

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年4月25日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	上坪 直樹
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	インデックスコレクション（バランス株式30） インデックスコレクション（バランス株式50） インデックスコレクション（バランス株式70）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	インデックスコレクション（バランス株式30） 10兆円を上限とします。 インデックスコレクション（バランス株式50） 10兆円を上限とします。 インデックスコレクション（バランス株式70） 10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

インデックスコレクション（バランス株式３０）

インデックスコレクション（バランス株式５０）

インデックスコレクション（バランス株式７０）

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

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて、10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

**( 7 ) 【申込期間】**

2023年 4月26日から2023年10月25日までとします。

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

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

**( 9 ) 【払込期日】**

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

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

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

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**( 12 ) 【その他】**

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

当ファンドは「分配金再投資コース」（自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）専用ファンドです。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所での有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場での有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受け付けを中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取り消すことができます。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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。

## &lt;信託金限度額&gt;

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。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

#### < 商品分類表定義 >

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
- (2) 追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

## [ 独立した区分 ]

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

## [ 補足分類 ]

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

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

資産配分固定型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

資産配分変更型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

## [ 決算頻度による属性区分 ]

(1)年1回...目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

(4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とす



る旨の記載があるものをいう。

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

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

#### [ 特殊型 ]

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

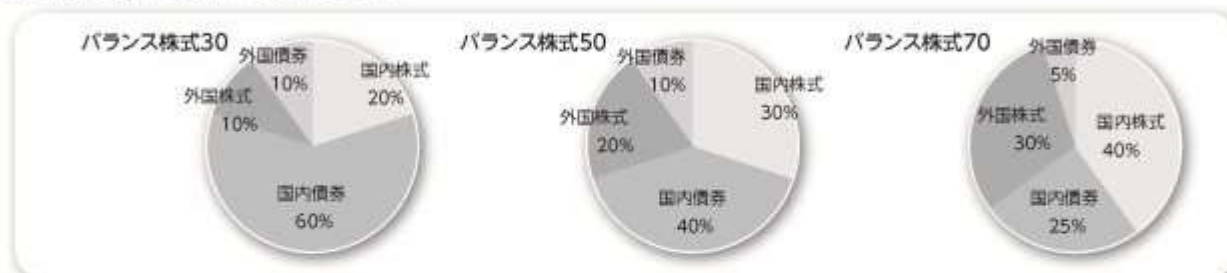
#### < ファンドの特色 >

## 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旨とする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

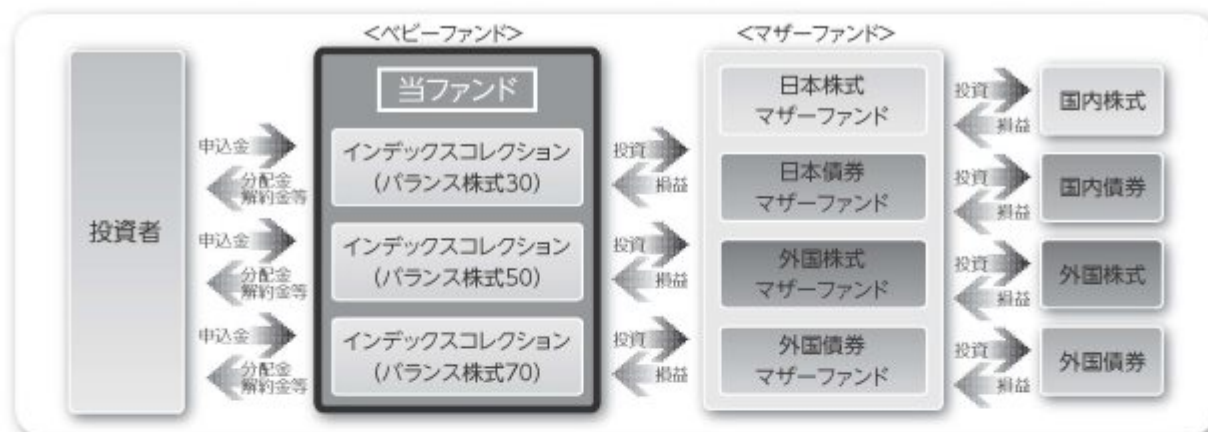
ファンドマネジャーは各ファンドの基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※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商標又は商標は、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商標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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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いません。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】

当ファンドの仕組み及び関係法人



#### 委託会社の概況（2023年 2月28日現在）

イ．資本金の額：20億円

#### ロ．委託会社の沿革

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

#### ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### 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。

### 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】

### 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せん。）



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

4．約束手形（上記1．に掲げるものに該当するものを除きます。）

B．次に掲げる特定資産以外の資産

1．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「日本株式マザーファンド」、「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券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6．資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証券

9．資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10．コマーシャル・ペーパー

11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券

12．外国又は外国の者の発行する証券又は証券で、上記1．から11．までの証券又は証券の性質を有するもの

13．投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。）

14．投資証券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16．オプションを表示する証券又は証券（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）

17．預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

18．外国法人が発行する譲渡性預金証券

19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）

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

運用指図できる金融商品

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

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

1. 預金
  2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
  3. コール・ローン
  4. 手形割引市場において売買される手形
  5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  6. 外国の者に対する権利で上記5.の権利の性質を有するもの
- B. 金融商品による運用の特例
- 上記の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記A.に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考) マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

株式への投資は、原則として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。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

### 3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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



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

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「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

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。

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

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

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

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

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

### 3. 投資制限

株式への投資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、）を行使したものに限り、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

外貨建資産への投資は、行いません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「外国株式マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

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

### 3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の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。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

## 「外国債券マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

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

### 3. 投資制限

株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（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。

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

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

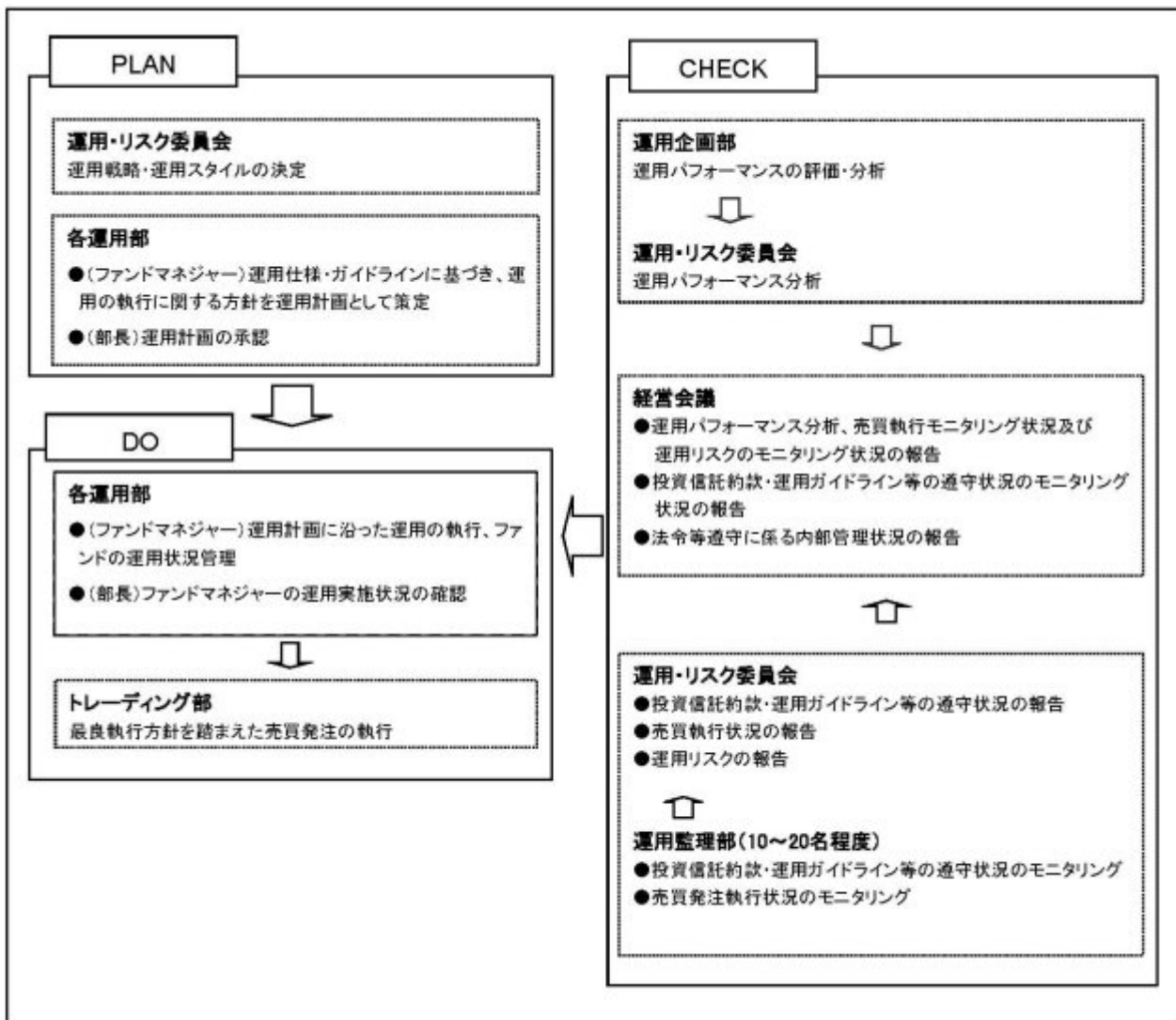
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

### （3）【運用体制】

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



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

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

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

#### （４）【分配方針】

年1回の毎決算時（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>

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

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

## I．信用取引の指図範囲

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

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。
- 二．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。
- 二．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。
- 二．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。

二．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、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

#### 為替変動リスク

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

#### 金利変動リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 流動性リスク

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

#### カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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

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

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

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。

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

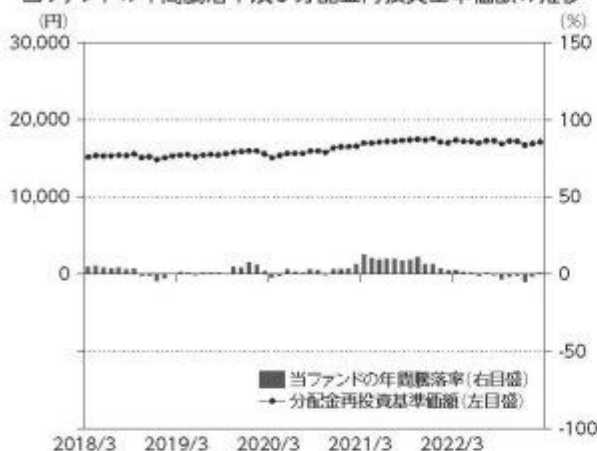
委託会社におけるリスク管理体制

- ・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。

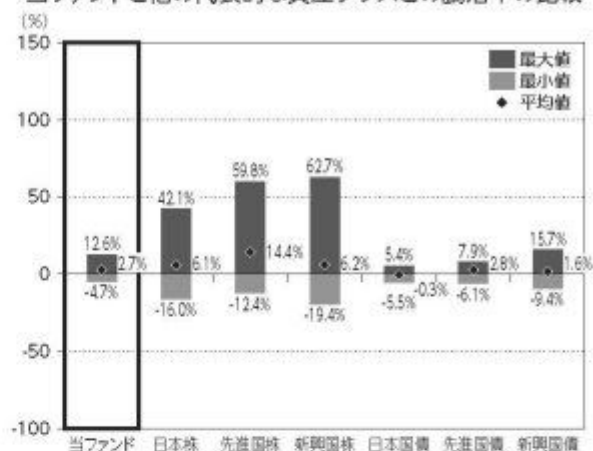
## 【参考情報】

### 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

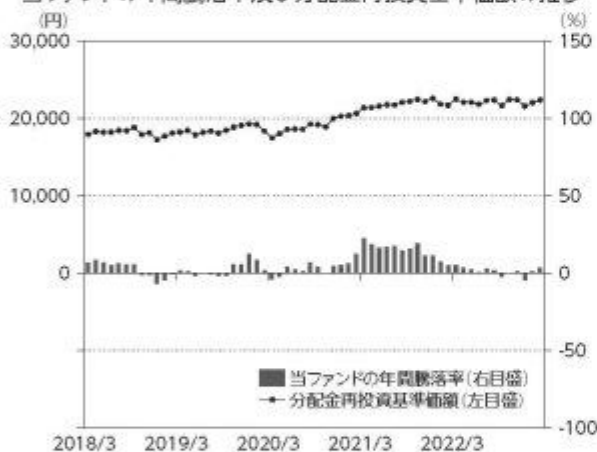


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

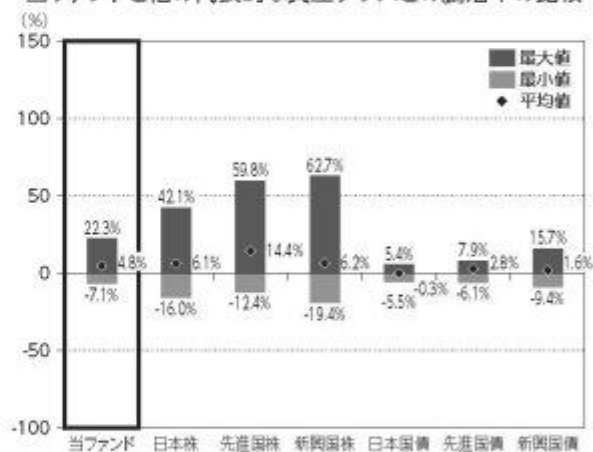


### インデックスコレクション(バランス株式50)

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

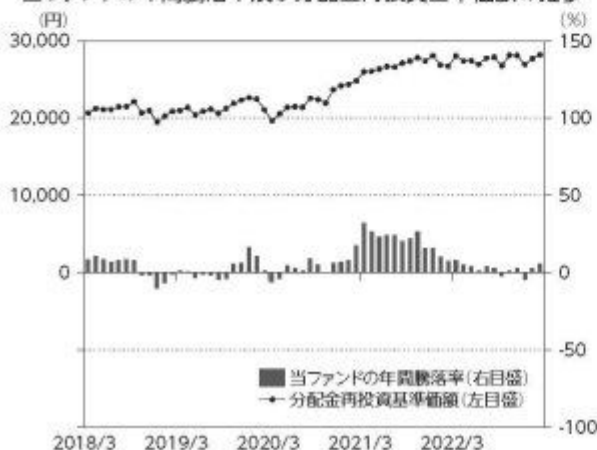


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

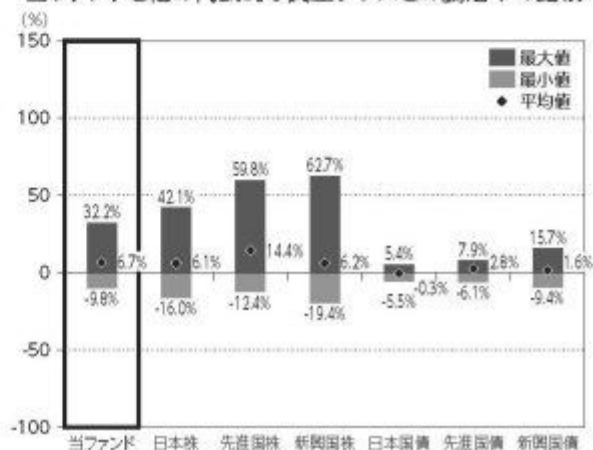


### インデックスコレクション(バランス株式70)

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。
- \*2018年3月～2023年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

### 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機動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権限又は商標は、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、数値値の公表、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権限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遅延、遺失又は中断に対し、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 NCMURA-BPI国債	NCMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリーリサーチ・コンサルティング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フィデューシャリーリサーチ・コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリーリサーチ・コンサルティング株式会社は、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・サービスに關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、本ファンドの権限、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、またデータの遅延、脱漏、又は遅延につき自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 JPELガンガバントポンドインデックス・エマージング・ マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が低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。本指数は許諾を要して使用されています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・引用・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

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。

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

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

#### (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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、2023年 2月28日現在のもので、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、2023年2月28日現在の状況について記載してあります。

### 【インデックスコレクション（バランス株式30）】

#### （1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	141,688,880,184	99.61
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		557,002,915	0.39
合計（純資産総額）		142,245,883,099	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### （2）【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	63,953,695,938	1.3407	85,742,720,145	1.3154	84,124,691,636	59.14
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	12,574,033,492	2.2284	28,019,976,234	2.3171	29,135,293,004	20.48
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	3,230,534,749	4.5456	14,684,718,756	4.7206	15,250,062,336	10.72
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	5,017,449,634	2.7599	13,847,659,245	2.6266	13,178,833,208	9.26

(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	99.61
合計	99.61

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

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第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
2022年 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	
9月末日	136,353,669,265		16,871	
10月末日	139,953,631,125		17,240	
11月末日	139,927,851,637		17,184	
12月末日	136,461,671,564		16,699	
2023年 1月末日	140,015,491,314		16,901	
2月末日	142,245,883,099		17,123	

### 【分配の推移】

	期 間	1万円当たりの分配金（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

## 【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
第13期中間計算期間	2022年 7月26日～2023年 1月25日	1.5

(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
第13期中間計算期間	2022年 7月26日～2023年 1月25日	4,297,955,350	2,335,876,659	81,667,818,386

(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	27,165,461,569	99.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		109,376,481	0.40
合計(純資産総額)		27,274,838,050	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### （2）【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	8,157,341,228	1.3358	10,896,576,413	1.3154	10,730,166,651	39.34
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	3,583,532,976	2.2375	8,018,155,034	2.3171	8,303,404,258	30.44
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	1,182,762,009	4.5531	5,385,233,704	4.7206	5,583,346,339	20.47
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	970,282,617	2.7411	2,659,641,682	2.6266	2,548,544,321	9.34

(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	99.60
合計	99.60

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第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
2022年 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	
9月末日	22,052,101,277		21,671	
10月末日	23,041,130,945		22,460	
11月末日	23,146,409,377		22,404	
12月末日	22,521,531,233		21,593	
2023年 1月末日	25,039,504,174		22,040	
2月末日	27,274,838,050		22,377	

## 【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

## 【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
第13期中間計算期間	2022年 7月26日～2023年 1月25日	0.6

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第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
第13期中間計算期間	2022年 7月26日～2023年 1月25日	888,067,575	285,904,926	10,509,202,817

(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	18,777,516,984	99.58
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		79,189,975	0.42
合計（純資産総額）		18,856,706,959	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## （2）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	3,291,828,655	2.2364	7,361,884,280	2.3171	7,627,496,176	40.45
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	1,210,797,180	4.5535	5,513,464,439	4.7206	5,715,689,167	30.31
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	3,494,386,186	1.3361	4,669,051,269	1.3154	4,596,515,589	24.38
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	318,973,598	2.7396	873,878,742	2.6266	837,816,052	4.44

(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	99.58
合計	99.58

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## （ 3 ） 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第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
2022年 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	
9月末日	14,963,147,468		26,805	
10月末日	15,832,042,600		28,142	
11月末日	15,934,578,124		28,138	
12月末日	15,516,064,288		26,946	
2023年 1月末日	17,329,835,311		27,719	
2月末日	18,856,706,959		28,203	

## 【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

## 【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
第13期中間計算期間	2022年 7月26日～2023年 1月25日	0.4

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第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
第13期中間計算期間	2022年 7月26日～2023年 1月25日	727,884,979	296,526,763	5,833,165,700

(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	311,556,310,170	99.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,389,650,743	0.76
合計(純資産総額)		313,945,960,913	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	2,374,050,000	0.76

(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	5,970,700	1,889.06	11,279,068,840	1,862.50	11,120,428,750	3.54
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	769,200	11,451.09	8,808,181,140	11,430.00	8,791,956,000	2.80
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,799,600	936.92	6,370,747,798	965.10	6,562,293,960	2.09
日本	株式	キーエンス	電気機器	108,800	58,387.60	6,352,571,764	58,890.00	6,407,232,000	2.04
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,397,400	3,830.42	5,352,638,784	3,947.00	5,515,537,800	1.76
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	782,600	5,519.90	4,319,878,420	5,972.00	4,673,687,200	1.49
日本	株式	第一三共	医薬品	950,100	4,269.52	4,056,476,615	4,283.00	4,069,278,300	1.30
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	965,100	4,198.63	4,052,106,015	4,212.00	4,065,001,200	1.29
日本	株式	日立製作所	電気機器	534,000	6,717.75	3,587,282,262	6,890.00	3,679,260,000	1.17
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	76,700	45,570.54	3,495,260,865	46,710.00	3,582,657,000	1.14
日本	株式	任天堂	その他製品	686,500	5,535.44	3,800,085,444	5,124.00	3,517,626,000	1.12
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	630,600	5,985.17	3,774,248,525	5,517.00	3,479,020,200	1.11
日本	株式	信越化学工業	化学	181,100	17,148.28	3,105,553,508	19,150.00	3,468,065,000	1.10
日本	株式	KDDI	情報・通信業	842,700	4,021.34	3,388,790,640	3,986.00	3,359,002,200	1.07

日本	株式	三菱商事	卸売業	719,300	4,358.14	3,134,812,960	4,629.00	3,329,639,700	1.06
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,548,800	1,993.22	3,087,112,220	2,122.50	3,287,328,000	1.05
日本	株式	三井物産	卸売業	841,800	3,857.00	3,246,825,972	3,824.00	3,219,043,200	1.03
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	883,900	3,093.58	2,734,419,764	3,542.00	3,130,773,800	1.00
日本	株式	HOYA	精密機器	232,200	13,683.74	3,177,365,874	13,470.00	3,127,734,000	1.00
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,078,400	2,720.12	2,933,379,274	2,890.50	3,117,115,200	0.99
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	827,600	4,205.91	3,480,819,040	3,704.00	3,065,430,400	0.98
日本	株式	ダイキン工業	機械	131,100	22,208.29	2,911,507,890	23,345.00	3,060,529,500	0.97
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	708,900	4,128.30	2,926,553,565	4,069.00	2,884,514,100	0.92
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,752,000	1,479.05	2,591,306,116	1,537.50	2,693,700,000	0.86
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	118,300	20,426.27	2,416,427,916	21,755.00	2,573,616,500	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	106,700	21,959.44	2,343,072,912	23,170.00	2,472,239,000	0.79
日本	株式	S M C	機械	35,600	62,713.90	2,232,614,935	69,100.00	2,459,960,000	0.78
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	396,500	6,047.52	2,397,845,595	6,090.00	2,414,685,000	0.77
日本	株式	村田製作所	電気機器	329,800	7,462.04	2,460,983,509	7,320.00	2,414,136,000	0.77
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,045,100	1,952.41	2,040,469,070	1,919.00	2,005,546,900	0.64

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.31
		建設業	1.96
		食料品	3.41
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.09
		医薬品	5.34
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.76
		ガラス・土石製品	0.73
		鉄鋼	0.92
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.56
		機械	5.36
		電気機器	17.21
		輸送用機器	7.41
精密機器	2.49		
その他製品	2.22		



	電気・ガス業	1.21
	陸運業	2.86
	海運業	0.67
	空運業	0.48
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	8.61
	卸売業	5.95
	小売業	4.45
	銀行業	6.69
	証券、商品先物取引業	0.80
	保険業	2.44
	その他金融業	1.17
	不動産業	1.90
	サービス業	5.12
	小計	99.24
合計		99.24

(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	119円		2,349,986,950	2,374,050,000	0.76

(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	325,237,600,040	84.59
地方債証券	日本	19,734,200,888	5.13
特殊債券	日本	21,822,413,039	5.68
社債券	日本	16,732,883,000	4.35
	フランス	297,991,000	0.08

	スペイン	198,206,000	0.05
	小計	17,229,080,000	4.48
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		445,135,491	0.12
合計（純資産総額）		384,468,429,458	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	日本	146,650,000	0.04

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	3,850,000,000	99.59	3,834,274,500	99.37	3,825,937,500	0.100	2028/3/20	1.00
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	3,485,000,000	99.53	3,468,934,150	99.37	3,463,358,150	0.005	2027/6/20	0.90
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	3,240,000,000	100.21	3,247,063,200	100.14	3,244,568,400	0.100	2026/9/20	0.84
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	3,210,000,000	101.08	3,244,924,800	101.07	3,244,475,400	0.400	2025/9/20	0.84
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	3,245,000,000	99.87	3,240,846,400	99.80	3,238,639,800	0.005	2026/9/20	0.84
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	3,205,000,000	99.95	3,203,589,800	99.78	3,198,141,300	0.100	2027/6/20	0.83
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	3,180,000,000	100.13	3,184,324,800	100.03	3,181,176,600	0.100	2026/12/20	0.83
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	3,295,000,000	97.64	3,217,238,000	96.42	3,177,236,700	0.100	2031/6/20	0.83
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	3,188,000,000	97.99	3,124,087,080	97.23	3,099,788,040	0.200	2032/3/20	0.81
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	3,120,000,000	100.18	3,125,616,000	98.82	3,083,371,200	0.200	2032/6/20	0.80
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	3,130,000,000	98.37	3,079,074,900	97.55	3,053,596,700	0.100	2030/6/20	0.79
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	3,010,000,000	100.86	3,036,156,900	100.86	3,036,096,700	0.600	2024/6/20	0.79
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	3,015,000,000	100.33	3,025,236,250	100.23	3,022,055,100	0.200	2032/9/20	0.79
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	3,020,000,000	99.86	3,015,802,200	99.66	3,009,732,000	0.100	2027/9/20	0.78

日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	3,005,000,000	100.04	3,006,202,000	99.91	3,002,565,950	0.100	2027/3/20	0.78
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	3,035,000,000	99.12	3,008,295,300	98.57	2,991,781,600	0.100	2029/3/20	0.78
日本	国債証券	第364回利付国債（10年）	3,075,000,000	97.53	2,999,078,250	96.28	2,960,702,250	0.100	2031/9/20	0.77
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	2,930,000,000	100.89	2,956,135,600	100.90	2,956,457,900	0.400	2025/3/20	0.77
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	2,940,000,000	100.29	2,948,790,600	100.27	2,948,055,600	0.100	2026/3/20	0.77
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	2,960,000,000	99.71	2,951,630,400	99.54	2,946,591,200	0.100	2027/12/20	0.77
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	2,890,000,000	100.98	2,918,339,850	100.99	2,918,639,900	0.400	2025/6/20	0.76
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	2,895,000,000	100.27	2,902,874,400	100.23	2,901,687,450	0.100	2026/6/20	0.75
日本	国債証券	第141回利付国債（5年）	2,868,000,000	100.19	2,873,678,640	100.24	2,874,911,880	0.100	2024/9/20	0.75
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	2,935,000,000	98.15	2,880,961,700	97.19	2,852,614,550	0.100	2030/9/20	0.74
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	2,930,000,000	97.96	2,870,345,200	96.88	2,838,730,500	0.100	2030/12/20	0.74
日本	国債証券	第365回利付国債（10年）	2,925,000,000	97.55	2,853,562,600	96.22	2,814,435,000	0.100	2031/12/20	0.73
日本	国債証券	第362回利付国債（10年）	2,910,000,000	97.77	2,845,383,000	96.64	2,812,282,200	0.100	2031/3/20	0.73
日本	国債証券	第144回利付国債（5年）	2,790,000,000	100.26	2,797,365,600	100.29	2,798,342,100	0.100	2025/6/20	0.73
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	2,750,000,000	99.27	2,729,952,500	98.80	2,717,055,000	0.100	2028/12/20	0.71
日本	国債証券	第150回利付国債（5年）	2,710,000,000	99.76	2,703,496,000	99.67	2,701,246,700	0.005	2026/12/20	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	84.59
地方債証券	5.13
特殊債券	5.68
社債券	4.48
合計	99.88

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
-------	-----	-------	---------	----	----	---------	---------	---------

債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	1円	146,480,330	146,650,000	0.04
--------	-------	--------	----	----	-------------	-------------	------

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

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

## 外国株式マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	238,944,281,843	65.71
	イギリス	16,223,191,697	4.46
	カナダ	13,181,354,116	3.62
	フランス	12,333,313,872	3.39
	スイス	11,916,001,748	3.28
	ドイツ	9,176,493,459	2.52
	オーストラリア	7,695,627,321	2.12
	オランダ	7,068,240,781	1.94
	アイルランド	6,563,730,291	1.81
	スウェーデン	3,475,129,188	0.96
	デンマーク	3,215,908,061	0.88
	スペイン	2,859,771,088	0.79
	香港	2,254,442,429	0.62
	イタリア	2,002,612,226	0.55
	フィンランド	1,366,182,263	0.38
	シンガポール	1,228,241,887	0.34
	ジャージー	1,172,218,688	0.32
	ベルギー	925,599,594	0.25
	ノルウェー	775,129,616	0.21
	イスラエル	734,926,036	0.20
	ケイマン	664,254,571	0.18
	キュラソー	562,737,957	0.15
	バミューダ	554,384,222	0.15
	ルクセンブルク	266,571,175	0.07
	ニュージーランド	250,523,738	0.07
	オーストリア	218,422,500	0.06
	ポルトガル	183,700,800	0.05
	リベリア	126,507,047	0.03
	パナマ	84,953,681	0.02
	マン島	74,980,350	0.02
	小計	346,099,432,245	95.18
投資信託受益証券	オーストラリア	88,603,104	0.02

	香港	44,583,176	0.01
	小計	133,186,280	0.04
投資証券	アメリカ	6,712,981,102	1.85
	オーストラリア	457,966,661	0.13
	シンガポール	164,508,077	0.05
	フランス	163,316,976	0.04
	イギリス	150,655,369	0.04
	香港	95,270,729	0.03
	カナダ	44,761,992	0.01
	ベルギー	30,006,546	0.01
	小計	7,819,467,452	2.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,578,005,637	2.63
合計(純資産総額)		363,630,091,614	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,693,129,166	2.12
	買建	カナダ	440,832,823	0.12
	買建	ドイツ	1,568,942,419	0.43
	買建	イギリス	377,661,948	0.10
	買建	オーストラリア	312,857,467	0.09

(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		1,905,435,798	0.52
	売建		127,619,372	0.04

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	852,213	20,685.35	17,628,324,946	20,165.93	17,185,670,771	4.73
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	375,818	35,005.45	13,155,679,749	34,104.31	12,817,014,628	3.52
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	486,498	13,930.19	6,777,014,148	12,782.30	6,218,563,775	1.71
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	132,418	28,750.63	3,807,101,413	32,038.91	4,242,528,821	1.17
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	141,703	26,551.63	3,762,445,739	28,306.19	4,011,073,161	1.10
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	318,772	14,028.35	4,471,847,417	12,251.97	3,905,587,244	1.07
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	294,920	14,106.06	4,160,160,719	12,283.33	3,622,600,568	1.00
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	221,643	15,232.15	3,376,099,621	15,071.28	3,340,444,045	0.92
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	49,740	64,789.46	3,222,628,198	65,891.01	3,277,419,116	0.90
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	155,995	19,347.95	3,018,184,021	19,380.67	3,023,288,053	0.83
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	139,834	22,270.86	3,114,224,668	21,217.03	2,966,863,278	0.82
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	69,208	42,048.26	2,910,076,109	41,534.29	2,874,505,682	0.79
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	121,381	25,365.55	3,078,897,014	23,113.38	2,805,526,173	0.77
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	86,992	31,279.55	2,721,071,066	30,040.31	2,613,267,126	0.72
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	126,953	19,277.06	2,447,280,852	18,968.95	2,408,165,896	0.66
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	146,347	16,240.40	2,376,734,755	15,826.67	2,316,186,435	0.64
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	45,913	50,847.00	2,334,538,315	48,462.58	2,225,062,821	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	54,487	44,889.37	2,445,887,599	40,355.04	2,198,825,244	0.60
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	98,959	23,127.02	2,288,626,891	22,197.25	2,196,617,722	0.60
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	134,895	14,182.40	1,913,136,184	14,909.04	2,011,156,138	0.55
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	94,161	19,770.57	1,861,617,263	21,032.99	1,980,487,597	0.54
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	21,642	89,744.96	1,942,260,554	86,115.25	1,863,706,349	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	42,999	46,033.18	1,979,381,042	43,164.80	1,856,043,433	0.51

アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	385,185	4,958.32	1,909,871,298	4,663.84	1,796,444,793	0.49
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	218,827	8,202.97	1,795,032,651	8,155.26	1,784,591,211	0.49
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	73,517	23,424.22	1,722,078,426	23,981.81	1,763,070,748	0.48
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	88,202	18,613.94	1,641,786,736	19,632.07	1,731,588,015	0.48
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	21,504	81,975.22	1,762,795,324	79,814.39	1,716,328,825	0.47
フランス	株式	LVMH	耐久消費財・アパレル	14,740	117,741.46	1,735,509,150	114,936.02	1,694,157,053	0.47
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	298,935	5,965.80	1,783,386,662	5,559.53	1,661,940,313	0.46

(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	5.50
		素材	4.31
		資本財	6.62
		商業・専門サービス	1.17
		運輸	1.88
		自動車・自動車部品	1.99
		耐久消費財・アパレル	1.67
		消費者サービス	1.97
		メディア・娯楽	4.89
		小売	4.30
		食品・生活必需品小売り	1.49
		食品・飲料・タバコ	4.16
		家庭用品・パーソナル用品	1.74
		ヘルスケア機器・サービス	4.64
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.66
		銀行	6.21
		各種金融	4.76
		保険	3.30
		不動産	0.38
		ソフトウェア・サービス	10.25
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.15		
電気通信サービス	1.42		
公益事業	2.95		

		半導体・半導体製造装置	4.76
		小計	95.18
投資信託受益証券			0.04
投資証券			2.15
合計			97.37

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	283	アメリカドル	58,164,371.5	7,929,548,767	56,430,200	7,693,129,166	2.12
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	18	カナダドル	4,474,545.5	449,154,877	4,391,640	440,832,823	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	33	スイスフラン	3,687,895	537,252,543	3,673,890	535,212,295	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	168	ユーロ	7,083,704.5	1,024,374,508	7,148,400	1,033,730,124	0.28
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	19	オーストラリアドル	3,540,771	325,396,854	3,404,325	312,857,467	0.09
	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	29	イギリスポンド	2,273,347.5	373,829,263	2,296,655	377,661,948	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	10,691,600.00	1,427,022,218	1,455,709,142	0.40
	カナダドル	買建	362,000.00	36,328,401	36,328,256	0.01
	ユーロ	買建	1,500,000.00	211,796,940	216,695,760	0.06
	イギリスポンド	買建	610,000.00	98,429,593	100,206,000	0.03
	スイスフラン	買建	400,000.00	58,270,120	58,268,560	0.02
	香港ドル	買建	2,200,000.00	38,228,520	38,228,080	0.01
	アメリカドル	売建	502,000.00	68,387,209	68,428,172	0.02
	イギリスポンド	売建	360,000.00	58,642,884	59,191,200	0.02



(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	74,744,705,307	49.21
	フランス	12,585,953,929	8.29
	イタリア	11,199,104,551	7.37
	ドイツ	9,678,515,756	6.37
	スペイン	7,409,957,027	4.88
	イギリス	7,199,796,745	4.74
	中国	6,507,632,741	4.28
	カナダ	3,091,553,656	2.04
	ベルギー	2,742,939,738	1.81
	オーストラリア	2,362,351,590	1.56
	オランダ	2,242,092,860	1.48
	オーストリア	1,762,877,985	1.16
	メキシコ	1,281,398,157	0.84
	アイルランド	950,734,938	0.63
	マレーシア	826,188,548	0.54
	フィンランド	750,482,750	0.49
	シンガポール	680,653,161	0.45
	ポーランド	675,950,486	0.45
	デンマーク	485,629,364	0.32
	イスラエル	481,661,144	0.32
ニュージーランド	319,138,945	0.21	
スウェーデン	296,911,864	0.20	
ノルウェー	294,637,005	0.19	
	小計	148,570,868,247	97.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,317,791,610	2.18
合計(純資産総額)		151,888,659,857	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	959,015,528	0.63
	買建	ドイツ	862,205,310	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		2,133,025,855	1.40

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	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 2.875% 04/30/25	10,770,000	13,201.64	1,421,816,997	13,116.96	1,412,697,634	2.875	2025/4/30	0.93
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	10,610,000	12,823.00	1,360,521,161	12,815.02	1,359,673,622	0.250	2024/6/15	0.90
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,110,000	11,351.60	1,374,679,081	11,080.54	1,341,853,430	1.375	2031/11/15	0.88
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	10,200,000	12,990.75	1,325,057,298	12,769.75	1,302,514,929	2.875	2028/8/15	0.86
中国	国債証券	CGB 1.99% 04/09/25	63,260,000	1,938.90	1,226,548,457	1,937.72	1,225,802,660	1.990	2025/4/9	0.81
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/30/25	8,000,000	12,494.43	999,554,524	12,426.26	994,101,324	0.375	2025/4/30	0.65
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	9,130,000	10,954.32	1,000,130,187	10,713.08	978,104,960	0.625	2030/8/15	0.64
アメリカ	国債証券	T 2.25% 03/31/24	7,300,000	13,237.32	966,324,611	13,222.94	965,274,984	2.250	2024/3/31	0.64
アメリカ	国債証券	T 1.125% 10/31/26	7,850,000	12,288.33	964,634,602	12,144.02	953,305,629	1.125	2026/10/31	0.63
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	6,900,000	12,774.54	881,443,744	12,541.29	865,349,354	2.625	2029/2/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	7,400,000	11,010.24	814,758,141	10,775.92	797,418,669	0.625	2030/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	12,988.09	785,779,757	12,926.05	782,026,289	2.000	2025/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/29	6,000,000	12,844.84	770,690,532	12,603.60	756,216,122	2.750	2029/5/31	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.125% 01/15/25	5,830,000	12,785.19	745,377,032	12,733.80	742,380,995	1.125	2025/1/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	6,550,000	11,303.67	740,390,651	11,033.14	722,670,955	1.250	2031/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	5,750,000	12,669.10	728,473,501	12,561.79	722,303,365	1.625	2026/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.125% 02/29/24	5,450,000	13,243.86	721,790,438	13,237.43	721,440,085	2.125	2024/2/29	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	5,460,000	13,160.10	718,541,750	13,123.89	716,564,538	2.375	2024/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	6,200,000	11,813.84	732,458,486	11,531.06	714,926,233	1.875	2032/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	5,500,000	12,951.88	712,353,538	12,841.11	706,261,291	2.250	2025/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.25% 05/31/28	6,000,000	11,958.69	717,521,831	11,769.64	706,178,747	1.250	2028/5/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.375% 08/15/24	5,500,000	12,767.62	702,219,323	12,745.25	700,989,153	0.375	2024/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	5,400,000	12,619.04	681,428,463	12,495.49	674,756,814	1.625	2026/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 4% 12/15/25	5,000,000	13,580.81	679,040,562	13,455.13	672,756,594	4.000	2025/12/15	0.44

アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	6,160,000	11,125.27	685,316,853	10,881.37	670,292,429	0.875	2030/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.25% 12/31/26	5,500,000	12,308.57	676,971,643	12,155.20	668,536,224	1.250	2026/12/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	5,230,000	12,746.85	666,660,516	12,707.44	664,599,486	0.750	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	5,260,000	12,680.82	667,011,139	12,492.56	657,109,058	2.250	2027/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	5,300,000	12,509.34	662,995,152	12,375.14	655,882,568	1.500	2026/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/28	5,550,000	12,008.75	666,485,953	11,801.59	654,988,696	1.500	2028/11/30	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	97.82
合計	97.82

(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	26	アメリカ ドル	2,790,541.56	380,434,531	2,783,625	379,491,596	0.25
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	19	アメリカ ドル	2,126,506.41	289,906,619	2,120,578.22	289,098,429	0.19
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	17	アメリカ ドル	2,144,539.75	292,365,104	2,130,312.5	290,425,503	0.19
	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	1,162,423.4	168,098,048	1,155,990	167,167,714	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	1,754,824.7	253,765,200	1,732,800	250,580,208	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	3,133,023.1	453,066,469	3,073,490	444,457,388	0.29

(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	8,370,000.00	1,105,480,298	1,138,705,857	0.75

カナダドル	買建	750,000.00	73,960,506	75,140,325	0.05
ユーロ	買建	5,010,000.00	706,706,646	723,610,332	0.48
イギリスポンド	買建	640,000.00	101,746,273	105,049,600	0.07
オフショア人民元	買建	4,630,000.00	89,402,568	90,519,741	0.06

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

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

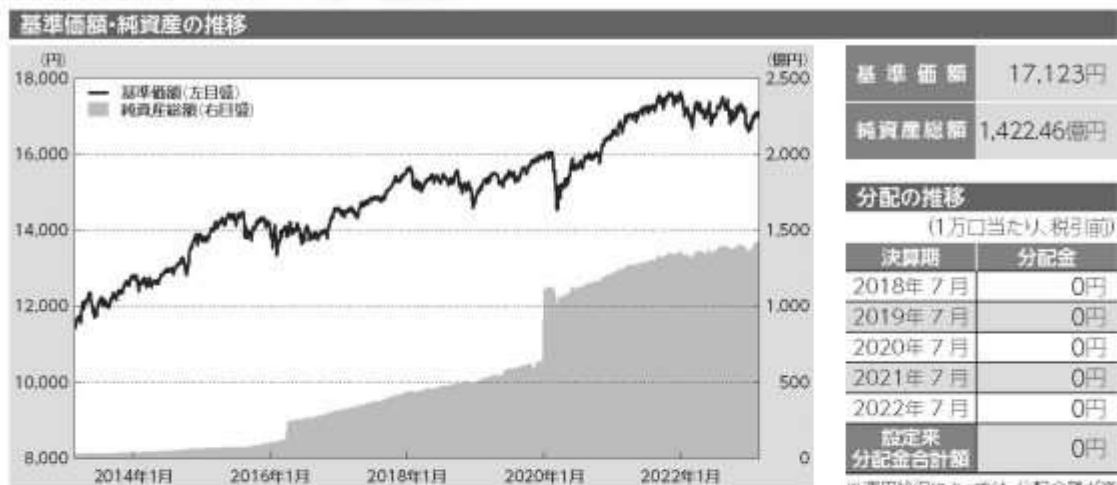
#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

当初設定日：2010年10月20日

作成基準日：2023年2月28日

**インデックスコレクション(バランス株式30)**

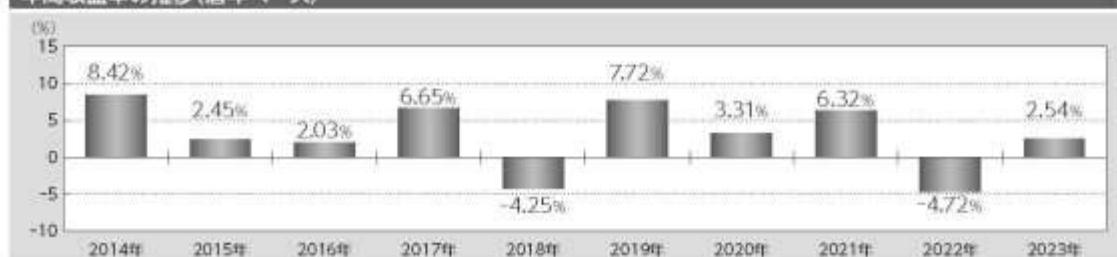
※上記グラフは作成基準日以前の最近10年間を表示しております。

※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	59.1%	第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.6%
		第153回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2027/06/20	0.5%
		第340回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.400%	2025/09/20	0.5%
日本株式 マザーファンド	20.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.7%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.6%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.4%
外国株式 マザーファンド	10.7%	APPLE INC	アメリカ	株式	パソコン・ソフトウェア機器	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.4%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.2%
外国債券 マザーファンド	9.3%	T 2.875% 04/30/25	アメリカ	国債	-	2.875%	2025/04/30	0.1%
		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%

※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)**

※2023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。

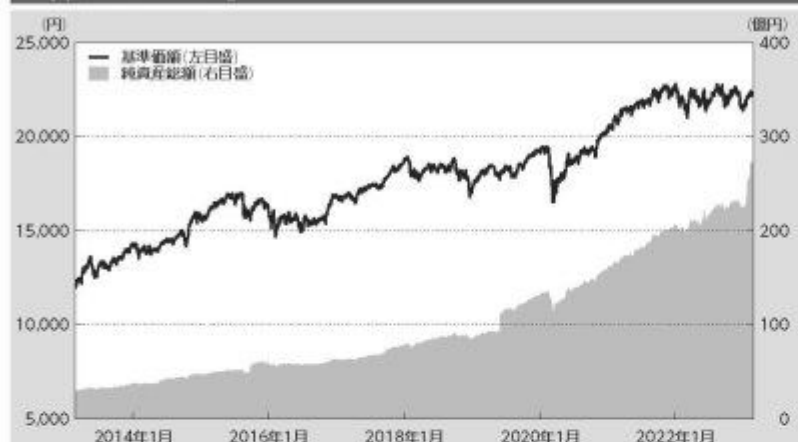
運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページ等でご確認いただけます。

当初設定日：2010年10月20日

作成基準日：2023年2月28日

## インデックスコレクション(バランス株式50)

## 基準価額・純資産の推移



基準価額 22,377円

純資産総額 272.75億円

## 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。

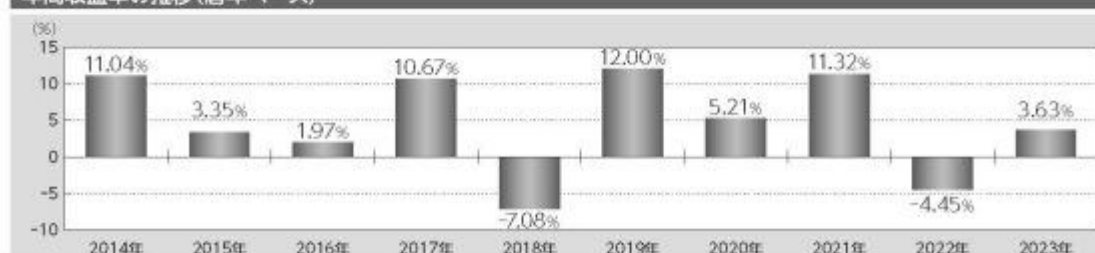
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

## 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券 マザーファンド	39.3%	第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.4%
		第153回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2027/06/20	0.4%
		第340回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.400%	2025/09/20	0.3%
日本株式 マザーファンド	30.4%	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	-	-	0.9%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	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/ソフトウェア	-	-	1.0%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.7%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.4%
外国債券 マザーファンド	9.3%	T 2.875% 04/30/25	アメリカ	国債	-	2.875%	2025/04/30	0.1%
		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%

※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)




※2023年は年初から作成基準日までの収益率です。

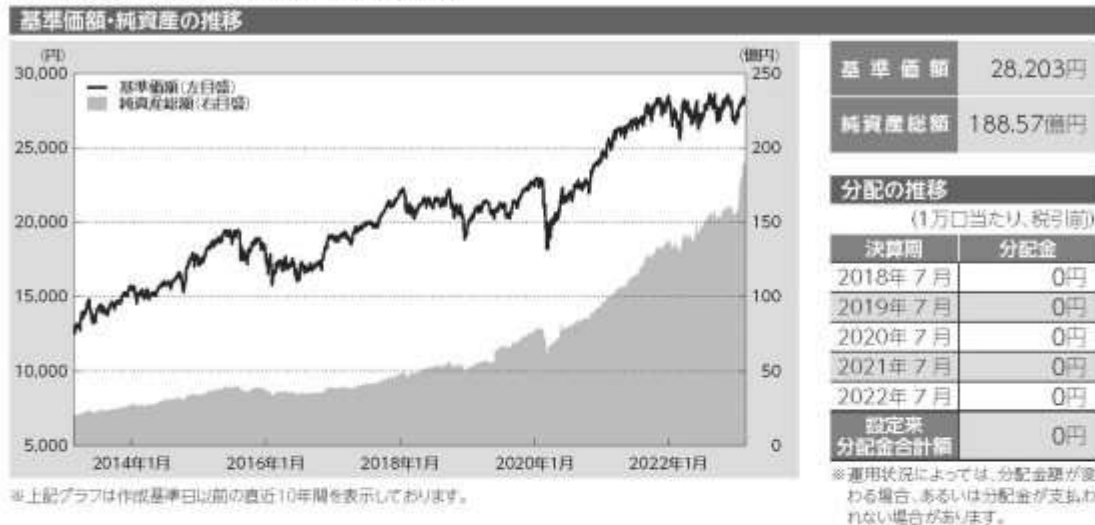
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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。

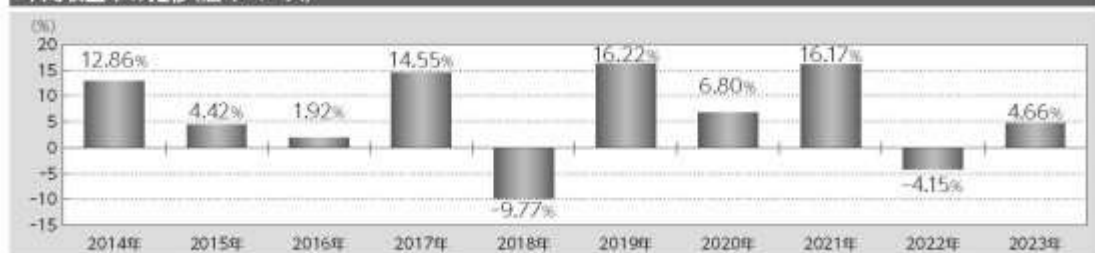

**運用実績**

 当初設定日：2010年10月20日  
 作成基準日：2023年2月28日

**インデックスコレクション(バランス株式70)**

**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	40.4%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.4%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	1.1%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.8%
外国株式 マザーファンド	30.3%	APPLE INC	アメリカ	株式	IT/ハードウェア/ソフトウェア	-	-	1.4%
		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	-	-	0.5%
日本債券 マザーファンド	24.4%	第350日利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.2%
		第153日利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2027/06/20	0.2%
		第340日利付国債(10年)	日本	国債	-	0.400%	2025/09/20	0.2%
外国債券 マザーファンド	4.4%	T 2.875% 04/30/25	アメリカ	国債	-	2.875%	2025/04/30	0.0%
		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%

※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)**


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

#### < その他 >

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



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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

#### < 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（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基づき、振替口座へ振り込まれることとなります。

#### < 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ません。

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け付けを中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け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け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記<解約価額>の規定に準じて計算された価額とします。

### <一部解約の制限>

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

### <その他>

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

### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 3【資産管理等の概要】

### （1）【資産の評価】

#### <基準価額の算出方法>

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

#### <基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

**< 主要な投資対象資産の評価方法 >**

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せん。）

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）

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

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

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

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

#### (2) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

### < 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

#### (1) 投資信託約款の変更等

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

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

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

委託会社は、監督官庁の命令に基いて、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。

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

### < 運用報告書 >

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

### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

収益分配金は、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てします。）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

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

### (3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

#### 1【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)
<b>資産の部</b>		
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
<b>負債の部</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
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		第12期	
	自	2020年 7月28日 至 2021年 7月26日	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 (1万口当たり純資産額) 1.7227円 (17,227円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.7240円 (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			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			分配金の計算過程		
項目			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	8,087,265,659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	39,949,258,278円	収益調整金額	C	42,723,150,393円
分配準備積立金額	D	4,674,699,654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	54,191,292,813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	74,988,698,593口	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	7,226円	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	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	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	第12期
	自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日	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)
<b>資産の部</b>		
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
<b>負債の部</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
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		第12期	
	自 2020年 7月28日	至 2021年 7月26日	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 (1万口当たり純資産額) 2.1871円 (21,871円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.2268円 (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			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			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	231,837,880円	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	2,026,107,805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	5,842,376,080円	収益調整金額	C	7,993,431,809円
分配準備積立金額	D	1,814,088,454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	9,914,410,219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	8,351,781,813口	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	11,871円	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	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	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	第12期
	自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日	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)
<b>資産の部</b>		
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
<b>負債の部</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
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		第12期	
	自	2020年 7月28日	自	2021年 7月27日
	至	2021年 7月26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 (1万口当たり純資産額) 2.6791円 (26,791円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.7683円 (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			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			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	154,103,316円	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	1,610,015,783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	4,601,221,094円	収益調整金額	C	6,927,447,965円
分配準備積立金額	D	817,863,703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	7,183,203,896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	4,277,881,661口	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	16,791円	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	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	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	第12期
	自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日	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

項目	2022年 7月25日現在
	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
D C 日本株式インデックスファンド	289,015,491円
D C 日本株式インデックスファンド L	53,888,428,077円
D C 日本株式インデックスファンド A	664,326,423円
D C バランスファンド 3 0	2,433,151,911円
D C バランスファンド 5 0	3,810,580,363円
D C バランスファンド 7 0	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 3 0）	12,360,581,100円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	2,970,071,322円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	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 V A（適格機関投資家専用）	945,544,352円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	47,354,650円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	530,435,125円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	65,889,800円
V A バランスファンド（株 5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	130,918,304円
V A バランスファンド（株 6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	87,710,306円
バランス V A 2 5（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)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	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ではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,300	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	
I N P E X	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	
飛鳥建設	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	
銭高組	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	
浅沼組	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
大気社	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
ニッポン	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
D M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
キューピー	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
ピク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
ゲンゼ	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
日本フェルト	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
T S I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

トモク	5,800	1,545.00	8,961,000
ザ・バック	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
東亜合成	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
J S R	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
K H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
U B E	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
A D E K A	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
D I C	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S Cホールディングス	21,700	1,945.00	42,206,500
T & K T O K A	9,500	870.00	8,265,000
富士フィ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P M C	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
J C U	12,300	3,575.00	43,972,500
新田ゼラチン	6,800	620.00	4,216,000
O A T 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
J S P	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
大太平洋金属	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
D O W A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
U A C J	16,200	2,160.00	34,992,000
C K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
文化シャッター	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
東洋シャッター	2,600	560.00	1,456,000
LIXIL	186,700	2,766.00	516,412,200
日本フィルコン	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
F U J I	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
D M G 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
富士ダイス	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
N C 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
ナプテスコ	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
S M C	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・ピー機械	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
日本エアージェット	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
西島製作所	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
C K D	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
S A N K Y O	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
J U K I	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
T P R	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
N T N	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
T H K	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
I H I	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
P H C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
J V C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 - P E X	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
I D E C	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
E I Z O	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
T D K	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
エスベック	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
オブテックスグループ	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
ハリオス 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
K O A	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
S C R E E Nホールディングス	18,900	9,450.00	178,605,000
キャノン電子	11,700	1,575.00	18,427,500
キャノン	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
M U T O H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
日本車輛製造	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
G M B	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
N O K	45,100	1,211.00	54,616,100
フタバ産業	26,700	401.00	10,706,700
K Y B	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
S U B A R U	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
T B K	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
J M S	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
H O Y A	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
前田工織	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
S H O E I	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
N I S S H A	20,800	1,553.00	32,302,400
光村印刷	900	1,240.00	1,116,000
T A K A R A & C O M P A N Y	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
S G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
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
キュ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
エーアイティー	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 ネットエスアイ	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
ソフトクリエイイトホールディングス	5,200	4,235.00	22,022,000
T I S	103,000	3,800.00	391,400,000
J N S 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
G M O 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
A G S	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
K L a b	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・テクノロジー	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
C A R T A H O L D I N G S	4,900	1,911.00	9,363,900
オブティム	8,400	820.00	6,888,000
セレス	4,500	1,219.00	5,485,500
S H I F T	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
G M O 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
G M O グローバルサイン・ホールディングス	2,600	5,680.00	14,768,000
S R A 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
e B A S E	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
g u m i	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
P C I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
P R T I M E S	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
U b i c o m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
C E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
I P S	3,300	2,412.00	7,959,600
F I G	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
トピラシステムズ	2,500	946.00	2,365,000
S a n s a n	37,300	1,196.00	44,610,800
L i n k - 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
J M D C	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J SAT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йд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
カブコン	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

J B C C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
オルパ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
O C H Iホールディングス	2,700	1,226.00	3,310,200
T O K A Iホールディングス	57,300	900.00	51,570,000
黒谷	3,200	610.00	1,952,000
C o m i n i x	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
佐島電機	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
メディバルホールディングス	109,300	2,050.00	224,065,000
S P K	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
I D O M	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
キャ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

G S I 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
P A L T A C	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
J K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
キャンドウ	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
ジー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
D C M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
ブロンコピリー	6,300	2,446.00	15,409,800
Z O Z O	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
H a m e e	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
クリエイティブSDホールディングス	17,500	3,125.00	54,687,500
丸善C H I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
S F P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
B E E N O S	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
クリエイティブ・レストランズ・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
T O K Y O B A S E	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
J M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
パ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
V T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
S R S 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
パ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
サックスパー 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
F P G	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
S B I 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
S O M P O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
M S & A D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
C a s a	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H C 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
N E C 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
S R E ホールディングス	3,400	2,427.00	8,251,800
A D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

総合警備保障	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
J P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
K e e P e r 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
G u n o s y	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
I B J	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
E R I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
S M N	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
R P A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
L I T A L I C O	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
T R E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
K N T - C T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

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

(貸借対照表に関する注記)

	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	<p>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。</p> <p>有価証券 100,423,000円</p>
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
D C 日本債券インデックスファンド	1,985,071,127円
D C 日本債券インデックスファンド L	44,220,411,251円
D C バランスファンド 3 0	11,865,055,437円
D C バランスファンド 5 0	8,236,338,576円
D C バランスファンド 7 0	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 3 0）	60,586,638,973円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	6,428,434,943円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	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 V A 3 0（適格機関投資家専用）	179,554,646円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	844,556,828円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	125,085,958円

区分	2022年 7月25日現在
V Aバランスファンド（株50 / 100）（適格機関投資家専用）	81,449,125円
V A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V A 2 5（適格機関投資家専用）	2,903,309,226円
バランスV A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	988,930,985円
バランスV A 5 0 L（適格機関投資家専用）	11,292,552,623円
バランスV A 7 5（適格機関投資家専用）	141,307,157円
V Aバランスファンド（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	276,629,144円
V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	2,918,808,490円
V A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V A 4 0（適格機関投資家専用）	342,366,818円
バランスファンドV A（適格機関投資家専用）	3,037,754,111円
V A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
V Aバランス50 - 50（適格機関投資家専用）	788,325,775円
V A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V A 2（適格機関投資家専用）	3,150,122,581円
バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用）	1,432,279,049円
バランスファンドV A 3（適格機関投資家専用）	23,511,156,346円
世界バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	442,580,340円
国内バランスV A 3 0（適格機関投資家専用）	127,871,059円
国内バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	38,179,872円
V A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A L（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bond（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 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	10,278,000	10,366,082	
第 1 2 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 1 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,451,000	
第 2 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,659,000	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,776,000	16,597,614	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,616,000	18,660,452	
第 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,366,000	34,037,703	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,845,000	10,949,762	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,358,000	32,642,750	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,082,000	12,353,482	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,717,000	24,007,325	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,135,000	22,333,777	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,264,000	10,384,704	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,629,000	21,694,900	
第 3 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,878,000	11,006,034	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,386,000	31,686,364	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,268,000	46,221,546	
第 4 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,940,000	24,501,632	
第 4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,220,000	11,426,335	
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,061,000	10,102,753	
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,495,000	27,694,428	
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,098,000	27,462,142	
第 4 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,094,000	
第 4 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,561,000	79,777,303	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,724,000	87,978,016	
第 4 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,447,000	10,572,990	
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,726,000	20,664,957	
第 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,568,000	21,474,637	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,624,000	30,722,609	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,808,000	22,801,572	
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,001,000	11,192,197	
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,352,000	25,438,829	
第 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,971,000	27,168,782	
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,787,000	30,098,535	
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,824,000	29,095,835	
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,386,000	39,789,776	

第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,390,000	41,207,454	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,421,000	35,889,744	
第 7 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,830,000	33,966,574	
第 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,757,000	34,945,921	
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,320,000	41,171,972	
第 8 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,746,000	
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,089,000	
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,366,000	63,860,289	
第 1 0 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,560,000	140,740,367	
第 1 1 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,581,000	71,397,929	
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,321,000	73,922,639	
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,945,000	73,374,144	
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,288,000	74,025,763	
第 1 1 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,146,000	
第 1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,774,000	74,821,855	
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,206,000	75,121,769	
第 1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,962,000	74,970,995	
第 1 2 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,132,000	75,940,147	
第 1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,046,000	77,761,132	
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,101,000	78,630,349	
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,186,000	77,849,018	
第 1 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,566,000	80,176,060	
第 1 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,541,000	80,976,736	
第 1 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,997,000	81,697,710	
第 1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,276,000	82,037,399	
第 1 4 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,183,000	81,508,277	
第 1 4 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,244,000	83,191,792	
第 1 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,490,000	84,280,316	
第 1 4 6 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（BFM）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（BFM）円貨社債	100,000,000	99,568,000	
	第8回ピー・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回ピー・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	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

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ではありません。

## 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。

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	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
FREEMPORT-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 SOFTWARE	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
SYNOPSIS 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
ENERGY 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
	SOLAREEDGE 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
BRENTAG 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
NEMETSCHKE 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
ASHTED 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
	イギリスボンド 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 SYSEMS 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 ケル	ICL LTD	28,484	31.48	896,676.32	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,248	776.50	969,072.00	
	BANK HAPOLIM 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	
		LENLEASE 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	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

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	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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
D C外国債券インデックスファンド	1,898,508,796円
D C外国債券インデックスファンドL	14,320,047,297円
D Cバランスファンド30	952,285,070円
D Cバランスファンド50	979,507,541円
D C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V A 2 5 L（適格機関投資家専用）	222,873,166円
世界バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	65,848,257円
V Aバランス2 0 - 8 0（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A L（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)	時価(円)		評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引	1,632,176,161	-	1,689,070,951	56,894,790
	買建				
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ではありません。

## 通貨関連

（2022年 7月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)				
			うち1年超						
市場取引以外の取引	為替予約取引	1,704,824,511	-	1,708,624,459	3,799,948				
	買建								
	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。

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	5,000,000.00	4,791,699.20	
		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	
	<b>アメリカドル 小計</b>	<b>624,860,000.00</b>	<b>584,761,141.52</b>	<b>(79,895,914,765)</b>
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		
	<b>カナダドル 小計</b>	<b>32,730,000.00</b>	<b>30,814,476.40</b>	<b>(3,253,700,563)</b>

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
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
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	
	マレーシアリングット 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%
マレーシアリングット	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。

【中間財務諸表】

## 【インデックスコレクション（バランス株式30）】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期中間計算期間(2022年7月26日から2023年1月25日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (2022年7月25日現在)	第13期中間計算期間 (2023年1月25日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	620,048,457	623,330,708
親投資信託受益証券	136,864,182,708	138,155,519,421
未収入金	78,936,360	95,213,519
流動資産合計	137,563,167,525	138,874,063,648
<b>資産合計</b>	<b>137,563,167,525</b>	<b>138,874,063,648</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	50,607,026	44,407,154
未払受託者報酬	14,590,530	15,323,896
未払委託者報酬	87,543,082	91,943,332
未払利息	252	314
その他未払費用	1,096,963	1,131,567
流動負債合計	153,837,853	152,806,263
<b>負債合計</b>	<b>153,837,853</b>	<b>152,806,263</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	79,705,739,695	81,667,818,386
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	57,703,589,977	57,053,438,999
(分配準備積立金)	14,980,439,584	14,553,718,762
元本等合計	137,409,329,672	138,721,257,385
<b>純資産合計</b>	<b>137,409,329,672</b>	<b>138,721,257,385</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>137,563,167,525</b>	<b>138,874,063,648</b>

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期中間計算期間 自 2021年 7月27日 至 2022年 1月26日	第13期中間計算期間 自 2022年 7月26日 至 2023年 1月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	2,986	592
有価証券売買等損益	937,463,071	1,906,466,683
営業収益合計	937,460,085	1,906,466,091
<b>営業費用</b>		
支払利息	155,852	167,816
受託者報酬	14,726,076	15,323,896
委託者報酬	88,356,366	91,943,332
その他費用	1,116,626	1,131,567
営業費用合計	104,354,920	108,566,611
営業利益又は営業損失（ ）	1,041,815,005	2,015,032,702
経常利益又は経常損失（ ）	1,041,815,005	2,015,032,702
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,041,815,005	2,015,032,702
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	35,030,313	26,926,783
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	54,191,292,813	57,703,589,977
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,367,361,971	3,028,371,438
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,367,361,971	3,028,371,438
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,664,136,505	1,690,416,497
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,664,136,505	1,690,416,497
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	54,817,672,961	57,053,438,999

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第12期 (2022年 7月25日現在)	第13期中間計算期間 (2023年 1月25日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	79,705,739,695口	81,667,818,386口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.7240円 (17,240円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6986円 (16,986円)

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

	第13期中間計算期間 (2023年 1月25日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
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。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第12期	第13期中間計算期間
	自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日	自 2022年 7月26日 至 2023年 1月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	74,988,698,593円	79,705,739,695円
期中追加設定元本額	8,983,817,540円	4,297,955,350円
期中一部解約元本額	4,266,776,438円	2,335,876,659円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。



## 【インデックスコレクション（バランス株式50）】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期中間計算期間(2022年7月26日から2023年1月25日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (2022年7月25日現在)	第13期中間計算期間 (2023年1月25日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	98,540,175	116,134,868
親投資信託受益証券	21,972,921,509	23,158,065,003
未収入金	7,071,996	-
流動資産合計	22,078,533,680	23,274,199,871
<b>資産合計</b>	<b>22,078,533,680</b>	<b>23,274,199,871</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	1,598,330	3,317,311
未払受託者報酬	2,256,207	2,508,694
未払委託者報酬	13,537,156	15,052,085
未払利息	40	58
その他未払費用	563,990	627,114
流動負債合計	17,955,723	21,505,262
<b>負債合計</b>	<b>17,955,723</b>	<b>21,505,262</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	9,907,040,168	10,509,202,817
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	12,153,537,789	12,743,491,792
(分配準備積立金)	4,160,105,980	4,045,477,159
元本等合計	22,060,577,957	23,252,694,609
<b>純資産合計</b>	<b>22,060,577,957</b>	<b>23,252,694,609</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>22,078,533,680</b>	<b>23,274,199,871</b>

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期中間計算期間 自 2021年 7月27日 至 2022年 1月26日	第13期中間計算期間 自 2022年 7月26日 至 2023年 1月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	447	97
有価証券売買等損益	129,570,607	118,949,872
営業収益合計	129,570,160	118,949,775
<b>営業費用</b>		
支払利息	22,139	28,202
受託者報酬	2,178,417	2,508,694
委託者報酬	13,070,451	15,052,085
その他費用	544,541	627,114
営業費用合計	15,815,548	18,216,095
営業利益又は営業損失（ ）	145,385,708	137,165,870
経常利益又は経常損失（ ）	145,385,708	137,165,870
中間純利益又は中間純損失（ ）	145,385,708	137,165,870
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	12,110,196	3,282,187
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	9,914,410,219	12,153,537,789
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,292,739,668	1,074,473,762
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,292,739,668	1,074,473,762
剰余金減少額又は欠損金増加額	355,554,607	350,636,076
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	355,554,607	350,636,076
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	10,694,099,376	12,743,491,792

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第12期 (2022年 7月25日現在)	第13期中間計算期間 (2023年 1月25日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,907,040,168口	10,509,202,817口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.2268円 (22,268円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.2126円 (22,126円)

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

	第13期中間計算期間 (2023年 1月25日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
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。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第12期	第13期中間計算期間
	自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日	自 2022年 7月26日 至 2023年 1月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	8,351,781,813円	9,907,040,168円
期中追加設定元本額	2,149,578,883円	888,067,575円
期中一部解約元本額	594,320,528円	285,904,926円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 【インデックスコレクション（バランス株式70）】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期中間計算期間(2022年7月26日から2023年1月25日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (2022年7月25日現在)	第13期中間計算期間 (2023年1月25日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	75,547,978	95,629,479
親投資信託受益証券	14,894,310,666	16,143,909,208
未収入金	445,484	-
流動資産合計	14,970,304,128	16,239,538,687
<b>資産合計</b>	<b>14,970,304,128</b>	<b>16,239,538,687</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	5,616,258	13,048,784
未払受託者報酬	1,502,419	1,720,131
未払委託者報酬	9,014,469	10,320,726
未払利息	30	48
その他未払費用	375,544	429,971
流動負債合計	16,508,720	25,519,660
<b>負債合計</b>	<b>16,508,720</b>	<b>25,519,660</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	5,401,807,484	5,833,165,700
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	9,551,987,924	10,380,853,327
(分配準備積立金)	2,624,539,959	2,489,004,463
元本等合計	14,953,795,408	16,214,019,027
<b>純資産合計</b>	<b>14,953,795,408</b>	<b>16,214,019,027</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>14,970,304,128</b>	<b>16,239,538,687</b>

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期中間計算期間 自 2021年 7月27日 至 2022年 1月26日	第13期中間計算期間 自 2022年 7月26日 至 2023年 1月25日
営業収益		
受取利息	300	75
有価証券売買等損益	74,822,296	84,881,605
営業収益合計	74,821,996	84,881,680
営業費用		
支払利息	14,980	21,106
受託者報酬	1,422,557	1,720,131
委託者報酬	8,535,284	10,320,726
その他費用	355,583	429,971
営業費用合計	10,328,404	12,491,934
営業利益又は営業損失（ ）	85,150,400	72,389,746
経常利益又は経常損失（ ）	85,150,400	72,389,746
中間純利益又は中間純損失（ ）	85,150,400	72,389,746
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	26,056,961	2,389,361
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	7,183,203,896	9,551,987,924
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,686,370,863	1,283,276,093
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,686,370,863	1,283,276,093
剰余金減少額又は欠損金増加額	602,100,321	524,411,075
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	602,100,321	524,411,075
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	8,156,267,077	10,380,853,327

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第12期 (2022年 7月25日現在)	第13期中間計算期間 (2023年 1月25日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	5,401,807,484口	5,833,165,700口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.7683円 (27,683円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.7796円 (27,796円)

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

	第13期中間計算期間 (2023年 1月25日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
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。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第12期	第13期中間計算期間
	自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日	自 2022年 7月26日 至 2023年 1月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,277,881,661円	5,401,807,484円
期中追加設定元本額	1,822,918,129円	727,884,979円
期中一部解約元本額	698,992,306円	296,526,763円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 日本株式マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2023年 1月25日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,113,486,181
株式	308,257,018,720
派生商品評価勘定	97,391,150
未収入金	3,720,650
未収配当金	516,269,916
差入委託証拠金	102,670,500
流動資産合計	311,090,557,117
資産合計	311,090,557,117
負債の部	
流動負債	



	2023年 1月25日現在
項目	金額（円）
前受金	97,402,700
未払解約金	210,811,806
未払利息	1,064
流動負債合計	308,215,570
負債合計	308,215,570
純資産の部	
元本等	
元本	135,039,599,146
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	175,742,742,401
元本等合計	310,782,341,547
純資産合計	310,782,341,547
負債純資産合計	311,090,557,117

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 1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	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)

	2023年 1月25日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	135,039,599,146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 2.3014円 (1万口当たり純資産額) (23,014円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 1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	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年 1月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月26日
期首元本額	135,440,792,758円
期中追加設定元本額	4,275,708,315円
期中一部解約元本額	4,676,901,927円
期末元本額	135,039,599,146円

区分	2023年 1月25日現在
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	609,521,439円
D C日本株式インデックスファンド	283,842,413円
D C日本株式インデックスファンドL	54,099,808,662円
D C日本株式インデックスファンドA	658,829,840円
D Cバランスファンド3 0	2,421,146,481円
D Cバランスファンド5 0	3,823,514,668円
D Cバランスファンド7 0	2,363,560,461円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	575,514,985円
日本株式インデックスe	1,437,353,281円
インデックスコレクション（国内株式）	21,999,452,108円
インデックスコレクション（バランス株式3 0）	12,410,417,123円
インデックスコレクション（バランス株式5 0）	3,099,106,096円
インデックスコレクション（バランス株式7 0）	2,879,092,845円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,732,534,441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）	2,714,363,607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）	772,399,270円
バランスVA3 0（適格機関投資家専用）	39,581,554円
バランスVA5 0（適格機関投資家専用）	458,903,752円
VAバランスファンド（株2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	56,117,818円
VAバランスファンド（株5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	122,832,479円
VAバランスファンド（株6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	47,522,098円
バランスVA2 5（適格機関投資家専用）	604,855,407円
バランスVA3 7 . 5（適格機関投資家専用）	391,293,253円
バランスVA5 0 L（適格機関投資家専用）	6,755,090,526円
バランスVA7 5（適格機関投資家専用）	635,032,221円
VAバランスファンド（株4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	58,543,108円
VAポートフォリオ4 0（適格機関投資家専用）	1,088,438,604円
VAポートフォリオ2 0（適格機関投資家専用）	21,963,797円
バランスVA4 0（適格機関投資家専用）	139,635,786円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,759,716,272円
VAバランスファンド2（株4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	47,683,872円
VAバランス5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	50,941,360円
VAファンド2 5（適格機関投資家専用）	15,642,450円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	513,876,652円
バランスVA2 5 L（適格機関投資家専用）	237,105,709円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	3,887,567,319円
世界バランスVA2 5（適格機関投資家専用）	78,233,390円
国内バランスVA3 0（適格機関投資家専用）	31,569,934円
国内バランスVA2 5（適格機関投資家専用）	7,677,578円
VAバランス2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	107,049,305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）	2,267,182円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2023年 1月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,238,407,300	-	2,335,810,000	97,402,700
	合計	2,238,407,300	-	2,335,810,000	97,402,700

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 日本債券マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2023年 1月25日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	249,936,392
国債証券	321,091,488,760
地方債証券	19,723,550,544
特殊債証券	21,994,916,596
社債券	16,679,990,000
未収利息	699,632,577
前払費用	16,523,818
流動資産合計	380,456,038,687
資産合計	380,456,038,687
負債の部	
流動負債	
未払金	1,124,523,450
未払解約金	151,305,611
未払利息	125
流動負債合計	1,275,829,186
負債合計	1,275,829,186
純資産の部	
元本等	
元本	289,514,806,732
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	89,665,402,769
元本等合計	379,180,209,501
純資産合計	379,180,209,501
負債純資産合計	380,456,038,687

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 1月25日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2023年 1月25日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	289,514,806,732口
2. 担保資産	<p>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。</p> <p>有価証券 99,516,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.3097円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,097円)</p>

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

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 1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

	2023年 1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	<p>売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## (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	2023年 1月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月26日
期首元本額	286,937,109,481円
期中追加設定元本額	10,817,402,718円
期中一部解約元本額	8,239,705,467円
期末元本額	289,514,806,732円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	782,267,804円
D C 日本債券インデックスファンド	1,922,866,654円
D C 日本債券インデックスファンド L	44,692,368,457円
D C バランスファンド 3 0	12,231,627,607円
D C バランスファンド 5 0	8,609,126,417円
D C バランスファンド 7 0	2,505,354,638円
日本債券インデックス e	1,063,903,026円
インデックスコレクション (国内債券)	37,596,658,869円
インデックスコレクション (バランス株式 3 0)	63,000,373,915円
インデックスコレクション (バランス株式 5 0)	7,032,775,886円
インデックスコレクション (バランス株式 7 0)	3,048,681,207円
私募日本債券パッシブファンド (適格機関投資家専用)	51,565,475,065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)	4,457,312,968円

区分	2023年 1月25日現在
バランスVA30（適格機関投資家専用）	152,143,142円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	748,900,705円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	110,339,178円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	79,115,043円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	121,101,164円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	2,666,937,118円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	953,573,505円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	10,928,483,175円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	129,048,645円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	248,259,716円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	2,767,480,846円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	148,956,243円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	338,373,432円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,929,264,806円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	323,219,718円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	776,965,469円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	53,022,542円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	2,892,784,948円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	1,339,842,326円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	22,158,467,002円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	430,641,695円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	123,783,577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）	544,129,320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）	3,001,032円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月25日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	9,637,390,656
コール・ローン	1,123,526,051
株式	327,492,882,697
投資信託受益証券	133,002,263
投資証券	7,680,320,951

	2023年 1月25日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	277,859,364
未収入金	23,432,035
未収配当金	261,614,338
差入委託証拠金	3,552,981,847
流動資産合計	350,183,010,202
資産合計	350,183,010,202
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,973,276
前受金	277,657,359
未払解約金	49,506,108
未払利息	566
流動負債合計	338,137,309
負債合計	338,137,309
純資産の部	
元本等	
元本	76,778,591,222
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	273,066,281,671
元本等合計	349,844,872,893
純資産合計	349,844,872,893
負債純資産合計	350,183,010,202

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月25日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p>



2023年 1月25日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2023年 1月25日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	76,778,591,222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 4.5565円 (1万口当たり純資産額) (45,565円)

## (金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 1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	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年 1月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月26日
期首元本額	74,737,903,542円
期中追加設定元本額	4,212,227,332円
期中一部解約元本額	2,171,539,652円
期末元本額	76,778,591,222円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,486,879,007円
DC外国株式インデックスファンド	5,053,254,740円
DC外国株式インデックスファンドL	28,025,693,097円

区分	2023年 1月25日現在
DCバランスファンド30	618,436,478円
DCバランスファンド50	1,260,148,586円
DCバランスファンド70	856,535,323円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	280,306,662円
外国株式インデックスe	4,592,294,793円
インデックスコレクション（外国株式）	16,615,355,098円
インデックスコレクション（バランス株式30）	3,189,036,522円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,021,192,868円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,055,844,437円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,241,396,670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）	1,441,690,416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）	368,725,506円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	18,855,934円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	219,591,501円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	28,182,112円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	61,677,719円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	119,285,558円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	202,721,126円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	166,490,125円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	3,260,312,312円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	353,108,185円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	88,166,463円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	546,513,366円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	11,030,021円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	67,320,867円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	71,156,257円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	229,518,020円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	7,853,642円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	54,562,738円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	160,406,272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）	5,048,801円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 1月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	14,944,216,995	-	15,221,874,354	277,657,359
合計		14,944,216,995	-	15,221,874,354	277,657,359

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2023年 1月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,784,705,072	-	1,773,933,801	10,771,271
	アメリカドル	1,375,564,300	-	1,365,113,595	10,450,705
	カナダドル	51,652,157	-	51,651,256	901
	ユーロ	248,397,295	-	248,140,010	257,285
	イギリスポンド	48,120,540	-	48,077,460	43,080
	スイスフラン	22,635,280	-	22,616,880	18,400
	スウェーデンクローナ	38,335,500	-	38,334,600	900
合計		1,784,705,072	-	1,773,933,801	10,771,271

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国債券マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年 1月25日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	124,225,814
コール・ローン	1,965,762,052
国債証券	146,676,961,535
派生商品評価勘定	39,972,670
未収入金	41,942
未収利息	1,043,149,979
前払費用	50,792,171
差入委託証拠金	124,339,218

	2023年 1月25日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	150,025,245,381
資産合計	150,025,245,381
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,357,130
前受金	12,855,861
未払金	710,952
未払解約金	60,802,946
未払利息	990
流動負債合計	80,727,879
負債合計	80,727,879
純資産の部	
元本等	
元本	57,376,910,224
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	92,567,607,278
元本等合計	149,944,517,502
純資産合計	149,944,517,502
負債純資産合計	150,025,245,381

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月25日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

2023年 1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)

2023年 1月25日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	57,376,910,224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 2.6133円 (1万口当たり純資産額) (26,133円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2023年 1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。

	2023年 1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。

## （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	2023年 1月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月26日
期首元本額	57,470,888,861円
期中追加設定元本額	2,822,107,797円
期中一部解約元本額	2,916,086,434円
期末元本額	57,376,910,224円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	1,970,027,713円
DC外国債券インデックスファンド	1,895,276,438円
DC外国債券インデックスファンドL	14,615,666,139円
DCバランスファンド30	947,155,864円
DCバランスファンド50	982,877,911円
DCバランスファンド70	234,296,305円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	479,333,682円
外国債券インデックスe	1,029,583,030円
インデックスコレクション（外国債券）	9,210,324,221円
インデックスコレクション（バランス株式30）	4,803,027,141円
インデックスコレクション（バランス株式50）	827,264,514円
インデックスコレクション（バランス株式70）	273,275,928円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	4,889,806,327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）	2,996,735,705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）	356,956,746円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	77,549,093円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	371,906,401円

区分	2023年 1月25日現在
V Aバランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	230,965,273円
V Aバランスファンド（株 5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	168,495,470円
V Aバランスファンド（株 6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	101,762,004円
バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	1,156,382,471円
バランスV A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	516,723,534円
バランスV A 5 0 L（適格機関投資家専用）	5,482,029,304円
バランスV A 7 5（適格機関投資家専用）	292,566,376円
V Aバランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	175,621,639円
V Aポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	1,399,588,887円
V Aポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	75,317,526円
バランスV A 4 0（適格機関投資家専用）	168,905,717円
V Aバランスファンド 2（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	81,736,888円
V Aバランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	43,663,677円
V Aファンド 2 5（適格機関投資家専用）	53,630,984円
バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用）	200,749,064円
世界バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	63,239,863円
V Aバランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	1,192,489,689円
私募外国債券インデックスファンド A L（適格機関投資家専用）	11,978,700円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 債券関連

（2023年 1月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,950,151,730	-	1,963,007,591	12,855,861
	合計	1,950,151,730	-	1,963,007,591	12,855,861

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

（2023年 1月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		



市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	2,187,803,093	-	2,208,562,772	20,759,679
	アメリカドル	1,116,365,106	-	1,126,067,594	9,702,488
	カナダドル	86,705,116	-	87,497,190	792,074
	ユーロ	782,445,253	-	790,889,112	8,443,859
	イギリスポンド	111,970,877	-	113,783,322	1,812,445
	オフショア人民元	90,316,741	-	90,325,554	8,813
	合計	2,187,803,093	-	2,208,562,772	20,759,679

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【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】

(2023年 2月28日現在)

資産総額	142,350,774,570円
負債総額	104,891,471円
純資産総額（ - ）	142,245,883,099円
発行済口数	83,070,983,156口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7123円
（1万口当たり純資産額）	（17,123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】

(2023年 2月28日現在)

資産総額	27,285,055,637円
負債総額	10,217,587円
純資産総額（ - ）	27,274,838,050円
発行済口数	12,188,701,303口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2377円
（1万口当たり純資産額）	（22,377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】

(2023年 2月28日現在)

資産総額	18,871,980,964円
負債総額	15,274,005円
純資産総額（ - ）	18,856,706,959円
発行済口数	6,686,109,202口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8203円
（1万口当たり純資産額）	（28,203円）

(参考)

## 日本株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2023年 2月28日現在)

資産総額	314,142,281,036円
負債総額	196,320,123円
純資産総額（ - ）	313,945,960,913円
発行済口数	135,490,779,932口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3171円
（1万口当たり純資産額）	（23,171円）

## 日本債券マザーファンド

## 純資産額計算書

(2023年 2月28日現在)

資産総額	398,105,214,127円
負債総額	13,636,784,669円
純資産総額（ - ）	384,468,429,458円
発行済口数	292,276,848,080口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3154円
（1万口当たり純資産額）	（13,154円）

## 外国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2023年 2月28日現在)

資産総額	363,897,313,840円
負債総額	267,222,226円
純資産総額（ - ）	363,630,091,614円
発行済口数	77,029,927,166口
1口当たり純資産額（ / ）	4.7206円
（1万口当たり純資産額）	（47,206円）

## 外国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

(2023年 2月28日現在)

資産総額	151,958,690,986円
負債総額	70,031,129円
純資産総額（ - ）	151,888,659,857円
発行済口数	57,826,734,182口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6266円
（1万口当たり純資産額）	（26,266円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

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

###### 受益権の譲渡

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

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、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、

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

###### 受益権の譲渡の対抗要件

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

###### 受益権の再分割

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

###### 償還金

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

則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2023年 2月28日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ DO（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2023年 4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。

2023年2月28日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	535	14,367,379
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	68	210,009
単位型公社債投資信託	53	181,820
合計	656	14,759,208

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期事業年度（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。

また、第37期事業年度の中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	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
<b>評価・換算差額等</b>		
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	当事業年度
	（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	（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44-21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いません。

（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、

（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・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファ



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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針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。

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

#### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それら的一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

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

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

## 2. 金融商品の時価等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	投資有価証券 関係会社株式				
	米ドル		3,993	-	57	
	英ポンド		3,108	-	15	
	カナダドル		3	-	0	
	スイスフラン		57	-	0	
	香港ドル		110	-	1	
	ユーロ		108	-	0	
	人民元		6	-	0	
	買建					
	米ドル		38	-	0	
	香港ドル		3	-	0	
	人民元		1	-	0	
	合計		7,431	-	73	

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	
	英ポンド	277	-	1	
	カナダドル	111	-	1	
	スイスフラン	139	-	2	
	香港ドル	190	-	1	
	ユーロ	676	-	18	
	買建				
	ユーロ	21	-	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	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		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せん。

## 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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(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(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,365	未収運用受託報酬	5,402
							投信販売代行手数料等	9,124	未払手数料	1,888

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

## 運用受託報酬

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

## 投信販売代行手数料等

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

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(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	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

## 運用受託報酬

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

## 投信販売代行手数料等

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

## (エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

前事業年度（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。

#### 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022年9月30日)

#### 資産の部

##### 流動資産

現金及び預金		21,051
金銭の信託		13,989
未収委託者報酬		9,325
未収運用受託報酬		5,831
短期差入証拠金		4,507
その他		3,041
流動資産合計		57,747

##### 固定資産

有形固定資産	1	895
無形固定資産		6,915
投資その他の資産		
投資有価証券		4,202
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,228
その他		31
投資その他の資産合計		11,098

固定資産合計		18,909
--------	--	--------

資産合計		76,657
------	--	--------

#### 負債の部

##### 流動負債

未払金		7,649
未払法人税等		1,537
賞与引当金		321
その他	2	2,111
流動負債合計		11,619

##### 固定負債

退職給付引当金		871
---------	--	-----

資産除去債務	153
その他	20
固定負債合計	1,045
負債合計	12,665

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022年9月30日)

純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	42,655
利益剰余金合計	45,255
株主資本合計	64,494
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	278
繰延ヘッジ損益	780
評価・換算差額等合計	502
純資産合計	63,992
負債・純資産合計	76,657

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

第37期中間会計期間

(自 2022年4月1日

至 2022年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		20,422
運用受託報酬		5,485
その他営業収益		178
営業収益合計		26,086
営業費用		15,618
一般管理費	1	6,047
営業利益		4,421
営業外収益	2	2,365
営業外費用	3	1,945
経常利益		4,840
税引前中間純利益		4,840
法人税、住民税及び事業税		1,402
法人税等調整額		90

法人税等合計	1,492
中間純利益	3,347

## 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当中間期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
中間純利益			3,347	3,347	3,347
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	706	706	706
当中間期末残高	500	2,100	42,655	45,255	64,494

	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	941	509	431	64,219
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,641
中間純利益				3,347
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	663	270	933	933
当中間期変動額合計	663	270	933	227
当中間期末残高	278	780	502	63,992

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 第37期中間会計期間

(自 2022年4月1日

至 2022年9月30日)

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## (1) 有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

時価法によっております。

## (3) 金銭の信託

時価法によっております。

## 2. 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。

## 3. 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中間会計期間の負担額を計上しております。

## (2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

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

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間会計期間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。

## 4. 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。

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(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。

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

第37期中間会計期間  
(自 2022年4月1日  
至 2022年9月30日)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「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。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる中間財務諸表への影響はありません。

(追加情報)

第37期中間会計期間  
(自 2022年4月1日  
至 2022年9月30日)

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の適用

当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、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については、「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。以下、「実務対応報告第42号」という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項（1）に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

## （表示方法の変更）

第37期中間会計期間  
（自 2022年4月1日  
至 2022年9月30日）

従来「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。

## （中間貸借対照表関係）

第37期中間会計期間末  
（2022年9月30日）

- |   |  |        |
|---|--|--------|
| 1 | 有形固定資産の減価償却累計額                               | 777百万円 |
| 2 | 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。 |        |

## （中間損益計算書関係）

第37期中間会計期間  
（自 2022年4月1日  
至 2022年9月30日）

- |   |            |          |
|---|------------|----------|
| 1 | 減価償却実施額    |          |
|   | 有形固定資産     | 95百万円    |
|   | 無形固定資産     | 608百万円   |
| 2 | 営業外収益の主要項目 |          |
|   | デリバティブ利益   | 2,027百万円 |
|   | 投資有価証券売却益  | 317百万円   |
| 3 | 営業外費用の主要項目 |          |
|   | 為替差損       | 1,011百万円 |
|   | 金銭の信託運用損   | 904百万円   |

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

## 1. 発行済株式に関する事項

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

## 2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

### 3. 配当に関する事項

#### (1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの  
該当事項はありません。

#### (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)

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「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）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、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順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

#### (1) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区分	中間貸借対照表計上額（百万円）(*1)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	952	12,129	-	13,081
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,978	-	3,978
資産計	952	16,107	-	17,060
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	804	(0)	-	804
ヘッジ会計が適用されているもの	-	22	-	22
デリバティブ取引計	804	21	-	826

(\*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)金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額908百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は13,989百万円であります。

(\*3)投資有価証券のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額223百万円）は上記に含めておりません。

(\*4)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

（2）時価をもって中間貸借対照表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、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。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。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、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中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

（有価証券関係）

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額	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	2,657	1,966	690
小計	2,657	1,966	690

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,321	1,615	293
小計	1,321	1,615	293
合計	3,978	3,581	397

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額0百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額223百万円）は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	6,412	-	5	5
	英ポンド	250	-	1	1
	カナダドル	111	-	1	1
	スイスフラン	164	-	1	1
	香港ドル	219	-	0	0
	ユーロ	721	-	0	0
	買建				
	米ドル	259	-	0	0
香港ドル	2	-	0	0	
合計		8,141	-	0	0

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	13,818	-	804	804
合計		13,818	-	804	804

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

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

原則的 処理方法	為替予約取引	投資有価証券 関係会社株式			
	売建				
	米ドル		3,036	-	2
	英ポンド		3,333	-	19
	スイスフラン		70	-	0
	香港ドル		87	-	0
	ユーロ		82	-	0
	買建				
	米ドル		93	-	0
	英ポンド		77	-	2
	スイスフラン		53	-	0
	香港ドル		3	-	0
	ユーロ		60	-	1
	合計		6,898	-	22

（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）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針4．収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末にお

いて存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報  
重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

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

[関連情報]

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,950百万円

## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
1株当たり純資産額	21,330,712円74銭
1株当たり中間純利益	1,115,947円92銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
中間純利益	3,347百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	3,347百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

## 4【利害関係人との取引制限】

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

## (1)自己又はその役員との取引

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

## (2)運用財産相互間の取引

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

## (3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業

者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2023年4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

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2022年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （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

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2022年3月末日現在）

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

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

### 第3【その他】

- (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- (3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用すること

があります。

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

**独立監査人の監査報告書**

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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

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 公認会計士 後藤知弘 印  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、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드는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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

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 公認会計士 後藤知弘 印  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、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드는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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、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드는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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2022年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

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



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

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2023年4月6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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式30）の2022年7月26日から2023年1月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、インデックスコレクション（バランス株式30）の2023年1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中間計算期間（2022年7月26日から2023年1月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2023年4月6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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式50）の2022年7月26日から2023年1月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、インデックスコレクション（バランス株式50）の2023年1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中間計算期間（2022年7月26日から2023年1月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2023年4月6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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式70）の2022年7月26日から2023年1月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、インデックスコレクション（バランス株式70）の2023年1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中間計算期間（2022年7月26日から2023年1月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。