971,133.50 (796,669,714)	
イスラエルシェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	1,700,000.00	1,672,654.99	
	ILGOV 0.5% 02/27/26	490,000.00	459,206.58	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	660,000.00	628,576.21	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	250,000.00	222,492.85	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	930,000.00	772,913.42	
	ILGOV 1.5% 11/30/23	720,000.00	716,321.01	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,040,000.00	1,022,750.56	
	ILGOV 1% 03/31/30	1,570,000.00	1,408,732.58	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	1,070,000.00	1,060,990.70	
	ILGOV 2% 03/31/27	1,240,000.00	1,220,226.71	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	1,560,000.00	1,601,343.43	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	1,520,000.00	1,656,605.74	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,130,000.00	1,539,331.31	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,550,000.00	1,793,087.74	
イスラエルシェケル 小計		15,430,000.00	15,775,233.83 (626,551,272)	
オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	14,410,000.00	14,266,764.60	

		CGB 2.28% 03/17/24	5,100,000.00	5,110,302.00	
		CGB 2.47% 09/02/24	9,290,000.00	9,332,641.10	
		CGB 2.48% 04/15/27	13,270,000.00	13,236,161.50	
		CGB 2.56% 10/21/23	14,620,000.00	14,711,667.40	
		CGB 2.68% 05/21/30	6,850,000.00	6,785,747.00	
		CGB 2.69% 08/12/26	8,220,000.00	8,279,266.20	
		CGB 2.8% 03/24/29	3,270,000.00	3,280,169.70	
		CGB 2.84% 04/08/24	16,020,000.00	16,203,589.20	
		CGB 2.85% 06/04/27	6,010,000.00	6,089,933.00	
		CGB 2.89% 11/18/31	6,850,000.00	6,888,428.50	
		CGB 2.91% 10/14/28	14,300,000.00	14,471,028.00	
		CGB 3.01% 05/13/28	3,750,000.00	3,822,450.00	
		CGB 3.02% 05/27/31	7,400,000.00	7,516,328.00	
		CGB 3.03% 03/11/26	15,210,000.00	15,515,112.60	
		CGB 3.27% 11/19/30	3,430,000.00	3,550,461.60	
		CGB 3.28% 12/03/27	6,710,000.00	6,947,466.90	
		CGB 3.39% 03/16/50	2,760,000.00	2,793,782.40	
		CGB 3.53% 10/18/51	1,390,000.00	1,448,671.90	
		CGB 3.72% 04/12/51	3,150,000.00	3,378,721.50	
		CGB 3.81% 09/14/50	6,730,000.00	7,322,509.20	
		CGB 3.86% 07/22/49	2,890,000.00	3,164,983.50	
		CGB 4.08% 10/22/48	2,030,000.00	2,298,264.50	
	オフショア人民元 小計		173,660,000.00	176,414,450.30 (3,562,989,728)	
合計				156,246,711,979 (156,246,711,979)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券　197銘柄	100.0%	51.1%
カナダドル	国債証券　33銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券　13銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券　338銘柄	100.0%	34.5%
イギリスポンド	国債証券　54銘柄	100.0%	5.0%
スウェーデンクローナ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券　9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.4%

ポーランドズロチ	国債証券　14銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券　26銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	国債証券　19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券　27銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券　14銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券　23銘柄	100.0%	2.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【インデックスコレクション（バランス株式３０）】

【純資産額計算書】

（2022年 8月31日現在）

Ⅰ　資産総額	139,168,311,703円
Ⅱ　負債総額	27,814,745円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	139,140,496,958円
Ⅳ　発行済口数	80,531,382,674口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7278円
（1万口当たり純資産額）	（17,278円）

【インデックスコレクション（バランス株式５０）】

【純資産額計算書】

（2022年 8月31日現在）

Ⅰ　資産総額	22,592,302,677円
Ⅱ　負債総額	7,943,682円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	22,584,358,995円
Ⅳ　発行済口数	10,092,332,249口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2378円
（1万口当たり純資産額）	（22,378円）

【インデックスコレクション（バランス株式７０）】

【純資産額計算書】

（2022年 8月31日現在）

Ⅰ　資産総額	15,417,611,169円
Ⅱ　負債総額	21,778,647円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	15,395,832,522円
Ⅳ　発行済口数	5,513,769,521口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7923円
（1万口当たり純資産額）	（27,923円）

（参考）

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 8月31日現在）

Ⅰ　資産総額	**304,753,995,657円**
Ⅱ　負債総額	**87,764,422円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**304,666,231,235円**
Ⅳ　発行済口数	**135,276,250,663口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.2522円**
（1万口当たり純資産額）	**（22,522円）**

日本債券マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 8月31日現在）

Ⅰ　資産総額	**398,970,815,553円**
Ⅱ　負債総額	**10,735,001,553円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**388,235,814,000円**
Ⅳ　発行済口数	**288,860,547,367口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.3440円**
（1万口当たり純資産額）	**（13,440円）**

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 8月31日現在）

Ⅰ　資産総額	**347,345,249,899円**
Ⅱ　負債総額	**661,197,366円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**346,684,052,533円**
Ⅳ　発行済口数	**74,895,844,307口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**4.6289円**
（1万口当たり純資産額）	**（46,289円）**

外国債券マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 8月31日現在）

Ⅰ　資産総額	156,946,873,349円
Ⅱ　負債総額	85,250,472円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	156,861,622,877円
Ⅳ　発行済口数	57,572,512,528口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7246円
（1万口当たり純資産額）	（27,246円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

②受益権の譲渡

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

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

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

③受益権の譲渡の対抗要件

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

④受益権の再分割

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

⑤償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原

則として取得申込者とします。）に支払います。

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第二部【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（2022年 8月31日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

会社に取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。
取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。
また、監査等委員以外の取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席し、その議決権の３分の２以上をもって行います。
取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。
監査等委員である取締役の任期は、選任後２年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。
取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長１名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。
取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。
取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。
取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

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

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

［DO（実行）］

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

［CHECK（検証・評価）］

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

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

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

委託会社の機構は2022年10月25日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2022年8月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	539	14,041,250
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	70	221,703
単位型公社債投資信託	51	216,636
合計	660	14,479,589

3【委託会社等の経理状況】

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

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

		前事業年度 （2021年3月31日）		当事業年度 （2022年3月31日）
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		21,589		21,675
金銭の信託		10,857		14,913
前払費用		397		166
未収委託者報酬		8,471		9,067
未収運用受託報酬		6,151		6,252
未収収益		177		179
その他		3,428		4,891
流動資産合計		51,072		57,146
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	301	※1	289
器具備品	※1	692	※1	687
その他	※1	0	※1	－
有形固定資産合計		993		976
無形固定資産				
ソフトウェア		4,104		6,292
その他		41		31
無形固定資産合計		4,145		6,324
投資その他の資産				
投資有価証券		9,950		6,607
関係会社株式		5,636		5,636
繰延税金資産		311		907
その他		39		31
投資その他の資産合計		15,937		13,182
固定資産合計		21,077		20,482
資産合計		72,149		77,629

（単位：百万円）

	前事業年度 （2021年3月31日）	当事業年度 （2022年3月31日）
負債の部		
流動負債		
預り金	44	47
未払金	7,572	8,285
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,154	4,561
その他未払金	3,417	3,723
未払費用	1,046	1,049
未払法人税等	517	504
賞与引当金	556	578
その他	818	1,958
流動負債合計	10,555	12,423
固定負債		
退職給付引当金	626	820
資産除去債務	133	153
その他	8	12
固定負債合計	768	986
負債合計	11,324	13,410
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	38,258	41,948
利益剰余金合計	40,858	44,548
株主資本合計	60,098	63,788
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	791	941
繰延ヘッジ損益	△65	△509
評価・換算差額等合計	726	431
純資産合計	60,824	64,219
負債・純資産合計	72,149	77,629

（2）【損益計算書】

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）	当事業年度 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	37,224	41,730
運用受託報酬	10,982	11,883
その他営業収益	403	390
営業収益合計	48,611	54,004
営業費用		
支払手数料	17,936	20,567
広告宣伝費	203	286
調査費	5,064	5,567
調査費	898	1,062
委託調査費	4,154	4,487
図書費	11	17
営業雑経費	4,492	5,201
通信費	56	68
印刷費	449	454
協会費	58	55
諸会費	18	35
情報機器関連費	3,815	4,473
その他営業雑経費	93	112
営業費用合計	27,696	31,622
一般管理費		
給料	5,976	6,295
役員報酬	214	249
給料・手当	4,861	5,072
賞与	901	972
退職給付費用	170	254
福利費	608	632
交際費	1	3
旅費交通費	13	20
租税公課	315	327
不動産賃借料	276	323
寄付金	3	5
減価償却費	748	989
業務委託費	966	1,081
諸経費	848	1,301
一般管理費合計	9,929	11,234
営業利益	10,984	11,147

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）	当事業年度 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）

営業外収益		
受取利息	2	2
収益分配金	101	16
金銭の信託運用益	3,038	－
投資有価証券売却益	1	0
投資有価証券償還益	54	219
その他	45	8
営業外収益合計	3,243	247
営業外費用		
金銭の信託運用損	－	332
投資有価証券売却損	0	0
投資有価証券償還損	0	－
為替差損	158	291
デリバティブ費用	3,782	1,191
その他	5	33
営業外費用合計	3,946	1,848
経常利益	10,281	9,545
特別損失		
退職給付費用	－	120
システム統合費用	110	－
特別損失合計	110	120
税引前当期純利益	10,170	9,425
法人税、住民税及び事業税	3,242	3,403
法人税等調整額	△65	△465
法人税等合計	3,177	2,937
当期純利益	6,993	6,487

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本			
	利益剰余金			株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金	

当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
剰余金の配当	194		△3,857	△3,662	△3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	－	3,136	3,330	3,330
当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	△587	284	△302	56,464
当期変動額				
剰余金の配当				△3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,379	△349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	△349	1,029	4,360
当期末残高	791	△65	726	60,824

当事業年度（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			△2,797	△2,797	△2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	－	－	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	

当期首残高	791	△65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				△2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	149	△444	△295	△295
当期変動額合計	149	△444	△295	3,394
当期末残高	941	△509	431	64,219

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

２．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

３．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

４．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

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

５．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

６．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

（2）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用　　：発生事業年度に損益処理

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

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

７．収益及び費用の計上基準

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

（1）投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応

じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

（2）投資一任業務

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

（3）投資助言業務

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

（4）成功報酬

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

８．ヘッジ会計の会計処理

（1）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

（2）ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

（3）ヘッジ方針

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

（4）ヘッジ有効性評価の方法

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

９．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号　2021年8月21日）を適用する予定であります。

（会計方針の変更）

１．「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　2020年3月31日）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

２．「時価の算定に関する会計基準」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　2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号　2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号　2019年7月4日）第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載しておりません。

（未適用の会計基準等）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号　2021年6月17日）

(1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

(2) 適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

（追加情報）

退職給付債務及び費用の算定方法の変更

従来、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る事業年度末の自己都合要支給額を退職給付とする方法を用いた簡便法を適用しておりましたが、対象となる従業員数の増加に伴い、当事業年度より原則法による計算を併用しております。これにより、退職給付引当金が120百万円増加し、同額を退職給付費用として特別損失に計上しております。

なお、退職給付見込額の各期間への帰属方法などについては、「重要な会計方針６．引当金の計上基準（2）退職給付引当金」をご参照ください。

（貸借対照表関係）

※1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （2021年3月31日）		当事業年度 （2022年3月31日）	
建　　物	106	百万円	146	百万円
器具備品	391	〃	535	〃
そ の 他	4	〃	―	〃
計	503	〃	681	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2020年4月1日　至 2021年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	―	―	3,000

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 2021年4月1日　至 2022年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	－	－	3,000

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

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

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

2022年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	利益剰余金	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。

これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針８．ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

２.金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31 号 2019年7月4日。以下、「時価算定適用指針」という。）第26 項に従い経過措置を適用した投資信託、市場価格のない株式等及び、時価算定適用指針第27項に従い経過措置を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）*2、*3及び（注2）参照）。

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

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

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

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

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

（１）時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）（*1）
金銭の信託	10,857
投資有価証券	
その他有価証券	9,950
デリバティブ取引（*2）	
ヘッジ会計が適用されていないもの	(357)
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)
デリバティブ取引計	(431)

(*1) 負債に計上されているものについては、（　　）で示しております。
(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2022年3月31日）

区　分	貸借対照表計上額（百万円）(*1、*2)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*3)	－	196	－	196
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(1,333)	(80)	－	(1,413)
ヘッジ会計が適用されているもの	－	(71)	－	(71)
デリバティブ取引計	(1,333)	(151)	－	(1,485)

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
(*2) 投資有価証券のうち、投資信託（貸借対照表計上額6,474百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額133百万円）は上記に含めておりません。
(*3) 金銭の信託の信託財産のうち、投資信託（貸借対照表計上額13,876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額840百万円）は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,913百万円であります。
(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

（２）時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位:百万円）

区分	前事業年度 （2021年3月31日）	当事業年度 （2022年3月31日）
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

（注3） 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2021年3月31日）　　（単位:百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,589	－	－	－
未収委託者報酬	8,471	－	－	－
未収運用受託報酬	6,151	－	－	－
投資有価証券 投資信託	－	10	5,751	0

当事業年度（2022年3月31日）　　（単位:百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,675	－	－	－
未収委託者報酬	9,067	－	－	－
未収運用受託報酬	6,252	－	－	－
投資有価証券				
投資信託	－	108	1,712	0

（有価証券関係）

１．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位:百万円）

区分	前事業年度 （2021年3月31日）	当事業年度 （2022年3月31日）
子会社株式	5,636	5,636

２．その他有価証券

前事業年度（2021年3月31日）　　（単位:百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9	10	△1
小計	9	10	△1
合計	9,950	8,809	1,141

当事業年度（2022年3月31日）　　（単位：百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,585	1,711	△126
小計	1,585	1,711	△126
合計	6,474	5,115	1,358

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりません。

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位:百万円）

区分	前事業年度 （2021年3月31日）	当事業年度 （2022年3月31日）
非上場株式	0	0
組合出資金等	―	133

３．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）　（単位:百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	109	1	0

当事業年度（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日）　（単位:百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2021年3月31日）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	2,889	―	△41	△41
	英ポンド	128	―	△0	△0
	カナダドル	21	―	△0	△0
	スイスフラン	51	―	0	0
	香港ドル	128	―	△1	△1
	ユーロ	246	―	0	0
	買建				
	米ドル	99	―	1	1
	香港ドル	2	―	0	0
合計		3,567	―	△41	△41

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

（2）株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	13,711	―	△315	△315
合計		13,711	―	△315	△315

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等（百万円）	契約額等のうち1年超（百万円）	時価（百万円）
原則的処理方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	投資有価証券関係会社株式	3,993	－	△57
	英ポンド		3,108	－	△15
	カナダドル		3	－	△0
	スイスフラン		57	－	0
	香港ドル		110	－	△1
	ユーロ		108	－	0
	人民元		6	－	△0
	買建				
	米ドル		38	－	0
	香港ドル		3	－	0
	人民元		1	－	0
合計			7,431	－	△73

当事業年度（2022年3月31日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち1年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	5,498	－	△54	△54
	英ポンド	277	－	△1	△1
	カナダドル	111	－	△1	△1
	スイスフラン	139	－	△2	△2
	香港ドル	190	－	△1	△1
	ユーロ	676	－	△18	△18
	買建				
	ユーロ	21	－	0	0
合計		6,915	－	△80	△80

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

（2）株式関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち1年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	17,197	－	△1,333	△1,333
合計		17,197	－	△1,333	△1,333

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等（百万円）	契約額等のうち1年超（百万円）	時価（百万円）

原則的処理方法	為替予約取引 売建 米ドル	投資有価証券 関係会社株式	4,422	―	△43
	英ポンド		3,297	―	△21
	スイスフラン		79	―	△1
	香港ドル		119	―	△1
	ユーロ		125	―	△3
	人民元		13	―	△0
合計			8,057	―	△71

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。当社が有する退職一時金制度は従来簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しておりましたが、当事業年度より原則法と簡便法の併用により、これら計算を行っております。

2．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）	当事業年度 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）
退職給付債務の期首残高	600	626
勤務費用	―	124
利息費用	―	2
転籍者受入	18	―
退職給付の支払額	△69	△81
簡便法で計算した退職給付費用	77	8
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	―	120
その他	―	18
退職給付債務の期末残高	626	820

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）	当事業年度 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	626	820
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626	820
退職給付引当金	626	820
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626	820

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）	当事業年度 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）
勤務費用	―	124
利息費用	―	2
簡便法で計算した退職給付費用	77	8

簡便法から原則法への変更に伴う振替額	―	120
その他	―	18
確定給付制度に係る退職給付費用	77	274

(5) 年金資産に関する事項
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）	当事業年度 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）
割引率	―	0.4%

3．確定拠出制度
当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度92百万円、当事業年度100百万円であります。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 （2021年3月31日）		当事業年度 （2022年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	107	百万円	112	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	170	〃	177	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	191	〃	251	〃
税務上の収益認識差額	71	〃	74	〃
税務上の費用認識差額	―		439	
繰延ヘッジ損益	28	〃	224	〃
その他	123	〃	76	〃
繰延税金資産 合計	693	〃	1,357	〃
繰延税金負債				
有価証券評価差額	△349	〃	△415	〃
その他	△32	〃	△34	〃
繰延税金負債 合計	△382	〃	△450	〃
繰延税金資産の純額	311	〃	907	〃

2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（収益認識関係）

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

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

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

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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

［関連情報］

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2020年4月1日　至 2021年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,372百万円

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

当事業年度（自 2021年4月1日　至 2022年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,395百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395百万円

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

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）

１．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,365	未収運用受託報酬	5,402
							投信販売代行手数料等	9,124	未払手数料	1,888

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 運用受託報酬

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

② 投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 運用受託報酬

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

② 投信販売代行手数料等

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

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2021年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2022年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

	前事業年度 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	当事業年度 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1株当たり純資産額	20,274,967円09銭	21,406,512円22銭
1株当たり当期純利益金額	2,331,221円85銭	2,162,405円20銭

（注）１．潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
２．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）	当事業年度 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）
当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株主に帰属しない金額	－	－
普通株式に係る当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

４【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2022年10月25日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2022年3月末日現在）

③事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2022年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

２【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

３【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

①名称　　：株式会社日本カストディ銀行

②設立年月日　：2000年6月20日

③資本金の額　：51,000百万円（2022年3月末日現在）

④事業の内容　：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2021年10月26日	有価証券届出書
2021年10月26日	有価証券報告書
2022年 4月26日	有価証券届出書
2022年 4月26日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2022年６月２日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　三　上　和　彦
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　藤　澤　　孝

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

　当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任
　監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年10月5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　後藤知弘　　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式３０）の2021年7月27日から2022年7月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスコレクション（バランス株式３０）の2022年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の監査報告書

2022年10月5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　後藤知弘　　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式５０）の2021年7月27日から2022年7月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスコレクション（バランス株式５０）の2022年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の監査報告書

2022年10月5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　後藤知弘　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式７０）の2021年7月27日から2022年7月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスコレクション（バランス株式７０）の2022年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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