

## 【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】	2024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】	北添 道生
【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】

2024年 4月26日から2024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、当該時間を過ぎた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）有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融

商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。)をいいます。以下同じ。)における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付けを中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### <ファンドの目的>

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

###### <信託金限度額>

各ファンドについて、1兆円を上限とします。

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

###### <基本的性格>

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

##### 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	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	年1回	グローバル	ファミリー ファンド	あり ( )	日経225	ブル・ベア型
大型株 中小型株	年2回	(日本を 含む)	ファンド・ オブ・ファ ンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
債券 一般	年4回	日本			その他 ( )	ロング・ ショート型/ 絶対収益追求 型
公債 社債	年6回 (隔月)	北米				
その他債券 クレジット属 性 ( )	年12回 (毎月)	欧州				その他 ( )
不動産投信	日々	アジア				
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 ( )	オセアニア				
資産複合 ( )		中南米				
資産配分 固定型		アフリカ				
資産配分 変更型		中近東 (中東)				
		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、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

#### < 商品分類表定義 >

[ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

#### [ 投資対象地域による区分 ]

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

#### [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

#### [ 独立した区分 ]

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

#### [ 補足分類 ]

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

#### < 属性区分表定義 >

#### [ 投資対象資産による属性区分 ]

- (1)株式  
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。

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

< ファンドの特色 >

## 資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

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

## 国内外の株式・公社債へ分散投資します。

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



基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設けます。

### <投資対象とするマザーファンド>

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

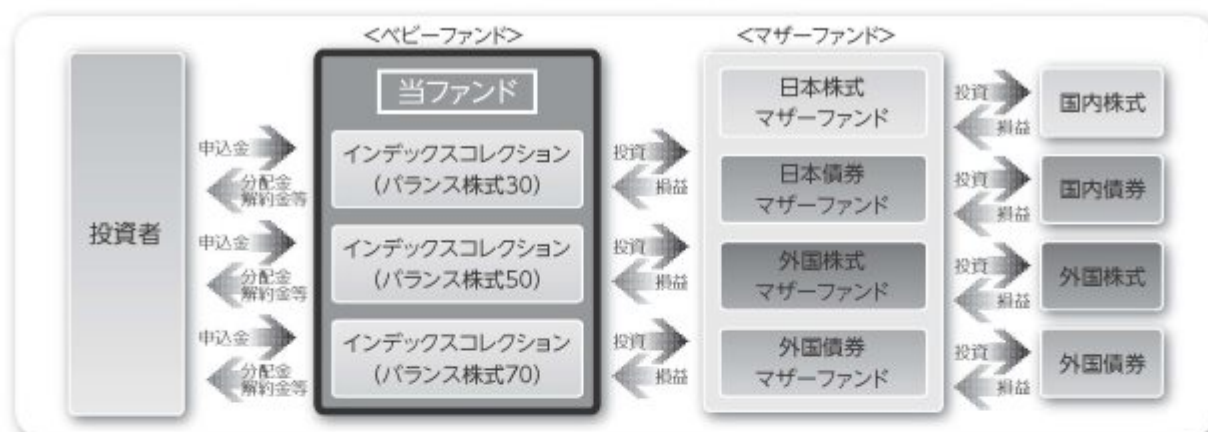
ファンドマネジャーは各ファンドの基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※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指数です。TOPIX(東証株価指数)(配当込み)(以下、「配当込みTOPIX」という。)の指数値及び配当込みTOPIXに係る標準又は商標は、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、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、配当込みTOPIX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、円換算ベース)】

「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。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。MSCIコクサイ・インデックス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MSCIコクサイ・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

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

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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2010年10月20日

信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

2012年4月1日

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

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

当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンドの名称を日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンドの名称を外国株式マザーファンド、中央三井外国債券マザーファンドの名称を外国債券マザーファンドに変更

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



## 委託会社の概況（2024年 2月29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。）

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を指図ができます。

### （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。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引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価格変動リスク回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引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価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）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（配当込み、円換算ベース）に採用されている国の株式に投資を行い、同指数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。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引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、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

### 3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

## 「外国債券マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引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、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）を行使したものに限ることとし、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

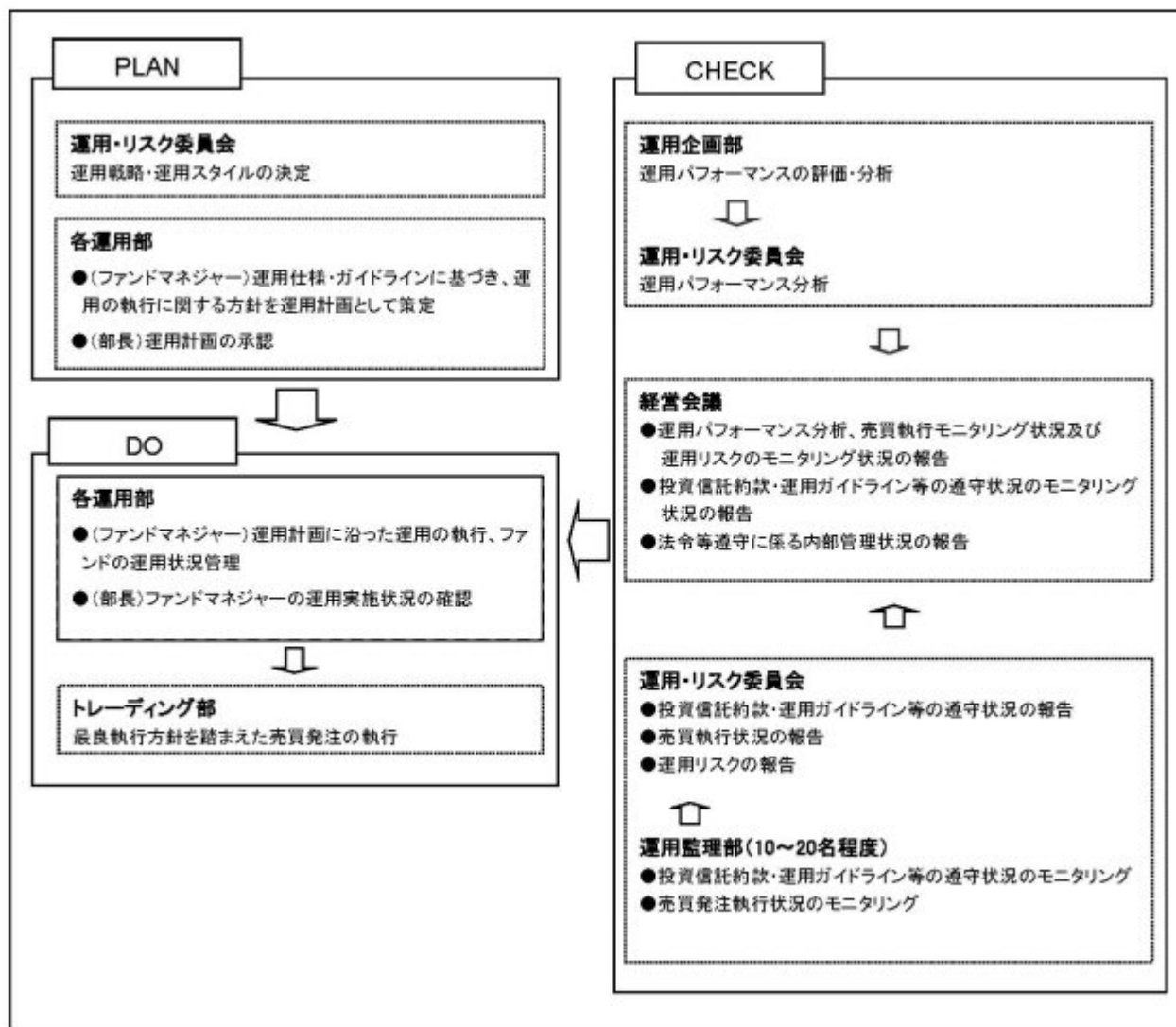
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

#### （3）【運用体制】

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



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

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

#### (4) 【分配方針】

年1回の毎決算時（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）で金融商品取引所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て、ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

資することを指図することができるものとします。

#### I．信用取引の指図範囲

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

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

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

#### J．先物取引等の運用指図

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

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

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

#### K．スワップ取引の運用指図

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

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

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

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

#### L．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

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

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

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

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

#### M．有価証券の貸付の指図及び範囲

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

a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価

合計額を超えないものとします。

- b. 公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ロ. 信託財産の一部解約等の事由により、上記イ. a. 及びb. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ. 委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めたときは、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ロ. の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- ロ. 上記イ. の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ. 信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ. の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- O. 公社債の借入れの指図及び範囲
- イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ. 上記イ. の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ. 信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ. の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ニ. 上記イ. の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- P. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- Q. 外国為替予約取引の指図
- イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- ロ. 上記イ. の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ハ. 信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- R. 一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図
- 委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。
- S. 再投資の指図



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

#### T. 資金の借入れ

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

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

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

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ます。受託会社は、委託会社の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。

二. 上記イ.からハ.までの場合、委託会社及び受託会社は、受益者に対して信託法第31条第3項

及び同法第32条第3項の通知は行いません。

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。

##### 有価証券の貸付等に係るリスク

有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産などにより決済が不履行となるリスクがあります。貸付契約が不履行となった場合、担保金による有価証券の買戻しの際、時価変動の影響から損失を被り、基準価額の下落要因となる可能性があります。

##### 流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が

低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

#### カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

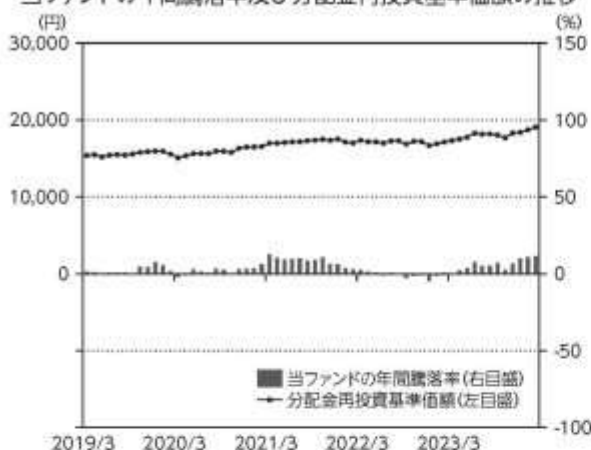
##### 委託会社におけるリスク管理体制

- ・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。

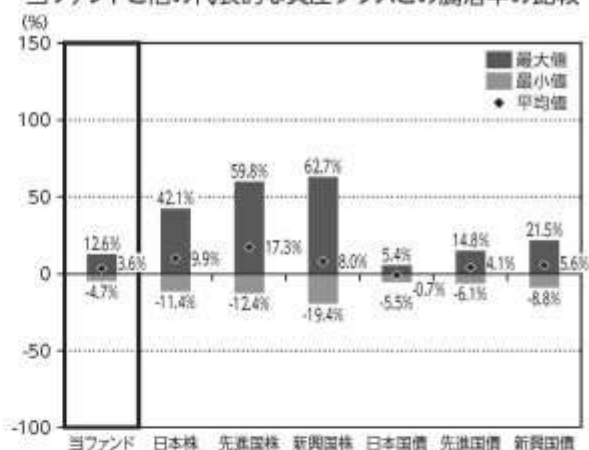
## 【参考情報】

## 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

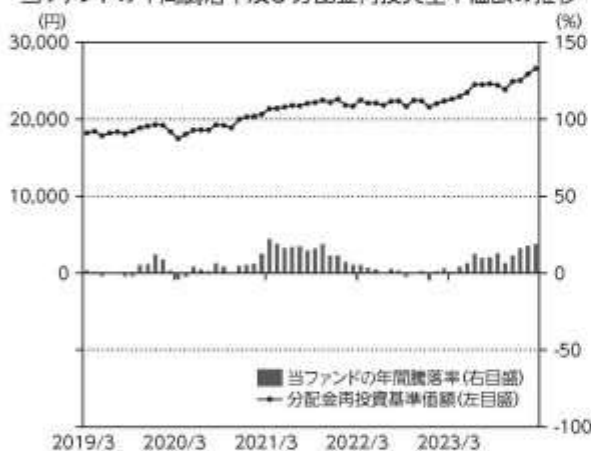


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

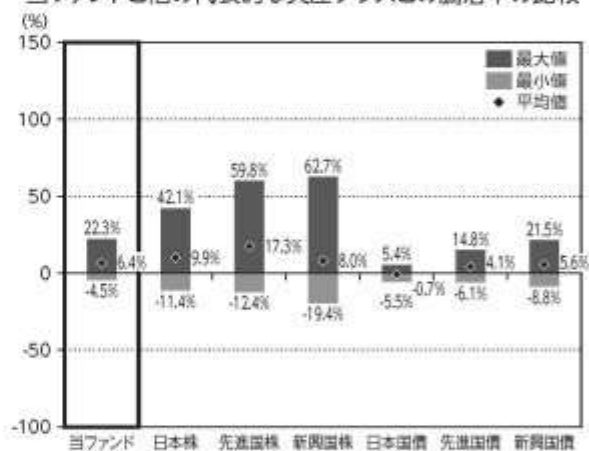


## インデックスコレクション(バランス株式50)

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

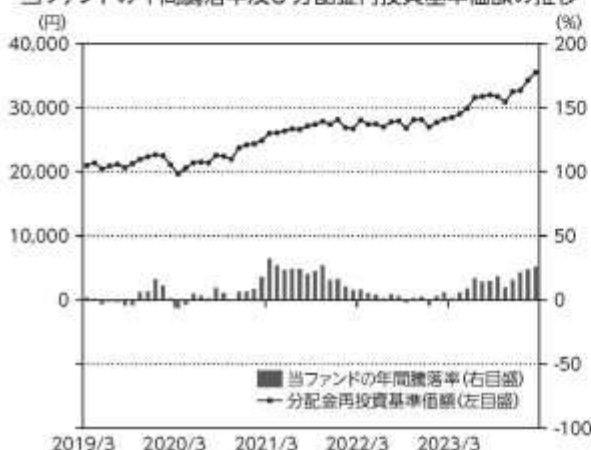


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

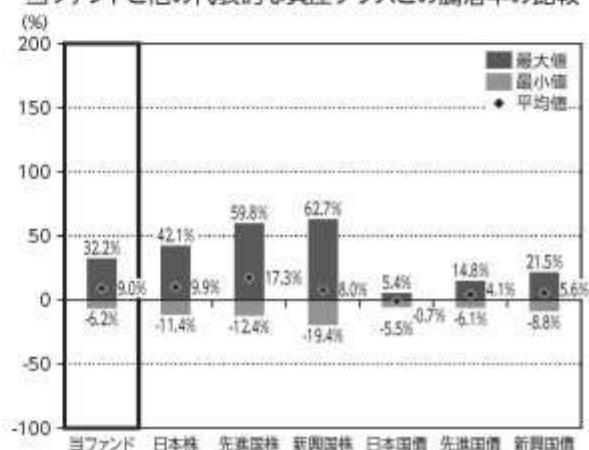


## インデックスコレクション(バランス株式70)

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。
- \*2019年3月～2024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JPMリサーチ＆コンサルティングが算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、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標準又は商標は、株式会社JPMリサーチ＆コンサルティングの関連会社(以下「JPM」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準又は商標に関するすべての権利はJPMが有します。JPMは、同指数の指数値の算出又は公表の遅延、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPM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JPMは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・ インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村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債・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が、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、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPMリサーチ＆コンサルティング・ 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)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

ありません。

### (2)【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

### (3)【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

イ．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（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。

ロ．有価証券の貸付の指図を行った場合は、ファンドの品貸料及びマザーファンドの品貸料のうちファンドに属するとみなした額に50%未満の率（ ）を乗じて得た額

2024年4月26日現在、合計で49.5%（税抜45%）以内とし、その配分は委託会社29.7%（税抜27%）、受託会社19.8%（税抜18%）です。（品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

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、2024年2月29日現在のものでありますので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

#### （参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
インデックスコレクション (バランス株式30)	0.16%	0.15%	0.01%
インデックスコレクション (バランス株式50)	0.16%	0.15%	0.01%
インデックスコレクション (バランス株式70)	0.16%	0.15%	0.01%

※対象期間は2022年7月26日～2023年7月25日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 5【運用状況】

以下は、2024年2月29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	164,279,845,915	99.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		622,455,740	0.38
合計(純資産総額)		164,902,301,655	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	74,396,085,675	1.3309	99,014,076,362	1.3059	97,153,848,282	58.92
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	10,588,699,991	2.6957	28,543,958,566	3.1902	33,780,070,711	20.48
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	2,636,276,177	5.5246	14,564,371,368	6.4873	17,102,314,443	10.37
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	5,377,433,204	2.8248	15,190,173,315	3.0207	16,243,612,479	9.85

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.62
合計	99.62

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

#### 【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
第13期計算期間末	(2023年 7月25日)	154,275,276,866	154,275,276,866	18,231	18,231
	2023年 2月末日	142,245,883,099		17,123	
	3月末日	145,524,487,559		17,331	
	4月末日	147,826,526,015		17,514	
	5月末日	150,174,459,974		17,762	
	6月末日	155,008,205,308		18,281	
	7月末日	154,443,155,524		18,154	
	8月末日	154,939,903,004		18,174	
	9月末日	154,158,457,612		18,041	
	10月末日	151,538,845,910		17,696	
	11月末日	157,099,092,186		18,310	
	12月末日	158,125,411,897		18,381	
	2024年 1月末日	161,386,315,759		18,732	
	2月末日	164,902,301,655		19,066	

#### 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
--	-----	---------------



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
第13期計算期間	2022年 7月26日～2023年 7月25日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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期計算期間	2022年 7月26日～2023年 7月25日	5.7
第14期中間計算期間	2023年 7月26日～2024年 1月25日	2.4

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配)から前計算期間末の基準価額(分配)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配)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期計算期間	2022年 7月26日～2023年 7月25日	9,635,639,646	4,720,461,836	84,620,917,505
第14期中間計算期間	2023年 7月26日～2024年 1月25日	3,881,831,456	2,723,656,139	85,779,092,822

(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	36,926,341,942	99.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		174,061,409	0.47
合計(純資産総額)		37,100,403,351	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	11,034,195,850	1.3274	14,647,283,598	1.3059	14,409,556,360	38.84
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	3,548,405,881	2.7200	9,651,707,616	3.1902	11,320,124,441	30.51
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	1,165,830,022	5.5721	6,496,123,793	6.4873	7,563,089,101	20.39
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	1,202,890,734	2.8364	3,411,957,772	3.0207	3,633,572,040	9.79

(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	99.53
合計	99.53

(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
第13期計算期間末	(2023年 7月25日)	31,075,058,212	31,075,058,212	24,503	24,503
	2023年 2月末日	27,274,838,050		22,377	
	3月末日	28,046,825,232		22,615	
	4月末日	28,683,750,417		22,964	
	5月末日	29,513,411,096		23,484	
	6月末日	31,088,989,054		24,520	
	7月末日	31,287,386,912		24,500	
	8月末日	31,635,848,412		24,616	
	9月末日	31,608,351,695		24,423	
	10月末日	31,073,649,382		23,879	
	11月末日	32,593,070,165		24,923	
	12月末日	32,986,763,805		25,039	
	2024年 1月末日	34,312,363,690		25,897	
	2月末日	37,100,403,351		26,594	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
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
第13期計算期間	2022年 7月26日～2023年 7月25日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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期計算期間	2022年 7月26日～2023年 7月25日	10.0

第14期中間計算期間	2023年 7月26日～2024年 1月25日	5.1
------------	-------------------------	-----

(注1)収益率は、各計算期間末の基準価額(分配)から前計算期間末の基準価額(分配)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配)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期計算期間	2022年 7月26日～2023年 7月25日	3,440,793,433	665,483,939	12,682,349,662
第14期中間計算期間	2023年 7月26日～2024年 1月25日	936,450,118	447,843,692	13,170,956,088

(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	28,306,755,453	99.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		105,671,299	0.37
合計(純資産総額)		28,412,426,752	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	3,626,645,628	2.7166	9,852,439,388	3.1902	11,569,724,882	40.72
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	1,344,341,862	5.5616	7,476,744,691	6.4873	8,721,148,961	30.69
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	5,234,369,415	1.3267	6,944,706,448	1.3059	6,835,563,019	24.06
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	390,743,401	2.8374	1,108,725,029	3.0207	1,180,318,591	4.15

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
----	---------

親投資信託受益証券	99.63
合計	99.63

(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
第13期計算期間末	(2023年 7月25日)	22,409,858,821	22,409,858,821	31,644	31,644
	2023年 2月末日	18,856,706,959		28,203	
	3月末日	19,407,232,997		28,462	
	4月末日	20,055,542,983		29,032	
	5月末日	20,798,652,245		29,895	
	6月末日	22,311,252,031		31,588	
	7月末日	22,642,484,109		31,772	
	8月末日	23,070,904,634		31,976	
	9月末日	23,116,880,955		31,729	
	10月末日	22,673,351,703		30,892	
	11月末日	23,957,349,990		32,507	
	12月末日	24,430,142,391		32,685	
	2024年 1月末日	25,943,090,799		34,283	
	2月末日	28,412,426,752		35,516	

#### 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
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
第13期計算期間	2022年 7月26日～2023年 7月25日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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期計算期間	2022年 7月26日～2023年 7月25日	14.3
第14期中間計算期間	2023年 7月26日～2024年 1月25日	7.6

(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期計算期間	2022年 7月26日～2023年 7月25日	2,386,770,370	706,798,835	7,081,779,019
第14期中間計算期間	2023年 7月26日～2024年 1月25日	866,186,986	429,380,607	7,518,585,398

(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	413,373,865,730	98.66
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,630,690,128	1.34
合計(純資産総額)		419,004,555,858	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	5,362,000,000	1.28

(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	5,991,200	2,982.00	17,865,758,400	3,621.00	21,694,135,200	5.18
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,544,300	1,308.00	8,559,944,400	1,542.00	10,091,310,600	2.41
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	771,800	14,800.00	11,422,640,000	12,945.00	9,990,951,000	2.38
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	230,900	28,700.00	6,626,830,000	36,870.00	8,513,283,000	2.03
日本	株式	キーエンス	電気機器	109,200	66,720.00	7,285,824,000	70,040.00	7,648,368,000	1.83
日本	株式	三菱商事	卸売業	2,214,600	2,602.50	5,763,496,500	3,205.00	7,097,793,000	1.69
日本	株式	日立製作所	電気機器	529,600	11,425.00	6,050,680,000	12,665.00	6,707,384,000	1.60
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	764,000	7,373.00	5,632,972,000	8,344.00	6,374,816,000	1.52
日本	株式	信越化学工業	化学	979,200	5,872.00	5,749,862,400	6,387.00	6,254,150,400	1.49
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	32,551,000	191.20	6,223,751,200	182.30	5,934,047,300	1.42
日本	株式	任天堂	その他製品	688,900	8,103.00	5,582,156,700	8,400.00	5,786,760,000	1.38
日本	株式	三井物産	卸売業	869,800	5,978.00	5,199,664,400	6,553.00	5,699,799,400	1.36
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	776,000	6,647.00	5,158,072,000	6,516.00	5,056,416,000	1.21
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	830,400	6,149.00	5,106,129,600	6,044.00	5,018,937,600	1.20
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	539,800	6,723.00	3,629,075,400	8,790.00	4,744,842,000	1.13
日本	株式	第一三共	医薬品	953,300	4,392.00	4,186,893,600	4,974.00	4,741,714,200	1.13
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,660,800	1,610.00	4,283,888,000	1,782.00	4,741,545,600	1.13
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,062,200	3,831.00	4,069,288,200	4,376.00	4,648,187,200	1.11
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	968,500	4,381.00	4,242,998,500	4,387.00	4,248,809,500	1.01
日本	株式	HOYA	精密機器	214,800	18,590.00	3,993,132,000	19,485.00	4,185,378,000	1.00
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,450,500	2,587.50	3,753,168,750	2,801.00	4,062,850,500	0.97

日本	株式	KDDI	情報・通信業	845,600	5,070.00	4,287,192,000	4,554.00	3,850,862,400	0.92
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,760,900	1,990.50	3,505,071,450	1,972.50	3,473,375,250	0.83
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	593,600	5,593.00	3,320,004,800	5,363.00	3,183,476,800	0.76
日本	株式	村田製作所	電気機器	992,700	3,051.00	3,028,727,700	3,023.00	3,000,932,100	0.72
日本	株式	S M C	機械	33,000	85,390.00	2,817,870,000	90,150.00	2,974,950,000	0.71
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,226,600	2,208.50	2,708,946,100	2,381.50	2,921,147,900	0.70
日本	株式	ダイキン工業	機械	131,600	24,560.00	3,232,096,000	21,175.00	2,786,630,000	0.67
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	1,193,700	1,930.33	2,304,238,900	2,230.00	2,661,951,000	0.64
日本	株式	ディスコ	機械	53,100	41,070.00	2,180,817,000	48,260.00	2,562,606,000	0.61

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	0.08
		鉱業	0.30
		建設業	1.97
		食料品	3.07
		繊維製品	0.34
		パルプ・紙	0.15
		化学	5.68
		医薬品	4.43
		石油・石炭製品	0.47
		ゴム製品	0.68
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.95
		非鉄金属	0.66
		金属製品	0.52
		機械	5.40
		電気機器	17.25
		輸送用機器	9.26
		精密機器	2.31
		その他製品	2.31
		電気・ガス業	1.28
		陸運業	2.55
		海運業	0.82
		空運業	0.41
倉庫・運輸関連業	0.13		
情報・通信業	7.43		
卸売業	7.22		
小売業	4.11		
銀行業	7.21		



	証券、商品先物取引業	0.88
	保険業	2.56
	その他金融業	1.16
	不動産業	1.87
	サービス業	4.49
	小計	98.66
合計		98.66

(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	東証株価指数先物	買建	200円		5,196,279,850	5,362,000,000	1.28

(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	350,835,101,160	84.64
地方債証券	日本	21,307,763,521	5.14
特殊債券	日本	21,995,076,560	5.31
	国際機関	199,602,000	0.05
	小計	22,194,678,560	5.35
社債券	日本	18,053,389,000	4.36
	フランス	797,325,000	0.19
	韓国	99,507,000	0.02
	小計	18,950,221,000	4.57
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,219,248,680	0.29
合計(純資産総額)		414,507,012,921	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### 投資資産

##### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
--------	----	-----	----	------------	------------	-----------	-----------	--------	------	----------

日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	4,465,000,000	97.16	4,338,410,850	96.70	4,317,833,600	0.100	2031/12/20	1.04
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	4,395,000,000	97.14	4,269,579,450	96.74	4,251,898,800	0.200	2032/9/20	1.03
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	4,150,000,000	99.76	4,140,113,000	99.21	4,117,588,500	0.100	2028/3/20	0.99
日本	国債証券	第452回利付国債(2年)	3,720,000,000	100.04	3,721,488,000	99.82	3,713,564,400	0.005	2025/9/1	0.90
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	3,676,000,000	99.22	3,647,445,600	98.84	3,633,505,440	0.500	2033/3/20	0.88
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	3,718,000,000	97.62	3,629,644,680	97.26	3,616,238,340	0.200	2032/3/20	0.87
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	3,675,000,000	98.46	3,618,467,600	97.95	3,599,956,500	0.100	2030/9/20	0.87
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	3,460,000,000	100.22	3,467,636,500	99.78	3,452,491,800	0.100	2026/9/20	0.83
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	3,555,000,000	97.44	3,464,169,750	96.94	3,446,430,300	0.100	2031/9/20	0.83
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	3,455,000,000	100.20	3,462,048,200	99.71	3,445,015,050	0.100	2027/3/20	0.83
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	3,440,000,000	98.16	3,376,979,200	97.72	3,361,568,000	0.400	2033/6/20	0.81
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	3,415,000,000	97.73	3,337,684,400	97.24	3,321,053,350	0.100	2031/6/20	0.80
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	3,260,000,000	100.21	3,266,846,000	99.74	3,251,784,800	0.100	2026/12/20	0.78
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	3,190,000,000	101.64	3,242,316,000	101.12	3,225,791,800	0.800	2033/9/20	0.78
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	3,260,000,000	98.73	3,218,688,000	98.15	3,199,853,000	0.100	2030/6/20	0.77
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	3,190,000,000	99.96	3,188,755,900	99.37	3,170,158,200	0.100	2027/12/20	0.76
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	3,145,000,000	99.97	3,144,150,850	99.54	3,130,595,900	0.005	2026/9/20	0.76
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	3,150,000,000	98.01	3,087,472,500	97.54	3,072,541,500	0.100	2031/3/20	0.74
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	3,145,000,000	97.46	3,065,179,900	97.02	3,051,499,150	0.200	2032/6/20	0.74
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	3,040,000,000	100.20	3,046,188,400	99.84	3,035,318,400	0.100	2026/3/20	0.73
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	3,050,000,000	99.51	3,035,140,300	99.03	3,020,689,500	0.500	2032/12/20	0.73
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	3,060,000,000	99.22	3,036,315,600	98.59	3,017,007,000	0.100	2029/6/20	0.73
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	2,995,000,000	100.21	3,001,469,200	99.81	2,989,489,200	0.100	2026/6/20	0.72
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	2,970,000,000	100.61	2,988,354,600	100.40	2,981,969,100	0.400	2025/6/20	0.72
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	2,955,000,000	100.15	2,959,487,100	99.62	2,943,830,100	0.100	2027/6/20	0.71
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	2,930,000,000	100.70	2,950,627,200	100.42	2,942,511,100	0.400	2025/9/20	0.71
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	2,980,000,000	98.94	2,948,441,800	98.28	2,928,893,000	0.100	2030/3/20	0.71
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	2,945,000,000	99.83	2,939,993,500	99.31	2,924,708,950	0.005	2027/6/20	0.71
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	2,910,000,000	100.07	2,912,045,000	99.50	2,895,624,600	0.100	2027/9/20	0.70
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	2,860,000,000	99.36	2,841,953,400	98.79	2,825,537,000	0.100	2028/12/20	0.68

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## □. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	84.64
地方債証券	5.14
特殊債券	5.35
社債券	4.57
合計	99.71

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 外国株式マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	355,680,318,401	69.41
	イギリス	18,658,507,222	3.64
	カナダ	16,372,270,451	3.19
	フランス	15,449,078,722	3.01
	スイス	15,095,784,104	2.95
	ドイツ	11,859,315,254	2.31
	オランダ	10,064,469,982	1.96
	アイルランド	9,520,810,574	1.86
	オーストラリア	9,033,474,321	1.76
	デンマーク	5,011,335,983	0.98
	スウェーデン	4,393,425,017	0.86
	スペイン	3,451,459,864	0.67
	イタリア	2,774,655,565	0.54
	香港	2,127,926,127	0.42
	シンガポール	1,427,460,190	0.28
	フィンランド	1,427,404,689	0.28
	ジャージー	1,169,238,626	0.23
	ベルギー	1,065,381,359	0.21
	イスラエル	1,009,973,771	0.20
	ノルウェー	827,105,376	0.16
	バミューダ	656,022,607	0.13
	ケイマン	612,962,946	0.12
	キュラソー	568,376,153	0.11
	ニュージーランド	362,541,762	0.07
ルクセンブルク	247,501,337	0.05	

	リベリア	236,949,863	0.05
	ポルトガル	231,700,068	0.05
	オーストリア	231,150,860	0.05
	パナマ	134,115,635	0.03
	マン島	58,566,024	0.01
	小計	489,759,282,853	95.57
新株予約権証券	カナダ	-	-
投資信託受益証券	オーストラリア	49,400,407	0.01
	香港	33,796,262	0.01
	小計	83,196,669	0.02
投資証券	アメリカ	8,058,383,535	1.57
	オーストラリア	618,485,938	0.12
	フランス	173,636,023	0.03
	シンガポール	171,892,803	0.03
	イギリス	139,465,149	0.03
	香港	110,960,850	0.02
	カナダ	44,967,190	0.01
	ベルギー	29,220,754	0.01
	小計	9,347,012,242	1.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		13,262,886,146	2.59
合計(純資産総額)		512,452,377,910	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	9,760,816,942	1.90
	買建	カナダ	398,423,334	0.08
	買建	ドイツ	1,754,429,878	0.34
	買建	イギリス	768,795,938	0.15
	買建	オーストラリア	522,708,564	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。

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		1,999,521,539	0.39

(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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	394,718	61,095.17	24,115,366,588	61,431.17	24,247,989,507	4.73
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	873,971	28,521.83	24,927,253,161	27,334.55	23,889,605,222	4.66
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	138,165	102,791.59	14,202,200,599	117,014.84	16,167,355,659	3.15
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	519,518	25,485.83	13,240,347,690	26,090.01	13,554,233,556	2.64
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	124,375	68,512.66	8,521,262,386	72,927.29	9,070,332,117	1.77
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	331,772	21,711.54	7,203,283,371	20,548.37	6,817,375,338	1.33
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	291,656	21,908.92	6,389,869,342	20,706.57	6,039,197,742	1.18
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	45,116	106,226.87	4,792,531,472	114,153.61	5,150,154,666	1.01
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	159,515	27,889.01	4,448,716,547	30,441.36	4,855,854,625	0.95
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	24,818	184,216.67	4,571,889,452	194,276.91	4,821,564,387	0.94
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	金融サービス	73,282	59,324.80	4,347,440,419	62,097.13	4,550,602,159	0.89
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	163,426	26,382.31	4,311,556,539	27,780.53	4,540,061,648	0.89
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	52,063	76,942.64	4,005,865,130	75,075.84	3,908,673,854	0.76
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	89,644	41,699.42	3,738,103,632	43,035.87	3,857,907,719	0.75
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	223,505	15,406.00	3,443,319,706	15,717.89	3,513,027,988	0.69
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	47,345	69,383.53	3,284,963,464	72,148.32	3,415,862,660	0.67
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	182,764	17,815.65	3,256,059,457	18,266.79	3,338,511,608	0.65
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	134,646	23,814.90	3,206,581,052	24,340.73	3,277,383,076	0.64
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	22,598	136,117.84	3,075,991,174	141,929.55	3,207,323,971	0.63
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	56,243	53,676.18	3,018,909,813	56,894.49	3,199,917,290	0.62
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	131,778	23,950.50	3,156,149,411	24,114.73	3,177,791,351	0.62

アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品 流通・小売 り	24,829	107,094.72	2,659,055,034	112,695.13	2,798,107,462	0.55
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	142,254	19,117.00	2,719,471,084	19,314.38	2,747,548,851	0.54
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	98,887	26,109.60	2,581,900,441	26,819.26	2,652,076,164	0.52
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェ ア・サービ ス	54,562	43,066.00	2,349,767,425	45,166.34	2,464,366,165	0.48
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半 導体製造装 置	90,389	25,294.47	2,286,342,717	26,599.28	2,404,282,483	0.47
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲 料・タバコ	149,344	17,042.40	2,545,180,678	15,783.81	2,357,217,843	0.46
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	101,663	22,954.57	2,333,630,908	22,953.06	2,333,477,732	0.46
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・ 娯楽	24,933	83,754.43	2,088,249,443	89,871.64	2,240,769,640	0.44
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品 流通・小売 り	249,087	8,528.42	2,124,319,607	8,982.94	2,237,534,921	0.44

(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、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.37
		素材	3.64
		資本財	6.79
		商業・専門サービス	1.58
		運輸	1.76
		自動車・自動車部品	1.73
		耐久消費財・アパレル	1.56
		消費者サービス	2.02
		メディア・娯楽	6.09
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.78
		生活必需品流通・小売り	1.72
		食品・飲料・タバコ	3.23
		家庭用品・パーソナル用品	1.57
		ヘルスケア機器・サービス	4.23
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.89
		銀行	5.21
		金融サービス	6.66
		保険	3.03
		エクイティ不動産投資信託(REIT)	0.04
		ソフトウェア・サービス	10.15
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.05		

	電気通信サービス	1.09
	公益事業	2.38
	半導体・半導体製造装置	7.69
	不動産管理・開発	0.31
	小計	95.57
新株予約権証券		
投資信託受益証券		0.02
投資証券		1.82
合計		97.41

(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	255	アメリカドル	63,718,408.05	9,600,452,540	64,782,750	9,760,816,942	1.90
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	14	カナダドル	3,558,982.5	394,655,569	3,592,960	398,423,334	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	29	スイスフラン	3,252,696	557,739,783	3,290,630	564,244,326	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	149	ユーロ	7,061,215.2	1,152,743,381	7,290,570	1,190,185,552	0.23
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	28	オーストラリアドル	5,285,706	517,364,903	5,340,300	522,708,564	0.10
	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	53	イギリスポンド	4,059,677.5	774,383,482	4,030,385	768,795,938	0.15

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

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

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	10,023,600.00	1,499,185,473	1,508,316,266	0.29
	カナダドル	買建	380,000.00	42,262,080	42,132,158	0.01
	ユーロ	買建	1,700,000.00	274,001,260	277,161,390	0.05
	イギリスポンド	買建	550,000.00	104,023,780	104,773,265	0.02
	スイスフラン	買建	200,000.00	34,232,200	34,292,060	0.01
	デンマーククローネ	買建	1,500,000.00	32,836,500	32,846,400	0.01

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

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

## 外国債券マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	82,970,136,556	46.43
	中国	14,836,747,863	8.30
	フランス	14,203,018,582	7.95
	イタリア	12,862,876,741	7.20
	ドイツ	11,016,372,258	6.16
	イギリス	9,151,194,059	5.12
	スペイン	8,513,726,680	4.76
	カナダ	3,503,745,605	1.96
	ベルギー	3,039,943,307	1.70
	オランダ	2,556,240,328	1.43
	オーストラリア	2,370,869,505	1.33
	オーストリア	2,089,255,033	1.17
	メキシコ	1,512,878,689	0.85
	アイルランド	1,004,116,706	0.56
	ポーランド	934,925,505	0.52
	フィンランド	906,689,528	0.51
	マレーシア	873,690,300	0.49
	シンガポール	712,244,982	0.40
	イスラエル	582,539,858	0.33
	デンマーク	475,983,935	0.27
ニュージーランド	415,772,695	0.23	
スウェーデン	356,184,317	0.20	
ノルウェー	302,729,465	0.17	
	小計	175,191,882,497	98.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,501,770,822	1.96
合計(純資産総額)		178,693,653,319	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	469,402,977	0.26
	買建	ドイツ	455,836,445	0.26

(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		1,073,567,286	0.60

(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 1.375% 11/15/31	12,110,000	12,375.53	1,498,677,828	12,213.39	1,479,041,846	1.375	2031/11/15	0.83
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	10,200,000	14,328.06	1,461,463,095	14,188.58	1,447,235,378	2.875	2028/8/15	0.81
アメリカ	国債証券	T 2.875% 04/30/25	8,370,000	14,742.11	1,233,915,260	14,717.10	1,231,821,619	2.875	2025/4/30	0.69
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/30/25	8,000,000	14,296.28	1,143,703,016	14,294.22	1,143,538,219	0.375	2025/4/30	0.64
中国	国債証券	CGB 1.99% 04/09/25	53,260,000	2,086.04	1,111,027,762	2,089.07	1,112,642,221	1.990	2025/4/9	0.62
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	9,130,000	12,115.39	1,106,135,855	11,984.44	1,094,179,817	0.625	2030/8/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	7,460,000	14,463.43	1,078,972,415	14,314.23	1,067,842,192	3.125	2028/11/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	6,900,000	14,094.11	972,494,221	13,956.10	962,971,107	2.625	2029/2/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 1.125% 10/31/26	6,850,000	13,878.41	950,671,343	13,805.13	945,652,004	1.125	2026/10/31	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	6,750,000	13,788.65	930,734,496	13,599.14	917,942,256	2.875	2032/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 3% 07/15/25	6,100,000	14,739.46	899,107,629	14,698.85	896,630,405	3.000	2025/7/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	7,400,000	12,213.68	903,812,828	12,083.32	894,165,832	0.625	2030/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	14,640.43	885,746,363	14,632.74	885,280,832	2.000	2025/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 3.75% 04/15/26	5,800,000	14,885.43	863,354,991	14,805.38	858,712,472	3.750	2026/4/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	6,000,000	14,394.28	863,656,917	14,190.05	851,403,215	3.500	2033/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	5,690,000	15,101.13	859,254,643	14,886.31	847,031,247	4.125	2032/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/29	6,000,000	14,128.54	847,712,970	13,984.05	839,043,563	2.750	2029/5/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.5% 01/31/27	5,800,000	13,948.15	808,993,139	13,865.46	804,197,007	1.500	2027/1/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/15/25	5,500,000	14,582.03	802,011,702	14,568.49	801,267,178	1.750	2025/3/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	6,550,000	12,340.52	808,304,087	12,181.90	797,914,767	1.250	2031/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.25% 05/31/28	6,000,000	13,396.97	803,818,568	13,280.14	796,808,878	1.250	2028/5/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	5,500,000	14,501.98	797,609,313	14,455.78	795,068,224	2.250	2025/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	6,200,000	12,805.18	793,921,426	12,633.32	783,266,232	1.875	2032/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	5,400,000	14,199.47	766,771,405	14,138.26	763,466,082	1.625	2026/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.25% 12/31/26	5,500,000	13,876.35	763,199,460	13,799.25	758,958,930	1.250	2026/12/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	6,160,000	12,266.95	755,644,189	12,117.16	746,417,297	0.875	2030/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 4% 12/15/25	5,000,000	14,948.40	747,420,314	14,880.72	744,036,123	4.000	2025/12/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	5,300,000	14,081.17	746,302,055	14,013.48	742,714,812	1.500	2026/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/28	5,550,000	13,394.03	743,368,845	13,269.55	736,460,241	1.500	2028/11/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	5,260,000	14,097.94	741,551,889	13,984.94	735,607,957	2.250	2027/11/15	0.41

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
----	---------

国債証券	98.04
合計	98.04

(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	12	アメリカドル	1,280,002.32	192,857,950	1,282,687.56	193,262,535	0.11
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	8	アメリカドル	880,303.66	132,635,352	882,750	133,003,942	0.07
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	8	アメリカドル	946,334.9	142,584,279	950,000	143,136,500	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	5	ユーロ	526,835.5	86,005,895	525,600	85,804,200	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	7	ユーロ	816,692.6	133,325,068	812,350	132,616,138	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	11	ユーロ	1,463,568.9	238,927,622	1,454,310	237,416,107	0.13

(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	3,480,000.00	521,551,582	523,071,492	0.29
	カナダドル	買建	370,000.00	41,057,282	40,941,277	0.02
	ユーロ	買建	2,160,000.00	350,387,337	351,983,232	0.20
	イギリスポンド	買建	310,000.00	58,719,871	58,996,193	0.03
	オフショア人民元	買建	4,730,000.00	98,377,541	98,575,092	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。

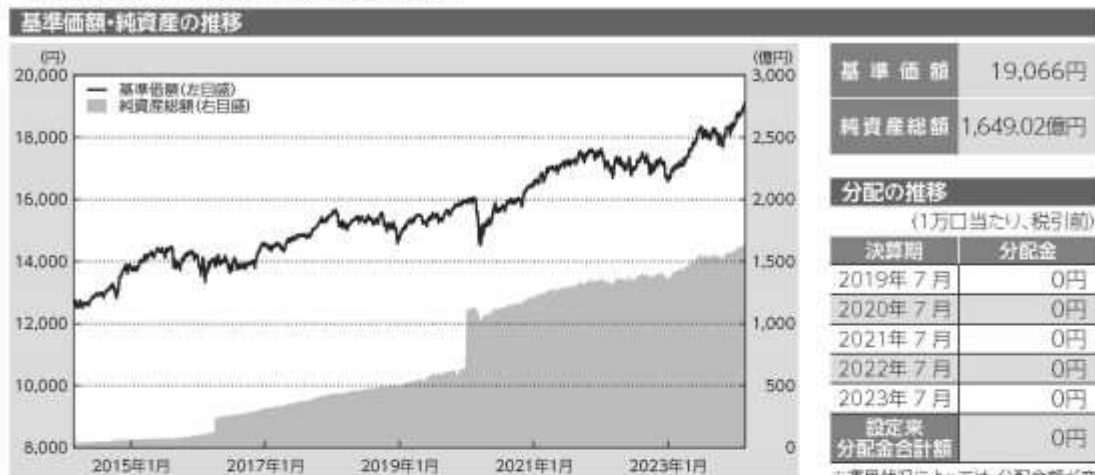
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 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：2024年2月29日

**インデックスコレクション(バランス株式30)**


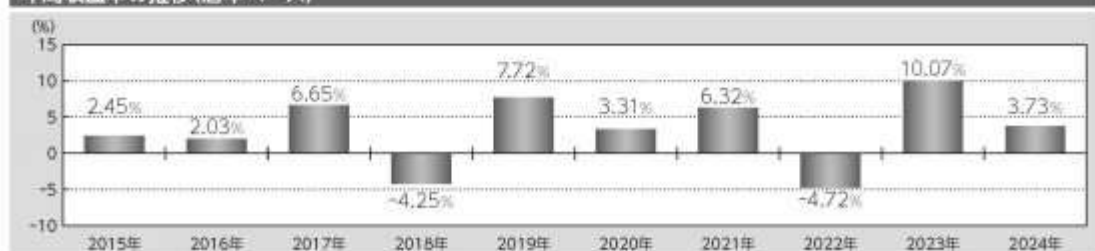
※上記グラフは作成基準日以前の最近10年間を表示しております。

※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	58.9%	第365回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2031/12/20	0.6%
		第368回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.200%	2032/09/20	0.6%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.6%
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	-	-	1.1%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.5%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.5%
外国株式 マザーファンド	10.4%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.5%
		APPLE INC	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.5%
		NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.3%
外国債券 マザーファンド	9.9%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.1%
		T 2.875% 08/15/28	アメリカ	国債	-	2.875%	2028/08/15	0.1%
		T 2.875% 04/30/25	アメリカ	国債	-	2.875%	2025/04/30	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)**


※2024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：2024年2月29日

## インデックスコレクション(バランス株式50)

### 基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額 26,594円

純資産総額 371.00億円

### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年7月	0円
2020年7月	0円
2021年7月	0円
2022年7月	0円
2023年7月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種別	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	38.8%	第365回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2031/12/20	0.4%
		第368回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.200%	2032/09/20	0.4%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.4%
日本株式 マザーファンド	30.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.6%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.7%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.7%
外国株式 マザーファンド	20.4%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.0%
		APPLE INC	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.0%
		NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.6%
外国債券 マザーファンド	9.8%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.1%
		T 2.875% 08/15/28	アメリカ	国債	-	2.875%	2028/08/15	0.1%
		T 2.875% 04/30/25	アメリカ	国債	-	2.875%	2025/04/30	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)




※2024年は年初から作成基準日までの収益率です。

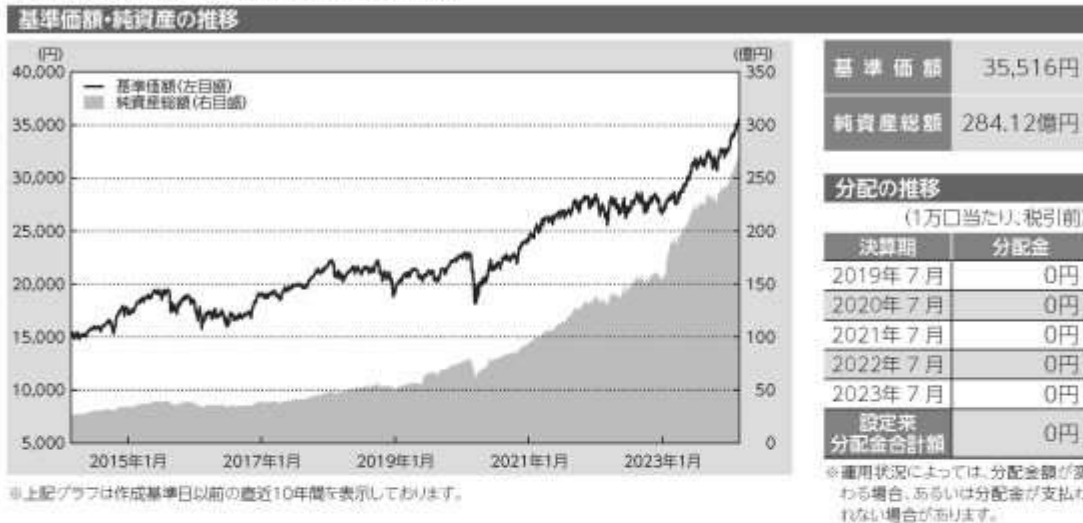
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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：2024年2月29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	40.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	2.1%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	-	-	1.0%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	1.0%
外国株式マザーファンド	30.7%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.5%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ソフトウェア	-	-	1.4%
		NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	1.0%
日本債券マザーファンド	24.1%	第365回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2031/12/20	0.3%
		第368回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.200%	2032/09/20	0.2%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.2%
外国債券マザーファンド	4.2%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.0%
		T 2.875% 08/15/28	アメリカ	国債	-	2.875%	2028/08/15	0.0%
		T 2.875% 04/30/25	アメリカ	国債	-	2.875%	2025/04/30	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、支払を受けることとなります。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

## ロンドン証券取引所の休業日

### <一部解約受付の中止等>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受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、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

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

### < 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

#### (1) 投資信託約款の変更等

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

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

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

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続きに従い

ます。

## (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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13期計算期間(2022年7月26日から2023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12期 (2022年 7月25日現在)	第13期 (2023年 7月25日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	620,048,457	865,235,237
親投資信託受益証券	136,864,182,708	153,538,872,748
未収入金	78,936,360	69,853,061
流動資産合計	137,563,167,525	154,473,961,046
資産合計	137,563,167,525	154,473,961,046
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	50,607,026	85,181,805
未払受託者報酬	14,590,530	16,051,824
未払委託者報酬	87,543,082	96,310,878
未払利息	252	2,106
その他未払費用	1,096,963	1,137,567
流動負債合計	153,837,853	198,684,180
負債合計	153,837,853	198,684,180
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	79,705,739,695	84,620,917,505
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	57,703,589,977	69,654,359,361
(分配準備積立金)	14,980,439,584	21,218,598,564
元本等合計	137,409,329,672	154,275,276,866
純資産合計	137,409,329,672	154,275,276,866
負債純資産合計	137,563,167,525	154,473,961,046

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自 至	2021年 7月27日 2022年 7月25日	自 至	2022年 7月26日 2023年 7月25日
<b>営業収益</b>				
受取利息		4,810		1,489
有価証券売買等損益		307,089,227		8,685,381,971
営業収益合計		307,094,037		8,685,383,460
<b>営業費用</b>				
支払利息		247,463		319,408
受託者報酬		29,316,606		31,375,720
委託者報酬		175,899,448		188,254,210
その他費用		2,213,589		2,269,134
営業費用合計		207,677,106		222,218,472
営業利益又は営業損失（ ）		99,416,931		8,463,164,988
経常利益又は経常損失（ ）		99,416,931		8,463,164,988
当期純利益又は当期純損失（ ）		99,416,931		8,463,164,988
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		3,050,042		62,094,473
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		6,500,849,642		6,963,414,472
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		6,500,849,642		6,963,414,472
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,084,919,367		3,413,715,603
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,084,919,367		3,413,715,603
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		57,703,589,977		69,654,359,361



## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	第12期 (2022年 7月25日現在)	第13期 (2023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	79,705,739,695口	84,620,917,505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) 1.8231円 (18,231円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日			第13期 自 2022年 7月26日 至 2023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	1,503,372,430円	費用控除後の配当等収益額	A	1,945,785,996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	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	5,126,635,271円
収益調整金額	C	42,723,150,393円	収益調整金額	C	48,435,760,797円
分配準備積立金額	D	13,477,067,154円	分配準備積立金額	D	14,146,177,297円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	57,703,589,977円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	69,654,359,361円
当ファンドの期末残存口数	F	79,705,739,695口	当ファンドの期末残存口数	F	84,620,917,505口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,239円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	8,231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13期 自 2022年 7月26日 至 2023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視部が、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13期 (2023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12期 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日	第13期 自 2022年 7月26日 至 2023年 7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	9,635,639,646円
期中一部解約元本額	4,266,776,438円	4,720,461,836円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第12期 (2022年 7月25日現在)	第13期 (2023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	395,949,279	8,131,132,423
合計	395,949,279	8,131,132,423

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	11,462,828,493	30,875,128,545	
	日本債券マザーファンド	68,069,549,702	90,777,551,482	
	外国株式マザーファンド	2,941,860,850	16,241,719,566	
	外国債券マザーファンド	5,541,004,872	15,644,473,155	
合計		88,015,243,917	153,538,872,748	

(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13期計算期間(2022年7月26日から2023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12期 (2022年 7月25日現在)	第13期 (2023年 7月25日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	98,540,175	181,536,166
親投資信託受益証券	21,972,921,509	30,927,294,568
未収入金	7,071,996	2,579,132
流動資産合計	22,078,533,680	31,111,409,866
資産合計	22,078,533,680	31,111,409,866
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,598,330	13,790,438
未払受託者報酬	2,256,207	3,112,472
未払委託者報酬	13,537,156	18,674,753
未払利息	40	442
その他未払費用	563,990	773,549
流動負債合計	17,955,723	36,351,654
負債合計	17,955,723	36,351,654
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	9,907,040,168	12,682,349,662
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	12,153,537,789	18,392,708,550
(分配準備積立金)	4,160,105,980	6,715,813,286
元本等合計	22,060,577,957	31,075,058,212
純資産合計	22,060,577,957	31,075,058,212
負債純資産合計	22,078,533,680	31,111,409,866

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自 至	2021年 7月27日 2022年 7月25日	自 至	2022年 7月26日 2023年 7月25日
<b>営業収益</b>				
受取利息		729		274
有価証券売買等損益		389,008,358		2,868,121,929
営業収益合計		389,009,087		2,868,122,203
<b>営業費用</b>				
支払利息		36,107		58,879
受託者報酬		4,434,624		5,621,166
委託者報酬		26,607,607		33,726,838
その他費用		1,108,531		1,400,663
営業費用合計		32,186,869		40,807,546
営業利益又は営業損失（ ）		356,822,218		2,827,314,657
経常利益又は経常損失（ ）		356,822,218		2,827,314,657
当期純利益又は当期純損失（ ）		356,822,218		2,827,314,657
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（ ）		11,457,912		35,058,619
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		2,600,830,981		4,262,800,754
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,600,830,981		4,262,800,754
剰余金減少額又は欠損金増加額		707,067,717		815,886,031
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		707,067,717		815,886,031
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		12,153,537,789		18,392,708,550

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	第12期 (2022年 7月25日現在)	第13期 (2023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	9,907,040,168口	12,682,349,662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) 2.4503円 (24,503円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日			第13期 自 2022年 7月26日 至 2023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	285,583,476円	費用控除後の配当等収益額	A	432,274,935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	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	2,359,981,103円
収益調整金額	C	7,993,431,809円	収益調整金額	C	11,676,895,264円
分配準備積立金額	D	3,814,741,674円	分配準備積立金額	D	3,923,557,248円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	12,153,537,789円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	18,392,708,550円
当ファンドの期末残存口数	F	9,907,040,168口	当ファンドの期末残存口数	F	12,682,349,662口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	12,267円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	14,502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13期 自 2022年 7月26日 至 2023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視部が、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13期 (2023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12期 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日	第13期 自 2022年 7月26日 至 2023年 7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	3,440,793,433円
期中一部解約元本額	594,320,528円	665,483,939円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第12期 (2022年 7月25日現在)	第13期 (2023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	402,094,092	2,740,222,261
合計	402,094,092	2,740,222,261

## （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	3,414,181,394	9,196,097,584	
	日本債券マザーファンド	9,083,236,803	12,113,404,600	
	外国株式マザーファンド	1,171,798,376	6,469,381,654	
	外国債券マザーファンド	1,115,113,243	3,148,410,730	
合計		14,784,329,816	30,927,294,568	

(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13期計算期間(2022年7月26日から2023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12期 (2022年 7月25日現在)	第13期 (2023年 7月25日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	75,547,978	111,434,467
親投資信託受益証券	14,894,310,666	22,302,636,133
未収入金	445,484	26,538,372
流動資産合計	14,970,304,128	22,440,608,972
資産合計	14,970,304,128	22,440,608,972
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,616,258	14,908,657
未払受託者報酬	1,502,419	2,185,014
未払委託者報酬	9,014,469	13,110,017
未払利息	30	271
その他未払費用	375,544	546,192
流動負債合計	16,508,720	30,750,151
負債合計	16,508,720	30,750,151
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,401,807,484	7,081,779,019
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	9,551,987,924	15,328,079,802
(分配準備積立金)	2,624,539,959	4,996,878,537
元本等合計	14,953,795,408	22,409,858,821
純資産合計	14,953,795,408	22,409,858,821
負債純資産合計	14,970,304,128	22,440,608,972

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自 至	2021年 7月27日 2022年 7月25日	自 至	2022年 7月26日 2023年 7月25日
<b>営業収益</b>				
受取利息		511		198
有価証券売買等損益		439,610,379		2,757,566,826
営業収益合計		439,610,890		2,757,567,024
<b>営業費用</b>				
支払利息		25,136		42,884
受託者報酬		2,924,976		3,905,145
委託者報酬		17,549,753		23,430,743
その他費用		731,127		976,163
営業費用合計		21,230,992		28,354,935
営業利益又は営業損失（ ）		418,379,898		2,729,212,089
経常利益又は経常損失（ ）		418,379,898		2,729,212,089
当期純利益又は当期純損失（ ）		418,379,898		2,729,212,089
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（ ）		28,205,450		76,470,049
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		3,158,305,684		4,376,414,164
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,158,305,684		4,376,414,164
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,179,696,104		1,253,064,326
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,179,696,104		1,253,064,326
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,551,987,924		15,328,079,802



## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	第12期 (2022年 7月25日現在)	第13期 (2023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	5,401,807,484口	7,081,779,019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) 3.1644円 (31,644円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日			第13期 自 2022年 7月26日 至 2023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	220,281,421円	費用控除後の配当等収益額	A	342,473,398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	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	2,310,268,642円
収益調整金額	C	6,927,447,965円	収益調整金額	C	10,331,201,265円
分配準備積立金額	D	2,234,365,511円	分配準備積立金額	D	2,344,136,497円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,551,987,924円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	15,328,079,802円
当ファンドの期末残存口数	F	5,401,807,484口	当ファンドの期末残存口数	F	7,081,779,019口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	17,682円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	21,644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13期 自 2022年 7月26日 至 2023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視部が、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13期 (2023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12期	第13期
	自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日	自 2022年 7月26日 至 2023年 7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	2,386,770,370円
期中一部解約元本額	698,992,306円	706,798,835円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第12期	第13期
	(2022年 7月25日現在)	(2023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	439,324,222	2,748,231,987
合計	439,324,222	2,748,231,987

## （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	3,363,834,997	9,060,489,564	
	日本債券マザーファンド	4,001,112,676	5,335,883,864	
	外国株式マザーファンド	1,254,914,948	6,928,259,936	
	外国債券マザーファンド	346,391,857	978,002,769	
合計		8,966,254,478	22,302,636,133	

(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

	2023年 7月25日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,682,306,802
株式	354,362,404,270
派生商品評価勘定	51,294,450
未収入金	2,179,350
未収配当金	465,267,088
差入委託証拠金	81,774,000
流動資産合計	356,645,225,960
資産合計	356,645,225,960
負債の部	
流動負債	
前受金	51,301,600
未払解約金	163,022,784
未払利息	4,096
流動負債合計	214,328,480
負債合計	214,328,480
純資産の部	
元本等	
元本	132,331,482,461
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	224,099,415,019
元本等合計	356,430,897,480
純資産合計	356,430,897,480
負債純資産合計	356,645,225,960

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023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）

	2023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	132,331,482,461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 2.6935円 (1万口当たり純資産額) (26,935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

	2023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

	2023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	2023年 7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	9,777,001,267円
期中一部解約元本額	12,886,311,564円
期末元本額	132,331,482,461円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	594,329,150円
DC日本株式インデックスファンド	278,009,360円
DC日本株式インデックスファンドL	53,967,722,338円
DC日本株式インデックスファンドA	655,373,773円
DCバランスファンド30	2,155,023,517円
DCバランスファンド50	3,574,270,179円

区分	2023年 7月25日現在
DCバランスファンド70	2,361,593,962円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	526,453,370円
日本株式インデックスe	1,415,045,419円
インデックスコレクション（国内株式）	22,688,298,180円
インデックスコレクション（バランス株式30）	11,462,828,493円
インデックスコレクション（バランス株式50）	3,414,181,394円
インデックスコレクション（バランス株式70）	3,363,834,997円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,889,372,601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）	2,677,823,019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）	662,015,883円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	28,461,915円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	362,777,825円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	48,069,154円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	113,973,982円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	35,176,221円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	491,922,948円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	321,415,261円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	5,736,280,143円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	594,978,112円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	47,446,177円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	939,210,978円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	18,075,313円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	120,084,536円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,535,025,393円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	38,839,510円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	41,825,645円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	13,089,122円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	446,986,164円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	206,545,834円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	3,319,529,355円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	66,932,363円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	24,177,839円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	6,735,611円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	84,668,238円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	3,079,187円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023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		52,207,300,749
合計		52,207,300,749

(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

(2023年 7月25日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益(円)
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引			
	買建	1,867,258,400	-	1,918,560,000
合計		1,867,258,400	-	1,918,560,000

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、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	5,800	3,660.00	21,228,000	
ニッスイ	152,200	674.70	102,689,340	
マルハニチロ	22,600	2,475.50	55,946,300	
雪国まいたけ	13,000	935.00	12,155,000	
カネコ種苗	4,700	1,465.00	6,885,500	
サカタのタネ	17,300	3,895.00	67,383,500	
ホクト	13,500	1,840.00	24,840,000	
ホクリヨウ	1,700	897.00	1,524,900	
住石ホールディングス	18,400	358.00	6,587,200	
日鉄鉱業	6,100	4,945.00	30,164,500	
三井松島ホールディングス	6,900	2,613.00	18,029,700	
I N P E X	562,800	1,840.00	1,035,552,000	
石油資源開発	17,600	4,865.00	85,624,000	
K & O エナジーグループ	6,900	2,275.00	15,697,500	
ショーボンドホールディングス	20,700	5,702.00	118,031,400	
ミライト・ワン	50,300	1,824.00	91,747,200	
タマホーム	9,600	3,505.00	33,648,000	
サンヨーホームズ	1,400	721.00	1,009,400	
日本アクア	4,900	887.00	4,346,300	
ファーストコーポレーション	3,000	737.00	2,211,000	
ベステラ	2,600	1,086.00	2,823,600	
R o b o t H o m e	25,900	196.00	5,076,400	
キャンディル	2,100	604.00	1,268,400	
ダイセキ環境ソリューション	2,400	1,338.00	3,211,200	
第一カッター興業	3,900	1,441.00	5,619,900	
安藤・間	88,200	1,120.00	98,784,000	
東急建設	43,300	760.00	32,908,000	
コムシスホールディングス	48,600	2,811.00	136,614,600	
ピーアールホールディングス	24,200	399.00	9,655,800	
高松コンストラクショングループ	9,900	2,672.00	26,452,800	
東建コーポレーション	4,400	7,420.00	32,648,000	
ソネック	1,300	973.00	1,264,900	
ヤマウラ	7,700	1,155.00	8,893,500	
オリエンタル白石	54,700	306.00	16,738,200	

大成建設	99,600	5,408.00	538,636,800	
大林組	380,700	1,311.00	499,097,700	
清水建設	301,800	957.90	289,094,220	
飛鳥建設	11,800	1,370.00	16,166,000	
長谷工コーポレーション	109,900	1,833.00	201,446,700	
松井建設	9,900	769.00	7,613,100	
銭高組	1,000	3,165.00	3,165,000	
鹿島建設	236,000	2,229.00	526,044,000	
不動テトラ	7,400	1,874.00	13,867,600	
大末建設	3,000	1,376.00	4,128,000	
鉄建建設	7,600	2,046.00	15,549,600	
西松建設	18,000	3,709.00	66,762,000	
三井住友建設	85,800	373.00	32,003,400	
大豊建設	4,400	3,945.00	17,358,000	
佐田建設	5,300	480.00	2,544,000	
ナカノフドー建設	5,900	398.00	2,348,200	
奥村組	17,300	4,200.00	72,660,000	
東鉄工業	14,700	2,727.00	40,086,900	
イチケン	1,900	2,048.00	3,891,200	
富士ピー・エス	3,700	447.00	1,653,900	
浅沼組	8,500	3,470.00	29,495,000	
戸田建設	130,900	779.80	102,075,820	
熊谷組	17,800	3,180.00	56,604,000	
北野建設	1,600	3,105.00	4,968,000	
植木組	2,300	1,420.00	3,266,000	
矢作建設工業	14,500	1,334.00	19,343,000	
ピーエス三菱	13,500	780.00	10,530,000	
日本ハウスホールディングス	21,100	374.00	7,891,400	
新日本建設	14,900	1,261.00	18,788,900	
東亜道路工業	4,200	4,880.00	20,496,000	
日本道路	2,100	9,340.00	19,614,000	
東亜建設工業	9,100	3,145.00	28,619,500	
日本国土開発	31,700	611.00	19,368,700	
若築建設	4,700	3,205.00	15,063,500	
東洋建設	34,500	1,081.00	37,294,500	
五洋建設	150,900	762.70	115,091,430	
世紀東急工業	13,700	1,447.00	19,823,900	
福田組	4,000	4,840.00	19,360,000	
住友林業	82,200	3,424.00	281,452,800	
日本基礎技術	5,000	502.00	2,510,000	
巴コーポレーション	9,300	517.00	4,808,100	
大和ハウス工業	294,300	3,843.00	1,130,994,900	

ライト工業	19,700	2,038.00	40,148,600
積水ハウス	322,700	2,930.00	945,511,000
日特建設	10,200	1,108.00	11,301,600
北陸電気工事	7,300	987.00	7,205,100
ユアテック	23,400	889.00	20,802,600
日本リーテック	9,400	1,460.00	13,724,000
四電工	4,500	2,313.00	10,408,500
中電工	16,500	2,386.00	39,369,000
関電工	58,300	1,236.00	72,058,800
きんでん	74,900	1,996.00	149,500,400
東京エネシス	10,600	985.00	10,441,000
トーエネック	3,500	3,725.00	13,037,500
住友電設	10,100	3,205.00	32,370,500
日本電設工業	17,500	2,131.00	37,292,500
エクシオグループ	49,000	2,909.00	142,541,000
新日本空調	5,900	2,363.00	13,941,700
九電工	25,900	4,115.00	106,578,500
三機工業	23,600	1,537.00	36,273,200
日揮ホールディングス	105,300	1,972.50	207,704,250
中外炉工業	3,500	2,081.00	7,283,500
ヤマト	6,900	905.00	6,244,500
太平電業	6,600	4,410.00	29,106,000
高砂熱学工業	25,700	2,549.00	65,509,300
三晃金属工業	1,000	4,525.00	4,525,000
朝日工業社	4,400	2,450.00	10,780,000
明星工業	18,300	988.00	18,080,400
大気社	12,300	4,230.00	52,029,000
ダイダン	7,000	2,980.00	20,860,000
日比谷総合設備	9,100	2,235.00	20,338,500
フィル・カンパニー	1,900	765.00	1,453,500
テスホールディングス	22,800	608.00	13,862,400
インフロニア・ホールディングス	111,500	1,371.50	152,922,250
東洋エンジニアリング	14,100	666.00	9,390,600
レイズネクスト	15,400	1,446.00	22,268,400
ニッポン	28,800	1,847.00	53,193,600
日清製粉グループ本社	98,800	1,720.50	169,985,400
日東富士製粉	1,900	4,825.00	9,167,500
昭和産業	9,300	2,701.00	25,119,300
鳥越製粉	6,700	623.00	4,174,100
中部飼料	14,800	1,086.00	16,072,800
フィード・ワン	15,600	753.00	11,746,800
東洋精糖	1,500	1,762.00	2,643,000



日本甜菜製糖	6,200	1,921.00	11,910,200
D M三井製糖ホールディングス	10,600	2,834.00	30,040,400
塩水港精糖	9,900	217.00	2,148,300
ウェルネオシュガー	5,500	2,075.00	11,412,500
森永製菓	19,500	4,535.00	88,432,500
中村屋	2,700	3,075.00	8,302,500
江崎グリコ	30,600	3,772.00	115,423,200
名糖産業	4,200	1,641.00	6,892,200
井村屋グループ	5,800	2,245.00	13,021,000
不二家	7,300	2,441.00	17,819,300
山崎製パン	71,500	2,154.50	154,046,750
第一屋製パン	1,600	389.00	622,400
モロゾフ	3,500	3,785.00	13,247,500
亀田製菓	6,800	4,345.00	29,546,000
寿スピリッツ	11,400	11,030.00	125,742,000
カルビー	48,900	2,735.00	133,741,500
森永乳業	19,400	4,697.00	91,121,800
六甲バター	7,800	1,322.00	10,311,600
ヤクルト本社	76,400	8,811.00	673,160,400
明治ホールディングス	131,000	3,333.00	436,623,000
雪印メグミルク	25,800	1,980.00	51,084,000
プリマハム	14,400	2,220.00	31,968,000
日本ハム	41,800	4,082.00	170,627,600
林兼産業	2,500	491.00	1,227,500
丸大食品	10,800	1,518.00	16,394,400
S Foods	11,800	3,345.00	39,471,000
柿安本店	4,200	2,343.00	9,840,600
伊藤ハム米久ホールディングス	81,600	722.00	58,915,200
サッポロホールディングス	35,200	3,664.00	128,972,800
アサヒグループホールディングス	246,900	5,662.00	1,397,947,800
キリンホールディングス	482,200	2,091.00	1,008,280,200
宝ホールディングス	72,900	1,222.00	89,083,800
オエノンホールディングス	31,900	367.00	11,707,300
養命酒製造	3,500	1,867.00	6,534,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	83,700	1,616.50	135,301,050
サントリー食品インターナショナル	75,200	5,108.00	384,121,600
ダイドーグループホールディングス	6,100	5,100.00	31,110,000
伊藤園	36,200	4,075.00	147,515,000
キーコーヒー	12,000	2,069.00	24,828,000
ユニカフェ	2,800	915.00	2,562,000
ジャパンフーズ	1,300	1,098.00	1,427,400
日清オイリオグループ	15,100	3,740.00	56,474,000

不二製油グループ本社	24,900	1,993.50	49,638,150
かどや製油	1,000	3,455.00	3,455,000
J・オイルミルズ	10,900	1,678.00	18,290,200
キッコーマン	70,800	8,074.00	571,639,200
味の素	258,000	5,591.00	1,442,478,000
ブルドックソース	5,700	1,933.00	11,018,100
キューピー	57,400	2,332.50	133,885,500
ハウス食品グループ本社	32,700	3,357.00	109,773,900
カゴメ	49,800	3,145.00	156,621,000
焼津水産化学工業	3,300	819.00	2,702,700
アリアケジャパン	9,300	5,087.00	47,309,100
ピエトロ	1,200	1,819.00	2,182,800
エバラ食品工業	2,900	2,929.00	8,494,100
やまみ	800	1,344.00	1,075,200
ニチレイ	49,000	3,185.00	156,065,000
東洋水産	54,000	6,125.00	330,750,000
イトアンドホールディングス	4,600	2,102.00	9,669,200
大冷	1,000	1,978.00	1,978,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,800	1,081.00	7,350,800
日清食品ホールディングス	37,600	11,705.00	440,108,000
永谷園ホールディングス	5,200	2,151.00	11,185,200
一正蒲鉾	3,600	734.00	2,642,400
フジッコ	11,000	1,857.00	20,427,000
ロック・フィールド	12,000	1,477.00	17,724,000
日本たばこ産業	703,400	3,108.00	2,186,167,200
ケンコーマヨネーズ	7,400	1,309.00	9,686,600
わらべや日洋ホールディングス	7,900	2,747.00	21,701,300
なとり	6,700	1,951.00	13,071,700
イフジ産業	1,400	1,199.00	1,678,600
ファーマフーズ	15,300	1,622.00	24,816,600
ユーグレナ	69,100	891.00	61,568,100
紀文食品	8,300	1,070.00	8,881,000
ピクルスホールディングス	6,300	1,218.00	7,673,400
ミヨシ油脂	2,900	1,033.00	2,995,700
理研ビタミン	9,200	2,045.00	18,814,000
片倉工業	10,200	1,634.00	16,666,800
ゲンゼ	7,800	4,420.00	34,476,000
東洋紡	47,300	1,061.50	50,208,950
ユニチカ	34,400	232.00	7,980,800
富士紡ホールディングス	4,400	3,395.00	14,938,000
倉敷紡績	8,300	2,368.00	19,654,400
シキボウ	4,700	1,034.00	4,859,800

日本毛織	29,000	1,166.00	33,814,000
トーア紡コーポレーション	3,300	479.00	1,580,700
帝国繊維	12,500	1,699.00	21,237,500
帝人	104,700	1,496.50	156,683,550
東レ	728,800	794.80	579,250,240
住江織物	1,800	2,325.00	4,185,000
日本フェルト	5,500	420.00	2,310,000
イチカワ	1,300	1,382.00	1,796,600
日東製網	900	1,414.00	1,272,600
アツギ	5,200	448.00	2,329,600
ダイニック	2,200	781.00	1,718,200
セーレン	21,100	2,430.00	51,273,000
ソトー	2,800	762.00	2,133,600
東海染工	900	1,090.00	981,000
小松マテーレ	16,000	737.00	11,792,000
ワコールホールディングス	20,800	3,024.00	62,899,200
ホギメディカル	14,600	3,120.00	45,552,000
T S Iホールディングス	36,800	726.00	26,716,800
マツオカコーポレーション	2,400	1,278.00	3,067,200
ワールド	14,000	1,762.00	24,668,000
三陽商会	3,200	2,053.00	6,569,600
ナイガイ	3,300	288.00	950,400
オンワードホールディングス	70,800	563.00	39,860,400
ルックホールディングス	2,500	2,699.00	6,747,500
ゴールドウイン	19,300	11,520.00	222,336,000
デサント	18,800	4,075.00	76,610,000
キング	3,900	640.00	2,496,000
ヤマトインターナショナル	7,100	310.00	2,201,000
特種東海製紙	4,900	3,275.00	16,047,500
王子ホールディングス	452,800	551.60	249,764,480
日本製紙	56,600	1,265.00	71,599,000
三菱製紙	10,200	581.00	5,926,200
北越コーポレーション	68,700	863.00	59,288,100
中越パルプ工業	3,400	1,347.00	4,579,800
巴川製紙所	2,700	710.00	1,917,000
大王製紙	48,000	1,151.00	55,248,000
阿波製紙	2,000	552.00	1,104,000
レンゴー	99,000	879.60	87,080,400
トーモク	6,300	2,160.00	13,608,000
ザ・パック	8,100	3,235.00	26,203,500
北の達人コーポレーション	45,800	259.00	11,862,200
クラレ	172,800	1,406.50	243,043,200

旭化成	678,800	961.10	652,394,680
共和レザー	4,900	612.00	2,998,800
レゾナック・ホールディングス	105,100	2,333.50	245,250,850
住友化学	806,400	444.60	358,525,440
住友精化	4,500	4,640.00	20,880,000
日産化学	51,400	6,254.00	321,455,600
ラサ工業	4,200	2,136.00	8,971,200
クレハ	9,300	8,400.00	78,120,000
多木化学	4,200	4,165.00	17,493,000
テイカ	7,300	1,453.00	10,606,900
石原産業	19,700	1,364.00	26,870,800
片倉コープアグリ	1,700	1,265.00	2,150,500
日本曹達	11,700	5,170.00	60,489,000
東ソー	145,100	1,819.00	263,936,900
トクヤマ	35,100	2,369.50	83,169,450
セントラル硝子	17,400	3,065.00	53,331,000
東亜合成	54,500	1,296.00	70,632,000
大阪ソーダ	6,500	5,480.00	35,620,000
関東電化工業	21,000	930.00	19,530,000
デンカ	39,500	2,747.50	108,526,250
信越化学工業	903,600	4,563.00	4,123,126,800
日本カーバイド工業	3,200	1,501.00	4,803,200
堺化学工業	8,300	1,977.00	16,409,100
第一稀元素化学工業	9,900	979.00	9,692,100
エア・ウォーター	102,600	1,968.00	201,916,800
日本酸素ホールディングス	105,500	3,165.00	333,907,500
日本化学工業	3,600	1,937.00	6,973,200
東邦アセチレン	1,800	1,470.00	2,646,000
日本パーカライズン	53,800	1,095.00	58,911,000
高压ガス工業	15,800	765.00	12,087,000
チタン工業	1,000	1,393.00	1,393,000
四国化成ホールディングス	12,900	1,469.00	18,950,100
戸田工業	2,500	2,220.00	5,550,000
ステラ ケミファ	6,400	3,105.00	19,872,000
保土谷化学工業	3,100	3,395.00	10,524,500
日本触媒	16,600	5,423.00	90,021,800
大日精化工業	7,600	2,211.00	16,803,600
カネカ	24,800	4,155.00	103,044,000
三菱瓦斯化学	81,200	2,123.00	172,387,600
三井化学	89,600	4,044.00	362,342,400
J S R	101,500	4,055.00	411,582,500
東京応化工業	19,000	8,424.00	160,056,000

大阪有機化学工業	8,200	2,678.00	21,959,600
三菱ケミカルグループ	733,600	833.00	611,088,800
KHネオケム	18,100	2,296.00	41,557,600
ダイセル	151,400	1,290.00	195,306,000
住友ベークライト	16,100	6,069.00	97,710,900
積水化学工業	220,600	2,060.50	454,546,300
日本ゼオン	65,200	1,338.50	87,270,200
アイカ工業	27,400	3,157.00	86,501,800
UBE	56,000	2,535.00	141,960,000
積水樹脂	15,700	2,205.00	34,618,500
タキロンシーアイ	23,800	576.00	13,708,800
旭有機材	7,200	4,295.00	30,924,000
ニチバン	6,700	2,030.00	13,601,000
リケンテクノス	23,400	673.00	15,748,200
大倉工業	5,000	2,272.00	11,360,000
積水化成成品工業	15,300	457.00	6,992,100
群栄化学工業	2,600	2,864.00	7,446,400
タイガースポリマー	3,900	690.00	2,691,000
ミライアル	2,600	1,557.00	4,048,200
ダイキアクシス	3,100	715.00	2,216,500
ダイキョーニシカワ	24,000	780.00	18,720,000
竹本容器	2,800	812.00	2,273,600
森六ホールディングス	5,500	2,101.00	11,555,500
恵和	7,000	1,123.00	7,861,000
日本化薬	83,000	1,256.50	104,289,500
カーリットホールディングス	9,800	812.00	7,957,600
日本精化	6,200	2,895.00	17,949,000
扶桑化学工業	10,100	4,495.00	45,399,500
トリケミカル研究所	14,500	2,556.00	37,062,000
ADEKA	37,900	2,794.50	105,911,550
日油	33,600	5,982.00	200,995,200
新日本理化	11,700	239.00	2,796,300
ハリマ化成グループ	5,900	890.00	5,251,000
花王	264,700	5,210.00	1,379,087,000
第一工業製薬	3,900	1,800.00	7,020,000
石原ケミカル	5,000	1,600.00	8,000,000
日華化学	3,400	840.00	2,856,000
ニイタカ	1,500	1,997.00	2,995,500
三洋化成工業	6,700	4,275.00	28,642,500
有機合成薬品工業	6,200	303.00	1,878,600
大日本塗料	13,300	939.00	12,488,700
日本ペイントホールディングス	481,000	1,222.00	587,782,000

関西ペイント	99,600	2,323.50	231,420,600
神東塗料	7,000	126.00	882,000
中国塗料	17,900	1,183.00	21,175,700
日本特殊塗料	5,400	1,130.00	6,102,000
藤倉化成	14,600	453.00	6,613,800
太陽ホールディングス	16,500	2,614.00	43,131,000
D I C	42,500	2,657.50	112,943,750
サカタインクス	24,200	1,225.00	29,645,000
東洋インキＳＣホールディングス	21,300	2,136.00	45,496,800
T & K T O K A	9,700	1,175.00	11,397,500
富士フィルムホールディングス	208,900	8,134.00	1,699,192,600
資生堂	227,300	6,172.00	1,402,895,600
ライオン	130,600	1,338.00	174,742,800
高砂香料工業	7,400	2,766.00	20,468,400
マンダム	23,500	1,382.00	32,477,000
ミルボン	16,100	4,939.00	79,517,900
ファンケル	47,600	2,451.00	116,667,600
コーセー	22,100	13,515.00	298,681,500
コタ	10,000	1,616.00	16,160,000
シーボン	1,100	1,553.00	1,708,300
ポーラ・オルビスホールディングス	55,800	2,021.00	112,771,800
ノエビアホールディングス	9,700	5,410.00	52,477,000
アジュバンホールディングス	2,100	930.00	1,953,000
新日本製薬	6,200	1,424.00	8,828,800
アクシージア	5,500	1,296.00	7,128,000
エステー	8,400	1,510.00	12,684,000
アグロ カネショウ	4,400	1,624.00	7,145,600
コニシ	18,200	2,201.00	40,058,200
長谷川香料	20,800	3,435.00	71,448,000
星光P M C	4,300	571.00	2,455,300
小林製薬	31,700	7,634.00	241,997,800
荒川化学工業	9,200	1,014.00	9,328,800
メック	9,000	3,415.00	30,735,000
日本高純度化学	2,700	2,492.00	6,728,400
タカラバイオ	29,300	1,772.00	51,919,600
J C U	12,200	3,350.00	40,870,000
新田ゼラチン	5,200	749.00	3,894,800
O A T アグリオ	3,500	2,047.00	7,164,500
デクセリアルズ	31,200	3,250.00	101,400,000
アース製薬	9,900	5,040.00	49,896,000
北興化学工業	11,000	880.00	9,680,000
大成ラミック	3,400	3,005.00	10,217,000

クミアイ化学工業	43,200	1,082.00	46,742,400
日本農薬	20,000	729.00	14,580,000
アキレス	6,900	1,498.00	10,336,200
有沢製作所	17,700	1,082.00	19,151,400
日東電工	79,000	10,360.00	818,440,000
レック	15,500	847.00	13,128,500
三光合成	13,700	645.00	8,836,500
きもと	12,400	194.00	2,405,600
藤森工業	8,600	3,495.00	30,057,000
前澤化成工業	7,000	1,534.00	10,738,000
未来工業	3,900	2,775.00	10,822,500
ウェーブロックホールディングス	2,500	605.00	1,512,500
JSP	7,600	1,842.00	13,999,200
エフピコ	20,600	2,881.50	59,358,900
天馬	9,200	2,594.00	23,864,800
信越ポリマー	20,100	1,436.00	28,863,600
東リ	19,000	366.00	6,954,000
ニフコ	39,300	4,049.00	159,125,700
バルカー	9,100	3,795.00	34,534,500
ユニ・チャーム	226,800	5,217.00	1,183,215,600
ショーエイコーポレーション	2,500	599.00	1,497,500
協和キリン	131,500	2,708.50	356,167,750
武田薬品工業	963,200	4,373.00	4,212,073,600
アステラス製薬	1,028,200	2,080.00	2,138,656,000
住友ファーマ	80,700	662.20	53,439,540
塩野義製薬	137,200	5,880.00	806,736,000
わかもと製薬	7,900	235.00	1,856,500
日本新薬	25,700	5,680.00	145,976,000
中外製薬	340,700	3,992.00	1,360,074,400
科研製薬	18,600	3,502.00	65,137,200
エーザイ	132,400	8,994.00	1,190,805,600
ロート製薬	105,400	3,045.00	320,943,000
小野薬品工業	210,000	2,640.50	554,505,000
久光製薬	24,200	4,335.00	104,907,000
持田製薬	12,500	3,240.00	40,500,000
参天製薬	198,300	1,205.00	238,951,500
扶桑薬品工業	3,500	2,050.00	7,175,000
日本ケミファ	800	1,912.00	1,529,600
ツムラ	34,300	2,646.00	90,757,800
キッセイ薬品工業	16,800	2,994.00	50,299,200
生化学工業	20,800	755.00	15,704,000
栄研化学	17,700	1,583.00	28,019,100

鳥居薬品	5,800	3,550.00	20,590,000
JCRファーマ	36,800	1,229.00	45,227,200
東和薬品	16,700	1,794.00	29,959,800
富士製薬工業	8,000	1,166.00	9,328,000
ゼリア新薬工業	15,100	2,340.00	35,334,000
そーせいグループ	37,400	1,794.00	67,095,600
第一三共	948,200	4,122.00	3,908,480,400
杏林製薬	23,600	1,764.00	41,630,400
大幸薬品	21,200	346.00	7,335,200
ダイト	7,600	2,268.00	17,236,800
大塚ホールディングス	249,000	5,245.00	1,306,005,000
大正製薬ホールディングス	24,200	5,406.00	130,825,200
ペプチドリーム	52,800	1,837.50	97,020,000
あすか製薬ホールディングス	11,200	1,516.00	16,979,200
サワイグループホールディングス	24,900	3,544.00	88,245,600
日本コークス工業	98,200	113.00	11,096,600
ニチレキ	12,900	2,081.00	26,844,900
ユシロ化学工業	5,600	1,121.00	6,277,600
ビーピー・カストロール	3,300	867.00	2,861,100
富士石油	22,200	295.00	6,549,000
MORESCO	2,800	1,192.00	3,337,600
出光興産	120,900	3,018.00	364,876,200
ENEOSホールディングス	1,846,300	512.50	946,228,750
コスモエネルギーホールディングス	43,000	4,314.00	185,502,000
横浜ゴム	61,900	3,149.00	194,923,100
TOYO TIRE	62,500	1,963.00	122,687,500
ブリヂストン	347,600	5,836.00	2,028,593,600
住友ゴム工業	106,800	1,460.00	155,928,000
藤倉コンポジット	6,000	984.00	5,904,000
オカモト	6,000	3,880.00	23,280,000
フコク	5,700	1,610.00	9,177,000
ニッタ	11,100	3,225.00	35,797,500
住友理工	21,100	828.00	17,470,800
三ツ星ベルト	15,900	4,440.00	70,596,000
バンドー化学	17,200	1,441.00	24,785,200
日東紡績	12,300	2,602.00	32,004,600
AGC	110,800	5,080.00	562,864,000
日本板硝子	55,500	647.00	35,908,500
石塚硝子	1,400	1,625.00	2,275,000
日本山村硝子	3,300	1,115.00	3,679,500
日本電気硝子	44,500	2,572.50	114,476,250
オハラ	5,300	1,391.00	7,372,300



住友大阪セメント	15,400	3,896.00	59,998,400
太平洋セメント	69,400	2,875.00	199,525,000
日本ヒューム	9,700	757.00	7,342,900
日本コンクリート工業	21,600	336.00	7,257,600
三谷セキサン	4,600	4,600.00	21,160,000
アジアパイルホールディングス	17,200	620.00	10,664,000
東海カーボン	91,400	1,233.50	112,741,900
日本カーボン	6,300	4,275.00	26,932,500
東洋炭素	6,800	5,310.00	36,108,000
ノリタケカンパニーリミテド	5,400	5,410.00	29,214,000
TOTO	71,900	4,350.00	312,765,000
日本碍子	126,600	1,721.00	217,878,600
日本特殊陶業	82,900	2,991.00	247,953,900
MARUWA	4,000	22,240.00	88,960,000
品川リフラクトリーズ	3,100	6,020.00	18,662,000
黒崎播磨	2,200	9,680.00	21,296,000
ヨータイ	6,000	1,513.00	9,078,000
東京窯業	8,200	348.00	2,853,600
ニッカトー	4,000	672.00	2,688,000
フジインコーポレーテッド	26,000	3,460.00	89,960,000
クニミネ工業	2,600	1,048.00	2,724,800
エーアンドエーマテリアル	1,700	1,143.00	1,943,100
ニチアス	27,600	2,909.00	80,288,400
ニチハ	13,700	3,270.00	44,799,000
日本製鉄	501,400	3,180.00	1,594,452,000
神戸製鋼所	225,200	1,463.50	329,580,200
中山製鋼所	23,100	903.00	20,859,300
合同製鐵	5,600	3,935.00	22,036,000
JFEホールディングス	299,200	2,204.00	659,436,800
東京製鐵	31,500	1,687.00	53,140,500
共英製鋼	12,800	2,184.00	27,955,200
大和工業	18,500	6,381.00	118,048,500
東京鐵鋼	5,300	3,360.00	17,808,000
大阪製鐵	5,200	1,501.00	7,805,200
淀川製鋼所	12,700	3,345.00	42,481,500
中部鋼鈹	9,200	2,042.00	18,786,400
丸一鋼管	34,100	3,329.00	113,518,900
モリ工業	2,000	3,495.00	6,990,000
大同特殊鋼	14,100	6,231.00	87,857,100
日本高周波鋼業	3,000	361.00	1,083,000
日本冶金工業	8,200	4,255.00	34,891,000
山陽特殊製鋼	11,100	2,717.00	30,158,700

愛知製鋼	6,500	3,500.00	22,750,000
日本金属	1,900	961.00	1,825,900
大太平洋金属	8,000	1,587.00	12,696,000
新日本電工	66,900	286.00	19,133,400
栗本鐵工所	5,300	2,476.00	13,122,800
虹技	1,100	1,298.00	1,427,800
三菱製鋼	7,000	1,656.00	11,592,000
日亜鋼業	8,900	328.00	2,919,200
日本精線	1,500	4,925.00	7,387,500
エンビプロ・ホールディングス	6,000	568.00	3,408,000
シンニッタン	9,500	253.00	2,403,500
新家工業	1,900	2,511.00	4,770,900
大紀アルミニウム工業所	16,000	1,557.00	24,912,000
日本軽金属ホールディングス	30,200	1,472.00	44,454,400
三井金属鉱業	32,600	3,298.00	107,514,800
東邦亜鉛	6,700	1,743.00	11,678,100
三菱マテリアル	74,700	2,547.50	190,298,250
住友金属鉱山	129,800	4,917.00	638,226,600
D O W Aホールディングス	25,200	4,527.00	114,080,400
古河機械金属	16,500	1,648.00	27,192,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	16,400	3,295.00	54,038,000
東邦チタニウム	20,300	1,879.00	38,143,700
U A C J	15,700	2,751.00	43,190,700
C Kサンエツ	2,700	4,205.00	11,353,500
古河電気工業	37,300	2,752.00	102,649,600
住友電気工業	386,700	1,817.50	702,827,250
フジクラ	120,100	1,187.50	142,618,750
S W C C	12,500	1,954.00	24,425,000
タツタ電線	22,900	714.00	16,350,600
カナレ電気	1,400	1,488.00	2,083,200
平河ヒューテック	6,500	1,693.00	11,004,500
リョービ	12,000	2,885.00	34,620,000
アーレスティ	9,700	748.00	7,255,600
A R Eホールディングス	45,300	1,928.00	87,338,400
稲葉製作所	5,800	1,594.00	9,245,200
宮地エンジニアリンググループ	3,100	4,330.00	13,423,000
トーカロ	30,500	1,433.00	43,706,500
アルファC o	3,200	1,256.00	4,019,200
S U M C O	213,200	2,049.50	436,953,400
川田テクノロジーズ	2,600	5,770.00	15,002,000
R S Technologies	7,500	2,979.00	22,342,500
ジェイテックコーポレーション	1,200	2,396.00	2,875,200

信和	4,800	785.00	3,768,000
東洋製罐グループホールディングス	66,800	2,246.50	150,066,200
ホッカンホールディングス	6,000	1,390.00	8,340,000
コロナ	6,300	915.00	5,764,500
横河ブリッジホールディングス	14,000	2,579.00	36,106,000
駒井ハルテック	1,400	1,976.00	2,766,400
高田機工	700	2,823.00	1,976,100
三和ホールディングス	103,100	1,900.00	195,890,000
文化シャッター	32,200	1,076.00	34,647,200
三協立山	12,800	920.00	11,776,000
アルインコ	8,500	1,095.00	9,307,500
東洋シャッター	2,000	657.00	1,314,000
L I X I L	163,100	1,905.00	310,705,500
日本フィルコン	5,700	471.00	2,684,700
ノーリツ	16,500	1,718.00	28,347,000
長府製作所	11,300	2,550.00	28,815,000
リンナイ	60,900	3,112.00	189,520,800
ダイニチ工業	4,300	745.00	3,203,500
日東精工	16,200	611.00	9,898,200
三洋工業	1,000	1,972.00	1,972,000
岡部	18,000	748.00	13,464,000
ジーテクト	12,500	1,854.00	23,175,000
東プレ	19,700	1,639.00	32,288,300
高周波熱錬	17,300	1,035.00	17,905,500
東京製綱	6,600	1,290.00	8,514,000
サンコール	7,700	535.00	4,119,500
モリテック スチール	6,400	321.00	2,054,400
パイオラックス	15,400	2,232.00	34,372,800
エイチワン	11,500	828.00	9,522,000
日本発條	99,100	1,118.50	110,843,350
中央発條	8,300	703.00	5,834,900
アドバネクス	1,100	985.00	1,083,500
立川ブラインド工業	5,100	1,248.00	6,364,800
三益半導体工業	8,600	2,915.00	25,069,000
日本ドライケミカル	2,100	1,702.00	3,574,200
日本製鋼所	30,200	2,982.50	90,071,500
三浦工業	45,800	3,609.00	165,292,200
タクマ	33,700	1,539.00	51,864,300
ツガミ	24,400	1,277.00	31,158,800
オークマ	11,000	7,428.00	81,708,000
芝浦機械	11,000	4,610.00	50,710,000
アマダ	175,000	1,401.50	245,262,500

アイダエンジニアリング	22,600	997.00	22,532,200
TAKISAWA	2,300	2,531.00	5,821,300
FUJI	47,700	2,647.50	126,285,750
牧野フライス製作所	12,100	5,790.00	70,059,000
オーエスジー	52,400	1,885.00	98,774,000
ダイジェット工業	900	932.00	838,800
旭ダイヤモンド工業	30,700	910.00	27,937,000
DMG森精機	66,500	2,456.00	163,324,000
ソディック	30,100	747.00	22,484,700
ディスコ	52,800	24,660.00	1,302,048,000
日東工器	5,300	1,904.00	10,091,200
日進工具	9,200	1,136.00	10,451,200
パンチ工業	7,800	476.00	3,712,800
富士ダイス	4,000	674.00	2,696,000
豊和工業	4,700	818.00	3,844,600
東洋機械金属	6,000	690.00	4,140,000
エンシュウ	1,900	838.00	1,592,200
島精機製作所	17,500	1,892.00	33,110,000
オプトラン	16,200	2,322.00	37,616,400
NCホールディングス	1,800	2,179.00	3,922,200
イワキポンプ	7,300	1,440.00	10,512,000
フリー	11,500	1,446.00	16,629,000
ヤマシンフィルタ	26,300	301.00	7,916,300
日阪製作所	10,700	932.00	9,972,400
やまびこ	17,900	1,552.00	27,780,800
野村マイクロ・サイエンス	3,700	6,280.00	23,236,000
平田機工	5,200	8,000.00	41,600,000
PEGASUS	12,200	577.00	7,039,400
マルマエ	4,800	1,754.00	8,419,200
タツモ	6,000	2,293.00	13,758,000
ナブテスコ	68,800	3,091.00	212,660,800
三井海洋開発	13,800	1,524.00	21,031,200
レオン自動機	11,600	1,455.00	16,878,000
SMC	35,500	74,610.00	2,648,655,000
ホソカワミクロン	7,600	3,490.00	26,524,000
ユニオンツール	4,800	3,315.00	15,912,000
瑞光	7,900	1,209.00	9,551,100
オイレス工業	15,300	1,932.00	29,559,600
日精エー・エス・ビー機械	4,400	4,040.00	17,776,000
サトーホールディングス	15,600	1,973.00	30,778,800
技研製作所	10,300	2,089.00	21,516,700
日本エアーテック	5,600	1,265.00	7,084,000

カワタ	2,500	1,209.00	3,022,500
日精樹脂工業	8,200	1,004.00	8,232,800
オカダアイヨン	2,600	2,215.00	5,759,000
ワイエイシイホールディングス	3,600	2,770.00	9,972,000
小松製作所	513,600	3,956.00	2,031,801,600
住友重機械工業	64,900	3,485.00	226,176,500
日立建機	43,700	4,284.00	187,210,800
日工	16,400	671.00	11,004,400
巴工業	4,700	2,868.00	13,479,600
井関農機	10,300	1,275.00	13,132,500
TOWA	11,200	2,378.00	26,633,600
丸山製作所	1,500	2,006.00	3,009,000
北川鉄工所	4,400	1,203.00	5,293,200
ローツェ	5,700	10,000.00	57,000,000
タカキタ	2,500	490.00	1,225,000
クボタ	580,100	2,115.50	1,227,201,550
荏原実業	5,300	2,976.00	15,772,800
三菱化工機	3,600	2,724.00	9,806,400
月島ホールディングス	14,900	1,271.00	18,937,900
帝国電機製作所	7,700	2,664.00	20,512,800
新東工業	22,200	1,082.00	24,020,400
澁谷工業	10,300	2,600.00	26,780,000
アイチ コーポレーション	15,400	891.00	13,721,400
小森コーポレーション	25,500	1,114.00	28,407,000
鶴見製作所	8,400	2,579.00	21,663,600
日本ギア工業	3,000	354.00	1,062,000
酒井重工業	1,400	5,210.00	7,294,000
荏原製作所	44,900	6,852.00	307,654,800
石井鐵工所	1,000	2,677.00	2,677,000
西島製作所	9,500	1,904.00	18,088,000
北越工業	11,100	1,531.00	16,994,100
ダイキン工業	130,900	28,910.00	3,784,319,000
オルガノ	15,100	4,100.00	61,910,000
トーヨーカネツ	4,200	3,675.00	15,435,000
栗田工業	61,300	5,569.00	341,379,700
椿本チエイン	15,600	3,845.00	59,982,000
大同工業	3,500	755.00	2,642,500
木村化工機	8,500	725.00	6,162,500
アネスト岩田	18,700	1,163.00	21,748,100
ダイフク	169,600	3,033.00	514,396,800
サムコ	2,900	5,200.00	15,080,000
加藤製作所	4,100	1,209.00	4,956,900

油研工業	1,300	2,085.00	2,710,500
タダノ	57,900	1,128.50	65,340,150
フジテック	38,400	3,625.00	139,200,000
C K D	30,300	2,164.00	65,569,200
平和	36,500	2,408.00	87,892,000
理想科学工業	9,700	2,348.00	22,775,600
S A N K Y O	21,500	5,819.00	125,108,500
日本金銭機械	12,100	1,130.00	13,673,000
マースグループホールディングス	6,500	2,857.00	18,570,500
フクシマガリレイ	8,100	4,895.00	39,649,500
オーイズミ	3,300	512.00	1,689,600
ダイコク電機	6,000	3,935.00	23,610,000
竹内製作所	19,900	4,645.00	92,435,500
アマノ	31,100	2,965.00	92,211,500
J U K I	17,100	582.00	9,952,200
ジャノメ	11,200	653.00	7,313,600
マックス	13,500	2,608.00	35,208,000
グローリー	26,300	2,844.00	74,797,200
新晃工業	11,100	1,923.00	21,345,300
大和冷機工業	16,800	1,439.00	24,175,200
セガサミーホールディングス	88,100	3,028.00	266,766,800
日本ピストンリング	2,900	1,696.00	4,918,400
リケン	4,300	3,310.00	14,233,000
T P R	12,600	1,788.00	22,528,800
ツバキ・ナカシマ	27,100	816.00	22,113,600
ホシザキ	70,600	5,203.00	367,331,800
大豊工業	9,500	957.00	9,091,500
日本精工	201,400	916.50	184,583,100
N T N	216,100	317.00	68,503,700
ジェイテクト	97,600	1,358.00	132,540,800
不二越	8,100	3,855.00	31,225,500
日本トムソン	26,900	589.00	15,844,100
T H K	63,300	2,911.50	184,297,950
ユーシン精機	8,700	709.00	6,168,300
前澤給装工業	7,700	1,157.00	8,908,900
イーグル工業	12,100	1,783.00	21,574,300
前澤工業	4,900	906.00	4,439,400
日本ピラー工業	10,200	4,450.00	45,390,000
キッツ	40,400	1,041.00	42,056,400
マキタ	136,400	4,033.00	550,101,200
三井E & S	51,900	497.00	25,794,300
日立造船	89,900	919.00	82,618,100

三菱重工業	191,700	6,669.00	1,278,447,300
I H I	69,100	3,730.00	257,743,000
スター精密	20,700	1,764.00	36,514,800
日清紡ホールディングス	89,200	1,213.50	108,244,200
イビデン	62,900	8,611.00	541,631,900
コニカミノルタ	245,300	512.80	125,789,840
ブラザー工業	146,600	2,223.50	325,965,100
ミネベアミツミ	190,700	2,693.00	513,555,100
日立製作所	533,000	8,886.00	4,736,238,000
東芝	210,900	4,540.00	957,486,000
三菱電機	1,132,800	2,101.00	2,380,012,800
富士電機	66,600	6,067.00	404,062,200
東洋電機製造	2,800	971.00	2,718,800
安川電機	129,900	6,355.00	825,514,500
シンフォニアテクノロジー	12,100	1,777.00	21,501,700
明電舎	16,600	2,037.00	33,814,200
オリジン	1,900	1,310.00	2,489,000
山洋電気	4,800	7,480.00	35,904,000
デンヨー	8,300	2,123.00	17,620,900
P H C ホールディングス	15,500	1,491.00	23,110,500
ソシオネクスト	15,400	15,520.00	239,008,000
東芝テック	16,400	3,975.00	65,190,000
芝浦メカトロニクス	2,100	23,990.00	50,379,000
マブチモーター	27,300	3,971.00	108,408,300
ニデック	266,700	8,362.00	2,230,145,400
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	8,400	525.00	4,410,000
トレックス・セミコンダクター	5,300	2,376.00	12,592,800
東光高岳	6,700	2,125.00	14,237,500
ダブル・スコープ	35,900	1,460.00	52,414,000
ダイヘン	9,900	5,470.00	54,153,000
ヤーマン	19,200	1,011.00	19,411,200
J V C ケンウッド	100,300	488.00	48,946,400
ミマキエンジニアリング	10,600	960.00	10,176,000
I - P E X	6,200	1,315.00	8,153,000
大崎電気工業	26,000	553.00	14,378,000
オムロン	100,400	8,496.00	852,998,400
日東工業	14,800	3,635.00	53,798,000
I D E C	16,200	3,045.00	49,329,000
正興電機製作所	3,400	1,032.00	3,508,800
不二電機工業	1,900	1,185.00	2,251,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,100	2,850.00	102,885,000
サクサホールディングス	1,800	2,152.00	3,873,600

メルコホールディングス	2,800	3,185.00	8,918,000
テクノメディカ	2,800	2,097.00	5,871,600
日本電気	155,000	6,869.00	1,064,695,000
富士通	109,200	18,435.00	2,013,102,000
沖電気工業	49,600	881.00	43,697,600
岩崎通信機	3,700	794.00	2,937,800
電気興業	4,400	2,392.00	10,524,800
サンケン電気	10,200	13,530.00	138,006,000
ナカヨ	1,400	1,179.00	1,650,600
アイホン	6,700	2,477.00	16,595,900
ルネサスエレクトロニクス	715,300	2,696.50	1,928,806,450
セイコーエプソン	140,600	2,280.50	320,638,300
ワコム	83,700	619.00	51,810,300
アルバック	26,000	6,039.00	157,014,000
アクセル	3,300	1,579.00	5,210,700
E I Z O	8,000	4,785.00	38,280,000
日本信号	25,000	1,031.00	25,775,000
京三製作所	23,000	512.00	11,776,000
能美防災	14,900	1,703.00	25,374,700
ホーチキ	8,300	1,791.00	14,865,300
星和電機	3,800	526.00	1,998,800
エレコム	26,400	1,505.00	39,732,000
パナソニック ホールディングス	1,294,700	1,756.50	2,274,140,550
シャープ	132,000	804.40	106,180,800
アンリツ	77,200	1,238.50	95,612,200
富士通ゼネラル	31,100	3,305.00	102,785,500
ソニーグループ	767,700	13,155.00	10,099,093,500
T D K	173,600	5,418.00	940,564,800
帝国通信工業	5,100	1,650.00	8,415,000
タムラ製作所	47,000	622.00	29,234,000
アルプスアルパイン	98,100	1,247.50	122,379,750
池上通信機	2,700	721.00	1,946,700
日本電波工業	13,300	1,205.00	16,026,500
鈴木	6,100	930.00	5,673,000
メイコー	12,100	2,727.00	32,996,700
日本トリム	2,500	3,220.00	8,050,000
ローランド ディー . ジー .	6,100	3,540.00	21,594,000
フォスター電機	10,100	924.00	9,332,400
S M K	2,600	2,516.00	6,541,600
ヨコオ	8,800	1,859.00	16,359,200
ホシデン	25,700	1,806.00	46,414,200
ヒロセ電機	17,700	18,300.00	323,910,000



日本航空電子工業	22,500	2,932.00	65,970,000
TOA	12,500	977.00	12,212,500
マクセル	22,300	1,562.00	34,832,600
古野電気	14,500	1,238.00	17,951,000
スミダコーポレーション	11,900	1,465.00	17,433,500
アイコム	4,200	2,863.00	12,024,600
リオン	4,600	1,979.00	9,103,400
横河電機	119,900	2,664.50	319,473,550
新電元工業	4,200	3,280.00	13,776,000
アズビル	75,800	4,502.00	341,251,600
東亜ディーケーケー	4,200	846.00	3,553,200
日本光電工業	50,200	3,719.00	186,693,800
チノー	4,500	2,262.00	10,179,000
共和電業	7,900	358.00	2,828,200
日本電子材料	7,200	1,754.00	12,628,800
堀場製作所	24,200	8,078.00	195,487,600
アドバンテクト	85,500	20,505.00	1,753,177,500
小野測器	3,600	449.00	1,616,400
エスペック	8,800	2,331.00	20,512,800
キーエンス	108,600	66,230.00	7,192,578,000
日置電機	5,700	8,110.00	46,227,000
シスメックス	93,600	9,566.00	895,377,600
日本マイクロニクス	18,000	2,119.00	38,142,000
メガチップス	9,000	4,105.00	36,945,000
OBARA GROUP	6,000	4,110.00	24,660,000
澤藤電機	1,200	1,219.00	1,462,800
原田工業	4,000	822.00	3,288,000
コーセル	13,200	1,250.00	16,500,000
イリソ電子工業	10,000	3,915.00	39,150,000
オブテックスグループ	20,000	1,863.00	37,260,000
千代田インテグレ	3,900	2,457.00	9,582,300
レーザーテック	49,800	20,655.00	1,028,619,000
スタンレー電気	77,300	2,744.50	212,149,850
ウシオ電機	55,300	1,962.00	108,498,600
岡谷電機産業	7,300	280.00	2,044,000
ヘリオス テクノ ホールディング	8,100	490.00	3,969,000
エノモト	2,300	1,783.00	4,100,900
日本セラミック	11,100	2,537.00	28,160,700
遠藤照明	4,000	1,315.00	5,260,000
古河電池	8,200	1,017.00	8,339,400
双信電機	4,000	357.00	1,428,000
山一電機	9,500	2,283.00	21,688,500

図研	9,500	3,940.00	37,430,000
日本電子	27,200	4,844.00	131,756,800
カシオ計算機	80,800	1,197.00	96,717,600
ファナック	529,200	4,768.00	2,523,225,600
日本シイエムケイ	23,400	515.00	12,051,000
エンプラス	3,200	5,310.00	16,992,000
大真空	13,600	641.00	8,717,600
ローム	50,200	13,170.00	661,134,000
浜松ホトニクス	87,100	6,815.00	593,586,500
三井ハイテック	11,200	9,380.00	105,056,000
新光電気工業	38,400	5,724.00	219,801,600
京セラ	168,600	7,606.00	1,282,371,600
太陽誘電	52,900	4,355.00	230,379,500
村田製作所	329,200	8,259.00	2,718,862,800
双葉電子工業	21,100	495.00	10,444,500
北陸電気工業	3,300	1,270.00	4,191,000
ニチコン	22,300	1,465.00	32,669,500
日本ケミコン	10,900	1,399.00	15,249,100
K O A	16,600	1,865.00	30,959,000
市光工業	16,000	537.00	8,592,000
小糸製作所	130,600	2,656.50	346,938,900
ミツバ	20,300	843.00	17,112,900
S C R E E Nホールディングス	18,600	15,265.00	283,929,000
キャノン電子	12,100	1,891.00	22,881,100
キャノン	595,400	3,760.00	2,238,704,000
リコー	272,100	1,255.00	341,485,500
象印マホービン	32,500	1,975.00	64,187,500
M U T O Hホールディングス	1,300	1,790.00	2,327,000
東京エレクトロン	229,700	19,665.00	4,517,050,500
イノテック	7,400	1,667.00	12,335,800
トヨタ紡織	45,700	2,618.50	119,665,450
芦森工業	1,600	2,075.00	3,320,000
ユニプレス	19,500	1,142.00	22,269,000
豊田自動織機	79,300	10,445.00	828,288,500
モリタホールディングス	19,100	1,554.00	29,681,400
三櫻工業	16,600	873.00	14,491,800
デンソー	223,800	9,734.00	2,178,469,200
東海理化電機製作所	30,600	2,181.00	66,738,600
川崎重工業	81,800	3,653.00	298,815,400
名村造船所	21,600	586.00	12,657,600
日本車輛製造	4,200	2,048.00	8,601,600
三菱ロジスネクスト	17,300	1,309.00	22,645,700

近畿車輛	1,200	1,640.00	1,968,000
日産自動車	1,541,600	665.00	1,025,164,000
いすゞ自動車	315,500	1,861.00	587,145,500
トヨタ自動車	5,959,100	2,344.50	13,971,109,950
日野自動車	139,900	631.40	88,332,860
三菱自動車工業	423,400	584.20	247,350,280
エフテック	5,900	947.00	5,587,300
レシップホールディングス	3,300	544.00	1,795,200
G M B	1,700	1,398.00	2,376,600
ファルテック	1,400	609.00	852,600
武蔵精密工業	26,500	1,789.00	47,408,500
日産車体	19,100	982.00	18,756,200
新明和工業	34,100	1,411.00	48,115,100
極東開発工業	17,900	1,829.00	32,739,100
トピー工業	8,800	2,453.00	21,586,400
ティラド	2,800	1,877.00	5,255,600
曙ブレーキ工業	66,200	143.00	9,466,600
タチエス	17,200	1,564.00	26,900,800
N O K	42,200	2,131.00	89,928,200
フタバ産業	29,200	597.00	17,432,400
K Y B	10,500	5,050.00	53,025,000
大同メタル工業	21,300	538.00	11,459,400
プレス工業	48,600	639.00	31,055,400
ミクニ	9,800	528.00	5,174,400
太平洋工業	24,900	1,373.00	34,187,700
アイシン	83,700	4,708.00	394,059,600
マツダ	359,000	1,450.50	520,729,500
今仙電機製作所	5,400	611.00	3,299,400
本田技研工業	882,200	4,481.00	3,953,138,200
スズキ	199,300	5,578.00	1,111,695,400
S U B A R U	343,400	2,721.00	934,391,400
安永	3,700	945.00	3,496,500
ヤマハ発動機	170,600	4,163.00	710,207,800
T B K	8,500	424.00	3,604,000
エクセディ	17,800	2,485.00	44,233,000
豊田合成	31,700	2,855.00	90,503,500
愛三工業	18,000	1,164.00	20,952,000
盟和産業	1,200	1,015.00	1,218,000
日本プラスト	6,700	462.00	3,095,400
ヨロズ	10,200	950.00	9,690,000
エフ・シー・シー	19,300	1,860.00	35,898,000
シマノ	44,100	23,630.00	1,042,083,000

テイ・エス テック	49,700	1,840.00	91,448,000
ジャムコ	4,600	1,573.00	7,235,800
テルモ	333,800	4,448.00	1,484,742,400
クリエートメディック	2,800	886.00	2,480,800
日機装	25,300	913.00	23,098,900
日本エム・ディ・エム	6,500	971.00	6,311,500
島津製作所	132,200	4,343.00	574,144,600
JMS	10,100	582.00	5,878,200
長野計器	7,900	2,080.00	16,432,000
ブイ・テクノロジー	5,300	2,438.00	12,921,400
東京計器	8,300	1,311.00	10,881,300
愛知時計電機	4,200	1,548.00	6,501,600
インターアクション	5,200	1,139.00	5,922,800
オーバル	7,500	394.00	2,955,000
東京精密	23,800	7,470.00	177,786,000
マニー	43,400	1,866.50	81,006,100
ニコン	156,900	1,828.50	286,891,650
トプコン	57,100	2,053.50	117,254,850
オリンパス	668,000	2,287.00	1,527,716,000
理研計器	6,700	5,350.00	35,845,000
タムロン	8,100	4,370.00	35,397,000
HOYA	229,900	15,845.00	3,642,765,500
シード	4,300	598.00	2,571,400
ノーリツ鋼機	10,300	2,461.00	25,348,300
A & Dホロンホールディングス	15,800	1,838.00	29,040,400
朝日インテック	121,300	2,845.50	345,159,150
シチズン時計	119,300	904.00	107,847,200
リズム	2,600	1,558.00	4,050,800
大研医器	6,400	513.00	3,283,200
メニコン	37,300	2,491.00	92,914,300
シンシア	800	583.00	466,400
松風	4,900	2,349.00	11,510,100
セイコーグループ	16,800	2,617.00	43,965,600
ニプロ	90,500	1,031.50	93,350,750
KYORITSU	12,500	181.00	2,262,500
中本パックス	2,600	1,627.00	4,230,200
スノーピーク	18,600	1,737.00	32,308,200
パラマウントベッドホールディングス	25,100	2,306.00	57,880,600
トランザクション	7,200	1,801.00	12,967,200
粧美堂	2,300	416.00	956,800
ニホンフラッシュ	10,200	968.00	9,873,600
前田工織	9,200	3,110.00	28,612,000

永大産業	9,000	218.00	1,962,000
アートネイチャー	11,200	793.00	8,881,600
バンダイナムコホールディングス	297,300	3,120.00	927,576,000
アイフィスジャパン	2,300	612.00	1,407,600
S H O E I	24,500	2,540.00	62,230,000
フランスベッドホールディングス	13,300	1,185.00	15,760,500
パイロットコーポレーション	17,000	4,532.00	77,044,000
萩原工業	7,300	1,543.00	11,263,900
フジシールインターナショナル	22,000	1,542.00	33,924,000
タカラトミー	49,900	1,874.00	93,512,600
広済堂ホールディングス	5,700	2,290.00	13,053,000
エステールホールディングス	2,000	621.00	1,242,000
タカノ	3,100	832.00	2,579,200
プロネクサス	9,000	1,047.00	9,423,000
ホクシン	6,400	136.00	870,400
ウッドワン	2,800	1,190.00	3,332,000
大建工業	6,600	2,325.00	15,345,000
凸版印刷	133,400	3,241.00	432,349,400
大日本印刷	118,600	4,024.00	477,246,400
共同印刷	3,100	3,205.00	9,935,500
N I S S H A	20,600	1,693.00	34,875,800
光村印刷	700	1,239.00	867,300
T A K A R A & C O M P A N Y	6,900	2,316.00	15,980,400
アシックス	100,200	4,282.00	429,056,400
ツツミ	1,900	2,204.00	4,187,600
ローランド	8,000	4,100.00	32,800,000
小松ウオール工業	4,000	2,745.00	10,980,000
ヤマハ	68,400	5,351.00	366,008,400
河合楽器製作所	2,900	3,510.00	10,179,000
クリナップ	12,200	727.00	8,869,400
ビジョン	69,100	1,910.50	132,015,550
キングジム	9,600	880.00	8,448,000
リンテック	21,800	2,313.50	50,434,300
イトーキ	22,200	1,083.00	24,042,600
任天堂	685,200	6,443.00	4,414,743,600
三菱鉛筆	15,400	1,638.00	25,225,200
タカラスタンダード	20,000	1,862.00	37,240,000
コクヨ	52,200	2,033.00	106,122,600
ナカバヤシ	11,700	510.00	5,967,000
グローブライド	8,800	2,233.00	19,650,400
オカムラ	32,700	1,965.00	64,255,500
美津濃	10,800	3,705.00	40,014,000

東京電力ホールディングス	978,300	523.80	512,433,540	
中部電力	399,900	1,729.00	691,427,100	
関西電力	419,100	1,801.00	754,799,100	
中国電力	172,800	991.80	171,383,040	
北陸電力	102,400	830.60	85,053,440	
東北電力	265,300	899.80	238,716,940	
四国電力	92,600	1,006.50	93,201,900	
九州電力	250,200	923.10	230,959,620	
北海道電力	104,800	573.70	60,123,760	
沖縄電力	25,400	1,179.00	29,946,600	
電源開発	81,700	2,208.00	180,393,600	
エフオン	7,000	557.00	3,899,000	
イーレックス	19,300	1,128.00	21,770,400	
レノバ	28,900	1,517.00	43,841,300	
東京瓦斯	229,400	3,187.00	731,097,800	
大阪瓦斯	219,800	2,184.50	480,153,100	
東邦瓦斯	42,700	2,470.00	105,469,000	
北海道瓦斯	6,500	2,360.00	15,340,000	
広島ガス	22,900	377.00	8,633,300	
西部ガスホールディングス	10,200	2,048.00	20,889,600	
静岡ガス	24,700	1,067.00	26,354,900	
メタウォーター	13,500	1,798.00	24,273,000	
SBSホールディングス	9,700	3,340.00	32,398,000	
東武鉄道	119,200	3,650.00	435,080,000	
相鉄ホールディングス	35,800	2,487.50	89,052,500	
東急	304,300	1,719.50	523,243,850	
京浜急行電鉄	123,100	1,319.50	162,430,450	
小田急電鉄	164,500	1,914.50	314,935,250	
京王電鉄	57,400	4,453.00	255,602,200	
京成電鉄	70,000	5,807.00	406,490,000	
富士急行	13,400	5,450.00	73,030,000	
東日本旅客鉄道	184,100	7,882.00	1,451,076,200	
西日本旅客鉄道	138,600	5,728.00	793,900,800	
東海旅客鉄道	83,600	17,750.00	1,483,900,000	
西武ホールディングス	131,300	1,504.50	197,540,850	
鴻池運輸	18,500	1,793.00	33,170,500	
西日本鉄道	29,000	2,474.50	71,760,500	
ハマキョウレックス	8,500	3,855.00	32,767,500	
サカイ引越センター	5,200	5,120.00	26,624,000	
近鉄グループホールディングス	108,300	4,639.00	502,403,700	
阪急阪神ホールディングス	144,500	4,617.00	667,156,500	
南海電気鉄道	51,800	2,985.50	154,648,900	

京阪ホールディングス	59,700	3,791.00	226,322,700
神戸電鉄	2,900	3,015.00	8,743,500
名古屋鉄道	119,700	2,215.00	265,135,500
山陽電気鉄道	8,200	2,185.00	17,917,000
アルプス物流	8,600	1,575.00	13,545,000
ヤマトホールディングス	138,700	2,668.50	370,120,950
山九	27,600	4,846.00	133,749,600
丸運	4,100	241.00	988,100
丸全昭和運輸	6,700	4,130.00	27,671,000
センコーグループホールディングス	57,400	1,032.00	59,236,800
トナミホールディングス	2,400	5,040.00	12,096,000
ニッコンホールディングス	34,700	2,937.00	101,913,900
日本石油輸送	800	2,847.00	2,277,600
福山通運	8,200	4,080.00	33,456,000
セイノーホールディングス	67,400	2,167.00	146,055,800
エスライングループ本社	2,400	857.00	2,056,800
神奈川中央交通	3,100	3,180.00	9,858,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	26,200	1,965.00	51,483,000
C & F ロジホールディングス	10,400	1,319.00	13,717,600
九州旅客鉄道	76,600	3,062.00	234,549,200
S Gホールディングス	207,900	2,163.00	449,687,700
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	40,400	8,272.00	334,188,800
日本郵船	290,100	3,451.00	1,001,135,100
商船三井	191,200	3,730.00	713,176,000
川崎汽船	81,600	4,264.00	347,942,400
N Sユナイテッド海運	6,000	3,640.00	21,840,000
飯野海運	40,600	893.00	36,255,800
共栄タンカー	2,300	870.00	2,001,000
乾汽船	14,300	1,288.00	18,418,400
日本航空	266,100	3,074.00	817,991,400
A N Aホールディングス	294,800	3,400.00	1,002,320,000
パスコ	1,600	1,845.00	2,952,000
トランコム	3,100	6,930.00	21,483,000
日新	8,200	2,585.00	21,197,000
三菱倉庫	23,300	3,517.00	81,946,100
三井倉庫ホールディングス	10,100	3,580.00	36,158,000
住友倉庫	29,200	2,436.00	71,131,200
澁澤倉庫	4,300	2,950.00	12,685,000
東陽倉庫	11,200	274.00	3,068,800
日本トランスシティ	21,800	638.00	13,908,400
ケイヒン	1,500	1,810.00	2,715,000
中央倉庫	5,200	1,103.00	5,735,600

川西倉庫	1,400	1,039.00	1,454,600
安田倉庫	7,400	1,012.00	7,488,800
ファイブホールディングス	1,500	1,197.00	1,795,500
東洋埠頭	2,400	1,404.00	3,369,600
上組	52,000	3,241.00	168,532,000
サンリツ	1,900	740.00	1,406,000
キムラユニティー	4,000	1,312.00	5,248,000
キューソー流通システム	5,000	932.00	4,660,000
東海運	4,900	291.00	1,425,900
エーアイティー	6,800	1,851.00	12,586,800
内外トランスライン	3,900	2,687.00	10,479,300
日本コンセプト	3,400	2,013.00	6,844,200
NEC ネットエスアイ	36,400	1,922.00	69,960,800
クロスキャット	6,200	1,122.00	6,956,400
システナ	183,100	287.00	52,549,700
デジタルアーツ	6,900	5,360.00	36,984,000
日鉄ソリューションズ	18,600	3,940.00	73,284,000
キューブシステム	6,500	1,196.00	7,774,000
コア	4,800	1,750.00	8,400,000
手間いらず	1,800	3,750.00	6,750,000
ラクーンホールディングス	9,100	697.00	6,342,700
ソリトンシステムズ	5,600	1,226.00	6,865,600
ソフトクリエイイトホールディングス	9,000	1,670.00	15,030,000
T I S	119,100	3,479.00	414,348,900
J N Sホールディングス	3,900	439.00	1,712,100
グリー	29,200	626.00	18,279,200
G M Oペパボ	1,600	1,717.00	2,747,200
コーエーテクモホールディングス	68,200	2,363.00	161,156,600
三菱総合研究所	5,300	5,290.00	28,037,000
電算	1,000	1,593.00	1,593,000
A G S	3,600	766.00	2,757,600
ファインデックス	8,700	609.00	5,298,300
ブレインパッド	8,200	933.00	7,650,600
K L a b	21,700	308.00	6,683,600
ポルトウウィンホールディングス	18,600	698.00	12,982,800
ネクソン	277,200	2,657.00	736,520,400
アイスタイル	31,700	492.00	15,596,400
エムアップホールディングス	13,400	1,150.00	15,410,000
エイチーム	6,500	708.00	4,602,000
エニグモ	13,900	375.00	5,212,500
テクノスジャパン	7,000	630.00	4,410,000
コロプラ	42,300	660.00	27,918,000



ブロードリーフ	63,600	440.00	27,984,000
クロス・マーケティンググループ	5,100	825.00	4,207,500
デジタルハーツホールディングス	6,800	1,450.00	9,860,000
システム情報	8,700	735.00	6,394,500
メディアドゥ	4,400	1,320.00	5,808,000
じげん	31,800	752.00	23,913,600
ブイキューブ	13,100	449.00	5,881,900
エンカレッジ・テクノロジー	2,000	513.00	1,026,000
サイバーリンクス	2,800	708.00	1,982,400
フィックスターズ	12,300	1,424.00	17,515,200
CARTA HOLDINGS	5,100	1,231.00	6,278,100
オブティム	9,000	956.00	8,604,000
セレス	4,400	1,026.00	4,514,400
SHIFT	7,200	31,990.00	230,328,000
ティーガイア	11,400	1,779.00	20,280,600
セック	1,200	2,975.00	3,570,000
テクマトリックス	19,900	1,748.00	34,785,200
プロシップ	4,800	1,360.00	6,528,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	31,900	2,739.50	87,390,050
GMOペイメントゲートウェイ	21,800	10,685.00	232,933,000
ザッパラス	2,400	373.00	895,200
システムリサーチ	3,400	2,566.00	8,724,400
インターネットイニシアティブ	60,300	2,582.00	155,694,600
さくらインターネット	12,200	1,059.00	12,919,800
ヴィンクス	2,500	1,286.00	3,215,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,300	2,954.00	9,748,200
SRAホールディングス	5,600	3,170.00	17,752,000
システムインテグレータ	2,600	426.00	1,107,600
朝日ネット	11,700	653.00	7,640,100
eBASE	15,400	716.00	11,026,400
アバントグループ	13,800	1,444.00	19,927,200
アドソル日進	4,600	1,635.00	7,521,000
ODKソリューションズ	1,900	571.00	1,084,900
フリービット	5,700	1,234.00	7,033,800
コムチュア	14,400	2,020.00	29,088,000
サイバーコム	1,400	1,443.00	2,020,200
アステリア	8,600	845.00	7,267,000
アイル	5,100	2,647.00	13,499,700
マークラインズ	5,900	2,715.00	16,018,500
メディカル・データ・ビジョン	16,300	678.00	11,051,400
gumi	16,100	701.00	11,286,100
ショーケース	2,000	374.00	748,000

モバイルファクトリー	1,800	847.00	1,524,600
テラスカイ	4,700	2,051.00	9,639,700
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,300	1,776.00	11,188,800
P C Iホールディングス	3,300	1,128.00	3,722,400
アイビーシー	1,400	583.00	816,200
ネオジャパン	3,700	1,036.00	3,833,200
P R T I M E S	2,800	1,565.00	4,382,000
ラクス	51,500	2,431.50	125,222,250
ランドコンピュータ	2,100	1,243.00	2,610,300
ダブルスタンダード	4,400	2,376.00	10,454,400
オープンドア	7,600	1,209.00	9,188,400
アカツキ	5,200	2,096.00	10,899,200
ベネフィットジャパン	500	1,254.00	627,000
U b i c o mホールディングス	3,400	1,393.00	4,736,200
カナミックネットワーク	11,800	459.00	5,416,200
ノムラシステムコーポレーション	8,200	117.00	959,400
チェンジホールディングス	26,700	1,849.00	49,368,300
シンクロ・フード	5,400	700.00	3,780,000
オークネット	5,400	1,726.00	9,320,400
キャピタル・アセット・プランニング	1,700	799.00	1,358,300
セグエグループ	2,400	1,109.00	2,661,600
エイトレッド	1,300	1,407.00	1,829,100
マクロミル	21,400	789.00	16,884,600
ビーグリー	1,400	1,117.00	1,563,800
オロ	3,300	1,900.00	6,270,000
ユーザーローカル	3,900	2,264.00	8,829,600
テモナ	2,100	285.00	598,500
ニーズウェル	4,700	751.00	3,529,700
マネーフォワード	26,300	5,548.00	145,912,400
サインポスト	3,300	463.00	1,527,900
S u n A s t e r i s k	7,700	1,106.00	8,516,200
電算システムホールディングス	5,300	3,165.00	16,774,500
A p p i e r G r o u p	41,300	1,639.00	67,690,700
ソルクシーズ	6,900	425.00	2,932,500
フェイス	2,400	508.00	1,219,200
プロトコーポレーション	13,600	1,224.00	16,646,400
ハイマックス	3,400	1,412.00	4,800,800
野村総合研究所	216,800	3,866.00	838,148,800
サイバネットシステム	9,200	804.00	7,396,800
C Eホールディングス	4,400	619.00	2,723,600
日本システム技術	3,500	2,390.00	8,365,000
インテージホールディングス	12,300	1,650.00	20,295,000

東邦システムサイエンス	2,400	1,226.00	2,942,400
ソースネクスト	55,500	192.00	10,656,000
インフォコム	14,000	2,261.00	31,654,000
シンプレクス・ホールディングス	18,600	2,541.00	47,262,600
HEROZ	3,700	1,843.00	6,819,100
ラクスル	26,100	1,447.00	37,766,700
メルカリ	65,600	3,580.00	234,848,000
I P S	3,500	2,303.00	8,060,500
F I G	9,900	282.00	2,791,800
システムサポート	4,200	1,965.00	8,253,000
イーソル	7,000	838.00	5,866,000
アルテリア・ネットワークス	10,200	1,979.00	20,185,800
東海ソフト	1,300	1,093.00	1,420,900
ウイングアーク1st	11,200	2,618.00	29,321,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,900	1,516.00	4,396,400
サーバーワークス	2,200	3,110.00	6,842,000
東名	600	2,762.00	1,657,200
ヴィッツ	900	1,176.00	1,058,400
トピラシステムズ	2,100	918.00	1,927,800
Sansan	35,600	1,513.00	53,862,800
Link-U	2,000	911.00	1,822,000
ギフトィ	11,900	1,641.00	19,527,900
メドレー	14,600	4,840.00	70,664,000
ベース	3,700	5,310.00	19,647,000
JMDC	17,900	5,392.00	96,516,800
フォーカスシステムズ	8,000	1,028.00	8,224,000
クレスコ	8,400	2,037.00	17,110,800
フジ・メディア・ホールディングス	104,600	1,567.00	163,908,200
オービック	36,400	22,985.00	836,654,000
ジャストシステム	15,600	4,195.00	65,442,000
TDCソフト	9,200	1,891.00	17,397,200
Zホールディングス	1,549,100	391.60	606,627,560
トレンドマイクロ	62,900	6,514.00	409,730,600
IDホールディングス	7,400	1,284.00	9,501,600
日本オラクル	20,800	10,250.00	213,200,000
アルファシステムズ	3,400	3,335.00	11,339,000
フューチャー	27,100	1,786.00	48,400,600
CAC Holdings	6,700	1,696.00	11,363,200
S Bテクノロジー	4,600	2,640.00	12,144,000
トーセ	2,500	752.00	1,880,000
オービックビジネスコンサルタント	21,400	5,360.00	114,704,000
伊藤忠テクノソリューションズ	58,400	3,503.00	204,575,200

アイティフォー	14,400	1,096.00	15,782,400
東計電算	1,500	6,190.00	9,285,000
エクスネット	1,200	1,021.00	1,225,200
大塚商会	61,700	5,542.00	341,941,400
サイボウズ	15,000	2,296.00	34,440,000
電通国際情報サービス	13,200	5,040.00	66,528,000
A C C E S S	12,900	904.00	11,661,600
デジタルガレージ	19,300	4,025.00	77,682,500
E Mシステムズ	18,200	860.00	15,652,000
ウェザーニューズ	3,400	6,320.00	21,488,000
C I J	18,100	536.00	9,701,600
ビジネスエンジニアリング	1,800	2,997.00	5,394,600
日本エンタープライズ	9,000	140.00	1,260,000
WOWOW	8,200	1,152.00	9,446,400
スカラ	10,100	751.00	7,585,100
インテリジェント ウェイブ	4,500	802.00	3,609,000
I M A G I C A G R O U P	9,100	664.00	6,042,400
ネットワンシステムズ	40,600	3,013.00	122,327,800
システムソフト	38,300	82.00	3,140,600
アルゴグラフィックス	10,000	3,560.00	35,600,000
マーベラス	17,700	682.00	12,071,400
エイベックス	18,500	1,504.00	27,824,000
B I P R O G Y	40,100	3,377.00	135,417,700
都築電気	5,700	1,969.00	11,223,300
T B Sホールディングス	55,700	2,625.00	146,212,500
日本テレビホールディングス	96,400	1,350.00	130,140,000
朝日放送グループホールディングス	10,200	682.00	6,956,400
テレビ朝日ホールディングス	26,400	1,772.00	46,780,800
スカパーJ S A Tホールディングス	96,600	589.00	56,897,400
テレビ東京ホールディングス	7,800	3,445.00	26,871,000
日本BS放送	3,100	940.00	2,914,000
ビジョン	14,400	1,669.00	24,033,600
スマートバリュー	2,100	383.00	804,300
U S E N - N E X T H O L D I N G S	12,200	3,390.00	41,358,000
ワイヤレスゲート	3,800	225.00	855,000
日本通信	100,600	233.00	23,439,800
クロップス	1,400	990.00	1,386,000
日本電信電話	34,866,900	163.00	5,683,304,700
K D D I	841,100	4,299.00	3,615,888,900
ソフトバンク	1,749,100	1,542.00	2,697,112,200
光通信	12,800	20,720.00	265,216,000
エムティーアイ	7,500	560.00	4,200,000

GMOインターネットグループ	40,200	2,746.50	110,409,300
ファイバーゲート	5,900	1,391.00	8,206,900
アйдママーケティングコミュニケーション	2,100	275.00	577,500
KADOKAWA	57,600	3,438.00	198,028,800
学研ホールディングス	18,200	886.00	16,125,200
ゼンリン	18,600	943.00	17,539,800
昭文社ホールディングス	3,700	314.00	1,161,800
インプレスホールディングス	7,600	215.00	1,634,000
アイネット	6,600	1,624.00	10,718,400
松竹	6,200	10,845.00	67,239,000
東宝	68,100	5,488.00	373,732,800
東映	3,000	17,330.00	51,990,000
NTTデータグループ	341,500	1,965.50	671,218,250
ピー・シー・エー	6,300	1,510.00	9,513,000
ビジネスブレイン太田昭和	4,700	2,197.00	10,325,900
DTS	23,200	3,340.00	77,488,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	54,700	6,328.00	346,141,600
シーイーシー	15,300	1,722.00	26,346,600
カブコン	108,200	5,683.00	614,900,600
アイ・エス・ビー	5,600	1,552.00	8,691,200
ジャステック	6,700	1,353.00	9,065,100
SCSK	88,800	2,184.00	193,939,200
NSW	4,200	2,438.00	10,239,600
アイネス	7,700	1,493.00	11,496,100
TKC	17,400	3,715.00	64,641,000
富士ソフト	24,600	4,595.00	113,037,000
NSD	38,900	2,734.00	106,352,600
コナミグループ	46,600	7,588.00	353,600,800
福井コンピュータホールディングス	7,600	2,632.00	20,003,200
JBCホールディングス	7,900	2,515.00	19,868,500
ミロク情報サービス	9,900	1,646.00	16,295,400
ソフトバンクグループ	536,900	6,966.00	3,740,045,400
高千穂交易	3,200	3,115.00	9,968,000
オルバヘルスケアホールディングス	1,300	1,764.00	2,293,200
伊藤忠食品	2,600	5,140.00	13,364,000
エレマテック	10,300	1,819.00	18,735,700
あらた	8,800	4,850.00	42,680,000
トーメンデバイス	1,700	4,960.00	8,432,000
東京エレクトロン デバイス	4,200	10,080.00	42,336,000
円谷フィールズホールディングス	19,700	2,970.00	58,509,000
双日	114,400	3,307.00	378,320,800
アルフレッサ ホールディングス	115,300	2,179.00	251,238,700

横浜冷凍	31,300	1,202.00	37,622,600
ラサ商事	4,100	1,476.00	6,051,600
アルコニックス	15,100	1,426.00	21,532,600
神戸物産	88,800	3,684.00	327,139,200
ハイパー	1,700	453.00	770,100
あい ホールディングス	18,400	2,256.00	41,510,400
ディーブイエックス	2,500	863.00	2,157,500
ダイワボウホールディングス	46,900	2,695.00	126,395,500
マクニカホールディングス	27,200	5,880.00	159,936,000
ラクト・ジャパン	4,400	1,963.00	8,637,200
グリムス	4,800	2,672.00	12,825,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	16,800	967.00	16,245,600
八洲電機	9,300	1,360.00	12,648,000
メディアスホールディングス	7,400	803.00	5,942,200
レスターホールディングス	11,000	2,351.00	25,861,000
ジューテックホールディングス	2,100	1,210.00	2,541,000
大光	3,800	583.00	2,215,400
OCHIホールディングス	2,000	1,342.00	2,684,000
TOKAIホールディングス	56,700	893.00	50,633,100
黒谷	2,500	618.00	1,545,000
Cominix	1,800	875.00	1,575,000
三洋貿易	13,000	1,350.00	17,550,000
ビューティガレージ	1,800	4,590.00	8,262,000
ウイン・パートナーズ	8,400	1,078.00	9,055,200
ミタチ産業	2,300	1,091.00	2,509,300
シップヘルスケアホールディングス	41,300	2,277.00	94,040,100
明治電機工業	4,300	1,523.00	6,548,900
デリカフーズホールディングス	3,500	600.00	2,100,000
スターティアホールディングス	1,800	1,231.00	2,215,800
コメダホールディングス	28,100	2,730.00	76,713,000
ピーバンドットコム	1,300	460.00	598,000
アセンテック	3,900	663.00	2,585,700
富士興産	2,000	1,686.00	3,372,000
協栄産業	800	2,022.00	1,617,600
フルサト・マルカホールディングス	11,400	2,559.00	29,172,600
ヤマエグループホールディングス	6,500	3,230.00	20,995,000
小野建	11,300	1,695.00	19,153,500
南陽	1,700	2,159.00	3,670,300
佐島電機	5,600	1,492.00	8,355,200
エコートレーディング	1,700	1,178.00	2,002,600
伯東	6,600	5,570.00	36,762,000
コンドーテック	8,800	1,224.00	10,771,200

中山福	4,800	347.00	1,665,600
ナガイレーベン	14,500	2,274.00	32,973,000
三菱食品	10,600	3,720.00	39,432,000
松田産業	8,700	2,303.00	20,036,100
第一興商	44,400	2,831.50	125,718,600
メディカルホールディングス	109,800	2,410.00	264,618,000
S P K	5,100	1,805.00	9,205,500
萩原電気ホールディングス	4,500	3,220.00	14,490,000
アズワン	16,300	5,488.00	89,454,400
スズデン	4,000	2,198.00	8,792,000
尾家産業	2,100	1,329.00	2,790,900
シモジマ	7,900	1,069.00	8,445,100
ドウシシャ	12,100	2,267.00	27,430,700
小津産業	2,000	1,587.00	3,174,000
高速	6,000	2,049.00	12,294,000
たけびし	4,400	1,738.00	7,647,200
リックス	1,800	3,140.00	5,652,000
丸文	10,300	1,217.00	12,535,100
ハピネット	9,800	2,172.00	21,285,600
橋本総業ホールディングス	4,600	1,230.00	5,658,000
日本ライフライン	33,700	988.00	33,295,600
タカショー	10,000	669.00	6,690,000
I D O M	34,700	815.00	28,280,500
進和	7,000	2,216.00	15,512,000
エスケイジャパン	2,200	672.00	1,478,400
ダイトロン	4,500	3,070.00	13,815,000
シークス	16,400	1,514.00	24,829,600
田中商事	2,500	653.00	1,632,500
オーハシテクニカ	5,600	1,582.00	8,859,200
白銅	4,200	2,370.00	9,954,000
ダイコー通産	900	1,130.00	1,017,000
伊藤忠商事	707,500	5,622.00	3,977,565,000
丸紅	896,000	2,454.00	2,198,784,000
高島	1,400	3,585.00	5,019,000
長瀬産業	52,600	2,412.00	126,871,200
蝶理	6,200	3,020.00	18,724,000
豊田通商	100,600	7,589.00	763,453,400
三共生興	16,500	637.00	10,510,500
兼松	44,600	2,073.00	92,455,800
ツカモトコーポレーション	1,300	1,301.00	1,691,300
三井物産	814,900	5,412.00	4,410,238,800
日本紙パルプ商事	6,100	4,550.00	27,755,000

カメイ	12,200	1,492.00	18,202,400
東都水産	500	6,500.00	3,250,000
OUGホールディングス	1,300	2,459.00	3,196,700
スターゼン	8,700	2,346.00	20,410,200
山善	31,000	1,174.00	36,394,000
椿本興業	1,900	4,585.00	8,711,500
住友商事	711,100	3,015.00	2,143,966,500
内田洋行	4,700	5,250.00	24,675,000
三菱商事	700,100	7,153.00	5,007,815,300
第一実業	4,100	5,390.00	22,099,000
キャノンマーケティングジャパン	26,600	3,695.00	98,287,000
西華産業	4,500	1,997.00	8,986,500
佐藤商事	8,000	1,501.00	12,008,000
菱洋エレクトロ	9,800	3,615.00	35,427,000
東京産業	10,500	869.00	9,124,500
ユアサ商事	10,300	4,570.00	47,071,000
神鋼商事	2,900	5,900.00	17,110,000
トルク	4,900	248.00	1,215,200
阪和興業	20,600	4,850.00	99,910,000
正栄食品工業	7,600	4,255.00	32,338,000
カナデン	7,700	1,349.00	10,387,300
RYODEN	9,300	2,151.00	20,004,300
岩谷産業	26,100	7,384.00	192,722,400
ナイス	2,400	1,523.00	3,655,200
ニチモウ	1,100	4,030.00	4,433,000
極東貿易	6,900	1,778.00	12,268,200
アステナホールディングス	19,900	445.00	8,855,500
三愛オブリ	30,400	1,588.00	48,275,200
稲畑産業	23,200	3,305.00	76,676,000
G S Iクレオス	6,700	2,027.00	13,580,900
明和産業	15,300	685.00	10,480,500
クワザワホールディングス	2,900	550.00	1,595,000
ワキタ	21,100	1,277.00	26,944,700
東邦ホールディングス	28,600	2,766.50	79,121,900
サンゲツ	28,800	2,583.00	74,390,400
ミツウロコグループホールディングス	14,700	1,356.00	19,933,200
シナネンホールディングス	3,700	3,840.00	14,208,000
伊藤忠エネクス	28,500	1,366.00	38,931,000
サンリオ	32,500	6,089.00	197,892,500
サンワテクノス	5,900	2,350.00	13,865,000
リョーサン	12,200	4,420.00	53,924,000
新光商事	15,400	1,137.00	17,509,800



トーホー	4,900	2,612.00	12,798,800
三信電気	4,600	2,145.00	9,867,000
東陽テクニカ	11,700	1,391.00	16,274,700
モスフードサービス	16,900	3,235.00	54,671,500
加賀電子	9,300	6,310.00	58,683,000
ソーダニッカ	6,600	841.00	5,550,600
立花エレテック	8,400	2,725.00	22,890,000
フォーバル	4,500	1,213.00	5,458,500
PALTAC	18,100	4,765.00	86,246,500
三谷産業	20,100	324.00	6,512,400
西本Wismettacホールディングス	2,900	4,575.00	13,267,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	700	2,034.00	1,423,800
コア商事ホールディングス	6,500	692.00	4,498,000
KPPグループホールディングス	26,800	615.00	16,482,000
ヤマタネ	5,100	1,819.00	9,276,900
丸紅建材リース	800	2,451.00	1,960,800
泉州電業	5,800	3,850.00	22,330,000
トラスコ中山	24,100	2,164.00	52,152,400
オートバックスセブン	40,000	1,556.50	62,260,000
モリト	8,200	1,152.00	9,446,400
加藤産業	14,200	3,825.00	54,315,000
北恵	2,000	795.00	1,590,000
イエローハット	20,300	1,845.00	37,453,500
JKホールディングス	8,800	1,010.00	8,888,000
日伝	6,800	2,422.00	16,469,600
北沢産業	4,800	342.00	1,641,600
杉本商事	5,100	2,120.00	10,812,000
因幡電機産業	29,800	3,150.00	93,870,000
東テク	3,800	5,280.00	20,064,000
ミスミグループ本社	173,300	2,724.50	472,155,850
アルテック	5,000	259.00	1,295,000
タキヒヨー	2,200	1,209.00	2,659,800
蔵王産業	1,500	2,458.00	3,687,000
スズケン	33,600	4,102.00	137,827,200
ジェコス	6,900	888.00	6,127,200
グローセル	10,800	421.00	4,546,800
ローソン	28,500	6,927.00	197,419,500
サンエー	8,800	4,690.00	41,272,000
カワチ薬品	9,100	2,176.00	19,801,600
エービーシー・マート	16,800	7,734.00	129,931,200
ハードオフコーポレーション	3,800	1,523.00	5,787,400
アスクル	23,900	1,982.00	47,369,800

ゲオホールディングス	11,400	1,922.00	21,910,800
アダストリア	14,000	2,836.00	39,704,000
くら寿司	13,500	3,065.00	41,377,500
キャンドウ	4,200	2,654.00	11,146,800
I Kホールディングス	3,700	372.00	1,376,400
パルグループホールディングス	11,400	4,000.00	45,600,000
エディオン	45,700	1,460.00	66,722,000
サーラコーポレーション	24,500	734.00	17,983,000
ワッツ	4,800	640.00	3,072,000
ハローズ	5,300	3,655.00	19,371,500
あみやき亭	2,900	3,410.00	9,889,000
大黒天物産	3,600	6,070.00	21,852,000
ハニーズホールディングス	9,200	1,614.00	14,848,800
ファーマライズホールディングス	2,500	620.00	1,550,000
アルペン	9,600	1,948.00	18,700,800
ハブ	3,300	882.00	2,910,600
クオールホールディングス	16,000	1,676.00	26,816,000
ジinzホールディングス	6,900	3,560.00	24,564,000
ビックカメラ	61,400	1,071.00	65,759,400
D C Mホールディングス	67,000	1,205.00	80,735,000
MonotaRO	163,000	1,779.00	289,977,000
東京一番フーズ	2,700	510.00	1,377,000
きちりホールディングス	2,100	856.00	1,797,600
アークランドサービスホールディングス	9,500	3,050.00	28,975,000
J . フロント リテイリング	143,000	1,364.50	195,123,500
ドトール・日レスホールディングス	20,500	2,227.00	45,653,500
マツキヨココカラ & カンパニー	69,700	8,061.00	561,851,700
ブロンコビリー	6,200	2,938.00	18,215,600
Z O Z O	76,000	2,771.50	210,634,000
トレジャー・ファクトリー	5,700	1,403.00	7,997,100
物語コーポレーション	19,300	3,535.00	68,225,500
三越伊勢丹ホールディングス	193,500	1,479.50	286,283,250
H a m e e	4,300	1,053.00	4,527,900
マーケットエンタープライズ	1,100	1,517.00	1,668,700
ウエルシアホールディングス	59,700	2,693.50	160,801,950
クリエイトSDホールディングス	19,100	3,455.00	65,990,500
丸善C H I ホールディングス	11,400	356.00	4,058,400
ミサワ	2,100	615.00	1,291,500
ティーライフ	1,400	1,577.00	2,207,800
チムニー	2,700	1,343.00	3,626,100
シュッピン	8,800	1,052.00	9,257,600
オイシックス・ラ・大地	15,600	2,298.00	35,848,800

ネクステージ	26,300	3,645.00	95,863,500
ジョイフル本田	34,000	1,635.00	55,590,000
鳥貴族ホールディングス	4,400	2,576.00	11,334,400
ホットランド	9,000	1,699.00	15,291,000
すかいらーくホールディングス	157,100	1,807.00	283,879,700
SFPホールディングス	6,300	2,228.00	14,036,400
綿半ホールディングス	9,100	1,370.00	12,467,000
ヨシックスホールディングス	1,900	2,611.00	4,960,900
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	37,700	1,111.00	41,884,700
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,600	788.00	4,412,800
B E E N O S	5,000	1,946.00	9,730,000
あさひ	9,800	1,250.00	12,250,000
日本調剤	8,100	1,200.00	9,720,000
コスモス薬品	11,400	15,805.00	180,177,000
トーエル	4,400	754.00	3,317,600
セブン&アイ・ホールディングス	395,700	5,884.00	2,328,298,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	86,400	1,091.00	94,262,400
ツルハホールディングス	24,100	10,490.00	252,809,000
サンマルクホールディングス	9,400	1,921.00	18,057,400
フェリシモ	2,300	1,006.00	2,313,800
トリドールホールディングス	28,700	3,345.00	96,001,500
T O K Y O B A S E	12,700	343.00	4,356,100
ウイルプラスホールディングス	1,700	1,162.00	1,975,400
J Mホールディングス	8,800	1,946.00	17,124,800
サツドラホールディングス	4,500	759.00	3,415,500
アレンザホールディングス	8,900	1,008.00	8,971,200
串カツ田中ホールディングス	3,300	1,520.00	5,016,000
パロックジャパンリミテッド	7,800	903.00	7,043,400
クスリのアオキホールディングス	10,300	7,869.00	81,050,700
力の源ホールディングス	5,100	2,105.00	10,735,500
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	61,400	2,629.00	161,420,600
メディカルシステムネットワーク	10,800	374.00	4,039,200
はるやまホールディングス	4,400	510.00	2,244,000
ノジマ	37,700	1,391.00	52,440,700
カップ・クリエイト	18,000	1,525.00	27,450,000
ライトオン	6,700	592.00	3,966,400
良品計画	125,600	1,796.00	225,577,600
パリミキホールディングス	12,100	326.00	3,944,600
アドヴァングループ	11,300	995.00	11,243,500
アルピス	3,900	2,441.00	9,519,900

コナカ	9,700	399.00	3,870,300
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,606.00	2,087,800
G - 7ホールディングス	14,600	1,246.00	18,191,600
イオン北海道	17,100	861.00	14,723,100
コジマ	19,500	643.00	12,538,500
ヒマラヤ	3,100	958.00	2,969,800
コーナン商事	15,600	3,455.00	53,898,000
エコス	4,400	2,030.00	8,932,000
ワタミ	13,900	893.00	12,412,700
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	231,800	2,718.00	630,032,400
西松屋チェーン	25,600	1,708.00	43,724,800
ゼンショーホールディングス	62,900	7,156.00	450,112,400
幸楽苑ホールディングス	7,500	1,017.00	7,627,500
ハークスレイ	3,600	658.00	2,368,800
サイゼリヤ	17,100	4,360.00	74,556,000
V Tホールディングス	44,200	530.00	23,426,000
魚力	3,700	2,154.00	7,969,800
フジ・コーポレーション	6,700	1,767.00	11,838,900
ユナイテッドアローズ	12,400	2,406.00	29,834,400
ハイデイ日高	17,200	2,522.00	43,378,400
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	7,000	184.00	1,288,000
コロワイド	52,900	2,063.00	109,132,700
壱番屋	9,100	5,480.00	49,868,000
P L A N T	2,500	760.00	1,900,000
スギホールディングス	23,200	6,176.00	143,283,200
薬王堂ホールディングス	6,500	2,552.00	16,588,000
スクロール	17,400	941.00	16,373,400
ヨンドシーホールディングス	10,100	1,900.00	19,190,000
木曽路	17,500	2,453.00	42,927,500
S R S ホールディングス	19,300	998.00	19,261,400
千趣会	21,900	395.00	8,650,500
リテールパートナーズ	17,200	1,537.00	26,436,400
ケーヨー	18,600	862.00	16,033,200
上新電機	10,400	2,006.00	20,862,400
日本瓦斯	61,200	1,950.00	119,340,000
ロイヤルホールディングス	22,300	2,633.00	58,715,900
いなげや	11,200	1,473.00	16,497,600
チヨダ	11,300	1,036.00	11,706,800
ライフコーポレーション	10,100	3,490.00	35,249,000
リンガーハット	14,800	2,451.00	36,274,800
M r M a x H D	16,600	598.00	9,926,800

AOKIホールディングス	21,600	920.00	19,872,000	
オークワ	18,500	856.00	15,836,000	
コメリ	17,800	2,972.00	52,901,600	
青山商事	24,800	1,289.00	31,967,200	
しまむら	13,500	13,785.00	186,097,500	
はせがわ	5,100	369.00	1,881,900	
高島屋	86,600	1,982.50	171,684,500	
松屋	19,600	1,017.00	19,933,200	
エイチ・ツー・オー リテイリング	56,000	1,515.00	84,840,000	
近鉄百貨店	5,100	2,440.00	12,444,000	
丸井グループ	84,700	2,455.50	207,980,850	
アクシアル リテイリング	7,900	3,680.00	29,072,000	
イオン	389,300	2,951.00	1,148,824,300	
イズミ	17,500	3,520.00	61,600,000	
平和堂	19,200	2,374.00	45,580,800	
フジ	17,700	1,804.00	31,930,800	
ヤオコー	13,000	7,513.00	97,669,000	
ゼビオホールディングス	15,900	1,109.00	17,633,100	
ケーズホールディングス	81,400	1,288.00	104,843,200	
Olympicグループ	3,900	528.00	2,059,200	
日産東京販売ホールディングス	12,200	398.00	4,855,600	
シルバーライフ	2,400	1,363.00	3,271,200	
Genky DrugStores	5,100	4,975.00	25,372,500	
ナルミヤ・インターナショナル	1,800	1,063.00	1,913,400	
ブックオフグループホールディングス	6,100	1,174.00	7,161,400	
ギフトホールディングス	2,500	4,625.00	11,562,500	
アインホールディングス	15,900	5,032.00	80,008,800	
元気寿司	3,300	3,890.00	12,837,000	
ヤマダホールディングス	471,600	431.00	203,259,600	
アーケランズ	17,000	1,643.00	27,931,000	
ニトリホールディングス	46,500	16,990.00	790,035,000	
グルメ杵屋	9,600	1,049.00	10,070,400	
愛眼	6,600	185.00	1,221,000	
ケーユーホールディングス	7,000	1,216.00	8,512,000	
吉野家ホールディングス	45,100	2,730.00	123,123,000	
松屋フーズホールディングス	5,500	4,155.00	22,852,500	
サガミホールディングス	18,700	1,304.00	24,384,800	
関西フードマーケット	10,600	1,425.00	15,105,000	
王将フードサービス	7,600	6,710.00	50,996,000	
ミニストップ	8,400	1,466.00	12,314,400	
アークス	21,200	2,437.00	51,664,400	
パローホールディングス	22,100	2,061.00	45,548,100	

ベルク	5,800	6,580.00	38,164,000
大庄	5,100	1,141.00	5,819,100
ファーストリテイリング	51,700	34,190.00	1,767,623,000
サンドラッグ	43,700	4,136.00	180,743,200
サクスパー ホールディングス	11,200	1,031.00	11,547,200
ヤマザワ	1,900	1,261.00	2,395,900
やまや	2,000	2,685.00	5,370,000
ペルーナ	28,100	705.00	19,810,500
いよぎんホールディングス	127,200	882.60	112,266,720
しずおかフィナンシャルグループ	239,700	1,091.50	261,632,550
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	90,000	895.80	80,622,000
楽天銀行	37,200	1,989.00	73,990,800
島根銀行	2,900	506.00	1,467,400
じもとホールディングス	7,300	407.00	2,971,100
めぶきフィナンシャルグループ	530,400	348.00	184,579,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,700	3,335.00	45,689,500
九州フィナンシャルグループ	188,100	643.40	121,023,540
ゆうちょ銀行	297,300	1,137.00	338,030,100
富山第一銀行	35,200	757.00	26,646,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	573,500	590.30	338,537,050
西日本フィナンシャルホールディングス	66,300	1,408.00	93,350,400
三十三フィナンシャルグループ	9,600	1,647.00	15,811,200
第四北越フィナンシャルグループ	16,800	3,265.00	54,852,000
ひろぎんホールディングス	139,400	833.50	116,189,900
おきなわフィナンシャルグループ	10,100	2,125.00	21,462,500
十六フィナンシャルグループ	13,900	3,305.00	45,939,500
北國フィナンシャルホールディングス	11,900	4,560.00	54,264,000
プロクレアホールディングス	13,100	2,059.00	26,972,900
あいちフィナンシャルグループ	15,000	2,341.00	35,115,000
あおぞら銀行	67,200	2,815.00	189,168,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,693,800	1,071.00	7,169,059,800
りそなホールディングス	1,350,900	704.00	951,033,600
三井住友トラスト・ホールディングス	194,200	5,281.00	1,025,570,200
三井住友フィナンシャルグループ	781,100	6,344.00	4,955,298,400
千葉銀行	297,900	919.80	274,008,420
群馬銀行	207,400	552.10	114,505,540
武蔵野銀行	13,700	2,364.00	32,386,800
千葉興業銀行	19,400	631.00	12,241,400
筑波銀行	46,900	209.00	9,802,100
七十七銀行	34,200	2,711.00	92,716,200
秋田銀行	7,200	1,755.00	12,636,000
山形銀行	11,900	1,085.00	12,911,500

岩手銀行	7,300	2,135.00	15,585,500
東邦銀行	84,500	234.00	19,773,000
東北銀行	4,100	1,039.00	4,259,900
ふくおかフィナンシャルグループ	85,300	3,097.00	264,174,100
スルガ銀行	94,200	576.00	54,259,200
八十二銀行	225,800	671.40	151,602,120
山梨中央銀行	11,000	1,300.00	14,300,000
大垣共立銀行	20,400	1,854.00	37,821,600
福井銀行	9,600	1,509.00	14,486,400
清水銀行	4,300	1,473.00	6,333,900
富山銀行	1,300	1,683.00	2,187,900
滋賀銀行	17,800	2,832.00	50,409,600
南都銀行	16,100	2,441.00	39,300,100
百五銀行	100,600	445.00	44,767,000
京都銀行	33,900	7,673.00	260,114,700
紀陽銀行	38,200	1,450.00	55,390,000
ほくほくフィナンシャルグループ	67,900	1,180.50	80,155,950
山陰合同銀行	66,900	859.00	57,467,100
鳥取銀行	2,700	1,182.00	3,191,400
百十四銀行	9,700	2,012.00	19,516,400
四国銀行	17,000	892.00	15,164,000
阿波銀行	15,000	2,043.00	30,645,000
大分銀行	6,400	2,275.00	14,560,000
宮崎銀行	7,000	2,468.00	17,276,000
佐賀銀行	6,300	1,729.00	10,892,700
琉球銀行	24,500	955.00	23,397,500
セブン銀行	382,900	292.10	111,845,090
みずほフィナンシャルグループ	1,545,800	2,240.50	3,463,364,900
高知銀行	2,800	848.00	2,374,400
山口フィナンシャルグループ	118,000	1,040.00	122,720,000
名古屋銀行	7,000	3,610.00	25,270,000
北洋銀行	162,000	286.00	46,332,000
大光銀行	2,500	1,146.00	2,865,000
愛媛銀行	14,400	843.00	12,139,200
トマト銀行	2,700	1,069.00	2,886,300
京葉銀行	48,900	562.00	27,481,800
栃木銀行	48,900	262.00	12,811,800
北日本銀行	3,700	2,030.00	7,511,000
東和銀行	19,600	564.00	11,054,400
福島銀行	8,700	217.00	1,887,900
大東銀行	3,200	657.00	2,102,400
トモニホールディングス	86,400	380.00	32,832,000

フィデアホールディングス	11,000	1,437.00	15,807,000
池田泉州ホールディングス	136,900	244.00	33,403,600
F P G	36,200	1,329.00	48,109,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	8,800	1,282.00	11,281,600
マーキュリアホールディングス	5,000	763.00	3,815,000
S B I ホールディングス	154,800	2,921.50	452,248,200
ジャフコ グループ	35,800	1,816.00	65,012,800
大和証券グループ本社	764,400	759.70	580,714,680
野村ホールディングス	1,968,700	577.80	1,137,514,860
岡三証券グループ	94,100	522.00	49,120,200
丸三証券	35,800	501.00	17,935,800
東洋証券	35,800	343.00	12,279,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	116,600	414.00	48,272,400
光世証券	2,100	641.00	1,346,100
水戸証券	29,000	388.00	11,252,000
いちよし証券	19,900	645.00	12,835,500
松井証券	63,300	798.00	50,513,400
マネックスグループ	115,400	549.00	63,354,600
極東証券	13,500	723.00	9,760,500
岩井コスモホールディングス	12,300	1,616.00	19,876,800
アイザワ証券グループ	15,600	824.00	12,854,400
マネーパートナーズグループ	9,100	268.00	2,438,800
スパークス・グループ	12,000	1,485.00	17,820,000
かんぽ生命保険	124,400	2,234.00	277,909,600
S O M P O ホールディングス	183,400	6,224.00	1,141,481,600
アニコム ホールディングス	36,300	614.00	22,288,200
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	217,500	5,118.00	1,113,165,000
第一生命ホールディングス	522,200	2,662.50	1,390,357,500
東京海上ホールディングス	1,056,500	3,180.00	3,359,670,000
T & D ホールディングス	286,800	2,121.50	608,446,200
アドバンスクリエイト	6,200	1,215.00	7,533,000
全国保証	28,000	4,982.00	139,496,000
あんしん保証	4,900	314.00	1,538,600
イントラスト	3,400	970.00	3,298,000
日本モーゲージサービス	5,000	566.00	2,830,000
C a s a	3,500	940.00	3,290,000
アルヒ	13,400	990.00	13,266,000
プレミアグループ	18,100	1,726.00	31,240,600
ネットプロテクションズホールディングス	36,100	322.00	11,624,200
クレディセゾン	67,800	2,257.00	153,024,600
芙蓉総合リース	9,900	11,460.00	113,454,000
みずほリース	16,000	4,715.00	75,440,000



東京センチュリー	20,000	5,367.00	107,340,000
日本証券金融	39,500	1,150.00	45,425,000
アイフル	177,700	340.00	60,418,000
リコーリース	10,200	4,300.00	43,860,000
イオンフィナンシャルサービス	61,600	1,245.00	76,692,000
アコム	191,400	359.60	68,827,440
ジャックス	11,400	5,160.00	58,824,000
オリエントコーポレーション	28,100	1,139.00	32,005,900
オリックス	701,700	2,655.50	1,863,364,350
三菱HCキャピタル	417,000	902.90	376,509,300
九州リースサービス	4,100	876.00	3,591,600
日本取引所グループ	300,400	2,387.50	717,205,000
イー・ギャランティ	17,500	2,081.00	36,417,500
アサックス	4,100	648.00	2,656,800
NECキャピタルソリューション	5,300	3,175.00	16,827,500
大東建託	39,200	14,550.00	570,360,000
いちご	124,700	272.00	33,918,400
日本駐車場開発	115,100	217.00	24,976,700
スター・マイカ・ホールディングス	10,300	624.00	6,427,200
SREホールディングス	5,400	3,615.00	19,521,000
ADワークスグループ	20,900	197.00	4,117,300
ヒューリック	249,700	1,238.00	309,128,600
三栄建築設計	5,500	1,481.00	8,145,500
野村不動産ホールディングス	67,000	3,461.00	231,887,000
三重交通グループホールディングス	23,600	559.00	13,192,400
サムティ	17,200	2,259.00	38,854,800
ディア・ライフ	18,800	844.00	15,867,200
地主	8,400	1,893.00	15,901,200
プレサンスコーポレーション	17,100	2,016.00	34,473,600
ハウスコム	1,800	918.00	1,652,400
JPMC	5,800	1,092.00	6,333,600
サンセイランディック	2,900	1,003.00	2,908,700
フージャースホールディングス	16,500	1,039.00	17,143,500
オープンハウスグループ	39,200	5,373.00	210,621,600
東急不動産ホールディングス	321,900	828.90	266,822,910
飯田グループホールディングス	93,800	2,488.50	233,421,300
イーランド	1,600	1,538.00	2,460,800
ムゲンエステート	6,200	895.00	5,549,000
And Doホールディングス	6,400	1,070.00	6,848,000
シーアールイー	6,300	1,382.00	8,706,600
ケイアイスター不動産	5,200	5,060.00	26,312,000
グッドコムアセット	10,400	842.00	8,756,800

ジェイ・エス・ビー	2,700	5,240.00	14,148,000
ロードスターキャピタル	6,400	1,706.00	10,918,400
テンポイノベーション	2,900	1,140.00	3,306,000
フェイスネットワーク	2,600	1,462.00	3,801,200
パーク24	83,500	1,836.50	153,347,750
パラカ	4,000	1,957.00	7,828,000
三井不動産	456,300	2,856.50	1,303,420,950
三菱地所	645,200	1,738.00	1,121,357,600
平和不動産	17,500	3,880.00	67,900,000
東京建物	102,100	1,904.00	194,398,400
京阪神ビルディング	18,400	1,207.00	22,208,800
住友不動産	193,300	3,713.00	717,722,900
テーオーシー	20,000	602.00	12,040,000
東京楽天地	1,900	4,200.00	7,980,000
レオパレス21	120,300	307.00	36,932,100
スターツコーポレーション	15,500	2,903.00	44,996,500
フジ住宅	15,600	697.00	10,873,200
空港施設	13,700	558.00	7,644,600
明和地所	4,400	1,137.00	5,002,800
ゴールドクレスト	10,400	1,882.00	19,572,800
エスリード	5,200	2,900.00	15,080,000
日神グループホールディングス	18,000	515.00	9,270,000
日本エスコン	24,000	855.00	20,520,000
MIRARTHホールディングス	54,000	477.00	25,758,000
AVANTIA	5,200	886.00	4,607,200
イオンモール	55,600	1,759.00	97,800,400
毎日コムネット	3,700	733.00	2,712,100
ファースト住建	3,800	1,113.00	4,229,400
カチタス	28,900	2,565.00	74,128,500
トーセイ	18,000	1,819.00	32,742,000
穴吹興産	1,800	2,162.00	3,891,600
サンフロンティア不動産	18,100	1,482.00	26,824,200
FJネクストホールディングス	11,700	1,036.00	12,121,200
インテリックス	2,000	515.00	1,030,000
ランドビジネス	3,000	273.00	819,000
サンネクスタグループ	2,900	973.00	2,821,700
グランディハウス	7,800	606.00	4,726,800
日本空港ビルデング	37,900	6,357.00	240,930,300
明豊ファシリティワークス	4,600	778.00	3,578,800
LIFULL	38,900	291.00	11,319,900
MIXI	25,500	2,665.00	67,957,500
ジェイエシーリクルートメント	10,200	2,664.00	27,172,800

日本M&Aセンターホールディングス	191,600	1,067.00	204,437,200
メンバーズ	3,400	1,651.00	5,613,400
中広	1,700	412.00	700,400
UTグループ	16,400	2,844.00	46,641,600
アイティメディア	4,400	1,320.00	5,808,000
E・Jホールディングス	6,700	1,610.00	10,787,000
オープンアップグループ	33,500	2,078.00	69,613,000
コシダカホールディングス	33,600	1,087.00	36,523,200
アルトナー	2,200	1,890.00	4,158,000
パソナグループ	13,700	1,665.00	22,810,500
CDS	2,300	1,746.00	4,015,800
リンクアンドモチベーション	32,100	423.00	13,578,300
エス・エム・エス	42,500	2,762.50	117,406,250
サニーサイドアップグループ	2,900	695.00	2,015,500
パーソルホールディングス	123,100	2,705.00	332,985,500
リニカル	5,200	775.00	4,030,000
クックパッド	31,700	160.00	5,072,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	4,600	609.00	2,801,400
学情	5,200	1,907.00	9,916,400
スタジオアリス	5,700	2,129.00	12,135,300
シミックホールディングス	5,500	1,926.00	10,593,000
エプロ	2,100	739.00	1,551,900
NJS	2,500	2,893.00	7,232,500
総合警備保障	207,300	785.10	162,751,230
カカクコム	82,000	2,009.50	164,779,000
アイロムグループ	4,100	1,935.00	7,933,500
セントケア・ホールディング	7,400	779.00	5,764,600
サイネックス	1,800	621.00	1,117,800
ルネサンス	8,000	910.00	7,280,000
ディップ	19,600	3,530.00	69,188,000
デジタルホールディングス	8,900	1,052.00	9,362,800
新日本科学	11,900	2,031.00	24,168,900
キャリアデザインセンター	1,900	1,730.00	3,287,000
ベネフィット・ワン	51,800	1,430.50	74,099,900
エムスリー	220,500	3,138.00	691,929,000
ツカダ・グローバルホールディング	5,600	486.00	2,721,600
アウトソーシング	66,600	1,413.00	94,105,800
ウェルネット	7,000	565.00	3,955,000
ワールドホールディングス	5,100	2,632.00	13,423,200
ディー・エヌ・エー	44,700	1,731.00	77,375,700
博報堂DYホールディングス	142,400	1,589.00	226,273,600
ぐるなび	21,100	377.00	7,954,700

タカミヤ	15,500	528.00	8,184,000
ジャパンベストレスキューシステム	5,500	763.00	4,196,500
ファンコミュニケーションズ	22,400	401.00	8,982,400
ライク	4,300	1,717.00	7,383,100
ビジネス・ブレイクスルー	3,700	433.00	1,602,100
エスプール	32,500	569.00	18,492,500
WDBホールディングス	5,800	2,058.00	11,936,400
ティア	5,600	453.00	2,536,800
CDG	1,100	1,378.00	1,515,800
アドウェイズ	15,600	676.00	10,545,600
バリューコマース	8,500	1,310.00	11,135,000
インフォマート	116,400	388.00	45,163,200
J Pホールディングス	32,700	323.00	10,562,100
エコナックホールディングス	17,100	91.00	1,556,100
CLホールディングス	3,300	847.00	2,795,100
プレステージ・インターナショナル	47,300	593.00	28,048,900
アミューズ	6,200	1,747.00	10,831,400
ドリームインキュベータ	3,500	2,721.00	9,523,500
クイック	8,600	2,377.00	20,442,200
TAC	5,200	201.00	1,045,200
電通グループ	109,700	4,653.00	510,434,100
イオンファンタジー	4,900	2,817.00	13,803,300
シーティーエス	12,600	740.00	9,324,000
ネクシィーズグループ	3,000	648.00	1,944,000
H.U.グループホールディングス	32,700	2,786.50	91,118,550
アルプス技研	9,800	2,773.00	27,175,400
日本空調サービス	12,300	785.00	9,655,500
オリエンタルランド	590,400	5,426.00	3,203,510,400
ダスキン	24,900	3,177.00	79,107,300
明光ネットワークジャパン	13,900	653.00	9,076,700
ファルコホールディングス	5,100	1,844.00	9,404,400
ラウンドワン	93,700	558.00	52,284,600
リゾートトラスト	44,100	2,181.50	96,204,150
ビー・エム・エル	13,800	2,980.00	41,124,000
リソー教育	51,500	257.00	13,235,500
早稲田アカデミー	6,300	1,378.00	8,681,400
ユー・エス・エス	114,800	2,419.50	277,758,600
東京個別指導学院	13,600	469.00	6,378,400
サイバーエージェント	246,700	1,010.50	249,290,350
楽天グループ	670,400	531.00	355,982,400
クリーク・アンド・リバー社	6,600	1,967.00	12,982,200
SBIグローバルアセットマネジメント	18,600	515.00	9,579,000

テー・オー・ダブリュー	22,500	308.00	6,930,000
山田コンサルティンググループ	5,800	1,568.00	9,094,400
セントラルスポーツ	4,300	2,360.00	10,148,000
フルキャストホールディングス	10,700	2,281.00	24,406,700
エン・ジャパン	20,300	2,575.00	52,272,500
リソルホールディングス	800	4,725.00	3,780,000
テクノプロ・ホールディングス	66,100	3,469.00	229,300,900
アトラグループ	2,000	175.00	350,000
インターワークス	2,800	355.00	994,000
アイ・アールジャパンホールディングス	5,900	1,619.00	9,552,100
Keeper 技研	6,900	6,070.00	41,883,000
ファーストロジック	1,200	1,065.00	1,278,000
三機サービス	1,500	1,044.00	1,566,000
Gunosy	9,200	574.00	5,280,800
デザインワン・ジャパン	3,300	173.00	570,900
イー・ガーディアン	4,300	2,087.00	8,974,100
リブセンス	4,700	277.00	1,301,900
ジャパンマテリアル	34,200	2,402.00	82,148,400
ベクトル	17,700	1,322.00	23,399,400
ウチヤマホールディングス	4,300	338.00	1,453,400
チャーム・ケア・コーポレーション	9,500	1,359.00	12,910,500
キャリアリンク	4,200	2,877.00	12,083,400
I B J	7,100	706.00	5,012,600
アサンテ	5,600	1,722.00	9,643,200
バリューHR	9,900	1,291.00	12,780,900
M&Aキャピタルパートナーズ	9,100	3,185.00	28,983,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,200	1,048.00	4,401,600
E R Iホールディングス	2,400	1,962.00	4,708,800
アビスト	1,400	3,230.00	4,522,000
シグマクシス・ホールディングス	17,100	1,312.00	22,435,200
ウィルグループ	9,500	1,105.00	10,497,500
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	10,500	140.00	1,470,000
メドピア	10,000	993.00	9,930,000
レアジョブ	1,900	1,014.00	1,926,600
リクルートホールディングス	826,000	4,760.00	3,931,760,000
エラン	15,000	879.00	13,185,000
土木管理総合試験所	4,300	335.00	1,440,500
日本郵政	1,342,600	1,031.50	1,384,891,900
ベルシステム24ホールディングス	15,100	1,388.00	20,958,800
鎌倉新書	13,000	675.00	8,775,000
S M N	2,500	464.00	1,160,000
グローバルキッズCOMPANY	1,900	674.00	1,280,600

エアトリ	8,200	2,508.00	20,565,600
アトラエ	6,900	772.00	5,326,800
ストライク	4,800	3,315.00	15,912,000
ソラスト	31,000	684.00	21,204,000
セラク	3,500	1,375.00	4,812,500
インソース	24,400	1,126.00	27,474,400
ペイカレント・コンサルティング	88,300	4,704.00	415,363,200
Orchestra Holdings	2,600	1,189.00	3,091,400
アイモバイル	5,100	1,282.00	6,538,200
キャリアインデックス	3,700	296.00	1,095,200
MS - Japan	3,000	1,176.00	3,528,000
船場	1,700	758.00	1,288,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	39,900	1,763.00	70,343,700
フルテック	1,400	1,116.00	1,562,400
GameWith	3,200	317.00	1,014,400
MS&Consulting	1,400	644.00	901,600
ウェルビー	8,600	455.00	3,913,000
エル・ティー・エス	1,500	3,550.00	5,325,000
ミダックホールディングス	6,900	1,702.00	11,743,800
日総工産	8,600	875.00	7,525,000
キュービーネットホールディングス	5,400	1,461.00	7,889,400
RPAホールディングス	15,600	392.00	6,115,200
スプリックス	2,800	804.00	2,251,200
マネジメントソリューションズ	6,200	3,720.00	23,064,000
プロレド・パートナーズ	3,100	516.00	1,599,600
テノ・ホールディングス	1,400	646.00	904,400
フロンティア・マネジメント	3,900	1,352.00	5,272,800
ピアラ	1,800	474.00	853,200
コプロ・ホールディングス	1,500	2,169.00	3,253,500
ギークス	1,400	710.00	994,000
アンビスホールディングス	12,000	2,836.00	34,032,000
カーブスホールディングス	30,700	761.00	23,362,700
フォーラムエンジニアリング	6,700	1,224.00	8,200,800
Fast Fitness Japan	4,000	1,470.00	5,880,000
ダイレクトマーケティングミックス	13,600	768.00	10,444,800
ポピンズ	1,800	1,414.00	2,545,200
LITALICO	8,800	2,193.00	19,298,400
アドバンテッジリスクマネジメント	4,300	586.00	2,519,800
リログループ	62,200	1,924.50	119,703,900
東祥	7,900	1,308.00	10,333,200
ID&Eホールディングス	6,800	3,460.00	23,528,000
ビーウィズ	2,900	2,499.00	7,247,100

TREホールディングス	23,700	1,231.00	29,174,700	
人・夢・技術グループ	4,300	1,737.00	7,469,100	
大栄環境	28,500	2,415.00	68,827,500	
日本管財ホールディングス	11,800	2,614.00	30,845,200	
エイチ・アイ・エス	29,300	1,998.00	58,541,400	
ラックランド	4,700	3,195.00	15,016,500	
共立メンテナンス	19,100	5,296.00	101,153,600	
イチネンホールディングス	12,000	1,360.00	16,320,000	
建設技術研究所	5,800	3,420.00	19,836,000	
スペース	8,300	1,092.00	9,063,600	
燦ホールディングス	4,800	2,270.00	10,896,000	
スバル興業	500	9,980.00	4,990,000	
東京テアトル	3,200	1,116.00	3,571,200	
タナベコンサルティンググループ	3,600	1,011.00	3,639,600	
ナガワ	3,000	6,990.00	20,970,000	
東京都競馬	9,400	3,865.00	36,331,000	
カナモト	20,500	2,439.00	49,999,500	
ニシオホールディングス	10,400	3,540.00	36,816,000	
トランス・コスモス	13,900	3,480.00	48,372,000	
乃村工藝社	48,900	888.00	43,423,200	
藤田観光	5,000	3,805.00	19,025,000	
KNT-CTホールディングス	6,700	1,417.00	9,493,900	
トーカイ	10,000	1,892.00	18,920,000	
セコム	113,600	9,195.00	1,044,552,000	
セントラル警備保障	6,100	2,823.00	17,220,300	
丹青社	21,900	793.00	17,366,700	
メイテック	43,600	2,510.00	109,436,000	
応用地質	10,500	2,518.00	26,439,000	
船井総研ホールディングス	23,300	2,576.00	60,020,800	
進学会ホールディングス	3,500	291.00	1,018,500	
オオバ	5,700	856.00	4,879,200	
いであ	2,000	1,679.00	3,358,000	
学究社	4,500	2,049.00	9,220,500	
ベネッセホールディングス	41,800	1,839.00	76,870,200	
イオンディライト	12,400	2,958.00	36,679,200	
ナック	5,100	980.00	4,998,000	
ダイセキ	22,800	4,380.00	99,864,000	
ステップ	4,200	1,764.00	7,408,800	
合 計	160,635,900		354,362,404,270	

## (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

	2023年 7月25日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	392,778,980
国債証券	339,862,248,460
地方債証券	20,661,829,781
特殊債券	22,689,675,413
社債券	18,260,753,000
未収入金	462,470,900
未収利息	717,819,256
前払費用	21,863,106
流動資産合計	403,069,438,896
資産合計	403,069,438,896
負債の部	
流動負債	
未払金	300,000,000
未払解約金	360,308,272
未払利息	956
流動負債合計	660,309,228
負債合計	660,309,228
純資産の部	
元本等	
元本	301,735,610,363
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	100,673,519,305
元本等合計	402,409,129,668
純資産合計	402,409,129,668
負債純資産合計	403,069,438,896

##### 注記表

###### (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 7月25日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

###### (貸借対照表に関する注記)



2023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	301,735,610,363口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。
	有価証券 100,162,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3336円 (1万口当たり純資産額) (13,336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

2023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

2023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	2023年 7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	29,052,908,156円
期中一部解約元本額	14,254,407,274円
期末元本額	301,735,610,363円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	787,415,037円
DC日本債券インデックスファンド	1,875,029,876円
DC日本債券インデックスファンドL	44,947,153,758円
DCバランスファンド30	12,812,464,363円

区分	2023年 7月25日現在
DCバランスファンド50	9,309,757,290円
DCバランスファンド70	2,754,861,511円
日本債券インデックスe	1,008,915,128円
インデックスコレクション（国内債券）	38,452,998,684円
インデックスコレクション（バランス株式30）	68,069,549,702円
インデックスコレクション（バランス株式50）	9,083,236,803円
インデックスコレクション（バランス株式70）	4,001,112,676円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	52,227,913,662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）	6,025,051,269円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	133,856,222円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	726,665,259円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	112,470,803円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	87,356,715円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	106,570,278円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	2,452,839,150円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	959,290,170円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	11,339,664,460円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	127,015,451円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	239,283,031円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	2,842,062,485円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	145,862,037円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	331,653,930円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,882,847,023円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	313,449,437円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	759,621,477円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	52,832,264円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	2,840,609,145円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	1,354,669,826円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	21,482,623,751円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	423,746,559円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	108,410,869円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	39,270,607円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	512,579,921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）	4,899,734円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023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	4,392,480,890
地方債証券	104,432,180
特殊債券	100,632,870
社債券	150,396,000
合計	4,747,941,940

(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439回利付国債(2年)	1,065,000,000	1,066,565,550	
	第440回利付国債(2年)	1,330,000,000	1,332,114,700	
	第441回利付国債(2年)	805,000,000	806,288,000	
	第442回利付国債(2年)	1,115,000,000	1,116,839,750	
	第443回利付国債(2年)	860,000,000	861,333,000	
	第444回利付国債(2年)	1,280,000,000	1,281,830,400	
	第445回利付国債(2年)	1,075,000,000	1,076,472,750	
	第446回利付国債(2年)	995,000,000	996,263,650	
	第447回利付国債(2年)	1,044,000,000	1,045,221,480	
	第448回利付国債(2年)	1,050,000,000	1,051,102,500	
	第449回利付国債(2年)	2,205,000,000	2,207,227,050	
	第450回利付国債(2年)	360,000,000	360,345,600	
	第141回利付国債(5年)	2,868,000,000	2,875,428,120	
	第142回利付国債(5年)	2,080,000,000	2,085,824,000	
	第143回利付国債(5年)	2,150,000,000	2,156,020,000	
	第144回利付国債(5年)	2,790,000,000	2,798,760,600	
	第145回利付国債(5年)	2,635,000,000	2,644,064,400	
	第146回利付国債(5年)	2,260,000,000	2,268,407,200	
	第147回利付国債(5年)	2,690,000,000	2,693,900,500	
	第148回利付国債(5年)	2,560,000,000	2,563,712,000	
	第149回利付国債(5年)	3,385,000,000	3,389,265,100	
	第150回利付国債(5年)	2,710,000,000	2,712,764,200	
	第151回利付国債(5年)	1,840,000,000	1,841,343,200	
	第152回利付国債(5年)	1,375,000,000	1,380,761,250	
	第153回利付国債(5年)	2,975,000,000	2,976,160,250	
	第154回利付国債(5年)	2,650,000,000	2,659,328,000	
	第155回利付国債(5年)	910,000,000	920,392,200	
	第156回利付国債(5年)	1,710,000,000	1,722,021,300	
	第157回利付国債(5年)	510,000,000	513,187,500	
	第158回利付国債(5年)	2,210,000,000	2,213,071,900	
	第1回利付国債(40年)	270,000,000	337,734,900	
	第2回利付国債(40年)	450,000,000	542,511,000	
	第3回利付国債(40年)	465,000,000	560,590,050	
	第4回利付国債(40年)	665,000,000	802,222,750	
第5回利付国債(40年)	495,000,000	575,739,450		
第6回利付国債(40年)	670,000,000	765,863,600		
第7回利付国債(40年)	990,000,000	1,081,525,500		
第8回利付国債(40年)	940,000,000	953,592,400		
第9回利付国債(40年)	1,020,000,000	764,051,400		
第10回利付国債(40年)	1,270,000,000	1,110,767,400		
第11回利付国債(40年)	1,080,000,000	908,668,800		

第12回利付国債(40年)	970,000,000	728,605,800	
第13回利付国債(40年)	1,320,000,000	981,142,800	
第14回利付国債(40年)	1,425,000,000	1,128,970,500	
第15回利付国債(40年)	1,511,000,000	1,316,488,970	
第16回利付国債(40年)	630,000,000	599,413,500	
第335回利付国債(10年)	2,780,000,000	2,800,043,800	
第336回利付国債(10年)	1,040,000,000	1,048,756,800	
第337回利付国債(10年)	2,050,000,000	2,061,500,500	
第338回利付国債(10年)	2,980,000,000	3,003,124,800	
第339回利付国債(10年)	2,890,000,000	2,915,576,500	
第340回利付国債(10年)	3,040,000,000	3,070,126,400	
第341回利付国債(10年)	2,390,000,000	2,410,410,600	
第342回利付国債(10年)	2,940,000,000	2,951,671,800	
第343回利付国債(10年)	2,865,000,000	2,877,061,650	
第344回利付国債(10年)	3,240,000,000	3,253,802,400	
第345回利付国債(10年)	3,180,000,000	3,193,515,000	
第346回利付国債(10年)	3,175,000,000	3,188,303,250	
第347回利付国債(10年)	2,905,000,000	2,916,881,450	
第348回利付国債(10年)	2,920,000,000	2,930,278,400	
第349回利付国債(10年)	2,960,000,000	2,967,784,800	
第350回利付国債(10年)	3,750,000,000	3,756,075,000	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	1,840,000,000	1,840,441,600	
第352回利付国債(10年)	2,770,000,000	2,768,559,600	
第353回利付国債(10年)	2,750,000,000	2,746,287,500	
第354回利付国債(10年)	3,025,000,000	3,018,193,750	
第355回利付国債(10年)	3,070,000,000	3,060,114,600	
第356回利付国債(10年)	2,560,000,000	2,549,068,800	
第357回利付国債(10年)	2,440,000,000	2,426,872,800	
第358回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,780,708,000	
第359回利付国債(10年)	2,990,000,000	2,964,585,000	
第360回利付国債(10年)	3,155,000,000	3,121,714,750	
第361回利付国債(10年)	2,930,000,000	2,892,789,000	
第362回利付国債(10年)	2,910,000,000	2,866,466,400	
第363回利付国債(10年)	3,195,000,000	3,140,812,800	
第364回利付国債(10年)	3,475,000,000	3,408,801,250	
第365回利付国債(10年)	3,685,000,000	3,608,315,150	
第366回利付国債(10年)	3,188,000,000	3,142,571,000	
第367回利付国債(10年)	2,965,000,000	2,917,767,550	
第368回利付国債(10年)	3,315,000,000	3,254,998,500	
第369回利付国債(10年)	2,900,000,000	2,920,967,000	
第370回利付国債(10年)	2,826,000,000	2,841,684,300	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	58,043,000	

第2回利付国債(30年)	100,000,000	114,346,000	
第3回利付国債(30年)	140,000,000	159,716,200	
第4回利付国債(30年)	190,000,000	226,276,700	
第5回利付国債(30年)	180,000,000	206,276,400	
第6回利付国債(30年)	205,000,000	239,556,850	
第7回利付国債(30年)	130,000,000	151,680,100	
第9回利付国債(30年)	180,000,000	196,221,600	
第10回利付国債(30年)	170,000,000	180,551,900	
第11回利付国債(30年)	375,000,000	420,030,000	
第12回利付国債(30年)	430,000,000	499,131,100	
第13回利付国債(30年)	130,000,000	149,874,400	
第14回利付国債(30年)	350,000,000	418,505,500	
第15回利付国債(30年)	370,000,000	446,960,000	
第16回利付国債(30年)	335,000,000	405,564,400	
第17回利付国債(30年)	405,000,000	486,696,600	
第18回利付国債(30年)	380,000,000	453,298,200	
第19回利付国債(30年)	345,000,000	411,978,300	
第20回利付国債(30年)	400,000,000	487,744,000	
第21回利付国債(30年)	685,000,000	820,842,350	
第22回利付国債(30年)	475,000,000	581,105,500	
第23回利付国債(30年)	170,000,000	208,426,800	
第24回利付国債(30年)	250,000,000	306,972,500	
第25回利付国債(30年)	185,000,000	222,632,700	
第26回利付国債(30年)	1,210,000,000	1,472,691,000	
第27回利付国債(30年)	890,000,000	1,097,708,200	
第28回利付国債(30年)	1,035,000,000	1,279,974,150	
第29回利付国債(30年)	880,000,000	1,077,568,800	
第30回利付国債(30年)	810,000,000	981,711,900	
第31回利付国債(30年)	900,000,000	1,078,695,000	
第32回利付国債(30年)	955,000,000	1,159,503,700	
第33回利付国債(30年)	1,420,000,000	1,658,261,800	
第34回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,619,743,500	
第35回利付国債(30年)	1,370,000,000	1,598,913,300	
第36回利付国債(30年)	1,365,000,000	1,593,323,550	
第37回利付国債(30年)	1,420,000,000	1,633,298,200	
第38回利付国債(30年)	935,000,000	1,057,830,950	
第39回利付国債(30年)	825,000,000	948,238,500	
第40回利付国債(30年)	755,000,000	854,154,150	
第41回利付国債(30年)	705,000,000	784,636,800	
第42回利付国債(30年)	858,000,000	954,259,020	
第43回利付国債(30年)	835,000,000	928,820,600	
第44回利付国債(30年)	880,000,000	978,155,200	

第45回利付国債(30年)	902,000,000	967,855,020
第46回利付国債(30年)	1,055,000,000	1,130,759,550
第47回利付国債(30年)	1,075,000,000	1,172,964,750
第48回利付国債(30年)	1,010,000,000	1,062,075,600
第49回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,123,649,800
第50回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,041,140,800
第51回利付国債(30年)	1,079,000,000	892,516,430
第52回利付国債(30年)	1,080,000,000	933,714,000
第53回利付国債(30年)	1,015,000,000	895,544,650
第54回利付国債(30年)	895,000,000	824,491,900
第55回利付国債(30年)	1,005,000,000	923,464,350
第56回利付国債(30年)	740,000,000	678,217,400
第57回利付国債(30年)	1,000,000,000	914,140,000
第58回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,221,758,400
第59回利付国債(30年)	950,000,000	843,562,000
第60回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,029,735,900
第61回利付国債(30年)	900,000,000	793,089,000
第62回利付国債(30年)	780,000,000	650,582,400
第63回利付国債(30年)	980,000,000	792,957,200
第64回利付国債(30年)	1,060,000,000	854,614,400
第65回利付国債(30年)	760,000,000	611,131,200
第66回利付国債(30年)	830,000,000	664,390,100
第67回利付国債(30年)	1,090,000,000	917,801,800
第68回利付国債(30年)	1,150,000,000	965,195,000
第69回利付国債(30年)	1,105,000,000	950,863,550
第70回利付国債(30年)	1,190,000,000	1,021,912,500
第71回利付国債(30年)	870,000,000	746,312,100
第72回利付国債(30年)	1,070,000,000	916,893,700
第73回利付国債(30年)	1,195,000,000	1,021,880,350
第74回利付国債(30年)	1,255,000,000	1,160,649,100
第75回利付国債(30年)	1,073,000,000	1,068,504,130
第76回利付国債(30年)	1,126,000,000	1,148,587,560
第77回利付国債(30年)	942,000,000	1,006,395,120
第78回利付国債(30年)	1,189,000,000	1,211,840,690
第72回利付国債(20年)	710,000,000	728,247,000
第73回利付国債(20年)	540,000,000	555,924,600
第74回利付国債(20年)	310,000,000	319,579,000
第75回利付国債(20年)	360,000,000	372,898,800
第76回利付国債(20年)	350,000,000	361,382,000
第77回利付国債(20年)	290,000,000	299,912,200
第78回利付国債(20年)	120,000,000	124,488,000
第79回利付国債(20年)	100,000,000	103,931,000
第80回利付国債(20年)	250,000,000	260,302,500

第81回利付国債(20年)	180,000,000	187,993,800	
第82回利付国債(20年)	485,000,000	507,586,450	
第83回利付国債(20年)	470,000,000	494,364,800	
第84回利付国債(20年)	190,000,000	199,393,600	
第85回利付国債(20年)	360,000,000	380,530,800	
第86回利付国債(20年)	240,000,000	254,961,600	
第87回利付国債(20年)	170,000,000	180,145,600	
第88回利付国債(20年)	290,000,000	309,754,800	
第89回利付国債(20年)	320,000,000	340,870,400	
第90回利付国債(20年)	610,000,000	653,035,500	
第91回利付国債(20年)	310,000,000	332,850,100	
第92回利付国債(20年)	1,190,000,000	1,276,108,400	
第93回利付国債(20年)	400,000,000	429,428,000	
第94回利付国債(20年)	445,000,000	479,362,900	
第95回利付国債(20年)	950,000,000	1,035,443,000	
第96回利付国債(20年)	530,000,000	573,528,900	
第97回利付国債(20年)	570,000,000	621,693,300	
第98回利付国債(20年)	370,000,000	402,019,800	
第99回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,406,783,700	
第100回利付国債(20年)	660,000,000	725,478,600	
第101回利付国債(20年)	360,000,000	399,056,400	
第102回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,190,321,500	
第103回利付国債(20年)	920,000,000	1,018,964,400	
第104回利付国債(20年)	260,000,000	285,430,600	
第105回利付国債(20年)	730,000,000	804,642,500	
第106回利付国債(20年)	400,000,000	442,952,000	
第107回利付国債(20年)	500,000,000	553,140,000	
第108回利付国債(20年)	925,000,000	1,013,374,500	
第109回利付国債(20年)	642,000,000	705,525,900	
第110回利付国債(20年)	515,000,000	571,732,400	
第111回利付国債(20年)	450,000,000	504,108,000	
第112回利付国債(20年)	880,000,000	980,663,200	
第113回利付国債(20年)	1,525,000,000	1,705,270,250	
第114回利付国債(20年)	920,000,000	1,032,129,600	
第115回利付国債(20年)	370,000,000	417,437,700	
第116回利付国債(20年)	330,000,000	373,431,300	
第117回利付国債(20年)	935,000,000	1,051,912,400	
第118回利付国債(20年)	450,000,000	504,621,000	
第119回利付国債(20年)	320,000,000	354,489,600	
第120回利付国債(20年)	895,000,000	979,291,100	
第121回利付国債(20年)	970,000,000	1,083,616,100	
第122回利付国債(20年)	490,000,000	543,949,000	

第123回利付国債(20年)	900,000,000	1,020,267,000
第124回利付国債(20年)	650,000,000	732,140,500
第125回利付国債(20年)	670,000,000	766,332,600
第126回利付国債(20年)	590,000,000	665,992,000
第127回利付国債(20年)	670,000,000	751,284,400
第128回利付国債(20年)	960,000,000	1,078,550,400
第129回利付国債(20年)	560,000,000	624,831,200
第130回利付国債(20年)	890,000,000	994,664,000
第131回利付国債(20年)	575,000,000	638,048,750
第132回利付国債(20年)	600,000,000	666,930,000
第133回利付国債(20年)	790,000,000	884,578,800
第134回利付国債(20年)	725,000,000	813,247,000
第135回利付国債(20年)	580,000,000	645,731,400
第136回利付国債(20年)	450,000,000	497,218,500
第137回利付国債(20年)	680,000,000	758,261,200
第138回利付国債(20年)	460,000,000	505,011,000
第139回利付国債(20年)	645,000,000	713,673,150
第140回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,434,406,950
第141回利付国債(20年)	750,000,000	838,350,000
第142回利付国債(20年)	870,000,000	980,368,200
第143回利付国債(20年)	1,160,000,000	1,286,927,200
第144回利付国債(20年)	550,000,000	605,082,500
第145回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,153,682,400
第146回利付国債(20年)	1,370,000,000	1,536,276,900
第147回利付国債(20年)	1,635,000,000	1,818,234,450
第148回利付国債(20年)	1,435,000,000	1,581,685,700
第149回利付国債(20年)	1,690,000,000	1,862,768,700
第150回利付国債(20年)	2,000,000,000	2,183,220,000
第151回利付国債(20年)	1,875,000,000	2,004,693,750
第152回利付国債(20年)	1,765,000,000	1,886,467,300
第153回利付国債(20年)	1,585,000,000	1,711,086,750
第154回利付国債(20年)	1,615,000,000	1,723,786,400
第155回利付国債(20年)	1,335,000,000	1,392,618,600
第156回利付国債(20年)	1,435,000,000	1,390,629,800
第157回利付国債(20年)	1,990,000,000	1,874,480,500
第158回利付国債(20年)	2,095,000,000	2,045,746,550
第159回利付国債(20年)	1,930,000,000	1,904,002,900
第160回利付国債(20年)	650,000,000	647,978,500
第161回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,462,777,700
第162回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,262,806,800
第163回利付国債(20年)	1,495,000,000	1,460,151,550
第164回利付国債(20年)	1,505,000,000	1,445,793,300
第165回利付国債(20年)	1,255,000,000	1,201,662,500



	第166回利付国債（20年）	1,190,000,000	1,169,960,400
	第167回利付国債（20年）	1,430,000,000	1,360,902,400
	第168回利付国債（20年）	1,520,000,000	1,419,634,400
	第169回利付国債（20年）	1,285,000,000	1,176,918,650
	第170回利付国債（20年）	1,310,000,000	1,195,768,000
	第171回利付国債（20年）	1,210,000,000	1,100,724,900
	第172回利付国債（20年）	1,120,000,000	1,032,180,800
	第173回利付国債（20年）	1,350,000,000	1,239,151,500
	第174回利付国債（20年）	1,375,000,000	1,257,877,500
	第175回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,223,970,000
	第176回利付国債（20年）	1,340,000,000	1,238,548,600
	第177回利付国債（20年）	1,545,000,000	1,397,869,650
	第178回利付国債（20年）	1,640,000,000	1,505,913,600
	第179回利付国債（20年）	1,610,000,000	1,473,423,700
	第180回利付国債（20年）	1,460,000,000	1,407,454,600
	第181回利付国債（20年）	1,465,000,000	1,433,722,250
	第182回利付国債（20年）	1,565,000,000	1,582,512,350
	第183回利付国債（20年）	1,443,000,000	1,531,802,220
	第184回利付国債（20年）	1,060,000,000	1,067,759,200
	国債証券合計	335,231,000,000	339,862,248,460
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	92,953,000
	第7回東京都公募公債（30年）	200,000,000	243,290,000
	第11回東京都公募公債（20年）	200,000,000	215,260,000
	第16回東京都公募公債（20年）	150,000,000	163,861,500
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	109,696,000
	第18回東京都公募公債（20年）	200,000,000	221,454,000
	第20回東京都公募公債（20年）	100,000,000	110,619,000
	第21回東京都公募公債（20年）	100,000,000	111,597,000
	第740回東京都公募公債	100,000,000	100,594,000
	第760回東京都公募公債	140,000,000	139,783,000
	第786回東京都公募公債	200,000,000	198,982,000
	第800回東京都公募公債	300,000,000	294,924,000
	第830回東京都公募公債	100,000,000	97,501,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,336,000
	令和4年度第1回北海道公募公債	100,000,000	97,697,000
	第3回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	122,116,000
	第11回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	110,402,000
	第15回神奈川県公募公債（20年）	300,000,000	332,421,000
	第16回神奈川県公募公債（20年）	600,000,000	672,396,000
	第21回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	110,103,000
	第243回神奈川県公募公債	100,000,000	98,277,000

第2回大阪府公募公債（20年）	300,000,000	334,935,000	
第183回大阪府公募公債（5年）	240,000,000	239,359,200	
第403回大阪府公募公債（10年）	300,000,000	302,730,000	
第417回大阪府公募公債（10年）	108,000,000	108,473,040	
第423回大阪府公募公債（10年）	300,000,000	300,300,000	
平成19年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	108,916,000	
平成25年度第2回京都府公募公債（15年）	100,000,000	103,860,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,928,000	
平成27年度第13回京都府公募公債	105,860,000	105,943,629	
令和2年度第1回京都府公募公債（10年）	100,000,000	98,460,000	
第3回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	108,860,000	
第4回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	104,882,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	104,388,000	
第11回兵庫県公募公債（15年）	200,000,000	204,340,000	
平成28年度第30回兵庫県公募公債	100,000,000	100,326,000	
令和3年度第9回兵庫県公募公債（5年）	100,000,000	99,619,000	
令和5年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	100,517,000	
令和5年度第4回兵庫県公募公債（グリーン ボンド・10年）	100,000,000	100,101,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	89,233,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	109,850,000	
平成26年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	100,648,000	
平成27年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	100,627,000	
平成27年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	100,817,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,267,000	
令和4年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	97,628,000	
平成22年度第14回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	111,902,000	
平成25年度第8回愛知県公募公債（30年）	110,000,000	126,300,900	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	201,502,000	
平成29年度第5回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	200,540,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,336,000	
平成29年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,271,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	199,622,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	98,269,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	98,259,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債（30年）	200,000,000	167,250,000	
	100,000,000	110,616,000	

平成20年度第1回広島県公募公債（20年）			
平成27年度第2回広島県公募公債	162,000,000	163,718,820	
平成29年度第7回広島県公募公債	131,440,000	131,347,992	
令和2年度第7回広島県公募公債	100,000,000	98,189,000	
第2回埼玉県公募公債（10年）	100,000,000	100,654,000	
第5回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	109,841,000	
第7回埼玉県公募公債（15年）	400,000,000	379,324,000	
第8回埼玉県公募公債（15年）	100,000,000	94,392,000	
第9回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	89,654,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	187,480,000	
平成29年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	100,335,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	122,441,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債（30年）	200,000,000	236,828,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	104,597,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,568,000	
平成29年度第8回福岡県公募公債	200,000,000	200,226,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	97,581,000	
令和3年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	99,652,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	200,000,000	186,570,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	222,170,000	
第8回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	111,966,000	
第9回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	110,019,000	
平成26年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	100,667,000	
平成28年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	99,985,000	
平成29年度第5回千葉県公募公債	120,000,000	120,183,600	
令和元年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	98,197,000	
平成27年度第3回新潟県公募公債	200,000,000	200,184,000	
平成28年度第1回新潟県公募公債	120,000,000	119,896,800	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	200,000,000	195,908,000	
第13回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	100,958,000	
第28回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	100,147,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,600,000	
第139回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,312,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,634,000	
第145回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,598,000	
第153回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,939,000	
第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	299,682,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,463,000	
第171回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,210,000	
第175回共同発行市場公募地方債	150,000,000	150,348,000	

第178回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,156,000	
第181回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,788,000	
第194回共同発行市場公募地方債	160,000,000	158,211,200	
第209回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,072,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	194,112,000	
第231回共同発行市場公募地方債	200,000,000	195,568,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	195,340,000	
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,380,000	
平成27年度第1回熊本市公募公債	100,000,000	100,937,000	
令和元年度第2回奈良県公募公債（5年）	100,000,000	99,960,000	
令和3年度第4回奈良県公募公債（5年）	100,000,000	99,650,000	
第7回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	92,790,000	
第10回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	111,927,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	100,000,000	97,626,000	
第3回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	120,847,000	
第13回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	92,862,000	
第488回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,679,000	
第495回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,079,000	
第522回名古屋市公募公債（10年）	200,000,000	199,088,000	
第2回京都市公募公債（20年）	100,000,000	104,394,000	
第6回京都市公募公債（20年）	100,000,000	109,170,000	
平成27年度第5回京都市公募公債	200,000,000	200,644,000	
令和4年度第3回京都市公募公債	200,000,000	199,088,000	
令和4年度第4回京都市公募公債	100,000,000	101,751,000	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	110,255,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	109,983,000	
平成26年度第3回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	108,021,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	83,363,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	104,005,000	
第5回横浜市公募公債（30年）	100,000,000	122,362,000	
第7回横浜市公募公債（30年）	100,000,000	121,719,000	
第25回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	109,960,000	
第26回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	110,633,000	
平成28年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	100,407,000	
平成29年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	100,245,000	
第55回横浜市公募公債（5年）	100,000,000	99,787,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	97,624,000	
平成25年度第5回札幌市公募公債（15年）	200,000,000	210,498,000	
第8回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	111,316,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	150,000,000	165,067,500	

	第66回川崎市公募公債（5年）	200,000,000	199,916,000	
	第87回川崎市公募公債	100,000,000	100,570,000	
	第88回川崎市公募公債	100,000,000	100,932,000	
	平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	400,000,000	433,412,000	
	平成29年度第12回福岡市公募公債	130,000,000	129,909,000	
	平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	100,124,000	
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,939,000	
	令和3年度第3回仙台市公募公債（5年）	135,000,000	134,481,600	
	平成27年度第1回三重県公募公債	100,000,000	100,939,000	
	令和3年度第2回三重県公募公債	100,000,000	97,690,000	
	平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	100,948,000	
	地方債証券合計	20,112,300,000	20,661,829,781	
特殊債券	第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,979,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	70,249,000	
	第148回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,772,000	
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	130,421,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	159,292,500	
	第21回道路債券	100,000,000	119,210,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	249,424,000	
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,902,000	
	第28回道路債券	300,000,000	361,809,000	
	第33回道路債券	100,000,000	122,021,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,299,000	
	第38回道路債券	100,000,000	102,583,000	
	第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,454,000	
	第42回道路債券	100,000,000	103,521,000	
	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	109,223,000	
	第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,655,000	
	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	110,176,000	
	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	110,985,000	
	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	112,008,000	
	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	119,546,000	

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	118,003,000	
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	111,119,000	
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	116,367,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	301,752,000	
第155回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,319,000	
第176回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,679,000	
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	110,012,000	
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	110,440,000	
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	105,432,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,912,000	
第238回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,244,000	
第246回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,885,000	
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	302,628,000	
第254回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,836,000	
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	100,678,000	
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	99,903,000	
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	99,811,000	
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	300,360,000	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,192,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,528,000	
第307回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,595,000	
第327回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,169,000	
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	243,330,480	
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	99,942,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	111,040,000	
第4回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	110,917,000	
第5回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	223,314,000	

第7回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	111,849,000	
第9回公営企業債券(20年)	100,000,000	102,690,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	500,000,000	500,005,000	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	103,364,000	
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	111,597,000	
第15回公営企業債券(20年)	100,000,000	104,442,000	
第15回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	334,725,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	106,067,000	
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	110,488,000	
第19回公営企業債券(20年)	100,000,000	107,451,000	
第22回公営企業債券(20年)	200,000,000	216,644,000	
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	327,969,000	
第24回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,474,000	
第30回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	110,816,000	
第34回地方公共団体金融機構債券(20年)	400,000,000	436,180,000	
第70回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,727,000	
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,847,000	
第75回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,926,000	
F76回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,061,000	
第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,512,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	421,000,000	424,346,950	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,842,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,944,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,030,000	
第96回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,168,000	
第103回政府保証地方公共団体金融機構債券	133,000,000	133,086,450	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	113,178,540	
第107回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,719,000	
第110回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	149,371,500	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,968,000	
F190回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,945,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,798,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,777,000	
第27回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,271,000	
第28回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,418,000	

第 8 9 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,920,000	
第 1 5 9 回都市再生債券	100,000,000	69,340,000	
第 1 6 1 回都市再生債券	100,000,000	76,431,000	
第 1 6 9 回都市再生債券	100,000,000	80,566,000	
第 5 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	139,095,000	138,178,363	
第 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,801,000	
第 7 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	51,475,000	51,121,881	
第 9 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	62,130,000	61,724,291	
第 1 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	11,248,000	11,461,262	
第 2 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,621,000	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,829,000	14,396,542	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,601,000	16,381,518	
第 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,032,000	30,238,279	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,852,000	10,957,264	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,168,000	21,185,677	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,080,000	20,011,104	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,316,000	19,138,754	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,918,000	41,400,953	
第 4 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,082,000	21,285,652	
第 4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,042,000	10,075,540	
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,897,000	24,809,865	
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,578,000	24,609,065	
第 4 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,135,000	
第 4 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,641,000	70,918,882	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,720,000	77,875,425	
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,691,000	18,392,448	
第 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,304,000	19,001,748	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,226,000	19,967,354	
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,731,000	22,533,743	
第 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,946,000	23,815,194	
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,785,000	26,755,805	
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,689,000	25,631,872	
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,200,000	35,098,776	
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,741,000	37,005,873	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,990,000	32,027,855	
第 7 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,304,000	30,059,164	
第 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,005,000	30,789,030	
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,348,000	36,635,020	
第 8 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,202,000	
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,440,000	



第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,791,000	58,396,071	
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	132,282,000	129,699,855	
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,885,000	65,902,758	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,727,000	68,423,105	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,273,000	67,796,099	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,550,000	68,325,224	
第115回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,349,000	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,196,000	69,244,142	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,466,000	69,375,890	
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,029,000	69,021,982	
第121回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,326,000	70,010,035	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,228,000	71,767,833	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,551,000	72,884,039	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,253,000	71,749,848	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,455,000	73,844,790	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,648,000	74,791,585	
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,985,000	75,368,315	
第139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,326,000	75,779,480	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,090,000	75,118,037	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,018,000	76,611,901	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,210,000	77,598,362	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,896,000	78,616,065	
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	253,812,000	244,035,161	
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	253,482,000	245,071,467	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,593,000	81,799,739	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,724,000	164,565,985	
第157回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,593,000	
	87,669,000	84,846,058	

第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,877,000	84,916,423	
第162回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,308,000	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,784,000	85,734,269	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,908,000	86,637,146	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,790,000	87,092,708	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,981,000	87,148,398	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,904,000	175,961,196	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,591,000	89,124,392	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,816,000	90,543,697	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,790,000	182,999,477	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,397,000	93,102,702	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,640,000	94,214,336	
第184回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,231,000	
第185回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,098,000	190,478,072	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,857,000	99,775,975	
第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,684,000	101,188,599	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,778,000	101,315,578	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,369,000	
第195回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,748,000	
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	199,442,000	
い第832号商工債	300,000,000	299,823,000	
い第835号商工債	200,000,000	199,772,000	
い第845号商工債	200,000,000	199,704,000	
い第853号商工債	100,000,000	99,622,000	
い第876号商工債	100,000,000	100,165,000	
第376回信金中金債（5年）	200,000,000	199,546,000	
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,680,000	
第386回信金中金債（5年）	100,000,000	99,579,000	
第34回国際協力機構債券	100,000,000	100,356,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	197,272,000	
第74回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,784,000	

	第 8 7 回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,542,000	
	第 1 0 2 回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,012,000	
	第 1 0 3 回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,605,000	
	第 8 8 回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,694,000	
	第 1 0 0 回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,355,000	
	第 2 7 回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,944,000	
	第 2 9 回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,394,000	
	第 5 4 回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,794,000	
	第 5 6 回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,847,000	
	第 7 0 回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,060,000	
	第 7 7 回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	300,783,000	
	第 6 6 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券	100,000,000	104,214,000	
	第 7 1 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券	100,000,000	100,637,000	
	特殊債券合計	22,137,024,000	22,689,675,413	
社債券	第 2 4 回フランス相互信用連合銀行（ B F C M ）円貨社債	100,000,000	99,923,000	
	第 2 9 回フランス相互信用連合銀行（ B F C M ）円貨社債	100,000,000	99,761,000	
	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	99,703,000	
	第 3 2 回ピー・ピー・シー・イー・エス・ エー円貨社債	300,000,000	299,889,000	
	第 1 9 回クレディ・アグリコル・エス・エー 円貨社債	200,000,000	200,062,000	
	第 1 回バンコ・サンタンデル・エセ・アー 円貨社債	200,000,000	199,320,000	
	第 3 回韓国輸出入銀行保証株式会社大韓航空 円貨社債（ 2 0 2 3 ）	100,000,000	99,912,000	
	第 5 2 回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	100,260,000	
	第 2 4 回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,833,000	
	第 1 7 回株式会社社長谷工コーポレーション無 担保社債	100,000,000	100,167,000	
	第 1 2 回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,457,000	
	第 5 回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,931,000	
	第 2 4 回大和ハウス工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,142,000	
	第 3 回高砂熱学工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,688,000	
	第 2 回 D M 三井製糖ホールディングス株式会 社無担保社債	100,000,000	100,044,000	
	第 1 9 回キリンホールディングス株式会社無 担保社債	100,000,000	99,486,000	
	第 1 2 回サントリーホールディングス株式会 社無担保社債	100,000,000	99,650,000	
	第 2 4 回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,049,000	
	第 1 1 回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	100,051,000	
	第 1 0 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	100,256,000	

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	98,928,000	
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	99,890,000	
第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	99,957,000	
第11回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,949,000	
第19回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,987,000	
第13回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,966,000	
第22回三菱瓦斯化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,756,000	
第56回三井化学株式会社無担保社債	200,000,000	200,072,000	
第12回J S R株式会社無担保社債	100,000,000	99,662,000	
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	99,940,000	
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	99,389,000	
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	99,886,000	
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	99,373,000	
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	86,122,000	
第6回株式会社電通無担保社債	100,000,000	98,854,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	200,000,000	193,046,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	200,000,000	200,182,000	
第3回株式会社ツムラ無担保社債	100,000,000	100,248,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,435,000	
第4回E N E O Sホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,542,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,187,000	
第9回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	100,025,000	
第9回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	99,332,000	
第34回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,047,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	100,025,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	99,838,000	
第14回株式会社L I X I L無担保社債	100,000,000	100,005,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	100,462,000	
第10回株式会社荏原製作所無担保社債	100,000,000	99,663,000	
第11回株式会社荏原製作所無担保社債	100,000,000	99,777,000	
第53回日本精工株式会社無担保社債	100,000,000	99,884,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	97,991,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	96,070,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	300,000,000	300,315,000	
第8回T D K株式会社無担保社債	100,000,000	99,264,000	
第15回株式会社デンソー無担保社債	200,000,000	199,914,000	
	100,000,000	99,569,000	

第1回株式会社東海理化電機製作所無担保社債			
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,708,000	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,942,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,528,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	89,475,000	
第69回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	110,470,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	97,631,000	
第87回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	99,102,000	
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	97,473,000	
第24回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	99,823,000	
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	104,267,000	
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	100,222,000	
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	104,102,000	
第23回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,659,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,890,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	98,372,000	
第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,435,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	98,590,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,809,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,826,000	
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	200,038,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,898,000	
第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,031,000	
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	99,685,000	
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	99,654,000	
第20回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	100,368,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,246,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,937,000	
第3回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	96,162,000	
第7回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,041,000	
	100,000,000	99,613,000	

第82回三菱UFJリース株式会社無担保社債			
第38回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,137,000	
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	99,124,000	
第4回野村ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,525,000	
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	99,569,000	
第1回損害保険ジャパン株式会社無担保社債	100,000,000	100,171,000	
第47回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	109,922,000	
第78回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	91,608,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	108,392,000	
第118回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,942,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	89,328,000	
第143回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,194,000	
第111回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,398,000	
第3回東急株式会社無担保社債	100,000,000	97,912,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	90,041,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	89,865,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	81,580,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	90,861,000	
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,201,000	
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	110,875,000	
第129回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	86,147,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	84,296,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	88,387,000	
第176回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	75,352,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	79,768,000	
第51回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	88,118,000	
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	110,701,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,059,000	
第8回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	108,550,000	
第10回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	110,883,000	
第13回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	107,931,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	84,112,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	85,828,000	
第45回西日本鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	198,418,000	
	100,000,000	99,495,000	

第58回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債			
第25回KDDI株式会社無担保社債	200,000,000	198,546,000	
第17回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	97,668,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	89,883,000	
第37回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	87,944,000	
第535回中部電力株式会社社債	200,000,000	195,138,000	
第509回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,204,000	
第510回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,252,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	97,380,000	
第541回関西電力株式会社社債	100,000,000	95,893,000	
第554回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,165,000	
第393回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,750,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	97,564,000	
第426回中国電力株式会社社債	100,000,000	97,174,000	
第445回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,379,000	
第448回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,818,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,169,000	
第321回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,017,000	
第364回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,458,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,194,000	
第521回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,114,000	
第535回東北電力株式会社社債	200,000,000	196,592,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,480,000	
第507回九州電力株式会社社債	200,000,000	195,330,000	
第516回九州電力株式会社社債	300,000,000	298,914,000	
第323回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,924,000	
第326回北海道電力株式会社社債	200,000,000	202,324,000	
第357回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,099,000	
第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,864,000	
第56回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	95,387,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,102,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,319,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,196,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,179,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,042,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,066,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	184,924,000	
第66回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,746,000	

第38回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	109,081,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	96,175,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	87,594,000	
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	99,882,000	
社債券合計	18,500,000,000	18,260,753,000	
合計		401,474,506,654	

(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

項目	2023年 7月25日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金	8,001,981,220	
コール・ローン	1,125,502,767	
株式	407,156,889,904	
投資信託受益証券	119,660,255	
投資証券	8,439,280,250	
派生商品評価勘定	376,275,567	
未収配当金	306,296,523	
差入委託証拠金	2,824,303,576	
流動資産合計	428,350,190,062	
資産合計	428,350,190,062	
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,956,466	
前受金	353,473,080	
未払金	95,028,684	
未払解約金	95,457,638	
未払利息	2,740	
流動負債合計	552,918,608	
負債合計	552,918,608	
純資産の部		
元本等		
元本	77,486,252,195	
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	350,311,019,259	
元本等合計	427,797,271,454	
純資産合計	427,797,271,454	
負債純資産合計	428,350,190,062	

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

		2023年 7月25日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式	



2023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>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 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 7月25日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	77,486,252,195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) 5.5209円 (55,209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

2023年 7月25日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>

2023年 7月25日現在	
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、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

2023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	2023年 7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	8,577,147,269円
期中一部解約元本額	5,828,798,616円
期末元本額	77,486,252,195円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,457,384,102円
DC外国株式インデックスファンド	5,086,320,661円
DC外国株式インデックスファンドL	28,480,175,920円
DCバランスファンド30	553,249,856円
DCバランスファンド50	1,205,820,878円
DCバランスファンド70	877,748,265円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	270,009,875円
外国株式インデックスe	4,479,723,873円
インデックスコレクション(外国株式)	17,524,811,677円
インデックスコレクション(バランス株式30)	2,941,860,850円
インデックスコレクション(バランス株式50)	1,171,798,376円

区分	2023年 7月25日現在
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,254,914,948円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,314,896,525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）	1,594,438,271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）	330,599,721円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	14,165,101円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	180,539,568円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	24,135,456円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	57,224,342円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	88,394,176円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	165,843,411円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	143,095,101円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	2,880,678,219円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	343,097,762円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	71,494,253円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	471,707,097円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	9,080,217円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	58,874,719円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	58,541,433円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	189,219,737円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	6,577,300円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	45,467,547円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	127,658,226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）	6,704,732円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023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	30,980,005,094
投資信託受益証券	11,700,354
投資証券	472,077,724
合計	30,496,227,016

(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

（2023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	11,882,790,785	-	12,236,263,865	353,473,080
合計		11,882,790,785	-	12,236,263,865	353,473,080

## (注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

（2023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	1,226,357,296	-	1,240,203,317	13,846,021
	アメリカドル	933,797,784	-	944,170,451	10,372,667
	ユーロ	215,682,440	-	218,950,540	3,268,100
	イギリスポンド	54,074,880	-	54,280,260	205,380
	スイスフラン	22,802,192	-	22,802,066	126
合計		1,226,357,296	-	1,240,203,317	13,846,021

(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	39.28	696,787.92	
	BAKER HUGHES CO	52,525	35.84	1,882,496.00	
	CHENIERE ENERGY INC	13,711	159.55	2,187,590.05	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	5,333	83.42	444,878.86	
	CHEVRON CORP	96,572	161.82	15,627,281.04	
	CONOCOPHILLIPS	64,886	114.72	7,443,721.92	
	COTERRA ENERGY INC	41,058	26.87	1,103,228.46	
	DEVON ENERGY CORPORATION	36,666	53.09	1,946,597.94	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	8,771	144.45	1,266,970.95	
	EOG RESOURCES INC	31,440	126.15	3,966,156.00	
	EQT CORPORATION	17,321	39.70	687,643.70	
	EXXON MOBIL	218,746	105.52	23,082,077.92	
	HALLIBURTON CO	47,084	38.26	1,801,433.84	
	HESS CORP	14,466	145.66	2,107,117.56	
	HF SINCLAIR CORP	8,443	50.28	424,514.04	
	KINDER MORGAN INC	105,760	18.11	1,915,313.60	
	MARATHON OIL CORP	36,460	25.64	934,834.40	
	MARATHON PETROLEUM CORP	23,304	128.39	2,992,000.56	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	38,623	62.32	2,406,985.36	
	ONEOK INC	24,617	67.25	1,655,493.25	
OVINTIV INC	13,202	42.25	557,784.50		
PHILLIPS 66	24,974	106.85	2,668,471.90		
PIONEER NATURAL RESOURCES	12,982	218.03	2,830,465.46		

SCHLUMBERGER	75,878	57.02	4,326,563.56
TARGA RESOURCES CORP	11,099	81.38	903,236.62
TEXAS PACIFIC LAND CORP	350	1,491.23	521,930.50
VALERO ENERGY CORP	20,196	125.71	2,538,839.16
WILLIAMS COS	63,260	33.96	2,148,309.60
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	12,269	302.10	3,706,464.90
ALBEMARLE CORP	6,375	210.80	1,343,850.00
ALCOA CORP	9,533	33.75	321,738.75
AMCOR PLC	82,838	10.11	837,492.18
AVERY DENNISON CORP	4,144	177.61	736,015.84
BALL CORP	17,147	57.95	993,668.65
CELANESE CORP-SERIES A	5,419	122.00	661,118.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	80.55	836,028.45
CLEVELAND-CLIFFS INC	27,048	16.51	446,562.48
CORTEVA INC	37,593	56.70	2,131,523.10
CROWN HOLDINGS INC	6,218	90.52	562,853.36
DOW INC	38,891	52.55	2,043,722.05
DUPONT DE NEMOURS INC	24,640	75.49	1,860,073.60
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,266	86.50	542,009.00
ECOLAB INC	13,900	189.43	2,633,077.00
FMC CORP	6,569	95.41	626,748.29
FREEMPORT-MCMORAN INC	76,831	42.10	3,234,585.10
INT'L PAPER CO	17,345	32.37	561,457.65
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,928	84.97	1,183,462.16
LINDE PLC	26,181	384.69	10,071,568.89
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,234	90.81	1,201,779.54
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,168	458.51	1,452,559.68
MOSAIC CO/THE	18,682	39.53	738,499.46
NEWMONT CORPORATION	41,716	43.23	1,803,382.68
NUCOR CORP	13,322	166.65	2,220,111.30
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,174	138.67	717,478.58
PPG INDUSTRIES INC	12,407	145.87	1,809,809.09
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	3,200	287.41	919,712.00
RPM INTERNATIONAL INC	6,687	91.99	615,137.13
SEALED AIR CORP	7,368	46.05	339,296.40
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	13,583	268.02	3,640,515.66
STEEL DYNAMICS INC	9,667	101.98	985,840.66
VULCAN MATERIALS CO	7,535	222.60	1,677,291.00
WESTLAKE CORP	2,096	128.59	269,524.64
WESTROCK CO	14,176	30.76	436,053.76
3 M COMPANY	29,781	104.27	3,105,264.87
AECOM	7,200	87.86	632,592.00

AERCAP HOLDINGS NV	10,161	65.00	660,465.00
ALLEGION PLC	4,638	126.35	586,011.30
AMETEK INC	12,923	158.23	2,044,806.29
AXON ENTERPRISE INC	3,591	178.30	640,275.30
BOEING CO	31,050	215.87	6,702,763.50
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	8,000	138.25	1,106,000.00
CARLISLE COS INC	2,870	266.69	765,400.30
CARRIER GLOBAL CORP	45,054	53.81	2,424,355.74
CATERPILLAR	27,631	259.37	7,166,652.47
CUMMINS INC	7,320	257.89	1,887,754.80
DEERE&CO	15,208	442.59	6,730,908.72
DOVER CORP	7,491	152.09	1,139,306.19
EATON CORP	21,840	207.36	4,528,742.40
EMERSON ELECTRIC CO	30,697	92.24	2,831,491.28
FASTENAL CO	29,312	58.42	1,712,407.04
FERGUSON PLC	11,566	159.58	1,845,702.28
FORTIVE CORP	18,487	74.03	1,368,592.61
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,412	72.89	467,370.68
GENERAC HOLDINGS INC	2,918	146.60	427,778.80
GENERAL DYNAMICS CORP	12,920	217.64	2,811,908.80
GENERAL ELECTRIC CO	58,757	110.25	6,477,959.25
GRACO INC	8,952	86.53	774,616.56
GRAINGER (WW) INC	2,333	769.26	1,794,683.58
HEICO CORP	2,252	177.74	400,270.48
HEICO CORP-CLASS A	4,228	141.32	597,500.96
HONEYWELL INTL INC	35,975	209.32	7,530,287.00
HOWMET AEROSPACE INC	22,727	50.07	1,137,940.89
HUBBELL INC	2,787	333.78	930,244.86
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	231.22	460,821.46
IDEX CORP	3,918	214.85	841,782.30
ILLINOIS TOOL WORKS	16,624	254.34	4,228,148.16
INGERSOLL-RAND INC	20,847	65.27	1,360,683.69
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,600	48.94	469,824.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	36,781	68.90	2,534,210.90
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	10,469	200.67	2,100,814.23
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,584	331.91	525,745.44
LOCKHEED MARTIN CORP	12,180	456.80	5,563,824.00
MASCO CORP	12,110	59.38	719,091.80
NORDSON CORP	2,536	244.91	621,091.76
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,890	452.21	3,567,936.90
OTIS WORLDWIDE CORP	21,403	87.23	1,866,983.69
OWENS CORNING	4,965	130.77	649,273.05

PACCAR INC	28,288	88.70	2,509,145.60
PARKER HANNIFIN CORP	6,957	397.87	2,767,981.59
PENTAIR PLC	7,637	66.26	506,027.62
QUANTA SERVICES INC	7,500	203.81	1,528,575.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	78,822	97.01	7,646,522.22
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,432	338.13	2,174,852.16
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,602	46.48	353,340.96
SMITH (A.O.) CORP	6,846	75.42	516,325.32
SNAP-ON INC	2,772	274.61	761,218.92
STANLEY BLACK&DECKER	8,223	96.43	792,943.89
TEXTRON	10,911	67.98	741,729.78
TORO CO	5,600	103.18	577,808.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,377	194.47	2,406,955.19
TRANSDIGM GROUP INC	3,041	882.04	2,682,283.64
UNITED RENTALS INC	3,678	450.21	1,655,872.38
WABTEC CORP	9,109	113.25	1,031,594.25
WATSCO INC	2,000	366.99	733,980.00
XYLEM INC	12,709	113.96	1,448,317.64
AUTOMATIC DATA PROCESS	22,247	239.50	5,328,156.50
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,038	115.87	815,493.06
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	5,961	169.86	1,012,535.46
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,963	68.42	476,408.46
CINTAS CORP	4,794	510.57	2,447,672.58
CLARIVATE PLC	15,370	9.50	146,015.00
COPART INC	23,382	89.65	2,096,196.30
EQUIFAX INC	6,976	206.55	1,440,892.80
JACOBS SOLUTIONS INC	6,625	126.00	834,750.00
LEIDOS HOLDINGS	6,940	91.43	634,524.20
PAYCHEX INC	16,816	125.25	2,106,204.00
PAYCOM SOFTWARE INC	2,625	350.98	921,322.50
PAYLOCITY HOLDING CORP	2,200	219.73	483,406.00
REPUBLIC SERVICES INC	12,099	154.30	1,866,875.70
ROBERT HALF INC	5,212	80.09	417,429.08
ROLLINS INC	15,210	44.75	680,647.50
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	12,962	61.77	800,662.74
TRANSUNION	10,758	78.97	849,559.26
VERISK ANALYTICS INC	8,140	234.16	1,906,062.40
WASTE CONNECTIONS INC	13,987	145.25	2,031,611.75
WASTE MANAGEMENT INC	21,458	171.80	3,686,484.40
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,274	97.94	614,475.56
CSX CORP	112,980	32.52	3,674,109.60
DELTA AIR LINES INC	7,841	47.48	372,290.68

EXPEDITORS INTL WASH INC	8,512	124.99	1,063,914.88
FEDEX CORP	12,818	258.77	3,316,913.86
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	134,628	3.60	484,660.80
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,321	198.34	857,027.14
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,000	57.48	574,800.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,643	235.37	2,975,782.91
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,632	389.46	2,193,438.72
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,754	37.20	251,248.80
U-HAUL HOLDING CO	5,076	58.50	296,946.00
UBER TECHNOLOGIES INC	99,742	47.32	4,719,791.44
UNION PACIFIC CORP	32,640	216.94	7,080,921.60
UNITED PARCEL SERVICE B	39,101	188.34	7,364,282.34
APTIV PLC	14,148	109.43	1,548,215.64
BORGWARNER INC	11,533	46.15	532,247.95
FORD MOTOR COMPANY	205,843	13.96	2,873,568.28
GENERAL MOTORS CO	75,461	39.30	2,965,617.30
LEAR CORP	2,989	151.26	452,116.14
LUCID GROUP INC	45,820	7.17	328,529.40
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	40,190	25.81	1,037,303.90
TESLA INC	153,903	269.06	41,409,141.18
DECKERS OUTDOOR CORP	1,600	549.47	879,152.00
DR HORTON INC	17,138	130.01	2,228,111.38
GARMIN LTD	7,784	105.87	824,092.08
HASBRO INC	7,256	64.98	471,494.88
LENNAR CORP-CL A	12,818	127.30	1,631,731.40
LULULEMON ATHLETICA INC	6,033	380.39	2,294,892.87
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,830	111.38	315,205.40
NIKE B	65,934	108.77	7,171,641.18
NVR INC	164	6,230.69	1,021,833.16
PULTE GROUP INC	12,386	78.53	972,672.58
VF CORP	16,318	19.52	318,527.36
WHIRLPOOL CORP	3,060	150.76	461,325.60
AIRBNB INC-CLASS A	23,073	147.62	3,406,036.26
ARAMARK	11,643	42.67	496,806.81
BOOKING HOLDINGS INC	2,049	2,893.76	5,929,314.24
CAESARS ENTERTAINMENT INC	12,243	57.77	707,278.11
CARNIVAL CORPORATION	57,539	17.85	1,027,071.15
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,441	2,082.99	3,001,588.59
DARDEN RESTAURANTS INC	6,950	170.08	1,182,056.00
DOMINO'S PIZZA INC	1,797	385.90	693,462.30
DOORDASH INC - A	14,879	84.31	1,254,448.49
EXPEDIA GROUP INC	8,454	116.83	987,680.82



HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	14,280	150.46	2,148,568.80
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,200	120.21	384,672.00
LAS VEGAS SANDS CORP	19,449	56.53	1,099,451.97
MARRIOTT INTL A	14,322	194.27	2,782,334.94
MCDONALD'S CORP	39,216	295.31	11,580,876.96
MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,799	49.00	774,151.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,881	102.93	1,325,841.33
STARBUCKS CORP	61,325	102.78	6,302,983.50
VAIL RESORTS INC	2,160	236.05	509,868.00
WYNN RESORTS LTD	5,210	107.51	560,127.10
YUM BRANDS INC	14,772	137.94	2,037,649.68
ACTIVISION BLIZZARD INC	39,597	92.55	3,664,702.35
ALPHABET INC-CL A	321,272	121.53	39,044,186.16
ALPHABET INC-CL C	288,636	121.88	35,178,955.68
ATLANTA BRAVES HOLDINGS IN-C	286	36.99	10,579.14
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	5,239	399.43	2,092,613.77
COMCAST CORP-CL A	225,140	43.29	9,746,310.60
ELECTRONIC ARTS INC	14,435	137.76	1,988,565.60
FOX CORP - CLASS A	15,560	33.20	516,592.00
FOX CORP- CLASS B	6,975	31.14	217,201.50
INTERPUBLIC GROUP OF COS	22,646	32.63	738,938.98
LIBERTY BROADBAND-C	7,402	88.86	657,741.72
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,885	70.48	696,694.80
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,928	31.72	251,476.16
LIVE NATION ENTERTAINMENT	8,618	97.16	837,324.88
MATCH GROUP INC	14,456	45.60	659,193.60
META PLATFORMS INC-CLASS A	119,440	291.61	34,829,898.40
NETFLIX INC	23,727	428.37	10,163,934.99
NEWS CORP-CLASS A	22,307	19.34	431,417.38
OMNICOM GROUP	10,921	83.09	907,425.89
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	30,808	15.48	476,907.84
PINTEREST INC- CLASS A	30,404	27.79	844,927.16
ROBLOX CORP -CLASS A	24,726	39.55	977,913.30
ROKU INC	6,927	71.86	497,774.22
SEA LTD-ADR	19,867	61.16	1,215,065.72
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,096	6.00	282,576.00
SNAP INC - A	62,654	12.68	794,452.72
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,959	150.28	1,346,358.52
THE WALT DISNEY CO	99,094	86.60	8,581,540.40
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	23,690	82.07	1,944,238.30
WARNER BROS DISCOVERY INC	122,994	12.61	1,550,954.34
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	14,227	25.82	367,341.14

ADVANCE AUTO PARTS	3,129	72.76	227,666.04
AMAZON.COM	497,664	128.80	64,099,123.20
AUTOZONE INC	975	2,494.79	2,432,420.25
BATH & BODY WORKS INC	13,789	35.25	486,062.25
BEST BUY COMPANY INC	10,832	84.79	918,445.28
BURLINGTON STORES INC	3,549	174.22	618,306.78
CARMAX INC	7,628	83.79	639,150.12
CHEWY INC - CLASS A	3,947	33.89	133,763.83
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,000	130.97	523,880.00
EBAY	29,667	48.94	1,451,902.98
ETSY INC	6,573	96.54	634,557.42
GENUINE PARTS CO	7,768	157.55	1,223,848.40
HOME DEPOT	54,734	325.11	17,794,570.74
LKQ CORP	13,325	56.92	758,459.00
LOWES COMPANIES	32,120	234.00	7,516,080.00
MERCADOLIBRE INC	2,390	1,198.43	2,864,247.70
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,383	957.98	3,240,846.34
POOL CORP	2,087	365.16	762,088.92
ROSS STORES INC	18,500	112.70	2,084,950.00
TJX COMPANIES INC	63,038	86.59	5,458,460.42
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,763	214.66	1,237,085.58
ULTA BEAUTY INC	2,749	454.67	1,249,887.83
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	19,000	22.05	418,950.00
COSTCO WHOLESALE CORP	24,006	563.93	13,537,703.58
DOLLAR GENERAL CORP	12,157	167.67	2,038,364.19
DOLLAR TREE INC	11,506	150.80	1,735,104.80
KROGER CO	35,291	48.74	1,720,083.34
SYSCO CORP	28,275	75.81	2,143,527.75
TARGET (DAYTON HUDSON)	24,705	135.41	3,345,304.05
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	40,229	30.64	1,232,616.56
WALMART INC	79,149	159.30	12,608,435.70
ALTRIA GROUP INC	96,590	45.60	4,404,504.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	30,271	83.11	2,515,822.81
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,737	69.09	1,087,269.33
BUNGE LIMITED	7,221	106.08	766,003.68
CAMPBELL SOUP CO (US)	10,059	46.41	466,838.19
COCA-COLA CO	222,327	62.46	13,886,544.42
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	12,052	64.73	780,125.96
CONAGRA BRANDS INC	26,163	33.26	870,181.38
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,857	271.26	2,402,549.82
DARLING INGREDIENTS INC	8,500	67.49	573,665.00
GENERAL MILLS INC	31,192	77.25	2,409,582.00

HERSHEY FOODS CORPORATION	7,990	245.82	1,964,101.80
HORMEL FOODS CORP	15,714	40.52	636,731.28
JM SMUCKER CO	5,275	153.13	807,760.75
KELLOGG CO	13,898	67.85	942,979.30
KEURIG DR PEPPER INC	51,374	32.36	1,662,462.64
KRAFT HEINZ CO/THE	45,077	36.35	1,638,548.95
LAMB WESTON HOLDINGS INC	8,000	112.69	901,520.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,652	88.77	1,211,888.04
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	10,122	69.85	707,021.70
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	73,446	74.32	5,458,506.72
MONSTER BEVERAGE CORP	41,030	58.38	2,395,331.40
PEPSICO INC	74,517	190.92	14,226,785.64
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	82,717	97.62	8,074,833.54
TYSON FOODS INC	14,778	53.47	790,179.66
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,611	98.08	1,236,886.88
CLOROX COMPANY	6,394	155.16	992,093.04
COLGATE-PALMOLIVE CO	41,461	77.48	3,212,398.28
ESTEE LAUDER CO-CL A	12,383	177.04	2,192,286.32
KIMBERLY-CLARK CORP	17,528	137.17	2,404,315.76
PROCTER & GAMBLE CO	127,453	153.42	19,553,839.26
ABBOTT LABORATORIES	93,365	114.62	10,701,496.30
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,193	337.01	1,413,082.93
AMERISOURCEBERGEN CORP	9,745	191.45	1,865,680.25
BAXTER INTERNATIONAL	26,594	48.28	1,283,958.32
BECTON DICKINSON & CO	15,316	279.97	4,288,020.52
BOSTON SCIENTIFIC CORP	78,829	52.17	4,112,508.93
CARDINAL HEALTH	14,569	93.05	1,355,645.45
CENTENE CORP	29,946	70.86	2,121,973.56
CVS HEALTH CORP	68,012	75.95	5,165,511.40
DAVITA INC	3,582	102.10	365,722.20
DENTSPLY SIRONA INC	10,094	40.46	408,403.24
DEXCOM INC	20,381	127.72	2,603,061.32
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	32,184	91.40	2,941,617.60
ELEVANCE HEALTH INC	12,828	471.16	6,044,040.48
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	19,005	80.63	1,532,373.15
HCA HEALTHCARE INC	11,263	285.18	3,211,982.34
HENRY SCHEIN INC	7,493	79.41	595,019.13
HOLOGIC INC	12,961	81.32	1,053,988.52
HUMANA INC	6,841	453.44	3,101,983.04
IDEXX LABORATORIES INC	4,442	554.03	2,461,001.26
INSULET CORP	3,546	279.60	991,461.60
INTUITIVE SURGICAL INC	18,641	323.56	6,031,481.96

LABORATORY CRP OF AMER	4,533	218.82	991,911.06
MASIMO CORP	2,735	112.72	308,289.20
MCKESSON CORP	7,488	413.18	3,093,891.84
MEDTRONIC PLC	71,130	88.76	6,313,498.80
MOLINA HEALTHCARE INC	3,016	313.97	946,933.52
NOVOCURE LTD	4,504	38.33	172,638.32
QUEST DIAGNOSTICS	6,246	144.02	899,548.92
RESMED INC	7,602	218.16	1,658,452.32
STERIS PLC	5,122	232.17	1,189,174.74
STRYKER CORP	18,246	290.73	5,304,659.58
TELEFLEX INC	2,672	257.17	687,158.24
THE CIGNA GROUP	16,011	292.06	4,676,172.66
THE COOPER COS INC	2,561	386.96	991,004.56
UNITEDHEALTH GROUP INC	50,390	508.68	25,632,385.20
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	148.32	578,151.36
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,693	196.98	1,515,367.14
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,864	140.87	1,671,281.68
ABBVIE INC	95,461	143.18	13,668,105.98
AGILENT TECHNOLOGIES	15,996	127.72	2,043,009.12
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,056	192.32	1,357,009.92
AMGEN	28,568	235.42	6,725,478.56
AVANTOR INC	34,993	22.84	799,240.12
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,302	416.90	542,803.80
BIO-TECHNE CORP	8,884	87.91	780,992.44
BIOGEN INC	8,034	277.00	2,225,418.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	10,231	87.41	894,291.71
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	113,962	64.73	7,376,760.26
CATALENT INC	8,308	47.94	398,285.52
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,641	207.25	547,347.25
DANAHER CORP	36,857	257.98	9,508,368.86
ELI LILLY & CO	43,649	459.32	20,048,858.68
EXACT SCIENCES CORP	9,063	93.84	850,471.92
GILEAD SCIENCES INC	67,061	77.66	5,207,957.26
HORIZON THERAPEUTICS PLC	11,362	100.40	1,140,744.80
ILLUMINA INC	8,558	188.07	1,609,503.06
INCYTE CORP	10,628	63.46	674,452.88
IQVIA HOLDINGS INC	10,091	228.16	2,302,362.56
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,254	131.89	429,170.06
JOHNSON & JOHNSON	140,334	171.08	24,008,340.72
MERCK & CO	137,195	108.79	14,925,444.05
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,168	1,362.02	1,590,839.36
MODERNA INC	17,875	123.01	2,198,803.75

NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,708	100.02	470,894.16
PFIZER	305,735	37.51	11,468,119.85
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,745	727.13	4,177,361.85
REPLIGEN CORP	2,737	176.51	483,107.87
REVVITY INC	6,426	130.01	835,444.26
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,093	31.00	560,883.00
SEAGEN INC	8,007	196.23	1,571,213.61
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56,857	8.64	491,244.48
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,870	571.52	11,927,622.40
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,421	245.73	594,912.33
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,754	357.05	4,910,865.70
VIATRIS INC	63,857	10.62	678,161.34
WATERS CORP	3,306	286.97	948,722.82
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,764	376.06	1,415,489.84
ZOETIS INC	24,431	185.58	4,533,904.98
BANK OF AMERICA CORP	385,185	32.65	12,576,290.25
CITIGROUP	103,674	47.66	4,941,102.84
CITIZENS FINANCIAL GROUP	25,193	32.14	809,703.02
FIFTH THIRD BANCORP	37,082	28.66	1,062,770.12
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	573	1,386.73	794,596.29
FIRST HORIZON CORP	27,858	13.20	367,725.60
HUNTINGTON BANCSHARES INC	78,770	12.11	953,904.70
JPMORGAN CHASE & CO	158,395	158.00	25,026,410.00
KEY CORP	48,984	11.89	582,419.76
M & T BANK CORP	9,606	139.79	1,342,822.74
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	21,205	135.60	2,875,398.00
REGIONS FINL CORP	49,382	20.00	987,640.00
TRUIST FINANCIAL CORP	69,336	33.50	2,322,756.00
US BANCORP	85,114	39.26	3,341,575.64
WEBSTER FINANCIAL CORP	8,680	46.37	402,491.60
WELLS FARGO & CO	202,346	46.42	9,392,901.32
ALLY FINANCIAL INC	18,129	29.61	536,799.69
AMERICAN EXPRESS	34,115	167.79	5,724,155.85
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,866	354.98	2,082,312.68
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	20,242	80.84	1,636,363.28
ARES MANAGEMENT CORP - A	8,035	100.47	807,276.45
BANK NEW YORK CO	45,067	45.51	2,050,999.17
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	70,108	349.63	24,511,860.04
BLACKROCK INC	8,057	756.58	6,095,765.06
BLACKSTONE INC	37,747	105.13	3,968,342.11
BLOCK INC	30,502	77.14	2,352,924.28
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,406	117.22	2,391,991.32

CARLYLE GROUP INC/THE	10,351	34.51	357,213.01
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,992	142.31	852,721.52
CME GROUP INC	18,867	191.04	3,604,351.68
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	10,291	98.85	1,017,265.35
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,285	108.84	1,554,779.40
EQUITABLE HOLDINGS INC	18,461	28.81	531,861.41
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,972	436.74	861,251.28
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	31,029	61.84	1,918,833.36
FISERV INC	34,179	129.75	4,434,725.25
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,879	251.71	976,383.09
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	29.53	435,508.44
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,286	49.38	112,882.68
GLOBAL PAYMENTS INC	15,111	112.50	1,699,987.50
GOLDMAN SACHS GROUP INC	17,887	358.93	6,420,180.91
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	30,232	116.28	3,515,376.96
INVESCO LTD	19,405	17.96	348,513.80
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,514	173.29	608,941.06
KKR & CO INC	33,954	60.77	2,063,384.58
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,096	232.07	950,558.72
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,112	271.31	573,006.72
MASTERCARD INC-CLASS A	46,026	404.79	18,630,864.54
MOODY'S CORP	8,574	356.88	3,059,889.12
MORGAN STANLEY	67,267	94.67	6,368,166.89
MSCI INC	4,355	502.75	2,189,476.25
NASDAQ INC	17,953	51.05	916,500.65
NORTHERN TRUST CORP	10,018	79.58	797,232.44
PAYPAL HOLDINGS INC	57,102	73.69	4,207,846.38
PRICE T ROWE GROUP INC	11,505	120.69	1,388,538.45
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,135	109.65	1,111,302.75
S&P GLOBAL INC	17,688	422.80	7,478,486.40
SCHWAB (CHARLES) CORP	82,257	66.56	5,475,025.92
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	64.08	402,999.12
STATE STREET CORP	17,821	71.24	1,269,568.04
SYNCHRONY FINANCIAL	23,931	35.84	857,687.04
TOAST INC-CLASS A	13,000	22.47	292,110.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	6,542	74.87	489,799.54
VISA INC-CLASS A SHARES	87,799	240.74	21,136,731.26
AFLAC	31,141	72.46	2,256,476.86
ALLSTATE CORP	14,193	112.11	1,591,177.23
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,803	120.41	457,919.23
AMERICAN INT'L GROUP	40,246	60.26	2,425,223.96
AON PLC	10,903	342.57	3,735,040.71

ARCH CAPITAL GROUP LTD	18,793	81.19	1,525,803.67
ARTHUR J GALLAGHER & CO	11,870	219.64	2,607,126.80
ASSURANT INC	2,684	130.51	350,288.84
BROWN & BROWN INC	13,365	70.63	943,969.95
CHUBB LTD	22,362	200.54	4,484,475.48
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,751	102.74	796,337.74
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,444	208.48	301,045.12
EVEREST GROUP LTD	2,065	370.11	764,277.15
FNF GROUP	12,836	38.00	487,768.00
GLOBE LIFE INC	4,559	114.51	522,051.09
HARTFORD FINANCIAL SVCS	16,673	74.84	1,247,807.32
LOEWS CORP	10,482	61.48	644,433.36
MARKEL GROUP INC	702	1,424.97	1,000,328.94
MARSH & MCLENNAN COS	27,109	192.47	5,217,669.23
METLIFE INC	35,762	61.98	2,216,528.76
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,725	83.71	1,065,209.75
PROGRESSIVE CORP	31,370	125.24	3,928,778.80
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	19,312	96.52	1,863,994.24
TRAVELERS COS INC/THE	12,320	174.84	2,154,028.80
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,009	232.25	1,395,590.25
WR BERKLEY CORP	11,919	61.32	730,873.08
WEYERHAEUSER CO	40,664	34.29	1,394,368.56
ACCENTURE PLC-CL A	33,739	313.29	10,570,091.31
ADOBE INC	24,596	523.86	12,884,860.56
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	8,949	92.80	830,467.20
ANSYS INC	4,382	339.84	1,489,178.88
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,805	173.21	312,644.05
ATLASSIAN CORP-CL A	8,000	173.09	1,384,720.00
AUTODESK INC	11,280	210.53	2,374,778.40
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	11,819	53.18	628,534.42
BILL HOLDINGS, INC.	4,833	124.25	600,500.25
BLACK KNIGHT INC	8,009	70.80	567,037.20
CADENCE DESIGN SYSTEMS	14,780	241.27	3,565,970.60
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,676	127.28	722,441.28
CLOUDFLARE INC - CLASS A	16,221	65.39	1,060,691.19
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	26,353	67.45	1,777,509.85
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	12,526	149.74	1,875,643.24
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,100	156.99	329,679.00
DATADOG INC - CLASS A	12,954	111.49	1,444,241.46
DOCUSIGN INC	9,538	51.82	494,259.16
DROPBOX INC-CLASS A	16,505	26.80	442,334.00
DYNATRACE INC	10,480	52.08	545,798.40

EPAM SYSTEMS INC	3,061	235.21	719,977.81
FAIR ISAAC CORP	1,345	834.78	1,122,779.10
FORTINET INC	34,510	77.27	2,666,587.70
GARTNER INC	4,134	357.21	1,476,706.14
GEN DIGITAL INC	29,838	19.31	576,171.78
GODADDY INC - CLASS A	8,747	74.92	655,325.24
HUBSPOT INC	2,683	536.12	1,438,409.96
INTL BUSINESS MACHINES CORP	48,259	139.54	6,734,060.86
INTUIT INC	15,282	488.50	7,465,257.00
MICROSOFT CORP	380,818	345.11	131,424,099.98
MONDAY.COM LTD	1,500	171.84	257,760.00
MONGODB INC	4,115	410.58	1,689,536.70
OKTA INC	7,338	70.50	517,329.00
ORACLE CORP	87,980	118.07	10,387,798.60
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	93,706	16.32	1,529,281.92
PALO ALTO NETWORKS INC	16,697	243.33	4,062,881.01
PTC INC	5,381	143.09	769,967.29
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,903	495.16	2,922,929.48
SALESFORCE INC	53,365	225.66	12,042,345.90
SERVICENOW INC	10,817	578.04	6,252,658.68
SNOWFLAKE INC-CLASS A	14,431	174.80	2,522,538.80
SPLUNK INC	8,652	103.58	896,174.16
SYNOPSYS INC	8,405	450.75	3,788,553.75
TWILIO INC - A	7,960	61.35	488,346.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,478	402.70	997,890.60
UIPATH INC - CLASS A	24,000	17.00	408,000.00
UNITY SOFTWARE INC	13,116	43.55	571,201.80
VERISIGN INC	5,329	211.88	1,129,108.52
VMWARE INC-CLASS A	13,256	160.43	2,126,660.08
WIX.COM LTD	3,273	83.79	274,244.67
WORKDAY INC-CLASS A	11,335	223.12	2,529,065.20
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	12,443	69.51	864,912.93
ZSCALER INC	4,184	148.33	620,612.72
AMPHENOL CORPORATION	31,392	83.59	2,624,057.28
APPLE INC	851,971	192.75	164,217,410.25
ARISTA NETWORKS INC	13,408	171.72	2,302,421.76
ARROW ELECTRONICS INC	2,451	138.97	340,615.47
CDW CORP/DE	7,411	189.99	1,408,015.89
CISCO SYSTEMS	222,005	53.11	11,790,685.55
COGNEX CORP	8,069	54.58	440,406.02
CORNING	43,885	33.19	1,456,543.15
DELL TECHNOLOGIES -C	14,009	53.73	752,703.57



F5 INC	2,841	150.21	426,746.61
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	66,144	17.35	1,147,598.40
HP INC	44,913	32.43	1,456,528.59
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	29.37	478,965.96
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,238	168.29	1,554,663.02
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,289	295.56	2,745,456.84
NETAPP INC	10,843	78.45	850,633.35
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,880	59.28	585,686.40
TE CONNECTIVITY LTD	17,335	140.47	2,435,047.45
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,404	413.81	994,799.24
TRIMBLE IMS HOLDINGS	13,869	52.95	734,363.55
WESTERN DIGITAL CORP	17,228	38.92	670,513.76
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,892	302.59	875,090.28
AT&T INC	380,487	14.95	5,688,280.65
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,831	19.11	149,650.41
LIBERTY GLOBAL PLC-C	12,682	20.19	256,049.58
T-MOBILE US INC	32,388	141.37	4,578,691.56
VERIZON COMMUNICATIONS	224,058	33.98	7,613,490.84
AES CORP	34,338	21.62	742,387.56
ALLIANT ENERGY CORPORATION	12,663	55.55	703,429.65
AMEREN CORPORATION	13,199	87.28	1,152,008.72
AMERICAN ELECTRIC POWER	26,863	87.60	2,353,198.80
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,087	147.72	1,637,771.64
ATMOS ENERGY CORP	7,575	123.17	933,012.75
CENTERPOINT ENERGY INC	31,584	30.87	974,998.08
CMS ENERGY CORP	14,716	62.67	922,251.72
CONSOLIDATED EDISON INC	18,713	97.13	1,817,593.69
CONSTELLATION ENERGY	16,951	96.55	1,636,619.05
DOMINION ENERGY INC	44,910	53.89	2,420,199.90
DTE ENERGY COMPANY	10,982	115.01	1,263,039.82
DUKE ENERGY CORP	41,313	94.77	3,915,233.01
EDISON INTL	19,236	72.54	1,395,379.44
ENERGY CORP	12,274	104.46	1,282,142.04
ESSENTIAL UTILITIES INC	12,969	42.68	553,516.92
EVERGY INC	11,724	61.15	716,922.60
EVERSOURCE ENERGY	18,286	73.70	1,347,678.20
EXELON CORP	54,634	42.83	2,339,974.22
FIRSTENERGY CORP	30,792	40.00	1,231,680.00
NEXTERA ENERGY INC	109,882	75.50	8,296,091.00
NISOURCE INC	20,005	28.05	561,140.25
NRG ENERGY INC	12,298	37.88	465,848.24
PG&E CORP	101,796	17.88	1,820,112.48

PPL CORPORATION	38,399	27.80	1,067,492.20	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	26,322	64.56	1,699,348.32	
SEMPRA ENERGY	16,421	151.25	2,483,676.25	
SOUTHERN CO	58,436	72.95	4,262,906.20	
UGI CORP	11,512	26.45	304,492.40	
VISTRA CORP	19,603	28.30	554,764.90	
WEC ENERGY GROUP INC	16,657	92.21	1,535,941.97	
XCEL ENERGY INC	28,707	65.08	1,868,251.56	
ADVANCED MICRO DEVICES	86,289	110.61	9,544,426.29	
ANALOG DEVICES	27,639	192.37	5,316,914.43	
APPLIED MATERIALS	44,754	138.35	6,191,715.90	
BROADCOM INC	22,554	901.59	20,334,460.86	
ENPHASE ENERGY INC	7,104	177.81	1,263,162.24	
ENTEGRIS INC	8,008	104.86	839,718.88	
FIRST SOLAR INC	5,850	197.66	1,156,311.00	
INTEL CORP	227,473	33.63	7,649,916.99	
KLA CORP	7,545	460.98	3,478,094.10	
LAM RESEARCH CORP	7,358	639.03	4,701,982.74	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	8,500	86.47	734,995.00	
MARVELL TECHNOLOGY INC	44,782	63.11	2,826,192.02	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	29,374	88.87	2,610,467.38	
MICRON TECHNOLOGY	58,159	65.48	3,808,251.32	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,249	533.22	1,199,211.78	
NVIDIA CORP	133,165	446.12	59,407,569.80	
NXP SEMICONDUCTORS NV	13,633	210.88	2,874,927.04	
ON SEMICONDUCTOR CORP	22,893	97.69	2,236,417.17	
QORVO INC	5,297	106.75	565,454.75	
QUALCOMM	59,951	124.10	7,439,919.10	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,922	112.59	1,004,527.98	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2,888	260.09	751,139.92	
TERADYNE INC	7,707	115.14	887,383.98	
TEXAS INSTRUMENTS	49,304	183.89	9,066,512.56	
WOLFSPEED INC	7,000	62.43	437,010.00	
CBRE GROUP INC-A	16,391	87.24	1,429,950.84	
COSTAR GROUP INC	20,926	90.58	1,895,477.08	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	64,300	3.66	235,338.00	
ZILLOW GROUP INC-C	7,537	53.54	403,530.98	
	18,337,259		2,126,498,087.78	
			(301,069,599,267)	
アメリカドル 小計				
カナダドル				
ARC RESOURCES LTD	36,244	19.36	701,683.84	
CAMECO CORP	22,453	43.44	975,358.32	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	58,177	78.63	4,574,457.51	

CENOVUS ENERGY INC	76,232	23.64	1,802,124.48
ENBRIDGE	108,593	49.65	5,391,642.45
IMPERIAL OIL	11,645	68.98	803,272.10
KEYERA CORP	10,963	32.58	357,174.54
PARKLAND CORP	8,544	36.17	309,036.48
PEMBINA PIPELINE CORP	28,103	41.86	1,176,391.58
SUNCOR ENERGY	73,948	39.80	2,943,130.40
TC ENERGY CORP	52,598	50.89	2,676,712.22
TOURMALINE OIL CORP	16,980	67.99	1,154,470.20
AGNICO EAGLE MINES	27,843	68.26	1,900,563.18
BARRICK GOLD CORP	93,249	22.88	2,133,537.12
CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	65.00	474,630.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	30,312	34.68	1,051,220.16
FRANCO-NEVADA CORP	10,313	192.71	1,987,418.23
IVANHOE MINES LTD-CL A	35,897	12.70	455,891.90
KINROSS GOLD CORP	74,937	6.54	490,087.98
LUNDIN MINING CORP	30,173	11.23	338,842.79
NUTRIEN LTD	27,026	87.22	2,357,207.72
PAN AMERICAN SILVER CORP	24,343	21.15	514,854.45
TECK RESOURCES LTD-CL B	24,191	56.40	1,364,372.40
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,575	115.27	412,090.25
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	26,120	58.64	1,531,676.80
CAE INC	16,864	28.80	485,683.20
TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,269	108.64	463,784.16
WSP GLOBAL INC	6,444	178.68	1,151,413.92
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	10,920	49.25	537,810.00
RB GLOBAL INC	9,865	84.13	829,942.45
THOMSON REUTERS CORP	8,466	173.29	1,467,073.14
AIR CANADA	6,737	25.58	172,332.46
CANADIAN NATL RAILWAY CO	30,425	156.72	4,768,206.00
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	49,943	108.32	5,409,825.76
TFI INTERNATIONAL INC	4,630	161.41	747,328.30
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,682	82.20	1,206,860.40
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,366	113.70	155,314.20
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	41.50	415,000.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,221	101.20	1,540,365.20
QUEBECOR INC -CL B	9,679	32.82	317,664.78
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,586	185.82	480,530.52
DOLLARAMA INC	14,800	89.15	1,319,420.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	42,716	67.15	2,868,379.40
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	36.64	268,571.20
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	120.60	1,093,600.80

METRO INC	13,489	74.07	999,130.23
WESTON (GEORGE) LTD	3,705	156.96	581,536.80
SAPUTO INC	11,041	28.38	313,343.58
BANK MONTREAL	39,095	123.42	4,825,104.90
BANK NOVA SCOTIA	64,360	67.11	4,319,199.60
CANADIAN IMPERIAL BANK	47,022	58.07	2,730,567.54
NATIONAL BANK OF CANADA	17,467	102.03	1,782,158.01
ROYAL BANK OF CANADA	74,323	132.06	9,815,095.38
TORONTO-DOMINION BANK	97,210	86.32	8,391,167.20
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	18,244	44.45	810,945.80
BROOKFIELD CORP	75,976	46.76	3,552,637.76
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	20,483	20.93	428,709.19
IGM FINANCIAL INC	3,890	41.73	162,329.70
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,153	43.40	93,440.20
ONEX CORP	3,361	78.70	264,510.70
TMX GROUP LTD	16,225	30.15	489,183.75
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,198	1,012.47	1,212,939.06
GREAT-WEST LIFECO INC	15,674	39.95	626,176.30
IA FINANCIAL CORP INC	5,415	93.12	504,244.80
INTACT FINANCIAL CORP	8,967	198.64	1,781,204.88
MANULIFE FINANCIAL CORP	100,823	25.91	2,612,323.93
POWER CORP OF CANADA	29,992	37.59	1,127,399.28
SUN LIFE FINANCIAL INC	32,024	69.35	2,220,864.40
CGI INC - CL A	11,043	135.19	1,492,903.17
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,063	2,806.13	2,982,916.19
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	4,402	104.30	459,128.60
OPEN TEXT CORP	15,045	55.62	836,802.90
SHOPIFY INC - CLASS A	65,609	87.15	5,717,824.35
BCE INC	3,102	58.39	181,125.78
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	18,199	59.44	1,081,748.56
TELUS CORP	23,120	24.66	570,139.20
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	37,267	10.87	405,092.29
ALTAGAS INCOME LTD	14,516	24.81	360,141.96
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,264	42.24	264,591.36
CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	34.23	204,626.94
EMERA INC	13,595	55.09	748,948.55
FORTIS INC	25,334	57.11	1,446,824.74
HYDRO ONE LTD	20,457	38.19	781,252.83
NORTHLAND POWER INC	13,044	27.16	354,275.04
FIRSTSERVICE CORP	2,028	206.81	419,410.68
カナダドル 小計	2,177,975		131,528,919.12 (14,138,043,516)

ユーロ	ENI	123,624	13.80	1,707,000.19
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	30,121	11.50	346,391.50
	NESTE OIL OYJ	21,882	37.89	829,108.98
	OMV AG	7,462	41.63	310,643.06
	REPSOL SA	71,632	13.89	994,968.48
	TENARIS SA	27,420	15.04	412,396.80
	TOTALENERGIES SE	126,984	54.79	6,957,453.36
	AIR LIQUIDE	28,052	160.78	4,510,200.56
	AKZO NOBEL	9,224	74.22	684,605.28
	ARCELORMITTAL	29,386	25.22	741,114.92
	ARKEMA	2,799	93.18	260,810.82
	BASF SE	48,561	47.33	2,298,392.13
	COVESTRO AG	10,438	48.79	509,270.02
	CRH PLC	39,369	53.16	2,092,856.04
	DSM-FIRMENICH AG	9,267	100.88	934,854.96
	EVONIK INDUSTRIES AG	9,603	18.28	175,542.84
	HEIDELBERG MATERIALS AG	8,131	70.50	573,235.50
	OCI NV	5,799	25.45	147,584.55
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	14,165	34.29	485,717.85
	SOLVAY SA	3,676	104.45	383,958.20
	STORA ENSO OYJ R	26,361	10.13	267,168.73
	SYMRISE AG	7,051	96.08	677,460.08
	UMICORE	12,057	27.37	330,000.09
	UPM KYMMENE OYJ	27,619	28.70	792,665.30
	VOESTALPINE AG	5,948	28.98	172,373.04
	WACKER CHEMIE AG	1,600	138.00	220,800.00
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	11,859	30.45	361,106.55
	ACS ACTIVIDADES DE CO-RIGHTS	11,859	1.49	17,669.91
	AIRBUS SE	31,717	136.36	4,324,930.12
	ALSTOM	16,908	27.42	463,617.36
	BOUYGUES ORD	11,344	31.91	361,987.04
	BRENTAG SE	8,989	68.94	619,701.66
	CNH INDUSTRIAL NV	57,411	13.99	803,466.94
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	29,498	33.04	974,613.92
DASSAULT AVIATION SA	1,210	170.60	206,426.00	
EIFFAGE	4,432	95.76	424,408.32	
FERROVIAL SE	29,779	30.17	898,432.43	
GEA GROUP AG	7,649	37.89	289,820.61	
IMCD NV	3,050	136.90	417,545.00	
KINGSPAN GROUP PLC	7,694	70.00	538,580.00	
KNORR-BREMSE AG	3,221	62.20	200,346.20	
KONE OYJ-B	19,254	46.25	890,497.50	

LEGRAND SA	13,982	90.38	1,263,693.16
METSO CORPORATION	35,225	10.30	362,993.62
MTU AERO ENGINES AG	2,774	229.10	635,523.40
PRYSMIAN SPA	15,275	36.40	556,010.00
RATIONAL AG	268	671.00	179,828.00
RHEINMETALL AG	2,442	255.10	622,954.20
SAFRAN SA	18,948	143.08	2,711,079.84
SAINT-GOBAIN	25,279	58.41	1,476,546.39
SCHNEIDER ELECTRIC SE	29,076	162.92	4,737,061.92
SIEMENS	40,895	151.10	6,179,234.50
SIEMENS ENERGY AG	24,753	15.54	384,785.38
THALES SA	5,540	132.30	732,942.00
VINCI S.A.	28,939	107.68	3,116,151.52
WARTSILA OYJ	30,397	11.58	352,149.24
BUREAU VERITAS SA	15,662	24.14	378,080.68
RANDSTAD NV	5,866	51.44	301,747.04
TELEPERFORMANCE	3,110	156.85	487,803.50
WOLTERS KLUWER	13,534	112.75	1,525,958.50
ADP	1,532	127.20	194,870.40
AENA SME SA	4,116	141.90	584,060.40
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	38,499	8.82	339,638.17
DHL GROUP	52,557	46.29	2,432,863.53
GETLINK	18,582	16.04	298,055.28
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,499	108.60	1,900,391.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,480	101.20	352,176.00
CONTINENTAL AG	6,262	73.50	460,257.00
DR ING HC F PORSCHE AG	5,800	111.55	646,990.00
FERRARI NV	6,834	287.00	1,961,358.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	47,099	71.40	3,362,868.60
MICHELIN	35,958	28.66	1,030,556.28
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	8,889	54.46	484,094.94
RENAULT SA	11,301	40.00	452,040.00
STELLANTIS NV	121,390	16.77	2,036,438.64
VALEO SA	10,032	21.48	215,487.36
VOLKSWAGEN AG-PFD	11,635	125.60	1,461,356.00
VOLKSWAGEN STAMM	1,657	150.75	249,792.75
ADIDAS AG	9,192	174.80	1,606,761.60
HERMES INTERNATIONAL	1,665	1,897.40	3,159,171.00
KERING	3,887	532.60	2,070,216.20
LVMH	14,940	857.60	12,812,544.00
MONCLER SPA	9,963	62.38	621,491.94
PUMA SE	6,274	56.62	355,233.88

SEB SA	1,310	98.85	129,493.50
ACCOR	7,911	33.76	267,075.36
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	25,319	67.28	1,703,462.32
DELIVERY HERO SE	8,935	40.30	360,125.17
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	9,149	177.90	1,627,607.10
JUST EAT TAKEAWAY	8,459	15.73	133,110.82
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,332	35.42	188,859.44
SODEXO	4,698	97.36	457,397.28
BOLLORE SE	51,405	5.98	307,658.92
PUBLICIS GROUPE	11,624	69.88	812,285.12
SCOUT24 SE	4,128	60.20	248,505.60
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	47,953	21.70	1,040,580.10
VIVENDI SE	41,539	8.36	347,515.27
D'IETTEREN GROUP	1,617	155.70	251,766.90
INDITEX	57,568	34.49	1,985,520.32
PROSUS	42,422	67.45	2,861,363.90
ZALANDO SE	11,285	30.82	347,803.70
CARREFOUR	30,831	17.63	543,704.68
HELLOFRESH SE	7,756	23.47	182,033.32
JERONIMO MARTINS	13,062	26.86	350,845.32
KESKO OYJ-B SHS	14,326	17.83	255,504.21
KONINKLIJKE AHOLD NV	52,445	31.46	1,649,919.70
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	46,853	52.70	2,469,153.10
DANONE (GROUPE)	35,678	56.29	2,008,314.62
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	26,648	12.53	334,032.68
HEINEKEN HOLDING NV	7,127	81.40	580,137.80
HEINEKEN NV	14,200	98.20	1,394,440.00
JDE PEET'S BV	4,123	27.14	111,898.22
KERRY GROUP PLC-A	8,173	89.42	730,829.66
PERNOD-RICARD	10,784	201.20	2,169,740.80
REMY COINTREAU	1,020	145.55	148,461.00
BEIERSDORF AG	5,845	114.90	671,590.50
HENKEL AG & CO KGAA	6,247	63.28	395,310.16
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	10,083	70.22	708,028.26
LOREAL	12,929	407.60	5,269,860.40
AMPLIFON SPA	6,606	31.17	205,909.02
BIOMERIEUX	2,374	95.40	226,479.60
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,091	102.25	213,804.75
DIASORIN ITALIA SPA	1,418	94.02	133,320.36
ESSILORLUXOTTICA	15,295	176.00	2,691,920.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	9,705	48.59	471,565.95
FRESENIUS SE&CO KGAA	23,936	28.00	670,208.00

KONINKLIJKE PHILIPS	47,904	19.62	940,259.71
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,577	51.24	746,925.48
ARGENX SE	2,857	478.90	1,368,217.30
BAYER	51,521	51.49	2,652,816.29
EUROFINS SCIENTIFIC	6,490	61.20	397,188.00
GRIFOLS SA	14,240	13.28	189,178.40
IPSEN	1,866	111.40	207,872.40
MERCK KGAA	6,723	157.55	1,059,208.65
ORION OYJ-CLASS B	5,393	34.96	188,539.28
QIAGEN N.V.	13,106	42.29	554,252.74
RECORDATI SPA	5,195	45.06	234,086.70
SANOFI	61,013	98.17	5,989,646.21
SARTORIUS AG-VORZUG	1,216	358.80	436,300.80
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,435	272.90	391,611.50
UCB (GROUPE)	6,718	81.42	546,979.56
ABN AMRO BANK NV-CVA	19,718	15.64	308,488.11
AIB GROUP PLC	55,516	3.97	220,398.52
BANCO BILBAO VIZCAYA	328,517	7.11	2,338,384.00
BANCO SANTANDER SA	904,812	3.52	3,184,938.24
BANK OF IRELAND GROUP PLC	52,138	9.30	484,883.40
BNP PARIBAS	61,159	58.37	3,569,850.83
CAIXABANK	240,435	3.78	910,767.78
COMMERZBANK AG	56,376	11.20	631,693.08
CREDIT AGRICOLE SA	64,475	11.19	721,991.05
ERSTE GROUP BANK AG	18,119	34.59	626,736.21
FINECOBANK SPA	27,362	13.83	378,416.46
ING GROEP NV-CVA	199,441	13.31	2,654,958.59
INTESA SANPAOLO	853,697	2.53	2,164,975.59
KBC GROEP NV	12,855	67.18	863,598.90
MEDIOBANCA	29,447	11.55	340,112.85
SOCIETE GENERALE	41,916	24.51	1,027,361.16
UNICREDIT SPA	97,949	22.38	2,192,098.62
ADYEN NV	1,178	1,566.60	1,845,454.80
AMUNDI SA	2,812	57.40	161,408.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	111,998	10.27	1,150,667.45
DEUTSCHE BOERSE	10,526	166.75	1,755,210.50
EDENRED	12,673	59.18	749,988.14
EURAZEO SA	2,340	61.85	144,729.00
EURONEXT NV	4,500	64.40	289,800.00
EXOR NV	6,325	83.14	525,860.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,582	72.94	407,151.08
NEXI SPA	36,598	7.58	277,412.84



SOFINA	752	199.40	149,948.80
WENDEL	1,047	93.40	97,789.80
WORLDLINE SA	13,712	34.62	474,709.44
AEGON	95,201	4.83	460,392.03
AGEAS	8,621	38.26	329,839.46
ALLIANZ SE-REG	21,750	215.25	4,681,687.50
ASSICURAZIONI GENERALI	58,531	19.10	1,117,942.10
AXA SA	100,654	27.77	2,795,664.85
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,976	195.50	581,808.00
MUENCHENER RUECKVERSICH.	7,773	340.60	2,647,483.80
NN GROUP NV	13,557	34.50	467,716.50
POSTE ITALIANE SPA	25,777	10.23	263,698.71
SAMPO OYJ-A SHS	25,899	39.86	1,032,334.14
TALANX AG	5,000	54.95	274,750.00
BECHTLE AG	4,296	37.96	163,076.16
CAPGEMINI SA	9,097	171.60	1,561,045.20
DASSAULT SYSTEMES SA	35,217	40.03	1,409,912.59
NEMETSCHEK SE	3,320	64.40	213,808.00
SAP SE	55,816	119.78	6,685,640.48
NOKIA OYJ	300,315	3.58	1,076,929.59
CELLNEX TELECOM SA	30,696	36.70	1,126,543.20
DEUTSCHE TELEKOM	174,076	19.89	3,463,067.94
ELISA A	7,825	48.99	383,346.75
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,877	11.65	173,391.43
KPN (KON.)	173,861	3.31	576,696.93
ORANGE	104,881	10.85	1,138,797.89
TELECOM ITALIA ORD	489,749	0.26	129,734.51
TELEFONICA	280,413	3.77	1,059,119.90
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	2.44	100,030.91
ACCIONA SA	1,278	141.70	181,092.60
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	3,416	29.00	99,064.00
E.ON SE	123,229	11.59	1,428,224.11
EDP RENOVAVEIS SA	15,623	17.75	277,308.25
ELIA GROUP SA/NV	1,604	113.70	182,374.80
ENAGAS	11,944	16.28	194,448.32
ENDESA	17,138	19.30	330,763.40
ENEL	429,494	6.19	2,660,715.33
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	139,324	4.27	595,749.42
ENGIE	100,082	15.39	1,540,662.30
FORTUM OYJ	26,655	12.53	333,987.15
IBERDROLA SA	311,203	11.47	3,569,498.41
IBERDROLA SA-RTS	311,203	0.30	95,321.47

	NATURGY ENERGY GROUP SA	9,726	27.54	267,854.04
	REDEIA CORP SA	23,296	15.31	356,661.76
	RWE STAMM	33,396	39.85	1,330,830.60
	SNAM SPA	115,930	4.84	561,333.06
	TERNA SPA	80,424	7.80	627,468.04
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,814	29.60	1,089,694.40
	VERBUND AG	3,916	76.70	300,357.20
	ASM INTERNATIONAL NV	2,534	379.75	962,286.50
	ASML HOLDING NV	21,802	615.70	13,423,491.40
	INFINEON TECHNOLOGIES	72,297	36.82	2,662,337.02
	STMICROELECTRONICS NV	37,319	45.67	1,704,358.73
	LEG IMMOBILIEN SE	3,774	63.94	241,309.56
	VONOVIA SE	36,313	21.11	766,567.43
	ユーロ 小計	10,010,342		258,611,207.46 (40,524,376,208)
イギリスポンド	BP PLC	965,605	4.83	4,670,631.38
	SHELL PLC-NEW	368,379	24.43	8,999,498.97
	ANGLO AMERICAN PLC	68,460	23.90	1,636,536.30
	ANTOFAGASTA PLC	22,358	15.54	347,555.11
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,013	56.62	453,696.06
	ENDEAVOUR MINING PLC	13,000	19.38	251,940.00
	GLENCORE PLC	587,098	4.78	2,810,144.57
	JOHNSON MATTHEY PLC	9,824	18.28	179,631.84
	MONDI PLC	25,878	13.05	337,837.29
	RIO TINTO PLC REG	61,891	51.77	3,204,097.07
	ASHTED GROUP PLC	22,405	55.88	1,251,991.40
	BAE SYSTEMS PLC	170,458	9.19	1,567,531.76
	BUNZL PLC	19,312	28.36	547,688.32
	DCC PLC	4,499	45.56	204,974.44
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	458,658	1.56	718,717.08
	SMITHS GROUP PLC	20,046	16.78	336,371.88
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,672	108.65	398,962.80
	EXPERIAN PLC	48,173	30.12	1,450,970.76
	INTERTEK GROUP PLC	7,435	42.21	313,831.35
	RELX PLC	101,318	25.82	2,616,030.76
	RENTOKIL INITIAL PLC	130,328	6.40	834,359.85
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	4.58	233,479.24
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,048	43.09	260,608.32
	BURBERRY GROUP PLC	22,327	21.82	487,175.14
	PERSIMMON PLC	14,327	11.87	170,061.49
	TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.15	191,868.46
	COMPASS GROUP PLC	95,637	21.26	2,033,242.62

ENTAIN PLC	33,614	12.75	428,746.57
INTERCONTINENTAL HOTELS	10,141	56.12	569,112.92
PEARSON	34,302	8.62	295,751.84
WHITBREAD PLC	10,170	33.95	345,271.50
AUTO TRADER GROUP PLC	43,890	6.50	285,285.00
INFORMA PLC	79,688	7.46	594,631.85
MPP PLC	56,693	8.11	460,233.77
JD SPORTS FASHION PLC	114,330	1.57	179,612.43
KINGFISHER PLC	96,593	2.43	234,720.99
NEXT PLC	7,235	71.50	517,302.50
OCADO GROUP PLC	36,500	7.85	286,525.00
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.82	231,700.85
TESCO PLC	393,967	2.61	1,029,829.73
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	20,881	20.91	436,621.71
BRITISH AMERICAN TOBACCO	114,644	26.55	3,043,798.20
COCA-COLA HBC AG-CDI	14,115	23.96	338,195.40
DIAGEO	121,861	34.39	4,191,409.09
IMPERIAL BRANDS PLC	45,617	18.35	837,071.95
HALEON PLC	254,427	3.36	855,638.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	37,576	58.96	2,215,480.96
UNILEVER PLC	136,012	40.18	5,465,642.22
SMITH & NEPHEW PLC	42,096	12.01	505,783.44
ASTRAZENECA	83,892	107.80	9,043,557.60
GSK PLC	224,792	13.95	3,137,646.73
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	8,586	20.45	175,583.70
BARCLAYS	873,251	1.64	1,435,275.34
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,066,083	6.42	6,851,715.44
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,573,042	0.46	1,645,207.18
NATWEST GROUP PLC	280,916	2.52	709,312.90
STANDARD CHARTERED PLC	135,187	7.19	972,535.27
3I GROUP PLC	55,147	19.65	1,083,638.55
ABRDN PLC	100,722	2.33	234,883.70
HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,246	9.06	165,454.72
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	22,399	83.46	1,869,420.54
M&G PLC	118,170	2.01	237,994.38
SCHRODERS PLC	42,161	4.58	193,308.18
ST JAMES'S PLACE PLC	26,728	11.73	313,519.44
WISE PLC - A	45,000	7.62	343,080.00
ADMIRAL GROUP PLC	9,872	22.27	219,849.44
AVIVA PLC	152,469	4.04	616,279.69
LEGAL & GENERAL GROUP	313,717	2.33	733,470.34
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	43,255	5.56	240,584.31

	PRUDENTIAL	145,125	10.53	1,528,891.87
	SAGE GROUP PLC	56,360	9.19	518,173.84
	HALMA PLC	20,296	22.54	457,471.84
	BT GROUP PLC	373,976	1.25	471,022.77
	VODAFONE GROUP PLC	1,194,547	0.76	913,947.90
	CENTRICA PLC	370,000	1.25	466,015.00
	NATIONAL GRID PLC	203,012	10.60	2,151,927.20
	SEVERN TRENT PLC	14,219	25.72	365,712.68
	SSE PLC	56,670	18.09	1,025,160.30
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	10.06	349,242.96
	イギリスポンド 小計	14,921,101		98,327,683.99 (17,847,457,921)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	13,161	13.76	181,095.36
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	310	712.00	220,720.00
	GIVAUDAN-REG	479	2,873.00	1,376,167.00
	HOLCIM LTD	30,195	59.20	1,787,544.00
	SIG GROUP AG	16,000	24.80	396,800.00
	SIKA AG-BR	7,610	257.40	1,958,814.00
	ABB LTD	84,750	35.10	2,974,725.00
	GEBERIT AG-REG	1,930	474.60	915,978.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,332	202.00	269,064.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,021	211.00	426,431.00
	VAT GROUP AG	1,440	354.40	510,336.00
	ADECCO GROUP AG-REG	9,959	33.00	328,647.00
	SGS SA	8,675	82.88	718,984.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,730	265.20	723,996.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	28,553	138.20	3,946,024.60
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,572	268.10	421,453.20
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	50.90	152,903.60
	DUFREY AG-REG	5,500	42.00	231,000.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	189	1,651.00	312,039.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	107,000.00	642,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	55	10,790.00	593,450.00
	NESTLE SA - REGISTERED	148,547	104.40	15,508,306.80
	ALCON INC	25,942	72.82	1,889,096.44
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,788	238.40	664,659.20
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,767	139.70	805,649.90
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,950	74.45	145,177.50
	LONZA GROUP AG-REG	3,866	485.50	1,876,943.00
	NOVARTIS	109,820	90.80	9,971,656.00
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,944	293.80	571,147.20
	ROCHE HOLDING GENUSS	38,034	273.50	10,402,299.00

	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,564	97.40	152,333.60
	JULIUS BAER GROUP LTD	11,775	61.04	718,746.00
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,152	969.40	1,116,748.80
	UBS GROUP AG	170,563	18.63	3,177,588.69
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	135.10	315,323.40
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,500	128.60	321,500.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,612	544.20	877,250.40
	SWISS RE LTD	16,438	93.28	1,533,336.64
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,071	422.30	3,408,383.30
	TEMENOS AG - REG	3,520	73.08	257,241.60
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,298	54.96	456,058.08
	SWISSCOM	1,331	561.00	746,691.00
	BKW AG	807	153.90	124,197.30
	SWISS PRIME SITE-REG	3,622	83.10	300,988.20
	スイスフラン 小計	791,716		74,429,493.81 (12,123,820,246)
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	13,081	288.65	3,775,830.65
	HOLMEN AB-B SHARES	5,106	385.60	1,968,873.60
	SCA SV CELLULOSA B	34,632	132.10	4,574,887.20
	ALFA LAVAL AB	14,260	384.30	5,480,118.00
	ASSA ABLOY AB-B	57,678	252.60	14,569,462.80
	ATLAS COPCO A	142,288	148.15	21,079,967.20
	ATLAS COPCO B	85,638	128.55	11,008,764.90
	BEIJER REF AB	23,000	140.40	3,229,200.00
	EPIROC AB-A	37,140	202.10	7,505,994.00
	EPIROC AB-B	22,442	174.70	3,920,617.40
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	98.64	2,154,396.24
	INDUTRADE AB	14,669	220.30	3,231,580.70
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,081	208.60	1,685,696.60
	LIFCO AB-B SHS	13,590	206.60	2,807,694.00
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	80,939	93.48	7,566,177.72
	SAAB AB-B	5,800	568.00	3,294,400.00
	SANDVIK AB	56,973	207.30	11,810,502.90
	SKANSKA B	19,869	167.35	3,325,077.15
	SKF AB-B	18,340	193.40	3,546,956.00
	VOLVO AB-A SHS	8,748	234.60	2,052,280.80
	VOLVO B	80,587	228.50	18,414,129.50
	SECURITAS B	25,545	89.62	2,289,342.90
	VOLVO CAR AB-B	35,544	53.00	1,883,832.00
	EVOLUTION AB	9,622	1,289.80	12,410,455.60
	EMBRACER GROUP AB	34,541	28.59	987,699.89
	HENNES & MAURITZ B	33,524	176.64	5,921,679.36

	ESSITY AKTIEBOLAG-B	31,655	258.50	8,182,817.50	
	GETINGE AB-B SHS	12,650	191.90	2,427,535.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	9,481	204.40	1,937,916.40	
	NORDEA BANK ABP	180,364	119.76	21,600,392.64	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	82,855	125.90	10,431,444.50	
	SVENSKA HANDELSBK A	81,670	91.28	7,454,837.60	
	SWEDBANK AB-A	50,623	192.75	9,757,583.25	
	EQT AB	22,258	244.90	5,450,984.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,848	294.20	2,014,681.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	293.20	2,530,609.20	
	INVESTOR AB-A SHS	23,000	213.00	4,899,000.00	
	INVESTOR AB-B SHS	95,842	215.20	20,625,198.40	
	KINNEVIK AB - B	10,757	141.50	1,522,115.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,093	456.30	1,867,635.90	
	ERICSSON (LM) B	160,922	53.43	8,598,062.46	
	HEXAGON AB-B SHS	108,582	114.85	12,470,642.70	
	TELE2 AB-B SHS	34,520	81.72	2,820,974.40	
	TELIA CO AB	138,487	24.37	3,374,928.19	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	32,478	48.84	1,586,225.52	
	SAGAX AB-B	9,400	235.80	2,216,520.00	
	スウェーデンクローナ 小計	2,008,594		292,265,722.07 (3,977,736,477)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	17,052	279.40	4,764,328.80	
	EQUINOR ASA	50,840	315.85	16,057,814.00	
	NORSK HYDRO	72,015	62.30	4,486,534.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,449	407.80	3,853,302.20	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,500	446.00	2,007,000.00	
	ADEVINTA ASA	16,857	71.25	1,201,061.25	
	MOWI ASA	23,314	176.95	4,125,412.30	
	ORKLA	39,803	80.34	3,197,773.02	
	SALMAR ASA	2,953	451.10	1,332,098.30	
	DNB BANK ASA	46,261	207.80	9,613,035.80	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	159.80	1,782,249.40	
	TELENOR ASA	38,789	111.35	4,319,155.15	
	ノルウェークローネ 小計	332,986		56,739,764.72 (798,895,887)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,314	500.00	2,657,000.00	
	NOVOZYMES A/S	10,786	332.20	3,583,109.20	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	428	1,785.00	763,980.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	55,152	189.28	10,439,170.56	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	152	13,340.00	2,027,680.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	251	13,610.00	3,416,110.00	

	DSV A/S	10,213	1,464.50	14,956,938.50
	PANDORA A/S	4,249	663.20	2,817,936.80
	CARLSBERG AS-B	5,476	1,034.50	5,664,922.00
	COLOPLAST-B	6,218	817.80	5,085,080.40
	DEMANT A/S	4,463	270.00	1,205,010.00
	GENMAB A/S	3,603	2,694.00	9,706,482.00
	NOVO NORDISK A/S-B	89,502	1,100.00	98,452,200.00
	DANSKE BANK A/S	38,806	162.00	6,286,572.00
	TRYG A/S	16,972	135.75	2,303,949.00
	ORSTED A/S	9,594	616.00	5,909,904.00
	デンマーククローネ 小計	261,179		175,276,044.46 (3,686,055,214)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	12,821	32.89	421,682.69
	SANTOS	176,138	7.90	1,391,490.20
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	99,749	37.25	3,715,650.25
	BHP GROUP LTD	270,212	44.34	11,981,200.08
	BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	20.29	437,229.21
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	97,584	22.19	2,165,388.96
	IGO LTD	35,382	14.00	495,348.00
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	25,493	41.33	1,053,625.69
	MINERAL RESOURCES LTD	10,000	68.31	683,100.00
	NEWCREST MINING LIMITED	45,440	26.48	1,203,251.20
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	58,122	11.59	673,633.98
	ORICA LTD	26,961	15.26	411,424.86
	PILBARA MINERALS LTD	131,710	4.59	604,548.90
	RIO TINTO LTD	20,196	115.25	2,327,589.00
	SOUTH32 LTD	246,137	3.72	915,629.64
	REECE LTD	12,870	18.86	242,728.20
	BRAMBLES LTD	82,936	14.05	1,165,250.80
	COMPUTERSHARE LIMITED	28,589	25.07	716,726.23
	AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	3.75	351,015.00
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	39,948	6.69	267,252.12
	TRANSURBAN GROUP	167,820	14.08	2,362,905.60
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	31,473	38.66	1,216,746.18
	IDP EDUCATION LTD	12,550	23.18	290,909.00
	LOTTERY CORP LTD/THE	123,601	5.07	626,657.07
	REA GROUP LTD	3,000	148.28	444,840.00
	SEEK LTD	17,113	23.59	403,695.67
WESFARMERS LTD	58,879	49.26	2,900,379.54	
COLES GROUP LTD	68,071	18.09	1,231,404.39	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	74,362	5.96	443,197.52	
WOOLWORTHS GROUP LTD	63,525	38.83	2,466,675.75	

	TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	11.18	385,486.40	
	COCHLEAR LIMITED	3,460	234.78	812,338.80	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,641	56.58	545,487.78	
	SONIC HEALTHCARE LTD	25,969	35.50	921,899.50	
	CSL LIMITED	25,778	266.27	6,863,908.06	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	166,585	25.12	4,184,615.20	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	90,909	104.43	9,493,626.87	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	167,348	27.69	4,633,866.12	
	WESTPAC BANKING	183,712	21.96	4,034,315.52	
	ASX LTD	11,055	61.80	683,199.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	20,561	183.59	3,774,793.99	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,345	32.46	335,798.70	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	137,266	5.90	809,869.40	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	129,252	3.50	452,382.00	
	QBE INSURANCE GROUP	78,253	15.84	1,239,527.52	
	SUNCORP GROUP LIMITED	66,731	13.96	931,564.76	
	WISETECH GLOBAL LTD	8,342	81.56	680,373.52	
	XERO LTD	7,073	120.72	853,852.56	
	TELSTRA GROUP LTD	199,810	4.25	849,192.50	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	87,883	8.59	754,914.97	
	オーストラリアドル 小計	3,620,288		86,852,188.90	(8,279,619,167)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	64,661	8.37	541,212.57	
	EBOS GROUP LTD	10,256	38.30	392,804.80	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	36,015	24.52	883,087.80	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	104,543	5.10	533,692.01	
	MERCURY NZ LTD	40,719	6.45	262,637.55	
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	5.52	353,467.68	
	ニュージーランドドル 小計	320,228		2,966,902.41	(260,316,017)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	139,448	47.20	6,581,945.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	69,000	83.50	5,761,500.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	102,000	11.24	1,146,480.00	
	MTR CORP	82,500	35.15	2,899,875.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	81,000	15.66	1,268,460.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	117,000	53.05	6,206,850.00	
	SANDS CHINA LTD	127,000	27.55	3,498,850.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	83,000	18.40	1,527,200.00	
	WH GROUP LTD	446,619	3.97	1,773,077.43	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	191,500	22.75	4,356,625.00	
	HANG SENG BANK	39,600	113.30	4,486,680.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	64,800	290.20	18,804,960.00	



	AIA GROUP LTD	627,400	75.70	47,494,180.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	40.55	1,297,600.00
	CLP HOLDINGS	100,000	61.40	6,140,000.00
	HONG KONG & CHINA GAS	608,990	6.37	3,879,266.30
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	40.40	2,969,400.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	98,448	42.70	4,203,729.60
	ESR GROUP LTD	92,400	12.74	1,177,176.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	115,000	11.10	1,276,500.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	79,761	22.75	1,814,562.75
	NEW WORLD DEVELOPMENT	76,250	18.08	1,378,600.00
	SINO LAND CO	198,600	9.28	1,843,008.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	80,000	96.05	7,684,000.00
	SWIRE PACIFIC A	31,000	64.15	1,988,650.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,000	17.94	1,237,860.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	81,000	39.35	3,187,350.00
	香港ドル 小計	3,906,816		145,884,385.68 (2,643,425,068)
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,100	33.29	169,779.00
	KEPPEL CORP LTD	80,200	6.72	538,944.00
	SEATRIUM LTD	1,530,619	0.14	221,939.75
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	3.69	276,012.00
	SINGAPORE AIRLINES	73,350	7.41	543,523.50
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	0.93	297,321.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	106,600	3.74	398,684.00
	DBS GROUP	95,900	32.44	3,110,996.00
	OCBC BANK	179,550	12.64	2,269,512.00
	UNITED OVERSEAS BANK	72,300	28.36	2,050,428.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.50	403,750.00
	VENTURE CORP LTD	14,300	14.46	206,778.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	420,880	2.62	1,102,705.60
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	153,900	3.31	509,409.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	7.05	155,100.00
	UOL GROUP LIMITED	24,800	6.75	167,400.00
	シンガポールドル 小計	3,216,499		12,422,281.85 (1,320,737,006)
イスラエルシェケル	ICL LTD	39,375	24.02	945,787.50
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,248	775.50	967,824.00
	BANK HAPUALIM BM	63,371	32.22	2,041,813.62
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	82,181	29.39	2,415,299.59
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,227	19.59	1,258,206.93
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,698	136.50	1,187,277.00
	NICE LTD	3,165	789.80	2,499,717.00

	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	5,624	132.20	743,492.80
	AZRIELI GROUP	2,465	211.70	521,840.50
	イスラエルシェケル 小計	270,354		12,581,258.94 (486,807,910)
	合 計	60,175,337		407,156,889,904 (407,156,889,904)

## (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	623,905.20	
		LENLEASE GROUP	36,448	302,882.88	
	オーストラリアドル 小計		99,853	926,788.08 (88,350,707)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	1,727,900.00	
	香港ドル 小計		185,000	1,727,900.00 (31,309,548)	
投資信託受益証券合計			284,853	119,660,255 (119,660,255)	
投資証券	アメリカド ル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,183	1,007,409.13	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	16,172	603,053.88	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	24,921	4,755,674.43	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	24,773	503,882.82	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,676	1,508,180.48	
		BOSTON PROPERTIES	7,893	508,782.78	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,093	574,643.19	
		CROWN CASTLE INC	23,289	2,596,024.83	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,921	1,837,073.52	
		EQUINIX INC	5,148	4,216,726.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,979	642,896.40	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	18,842	1,293,314.88	
		ESSEX PROPERTY TRUST	3,594	878,373.60	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	11,358	1,662,697.62	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	15,190	751,297.40	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	19,000	382,850.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	30,237	668,842.44	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	40,506	706,019.58	
		INVITATION HOMES INC	30,792	1,113,438.72	
		IRON MOUNTAIN INC	16,160	1,004,344.00	
		KIMCO REALTY CORP	31,093	651,709.28	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,856	906,274.56	
		PROLOGIS INC	49,348	6,267,689.48	
PUBLIC STORAGE	8,202	2,424,921.30			

	REALTY INCOME CORP	36,949	2,341,458.13
	REGENCY CENTERS CORP	8,164	536,864.64
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,725	1,303,067.25
	SIMON PROPERTY GROUP	18,395	2,288,521.95
	SUN COMMUNITIES INC	6,650	932,662.50
	UDR INC	17,830	770,790.90
	VENTAS INC	20,307	1,008,851.76
	VICI PROPERTIES INC	51,241	1,684,804.08
	WELLTOWER INC	26,041	2,152,809.47
	WP CAREY INC	10,761	785,230.17
アメリカドル 小計		629,289	51,271,181.97 (7,258,973,943)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,069	266,122.50
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	180,867.90
カナダドル 小計		14,014	446,990.40 (48,046,998)
ユーロ	COVIVIO(FP)	3,076	138,973.68
	GECINA SA	2,719	268,637.20
	KLEPIERRE	11,603	277,891.85
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,185	325,083.60
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,235	201,567.10
ユーロ 小計		30,818	1,212,153.43 (189,944,442)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	39,175	133,547.57
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	209,436.37
	SEGRO PLC	63,208	493,654.48
イギリスポンド 小計		134,515	836,638.42 (151,858,239)
オーストラリアドル	DEXUS	74,283	601,692.30
	GOODMAN GROUP	90,044	1,863,910.80
	GPT GROUP	111,587	476,476.49
	MIRVAC GROUP	228,843	533,204.19
	SCENTRE GROUP	297,027	822,764.79
	STOCKLAND	121,481	505,360.96
	VICINITY CENTERS	221,263	434,781.79
オーストラリアドル 小計		1,144,528	5,238,191.32 (499,356,778)
香港ドル	LINK REIT	147,800	6,384,960.00
香港ドル 小計		147,800	6,384,960.00 (115,695,475)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	207,909	582,145.20
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	276,190	552,380.00

	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	174,778	297,122.60	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	132,200	218,130.00	
	シンガポールドル 小計	791,077	1,649,777.80	(175,404,375)
	投資証券合計	2,892,041	8,439,280,250	(8,439,280,250)
	合計		8,558,940,505	(8,558,940,505)

(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 606銘柄	97.6%			72.4%
	投資証券 34銘柄			2.4%	1.7%
カナダドル	株式 85銘柄	99.7%			3.4%
	投資証券 2銘柄			0.3%	0.0%
ユーロ	株式 223銘柄	99.5%			9.7%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 79銘柄	99.2%			4.3%
	投資証券 3銘柄			0.8%	0.0%
スイスフラン	株式 44銘柄	100.0%			2.9%
スウェーデンクローナ	株式 46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 16銘柄	100.0%			0.9%
オーストラリアドル	株式 50銘柄	93.4%			2.0%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.0%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.6%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 6銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 27銘柄	94.7%			0.6%
	投資信託受益証券 1銘柄		1.1%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.1%	0.0%
シンガポールドル	株式 16銘柄	88.3%			0.3%
	投資証券 4銘柄			11.7%	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

	2023年 7月25日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
<b>流動資産</b>	
預金	234,350,056
コール・ローン	1,213,451,710
国債証券	163,694,111,935
派生商品評価勘定	14,237,054
未収入金	2,569,098
未収利息	1,151,500,166
前払金	3,267,645
前払費用	98,311,535
差入委託証拠金	94,561,827
流動資産合計	166,506,361,026
<b>資産合計</b>	<b>166,506,361,026</b>
<b>負債の部</b>	
<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	4,206,790
未払金	153,372
未払解約金	92,602,426
未払利息	2,954
流動負債合計	96,965,542
<b>負債合計</b>	<b>96,965,542</b>
<b>純資産の部</b>	
<b>元本等</b>	
元本	58,940,295,467
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	107,469,100,017
元本等合計	166,409,395,484
<b>純資産合計</b>	<b>166,409,395,484</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>166,506,361,026</b>

##### 注記表

###### (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023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 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</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 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p>

2023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	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。 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 7月25日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	58,940,295,467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) 2.8234円 (28,234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

2023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。
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

2023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。

2023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	2023年 7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	7,444,037,723円
期中一部解約元本額	5,974,631,117円
期末元本額	58,940,295,467円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	1,948,409,567円
DC外国債券インデックスファンド	1,852,502,801円
DC外国債券インデックスファンドL	14,463,003,729円
DCバランスファンド30	1,041,917,790円
DCバランスファンド50	1,127,423,055円
DCバランスファンド70	240,537,331円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	515,038,113円
外国債券インデックスe	1,021,111,973円
インデックスコレクション（外国債券）	9,557,749,277円
インデックスコレクション（バランス株式30）	5,541,004,872円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,115,113,243円
インデックスコレクション（バランス株式70）	346,391,857円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,374,614,509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）	3,134,555,018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）	318,797,159円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	63,612,169円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	347,486,652円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	218,429,895円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	172,628,441円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	83,256,438円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,019,752,015円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	508,527,927円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	5,430,178,359円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	295,381,805円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	157,211,665円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,333,719,562円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	68,453,022円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	160,006,464円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	73,544,198円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	39,588,656円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	49,568,917円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	199,747,377円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	60,423,999円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	1,041,932,375円
私募外国債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	18,675,237円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023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	2,137,594,041	
合計	2,137,594,041	

(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

(2023年 7月25日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引					
	買建	926,151,035	-		922,883,390	3,267,645
	合計	926,151,035	-		922,883,390	3,267,645

(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 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	991,796,898	-		1,005,094,807	13,297,909
	アメリカドル	487,790,010	-		495,329,094	7,539,084
	カナダドル	40,035,312	-		40,725,208	689,896
	ユーロ	347,918,409	-		351,782,325	3,863,916
	イギリスポンド	54,093,845	-		54,280,260	186,415
	オフショア人民元	61,959,322	-		62,977,920	1,018,598
	合計	991,796,898	-		1,005,094,807	13,297,909

(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 0.25% 05/31/25	1,180,000.00	1,082,327.34	
		T 0.25% 06/30/25	4,310,000.00	3,945,081.04	
		T 0.25% 07/31/25	2,200,000.00	2,006,468.75	
		T 0.25% 09/30/25	3,290,000.00	2,985,932.01	
		T 0.375% 01/31/26	1,700,000.00	1,529,236.32	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,378,906.24	
		T 0.375% 07/31/27	4,000,000.00	3,427,265.64	
		T 0.375% 08/15/24	5,500,000.00	5,219,897.54	
		T 0.375% 09/15/24	1,600,000.00	1,512,968.75	
		T 0.375% 09/30/27	4,000,000.00	3,410,546.88	
		T 0.375% 11/30/25	3,770,000.00	3,409,420.12	
		T 0.5% 02/28/26	3,500,000.00	3,149,726.58	
		T 0.5% 03/31/25	4,000,000.00	3,708,515.64	
		T 0.5% 04/30/27	2,000,000.00	1,736,328.12	
		T 0.5% 05/31/27	300,000.00	259,845.70	
		T 0.5% 06/30/27	2,500,000.00	2,159,619.15	
		T 0.5% 08/31/27	1,100,000.00	945,162.10	
		T 0.5% 10/31/27	1,580,000.00	1,350,838.28	
		T 0.625% 03/31/27	3,400,000.00	2,974,269.54	
		T 0.625% 05/15/30	7,400,000.00	5,927,226.54	
		T 0.625% 07/31/26	4,000,000.00	3,568,437.52	
		T 0.625% 08/15/30	9,130,000.00	7,269,584.19	
		T 0.625% 10/15/24	3,250,000.00	3,071,503.89	
		T 0.625% 11/30/27	3,700,000.00	3,174,050.77	
		T 0.625% 12/31/27	3,000,000.00	2,567,285.16	
		T 0.75% 01/31/28	3,500,000.00	3,005,556.64	
		T 0.75% 03/31/26	2,750,000.00	2,488,857.41	
		T 0.75% 04/30/26	3,500,000.00	3,156,972.66	
		T 0.75% 08/31/26	3,000,000.00	2,679,726.57	
		T 0.75% 11/15/24	5,230,000.00	4,933,973.84	
		T 0.875% 09/30/26	5,000,000.00	4,479,980.45	
		T 0.875% 11/15/30	6,160,000.00	4,983,584.39	
		T 1.125% 01/15/25	5,830,000.00	5,496,027.51	
		T 1.125% 02/15/31	5,600,000.00	4,600,093.73	
		T 1.125% 02/29/28	3,880,000.00	3,384,769.52	
		T 1.125% 05/15/40	1,550,000.00	995,602.54	
		T 1.125% 08/15/40	4,000,000.00	2,547,187.52	
		T 1.125% 08/31/28	4,000,000.00	3,450,234.36	
		T 1.125% 10/31/26	7,850,000.00	7,067,913.05	
		T 1.25% 03/31/28	5,300,000.00	4,643,400.38	
T 1.25% 04/30/28	7,800,000.00	6,820,582.00			

T 1.25% 05/15/50	5,120,000.00	2,836,299.98	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,237,695.32	
T 1.25% 06/30/28	1,000,000.00	871,542.97	
T 1.25% 08/15/31	6,550,000.00	5,362,812.50	
T 1.25% 09/30/28	3,800,000.00	3,291,675.78	
T 1.25% 11/30/26	3,000,000.00	2,706,621.09	
T 1.25% 12/31/26	5,500,000.00	4,955,908.21	
T 1.375% 08/15/50	2,300,000.00	1,317,199.21	
T 1.375% 10/31/28	1,700,000.00	1,479,962.89	
T 1.375% 11/15/31	12,110,000.00	9,963,786.35	
T 1.375% 11/15/40	4,650,000.00	3,082,532.24	
T 1.5% 02/15/25	3,000,000.00	2,837,167.98	
T 1.5% 02/15/30	1,820,000.00	1,558,019.53	
T 1.5% 08/15/26	5,300,000.00	4,851,363.26	
T 1.5% 09/30/24	3,000,000.00	2,869,746.09	
T 1.5% 11/30/28	5,550,000.00	4,856,900.40	
T 1.625% 02/15/26	5,750,000.00	5,334,023.43	
T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	4,987,828.15	
T 1.625% 05/15/31	4,690,000.00	3,978,988.68	
T 1.625% 08/15/29	2,260,000.00	1,971,408.59	
T 1.625% 09/30/26	2,150,000.00	1,971,407.21	
T 1.625% 11/15/50	5,100,000.00	3,121,060.56	
T 1.625% 11/30/26	3,030,000.00	2,768,958.40	
T 1.75% 01/31/29	2,500,000.00	2,211,425.77	
T 1.75% 03/15/25	5,500,000.00	5,212,216.79	
T 1.75% 06/30/24	2,000,000.00	1,934,228.08	
T 1.75% 08/15/41	4,800,000.00	3,347,250.00	
T 1.75% 11/15/29	3,220,000.00	2,822,908.60	
T 1.75% 12/31/26	4,300,000.00	3,940,966.81	
T 1.875% 02/15/32	6,200,000.00	5,296,156.25	
T 1.875% 02/15/41	4,750,000.00	3,420,000.00	
T 1.875% 02/15/51	4,500,000.00	2,934,667.98	
T 1.875% 02/28/27	3,000,000.00	2,752,910.16	
T 1.875% 02/28/29	1,900,000.00	1,690,109.37	
T 1.875% 06/30/26	3,980,000.00	3,698,057.43	
T 1.875% 07/31/26	1,800,000.00	1,668,269.53	
T 1.875% 11/15/51	3,400,000.00	2,210,863.29	
T 1% 07/31/28	2,000,000.00	1,717,148.44	
T 1% 12/15/24	3,070,000.00	2,897,372.45	
T 2.125% 05/15/25	3,850,000.00	3,659,831.05	
T 2.125% 07/31/24	3,470,000.00	3,359,016.90	
T 2.125% 09/30/24	2,200,000.00	2,119,691.39	

T 2.125% 11/30/24	1,400,000.00	1,343,535.15
T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	3,628,523.41
T 2.25% 02/15/52	2,410,000.00	1,717,313.26
T 2.25% 03/31/26	1,500,000.00	1,412,695.32
T 2.25% 05/15/41	1,600,000.00	1,221,343.74
T 2.25% 08/15/27	2,320,000.00	2,145,184.38
T 2.25% 08/15/46	2,180,000.00	1,571,814.05
T 2.25% 08/15/49	4,110,000.00	2,944,429.68
T 2.25% 10/31/24	2,500,000.00	2,407,470.70
T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	4,810,839.85
T 2.25% 11/15/25	5,500,000.00	5,200,937.50
T 2.25% 11/15/27	5,260,000.00	4,848,857.04
T 2.25% 12/31/24	2,900,000.00	2,782,130.86
T 2.375% 02/15/42	1,350,000.00	1,042,004.88
T 2.375% 03/31/29	1,400,000.00	1,278,074.22
T 2.375% 04/30/26	1,820,000.00	1,717,625.00
T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,354,046.88
T 2.375% 05/15/29	1,390,000.00	1,267,777.73
T 2.375% 05/15/51	1,980,000.00	1,451,548.83
T 2.375% 08/15/24	5,460,000.00	5,292,631.83
T 2.375% 11/15/49	2,010,000.00	1,480,215.81
T 2.5% 01/31/25	4,000,000.00	3,845,703.12
T 2.5% 02/15/45	2,150,000.00	1,644,498.04
T 2.5% 02/15/46	1,250,000.00	949,853.51
T 2.5% 02/28/26	650,000.00	616,585.93
T 2.5% 05/15/46	1,810,000.00	1,374,716.21
T 2.625% 01/31/26	1,350,000.00	1,285,453.12
T 2.625% 02/15/29	6,900,000.00	6,391,933.61
T 2.625% 03/31/25	2,500,000.00	2,402,490.22
T 2.625% 05/31/27	2,900,000.00	2,727,076.16
T 2.625% 12/31/25	4,500,000.00	4,288,359.37
T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	4,389,070.31
T 2.75% 05/31/29	6,000,000.00	5,582,460.96
T 2.75% 06/30/25	2,000,000.00	1,920,039.06
T 2.75% 08/15/32	2,280,000.00	2,082,726.55
T 2.75% 08/15/42	2,330,000.00	1,903,864.85
T 2.75% 08/15/47	1,150,000.00	912,700.19
T 2.75% 08/31/25	5,000,000.00	4,792,187.50
T 2.75% 11/15/42	1,650,000.00	1,345,491.21
T 2.75% 11/15/47	1,400,000.00	1,110,675.77
T 2.875% 04/30/25	10,770,000.00	10,380,639.29
T 2.875% 04/30/29	4,170,000.00	3,908,804.87
T 2.875% 05/15/28	4,460,000.00	4,208,428.12

T 2.875% 05/15/32	4,500,000.00	4,158,808.60	
T 2.875% 05/15/43	1,050,000.00	869,408.20	
T 2.875% 05/15/49	4,400,000.00	3,586,945.29	
T 2.875% 05/15/52	3,000,000.00	2,451,796.86	
T 2.875% 07/31/25	500,000.00	480,996.09	
T 2.875% 08/15/28	10,200,000.00	9,612,105.45	
T 2.875% 08/15/45	1,480,000.00	1,206,893.75	
T 2% 02/15/25	6,050,000.00	5,766,288.09	
T 2% 02/15/50	3,370,000.00	2,276,987.88	
T 2% 06/30/24	1,000,000.00	969,262.55	
T 2% 08/15/25	3,750,000.00	3,542,285.17	
T 2% 08/15/51	6,940,000.00	4,660,914.82	
T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,500,347.66	
T 2% 11/15/41	4,140,000.00	3,006,432.43	
T 3.125% 02/15/42	1,000,000.00	872,343.75	
T 3.125% 02/15/43	3,600,000.00	3,106,828.11	
T 3.125% 05/15/48	1,400,000.00	1,191,121.09	
T 3.125% 08/15/25	2,500,000.00	2,415,820.30	
T 3.125% 08/15/44	1,550,000.00	1,326,400.39	
T 3.125% 08/31/29	4,300,000.00	4,080,548.81	
T 3.125% 11/15/28	3,960,000.00	3,772,750.76	
T 3.125% 11/15/41	870,000.00	761,266.99	
T 3.25% 05/15/42	1,500,000.00	1,326,621.09	
T 3.25% 06/30/27	4,850,000.00	4,666,704.09	
T 3.375% 05/15/33	1,210,000.00	1,161,694.52	
T 3.375% 05/15/44	400,000.00	356,515.62	
T 3.375% 08/15/42	1,200,000.00	1,079,273.43	
T 3.375% 11/15/48	1,000,000.00	890,800.78	
T 3.5% 02/15/33	6,000,000.00	5,820,000.00	
T 3.5% 02/15/39	900,000.00	857,689.45	
T 3.625% 02/15/44	1,600,000.00	1,482,812.49	
T 3.625% 02/15/53	2,070,000.00	1,958,899.20	
T 3.625% 08/15/43	1,600,000.00	1,485,750.00	
T 3.75% 04/15/26	5,800,000.00	5,676,523.45	
T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,054,689.44	
T 3.75% 11/15/43	900,000.00	850,552.73	
T 3.875% 02/15/43	830,000.00	801,533.58	
T 3.875% 08/15/40	680,000.00	669,786.71	
T 3.875% 09/30/29	1,050,000.00	1,038,208.00	
T 3.875% 11/30/29	3,880,000.00	3,838,547.67	
T 3% 02/15/47	2,400,000.00	1,995,375.00	
T 3% 02/15/48	3,100,000.00	2,577,480.46	

T 3% 02/15/49	1,940,000.00	1,617,626.55	
T 3% 05/15/42	1,100,000.00	937,986.32	
T 3% 05/15/45	600,000.00	500,894.53	
T 3% 05/15/47	1,300,000.00	1,080,294.91	
T 3% 07/15/25	6,100,000.00	5,883,164.03	
T 3% 08/15/48	3,060,000.00	2,545,298.45	
T 3% 08/15/52	2,570,000.00	2,155,286.32	
T 3% 09/30/25	3,660,000.00	3,524,036.70	
T 3% 10/31/25	1,000,000.00	962,109.38	
T 3% 11/15/44	1,550,000.00	1,296,944.33	
T 4.125% 11/15/32	3,740,000.00	3,806,618.74	
T 4.25% 05/15/39	850,000.00	883,103.51	
T 4.25% 10/15/25	680,000.00	672,177.34	
T 4.25% 11/15/40	900,000.00	928,810.54	
T 4.375% 02/15/38	500,000.00	528,818.36	
T 4.375% 05/15/40	750,000.00	786,987.30	
T 4.375% 05/15/41	550,000.00	574,395.50	
T 4.375% 11/15/39	650,000.00	683,617.18	
T 4.5% 02/15/36	600,000.00	643,839.84	
T 4.5% 05/15/38	250,000.00	267,446.29	
T 4.5% 08/15/39	750,000.00	801,005.85	
T 4.5% 11/15/25	4,350,000.00	4,325,531.25	
T 4.625% 02/15/40	700,000.00	757,695.31	
T 4.625% 03/15/26	2,170,000.00	2,170,847.64	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	821,938.47	
T 4% 02/28/30	2,400,000.00	2,393,906.25	
T 4% 11/15/52	3,500,000.00	3,548,671.87	
T 4% 12/15/25	5,000,000.00	4,919,824.20	
T 5.0% 05/15/37	300,000.00	338,021.48	
T 5.25% 11/15/28	900,000.00	945,667.97	
T 5.375% 02/15/31	750,000.00	819,667.96	
T 6.0% 02/15/26	600,000.00	619,523.43	
T 6.125% 11/15/27	1,050,000.00	1,127,314.45	
T 6.25% 05/15/30	720,000.00	814,500.00	
アメリカドル 小計	632,680,000.00	559,483,246.58 (79,211,638,050)	
カナダドル			
CAN 0.25% 03/01/26	1,130,000.00	1,014,930.32	
CAN 0.5% 09/01/25	1,590,000.00	1,459,676.98	
CAN 0.5% 12/01/30	2,320,000.00	1,862,538.54	
CAN 0.75% 10/01/24	300,000.00	285,428.30	
CAN 1.25% 03/01/25	500,000.00	472,898.98	
CAN 1.25% 03/01/27	640,000.00	579,301.23	
CAN 1.25% 06/01/30	1,940,000.00	1,665,115.90	

CAN 1.5% 04/01/25	1,210,000.00	1,145,108.66	
CAN 1.5% 06/01/26	740,000.00	685,557.03	
CAN 1.5% 06/01/31	2,010,000.00	1,728,043.95	
CAN 1.5% 09/01/24	660,000.00	635,174.13	
CAN 1.5% 12/01/31	1,230,000.00	1,049,728.60	
CAN 1.75% 12/01/53	1,520,000.00	1,063,044.30	
CAN 1% 06/01/27	640,000.00	573,742.11	
CAN 1% 09/01/26	1,140,000.00	1,034,574.39	
CAN 2.25% 06/01/25	670,000.00	641,430.64	
CAN 2.25% 06/01/29	390,000.00	362,030.23	
CAN 2.25% 12/01/29	240,000.00	221,570.71	
CAN 2.5% 12/01/32	940,000.00	864,780.50	
CAN 2.75% 06/01/33	510,000.00	478,634.37	
CAN 2.75% 08/01/24	280,000.00	273,424.76	
CAN 2.75% 09/01/27	710,000.00	676,821.84	
CAN 2.75% 12/01/48	510,000.00	455,885.98	
CAN 2.75% 12/01/55	150,000.00	132,381.87	
CAN 2.75% 12/01/64	350,000.00	303,647.08	
CAN 2% 06/01/28	500,000.00	461,771.68	
CAN 2% 06/01/32	1,190,000.00	1,052,467.36	
CAN 2% 12/01/51	2,510,000.00	1,889,719.41	
CAN 3.5% 03/01/28	780,000.00	766,932.41	
CAN 3.5% 08/01/25	1,940,000.00	1,896,687.57	
CAN 3.5% 12/01/45	590,000.00	596,725.26	
CAN 3% 10/01/25	370,000.00	357,719.74	
CAN 3% 11/01/24	1,790,000.00	1,745,320.95	
CAN 4.0% 06/01/41	490,000.00	524,012.36	
CAN 5.75% 06/01/29	480,000.00	532,314.42	
CAN 5.75% 06/01/33	620,000.00	733,996.59	
CAN 5% 06/01/37	500,000.00	581,405.09	
カナダドル 小計	34,080,000.00	30,804,544.24 (3,311,180,460)	
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	7,022,464.00
	MBONO 10% 12/05/24	20,780,000.00	20,665,240.99
	MBONO 5.5% 03/04/27	11,270,000.00	9,959,299.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	23,680,000.00	21,611,119.12
	MBONO 5% 03/06/25	1,100,000.00	1,020,591.00
	MBONO 7.5% 05/26/33	6,660,000.00	6,100,893.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	21,620,000.00	20,458,141.20
	MBONO 7.75% 05/29/31	22,210,000.00	20,918,488.50
	MBONO 7.75% 11/13/42	13,980,000.00	12,542,436.60
	MBONO 7.75% 11/23/34	4,970,000.00	4,608,780.40

	MBONO 8.5% 05/31/29	20,740,000.00	20,456,069.40
	MBONO 8.5% 11/18/38	13,720,000.00	13,331,724.00
	MBONO 8% 07/31/53	5,330,000.00	4,843,211.10
	MBONO 8% 09/05/24	18,530,000.00	17,955,516.81
	MBONO 8% 11/07/47	14,310,000.00	13,130,999.10
	メキシコペソ 小計	205,300,000.00	194,624,974.22 (1,635,706,133)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	660,000.00	547,571.77
	BGB 0.35% 06/22/32	960,000.00	763,754.78
	BGB 0.4% 06/22/40	400,000.00	249,986.53
	BGB 0.5% 10/22/24	540,000.00	521,153.31
	BGB 0.65% 06/22/71	340,000.00	137,778.20
	BGB 0.8% 06/22/25	1,100,000.00	1,051,823.96
	BGB 0.8% 06/22/27	920,000.00	848,684.65
	BGB 0.8% 06/22/28	810,000.00	735,633.90
	BGB 0.9% 06/22/29	1,100,000.00	986,532.80
	BGB 0% 10/22/27	600,000.00	531,476.04
	BGB 0% 10/22/31	730,000.00	574,544.16
	BGB 1.25% 04/22/33	550,000.00	471,658.68
	BGB 1.4% 06/22/53	520,000.00	327,258.88
	BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	321,183.20
	BGB 1.6% 06/22/47	640,000.00	455,499.52
	BGB 1.7% 06/22/50	660,000.00	464,467.08
	BGB 1.9% 06/22/38	510,000.00	427,574.47
	BGB 1% 06/22/26	1,000,000.00	944,604.00
	BGB 1% 06/22/31	910,000.00	787,828.86
	BGB 2.15% 06/22/66	450,000.00	331,127.55
	BGB 2.25% 06/22/57	380,000.00	295,032.38
	BGB 2.75% 04/22/39	70,000.00	65,296.77
	BGB 3.3% 06/22/54	310,000.00	300,142.62
	BGB 3.45% 06/22/43	280,000.00	282,020.48
	BGB 3.75% 06/22/45	520,000.00	550,560.40
	BGB 3% 06/22/33	610,000.00	606,590.90
	BGB 3% 06/22/34	350,000.00	346,072.68
	BGB 4.25% 03/28/41	1,110,000.00	1,244,454.07
	BGB 4.5% 03/28/26	750,000.00	777,172.50
	BGB 4% 03/28/32	620,000.00	667,999.09
	BGB 5.5% 03/28/28	1,170,000.00	1,303,943.94
	BGB 5% 03/28/35	1,270,000.00	1,493,593.66
	BKO 0.4% 09/13/24	1,140,000.00	1,102,965.83
	BKO 2.5% 03/13/25	1,900,000.00	1,879,830.07
	BTPS 0.25% 03/15/28	1,250,000.00	1,074,937.50
	BTPS 0.35% 02/01/25	1,440,000.00	1,370,862.72

BTPS 0.45% 02/15/29	1,710,000.00	1,439,180.46	
BTPS 0.5% 02/01/26	500,000.00	463,542.50	
BTPS 0.5% 07/15/28	730,000.00	628,716.55	
BTPS 0.6% 08/01/31	1,300,000.00	1,017,575.00	
BTPS 0.85% 01/15/27	1,600,000.00	1,461,731.20	
BTPS 0.9% 04/01/31	1,300,000.00	1,054,292.20	
BTPS 0.95% 03/01/37	600,000.00	406,476.60	
BTPS 0.95% 06/01/32	1,390,000.00	1,092,620.62	
BTPS 0.95% 08/01/30	1,330,000.00	1,104,546.38	
BTPS 0.95% 09/15/27	1,000,000.00	901,434.00	
BTPS 0.95% 12/01/31	1,120,000.00	893,975.04	
BTPS 0% 04/01/26	2,700,000.00	2,456,416.80	
BTPS 0% 08/01/26	1,330,000.00	1,196,327.02	
BTPS 0% 08/15/24	1,010,000.00	972,212.69	
BTPS 1.1% 04/01/27	1,600,000.00	1,466,952.00	
BTPS 1.2% 08/15/25	540,000.00	514,481.85	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,170,000.00	1,086,987.33	
BTPS 1.35% 04/01/30	1,010,000.00	870,865.43	
BTPS 1.45% 03/01/36	830,000.00	617,511.70	
BTPS 1.45% 05/15/25	1,070,000.00	1,030,731.00	
BTPS 1.45% 11/15/24	1,520,000.00	1,477,905.12	
BTPS 1.5% 04/30/45	650,000.00	403,100.75	
BTPS 1.5% 06/01/25	1,500,000.00	1,444,015.39	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,279,654.20	
BTPS 1.65% 03/01/32	1,300,000.00	1,096,649.08	
BTPS 1.65% 12/01/30	1,450,000.00	1,256,048.00	
BTPS 1.7% 09/01/51	750,000.00	448,445.43	
BTPS 1.75% 07/01/24	1,230,000.00	1,207,735.77	
BTPS 1.8% 03/01/41	890,000.00	627,435.76	
BTPS 1.85% 07/01/25	820,000.00	793,637.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	1,040,000.00	982,942.48	
BTPS 2.15% 03/01/72	340,000.00	200,617.83	
BTPS 2.15% 09/01/52	510,000.00	333,112.87	
BTPS 2.2% 06/01/27	1,110,000.00	1,057,674.27	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,190,000.00	970,480.70	
BTPS 2.45% 09/01/33	1,360,000.00	1,193,192.99	
BTPS 2.45% 09/01/50	970,000.00	692,774.00	
BTPS 2.5% 11/15/25	660,000.00	645,329.52	
BTPS 2.5% 12/01/24	1,300,000.00	1,280,904.30	
BTPS 2.5% 12/01/32	960,000.00	858,652.80	
BTPS 2.65% 12/01/27	770,000.00	742,020.70	
BTPS 2.7% 03/01/47	940,000.00	729,628.00	



BTPS 2.8% 03/01/67	500,000.00	355,879.50
BTPS 2.8% 06/15/29	700,000.00	668,523.80
BTPS 2.8% 12/01/28	1,260,000.00	1,212,823.71
BTPS 2.95% 09/01/38	850,000.00	734,744.25
BTPS 2% 02/01/28	930,000.00	870,480.93
BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,013,993.40
BTPS 3.1% 03/01/40	670,000.00	580,518.15
BTPS 3.25% 03/01/38	70,000.00	62,788.74
BTPS 3.25% 09/01/46	1,080,000.00	925,363.44
BTPS 3.35% 03/01/35	1,390,000.00	1,297,870.80
BTPS 3.4% 03/28/25	140,000.00	139,419.00
BTPS 3.4% 04/01/28	430,000.00	426,818.27
BTPS 3.45% 03/01/48	1,040,000.00	913,105.45
BTPS 3.5% 01/15/26	1,490,000.00	1,488,040.65
BTPS 3.5% 03/01/30	1,950,000.00	1,931,358.00
BTPS 3.75% 09/01/24	1,040,000.00	1,040,526.13
BTPS 3.85% 09/01/49	840,000.00	781,648.56
BTPS 3.85% 12/15/29	1,250,000.00	1,260,142.50
BTPS 3% 08/01/29	1,210,000.00	1,168,924.13
BTPS 4.4% 05/01/33	540,000.00	560,902.86
BTPS 4.45% 09/01/43	440,000.00	447,437.05
BTPS 4.5% 03/01/26	930,000.00	951,336.06
BTPS 4.5% 10/01/53	280,000.00	285,370.40
BTPS 4.75% 09/01/28	1,260,000.00	1,328,160.96
BTPS 4.75% 09/01/44	1,030,000.00	1,092,547.78
BTPS 4% 02/01/37	1,800,000.00	1,780,641.00
BTPS 4% 04/30/35	620,000.00	616,757.51
BTPS 4% 10/30/31	440,000.00	446,572.10
BTPS 5.0% 08/01/39	1,440,000.00	1,568,162.88
BTPS 5.25% 11/01/29	1,770,000.00	1,931,961.01
BTPS 5.75% 02/01/33	1,810,000.00	2,069,554.00
BTPS 5% 03/01/25	1,290,000.00	1,317,145.47
BTPS 5% 08/01/34	1,260,000.00	1,366,442.28
BTPS 5% 09/01/40	1,220,000.00	1,333,362.40
BTPS 6.5% 11/01/27	2,070,000.00	2,313,337.40
BTPS 6% 05/01/31	1,320,000.00	1,521,715.80
BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	389,590.25
DBR 0.25% 02/15/27	230,000.00	211,605.75
DBR 0.25% 02/15/29	1,750,000.00	1,554,086.92
DBR 0.25% 08/15/28	1,300,000.00	1,165,074.30
DBR 0.5% 02/15/25	2,090,000.00	2,006,820.09
DBR 0.5% 02/15/26	2,300,000.00	2,167,701.70
DBR 0.5% 02/15/28	1,510,000.00	1,381,663.59

DBR 0.5% 08/15/27	940,000.00	866,522.08
DBR 0% 02/15/30	1,660,000.00	1,422,616.12
DBR 0% 02/15/31	1,480,000.00	1,241,369.24
DBR 0% 02/15/32	2,080,000.00	1,705,086.24
DBR 0% 05/15/35	1,280,000.00	961,282.56
DBR 0% 05/15/36	1,320,000.00	964,499.85
DBR 0% 08/15/26	1,620,000.00	1,492,281.88
DBR 0% 08/15/29	2,430,000.00	2,104,479.63
DBR 0% 08/15/30	1,250,000.00	1,060,031.25
DBR 0% 08/15/30	400,000.00	339,696.00
DBR 0% 08/15/31	2,310,000.00	1,916,611.62
DBR 0% 08/15/50	2,740,000.00	1,444,722.54
DBR 0% 08/15/52	1,140,000.00	572,769.71
DBR 0% 11/15/27	1,230,000.00	1,104,510.48
DBR 0% 11/15/28	1,250,000.00	1,099,765.00
DBR 1.25% 08/15/48	1,880,000.00	1,469,597.88
DBR 1.7% 08/15/32	1,310,000.00	1,240,210.91
DBR 1.8% 08/15/53	1,390,000.00	1,194,597.55
DBR 1% 05/15/38	980,000.00	796,700.80
DBR 1% 08/15/24	1,610,000.00	1,572,057.53
DBR 1% 08/15/25	1,130,000.00	1,085,026.37
DBR 2.1% 11/15/29	450,000.00	441,337.08
DBR 2.3% 02/15/33	2,120,000.00	2,103,868.19
DBR 2.5% 07/04/44	1,620,000.00	1,618,972.92
DBR 2.5% 08/15/46	1,770,000.00	1,779,943.86
DBR 3.25% 07/04/42	930,000.00	1,028,766.00
DBR 4.0% 01/04/37	1,570,000.00	1,835,000.30
DBR 4.25% 07/04/39	1,090,000.00	1,331,386.38
DBR 4.75% 07/04/28	1,180,000.00	1,303,927.14
DBR 4.75% 07/04/34	1,240,000.00	1,513,418.76
DBR 4.75% 07/04/40	1,220,000.00	1,588,426.45
DBR 5.5% 01/04/31	1,640,000.00	1,984,506.60
DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	1,694,313.60
DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	748,782.62
DBR 6.5% 07/04/27	1,270,000.00	1,453,219.09
FRTR 0.25% 11/25/26	1,590,000.00	1,455,102.18
FRTR 0.5% 05/25/25	2,500,000.00	2,380,333.75
FRTR 0.5% 05/25/26	2,930,000.00	2,733,965.42
FRTR 0.5% 05/25/29	2,830,000.00	2,483,329.95
FRTR 0.5% 05/25/40	1,460,000.00	948,616.75
FRTR 0.5% 05/25/72	620,000.00	234,563.67
FRTR 0.5% 06/25/44	700,000.00	413,823.55

FRTR 0.75% 02/25/28	1,970,000.00	1,793,876.09
FRTR 0.75% 05/25/28	2,960,000.00	2,683,796.48
FRTR 0.75% 05/25/52	1,930,000.00	1,036,741.96
FRTR 0.75% 05/25/53	1,750,000.00	916,664.00
FRTR 0.75% 11/25/28	3,190,000.00	2,867,786.07
FRTR 0% 02/25/25	880,000.00	835,933.05
FRTR 0% 02/25/26	2,790,000.00	2,580,864.39
FRTR 0% 02/25/27	2,320,000.00	2,092,296.64
FRTR 0% 03/25/25	3,280,000.00	3,109,440.00
FRTR 0% 05/25/32	2,150,000.00	1,675,138.10
FRTR 0% 11/25/29	2,460,000.00	2,065,639.86
FRTR 0% 11/25/30	3,330,000.00	2,716,516.58
FRTR 0% 11/25/31	3,590,000.00	2,842,310.70
FRTR 1.25% 05/25/34	2,440,000.00	2,047,901.76
FRTR 1.25% 05/25/36	2,570,000.00	2,071,276.08
FRTR 1.25% 05/25/38	600,000.00	463,683.34
FRTR 1.5% 05/25/31	2,410,000.00	2,192,601.13
FRTR 1.5% 05/25/50	1,960,000.00	1,347,033.52
FRTR 1.75% 05/25/66	850,000.00	566,961.90
FRTR 1.75% 06/25/39	1,660,000.00	1,369,810.42
FRTR 1.75% 11/25/24	2,020,000.00	1,978,025.65
FRTR 1% 05/25/27	2,850,000.00	2,656,356.75
FRTR 1% 11/25/25	1,340,000.00	1,277,297.38
FRTR 2.5% 05/25/30	3,520,000.00	3,457,212.38
FRTR 2.5% 05/25/43	250,000.00	221,605.00
FRTR 2.5% 09/24/26	1,270,000.00	1,250,505.50
FRTR 2.75% 02/25/29	390,000.00	387,929.10
FRTR 2.75% 10/25/27	3,280,000.00	3,264,886.58
FRTR 2% 05/25/48	1,790,000.00	1,405,540.22
FRTR 2% 11/25/32	2,060,000.00	1,910,073.20
FRTR 3.25% 05/25/45	1,800,000.00	1,792,639.80
FRTR 3.5% 04/25/26	3,120,000.00	3,157,268.40
FRTR 3% 05/25/33	850,000.00	853,999.50
FRTR 3% 05/25/54	500,000.00	466,698.39
FRTR 4.5% 04/25/41	2,090,000.00	2,444,204.84
FRTR 4.75% 04/25/35	1,590,000.00	1,851,189.30
FRTR 4% 04/25/55	1,070,000.00	1,208,313.55
FRTR 4% 04/25/60	1,020,000.00	1,166,830.22
FRTR 4% 10/25/38	1,600,000.00	1,757,024.00
FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	2,848,025.00
FRTR 5.75% 10/25/32	2,150,000.00	2,640,850.80
FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	1,539,023.47
IRISH 0.2% 05/15/27	410,000.00	371,053.69

IRISH 0.2% 10/18/30	470,000.00	391,413.41	
IRISH 0.35% 10/18/32	170,000.00	136,482.13	
IRISH 0.4% 05/15/35	280,000.00	209,700.40	
IRISH 0.55% 04/22/41	320,000.00	207,214.72	
IRISH 0.9% 05/15/28	440,000.00	403,286.26	
IRISH 0% 10/18/31	380,000.00	303,516.73	
IRISH 1.1% 05/15/29	550,000.00	501,379.58	
IRISH 1.3% 05/15/33	310,000.00	269,311.12	
IRISH 1.35% 03/18/31	240,000.00	217,345.68	
IRISH 1.5% 05/15/50	460,000.00	322,437.00	
IRISH 1.7% 05/15/37	440,000.00	371,622.24	
IRISH 1% 05/15/26	670,000.00	636,136.99	
IRISH 2.4% 05/15/30	660,000.00	645,414.00	
IRISH 2% 02/18/45	620,000.00	503,446.20	
IRISH 3% 10/18/43	170,000.00	166,575.18	
IRISH 5.4% 03/13/25	620,000.00	642,170.51	
NETHER 0.25% 07/15/25	760,000.00	719,285.43	
NETHER 0.25% 07/15/29	760,000.00	658,605.81	
NETHER 0.5% 01/15/40	910,000.00	639,648.10	
NETHER 0.5% 07/15/26	1,050,000.00	979,213.20	
NETHER 0.5% 07/15/32	720,000.00	595,881.87	
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	832,120.20	
NETHER 0.75% 07/15/28	1,090,000.00	990,709.17	
NETHER 0% 01/15/26	870,000.00	808,934.70	
NETHER 0% 01/15/27	750,000.00	680,790.00	
NETHER 0% 01/15/29	1,040,000.00	897,154.96	
NETHER 0% 01/15/38	530,000.00	355,026.01	
NETHER 0% 01/15/52	1,010,000.00	483,591.72	
NETHER 0% 07/15/30	850,000.00	707,009.60	
NETHER 0% 07/15/31	930,000.00	753,544.39	
NETHER 2.5% 01/15/33	820,000.00	806,586.44	
NETHER 2.5% 07/15/33	90,000.00	88,501.68	
NETHER 2.75% 01/15/47	1,140,000.00	1,147,030.38	
NETHER 2% 01/15/54	330,000.00	281,461.62	
NETHER 2% 07/15/24	1,110,000.00	1,095,476.53	
NETHER 3.75% 01/15/42	1,010,000.00	1,149,108.10	
NETHER 4% 01/15/37	1,070,000.00	1,211,422.97	
NETHER 5.5% 01/15/28	650,000.00	722,701.85	
OBL 0% 04/10/26	1,500,000.00	1,390,392.00	
OBL 0% 04/11/25	1,050,000.00	996,445.80	
OBL 0% 04/16/27	1,510,000.00	1,371,143.42	
OBL 0% 10/09/26	1,360,000.00	1,247,285.36	

OBL 0% 10/10/25	1,970,000.00	1,846,410.08
OBL 0% 10/18/24	1,390,000.00	1,334,664.10
OBL 1.3% 10/15/27	2,620,000.00	2,489,749.32
OBL 2.2% 04/13/28	1,100,000.00	1,084,472.40
RAGB 0.25% 10/20/36	360,000.00	250,351.92
RAGB 0.5% 02/20/29	810,000.00	711,259.38
RAGB 0.5% 04/20/27	650,000.00	594,720.10
RAGB 0.7% 04/20/71	200,000.00	89,251.17
RAGB 0.75% 02/20/28	830,000.00	754,611.93
RAGB 0.75% 03/20/51	460,000.00	263,209.70
RAGB 0.75% 10/20/26	900,000.00	839,470.50
RAGB 0.85% 06/30/20	200,000.00	81,196.00
RAGB 0.9% 02/20/32	800,000.00	675,976.80
RAGB 0% 02/20/30	870,000.00	719,883.24
RAGB 0% 02/20/31	720,000.00	577,300.32
RAGB 0% 04/20/25	370,000.00	350,392.22
RAGB 0% 07/15/24	660,000.00	639,357.84
RAGB 0% 10/20/28	380,000.00	327,069.42
RAGB 0% 10/20/40	330,000.00	194,835.63
RAGB 1.2% 10/20/25	830,000.00	796,858.10
RAGB 1.5% 02/20/47	570,000.00	417,789.77
RAGB 1.5% 11/02/86	200,000.00	119,156.20
RAGB 1.65% 10/21/24	560,000.00	549,264.42
RAGB 1.85% 05/23/49	220,000.00	171,389.02
RAGB 2.1% 09/20/17	360,000.00	261,203.04
RAGB 2.4% 05/23/34	530,000.00	499,101.48
RAGB 2.9% 02/20/33	410,000.00	405,692.13
RAGB 2% 07/15/26	260,000.00	252,616.26
RAGB 3.15% 06/20/44	450,000.00	452,471.85
RAGB 3.8% 01/26/62	210,000.00	241,504.20
RAGB 4.15% 03/15/37	840,000.00	933,141.38
RAGB 4.85% 03/15/26	540,000.00	564,663.52
RAGB 6.25% 07/15/27	540,000.00	606,392.46
RFGB 0.125% 04/15/36	270,000.00	186,661.39
RFGB 0.125% 04/15/52	240,000.00	110,946.72
RFGB 0.125% 09/15/31	370,000.00	296,387.16
RFGB 0.25% 09/15/40	210,000.00	130,904.34
RFGB 0.5% 04/15/26	600,000.00	561,834.60
RFGB 0.5% 04/15/43	180,000.00	111,599.46
RFGB 0.5% 09/15/27	380,000.00	345,152.55
RFGB 0.5% 09/15/28	290,000.00	257,708.79
RFGB 0.5% 09/15/29	290,000.00	252,186.90
RFGB 0.75% 04/15/31	270,000.00	230,885.64

RFGB 0.875% 09/15/25	410,000.00	391,238.40
RFGB 0% 09/15/30	330,000.00	269,688.87
RFGB 1.125% 04/15/34	340,000.00	282,104.12
RFGB 1.375% 04/15/27	380,000.00	359,243.26
RFGB 1.375% 04/15/47	270,000.00	196,543.64
RFGB 1.5% 09/15/32	220,000.00	195,070.04
RFGB 2.625% 07/04/42	380,000.00	356,042.52
RFGB 2.75% 04/15/38	170,000.00	161,691.92
RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	378,663.54
RFGB 3% 09/15/33	290,000.00	290,599.51
RFGB 4% 07/04/25	240,000.00	243,527.16
SPGB 0.1% 04/30/31	1,570,000.00	1,237,073.65
SPGB 0.5% 04/30/30	1,980,000.00	1,661,556.60
SPGB 0.5% 10/31/31	1,180,000.00	946,833.18
SPGB 0.6% 10/31/29	970,000.00	830,957.29
SPGB 0.7% 04/30/32	930,000.00	748,808.10
SPGB 0.8% 07/30/27	1,190,000.00	1,085,369.25
SPGB 0.8% 07/30/29	680,000.00	592,471.35
SPGB 0.85% 07/30/37	640,000.00	445,777.60
SPGB 0% 01/31/25	1,390,000.00	1,320,392.97
SPGB 0% 01/31/26	1,070,000.00	986,629.88
SPGB 0% 01/31/27	1,080,000.00	966,702.81
SPGB 0% 01/31/28	1,280,000.00	1,112,416.00
SPGB 0% 05/31/25	1,760,000.00	1,654,282.58
SPGB 1.2% 10/31/40	950,000.00	646,460.21
SPGB 1.25% 10/31/30	1,200,000.00	1,049,946.00
SPGB 1.3% 10/31/26	1,460,000.00	1,375,569.44
SPGB 1.4% 04/30/28	1,420,000.00	1,312,310.50
SPGB 1.4% 07/30/28	780,000.00	717,805.45
SPGB 1.45% 04/30/29	750,000.00	683,900.25
SPGB 1.45% 10/31/27	1,330,000.00	1,240,528.24
SPGB 1.45% 10/31/71	260,000.00	125,360.30
SPGB 1.5% 04/30/27	1,460,000.00	1,375,244.08
SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,212,593.75
SPGB 1.85% 07/30/35	1,290,000.00	1,082,223.14
SPGB 1.9% 10/31/52	820,000.00	539,543.60
SPGB 1.95% 04/30/26	1,340,000.00	1,294,795.10
SPGB 1.95% 07/30/30	1,520,000.00	1,402,789.00
SPGB 1% 07/30/42	480,000.00	301,142.98
SPGB 1% 10/31/50	1,130,000.00	600,642.46
SPGB 2.15% 10/31/25	1,650,000.00	1,610,690.40
SPGB 2.35% 07/30/33	1,030,000.00	941,504.46

	SPGB 2.55% 10/31/32	1,480,000.00	1,388,949.20
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,020,000.00	836,470.54
	SPGB 2.75% 10/31/24	1,560,000.00	1,545,036.48
	SPGB 2.8% 05/31/26	330,000.00	325,738.05
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,120,000.00	968,212.00
	SPGB 3.15% 04/30/33	980,000.00	961,928.80
	SPGB 3.45% 07/30/43	480,000.00	453,852.61
	SPGB 3.45% 07/30/66	900,000.00	815,852.26
	SPGB 3.55% 10/31/33	730,000.00	737,435.05
	SPGB 3.9% 07/30/39	320,000.00	325,384.70
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,310,000.00	1,392,619.99
	SPGB 4.65% 07/30/25	1,410,000.00	1,445,540.46
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,300,000.00	1,460,707.30
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,080,000.00	1,234,701.25
	SPGB 5.15% 10/31/28	1,100,000.00	1,204,643.00
	SPGB 5.15% 10/31/44	850,000.00	1,015,794.54
	SPGB 5.75% 07/30/32	1,450,000.00	1,726,068.40
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,360,000.00	1,461,239.76
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	2,683,151.27
	ユーロ 小計	382,870,000.00	352,160,210.71 (55,183,505,018)
イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	780,000.00	697,321.09
	UKT 0.125% 01/31/28	880,000.00	726,924.00
	UKT 0.25% 01/31/25	1,540,000.00	1,434,426.84
	UKT 0.25% 07/31/31	1,730,000.00	1,269,058.80
	UKT 0.375% 10/22/26	1,170,000.00	1,019,713.50
	UKT 0.375% 10/22/30	1,090,000.00	831,911.98
	UKT 0.5% 01/31/29	1,180,000.00	957,098.00
	UKT 0.5% 10/22/61	1,050,000.00	327,623.10
	UKT 0.625% 06/07/25	1,160,000.00	1,072,522.77
	UKT 0.625% 07/31/35	1,280,000.00	842,713.60
	UKT 0.625% 10/22/50	640,000.00	261,760.00
	UKT 0.875% 01/31/46	510,000.00	253,113.00
	UKT 0.875% 07/31/33	1,180,000.00	860,373.40
	UKT 0.875% 10/22/29	820,000.00	670,563.52
	UKT 1.125% 01/31/39	1,320,000.00	835,224.72
	UKT 1.125% 10/22/73	480,000.00	184,032.00
	UKT 1.25% 07/22/27	740,000.00	653,309.00
	UKT 1.25% 07/31/51	1,050,000.00	523,558.55
	UKT 1.25% 10/22/41	1,400,000.00	849,788.80
	UKT 1.5% 07/22/26	1,180,000.00	1,078,354.80
UKT 1.5% 07/22/47	1,010,000.00	575,861.60	
UKT 1.5% 07/31/53	680,000.00	356,618.78	

UKT 1.625% 10/22/28	480,000.00	419,712.00	
UKT 1.625% 10/22/54	720,000.00	387,990.72	
UKT 1.625% 10/22/71	710,000.00	346,472.90	
UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	357,300.00	
UKT 1.75% 07/22/57	1,050,000.00	578,980.50	
UKT 1.75% 09/07/37	1,110,000.00	803,998.53	
UKT 1% 01/31/32	1,880,000.00	1,451,250.96	
UKT 2.5% 07/22/65	860,000.00	572,871.80	
UKT 2.75% 09/07/24	440,000.00	428,657.85	
UKT 2% 09/07/25	1,300,000.00	1,224,436.20	
UKT 3.25% 01/22/44	1,240,000.00	1,038,390.13	
UKT 3.25% 01/31/33	1,190,000.00	1,098,352.86	
UKT 3.5% 01/22/45	1,230,000.00	1,064,566.72	
UKT 3.5% 07/22/68	920,000.00	788,716.00	
UKT 3.5% 10/22/25	240,000.00	231,567.84	
UKT 3.75% 01/29/38	370,000.00	343,119.20	
UKT 3.75% 07/22/52	900,000.00	804,879.00	
UKT 3.75% 10/22/53	660,000.00	587,452.80	
UKT 4.125% 01/29/27	1,570,000.00	1,535,822.33	
UKT 4.25% 03/07/36	950,000.00	944,123.30	
UKT 4.25% 06/07/32	1,070,000.00	1,076,901.50	
UKT 4.25% 09/07/39	670,000.00	655,758.48	
UKT 4.25% 12/07/27	1,100,000.00	1,087,955.00	
UKT 4.25% 12/07/40	920,000.00	899,361.45	
UKT 4.25% 12/07/46	1,060,000.00	1,025,327.40	
UKT 4.25% 12/07/49	810,000.00	786,271.86	
UKT 4.25% 12/07/55	1,100,000.00	1,080,618.00	
UKT 4.5% 09/07/34	840,000.00	856,884.00	
UKT 4.5% 12/07/42	850,000.00	855,510.71	
UKT 4.75% 12/07/30	850,000.00	879,282.50	
UKT 4.75% 12/07/38	810,000.00	841,685.90	
UKT 4% 01/22/60	710,000.00	672,415.15	
UKT 4% 10/22/63	320,000.00	303,085.39	
UKT 5% 03/07/25	1,080,000.00	1,080,826.20	
UKT 6.0% 12/07/28	1,070,000.00	1,150,688.70	
イギリスポンド 小計	54,550,000.00	44,543,105.73	(8,085,019,121)
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	3,010,000.00	2,511,721.59
	SGB 0.75% 05/12/28	3,240,000.00	2,972,006.60
	SGB 0.75% 11/12/29	4,290,000.00	3,861,246.28
	SGB 1.75% 11/11/33	1,570,000.00	1,479,770.42
	SGB 1% 11/12/26	4,650,000.00	4,376,941.21



	SGB 2.25% 06/01/32	2,560,000.00	2,520,666.08
	SGB 2.5% 05/12/25	4,430,000.00	4,368,284.20
	SGB 3.5% 03/30/39	2,440,000.00	2,748,464.80
スウェーデンクローナ 小計		26,190,000.00	24,839,101.18 (338,060,167)
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	2,370,000.00	1,963,414.65
	NGB 1.375% 08/19/30	3,280,000.00	2,801,694.00
	NGB 1.5% 02/19/26	2,470,000.00	2,316,798.25
	NGB 1.75% 02/17/27	2,650,000.00	2,456,679.85
	NGB 1.75% 03/13/25	2,960,000.00	2,849,250.70
	NGB 1.75% 09/06/29	2,470,000.00	2,198,053.00
	NGB 2.125% 05/18/32	1,520,000.00	1,339,728.00
	NGB 2% 04/26/28	2,510,000.00	2,308,943.98
	NGB 3% 08/15/33	1,540,000.00	1,454,209.68
ノルウェークローネ 小計		21,770,000.00	19,688,772.11 (277,217,911)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	2,880,000.00	1,504,235.52
	DGB 0.5% 11/15/27	4,470,000.00	4,074,195.80
	DGB 0.5% 11/15/29	4,350,000.00	3,823,888.38
	DGB 0% 11/15/24	2,690,000.00	2,578,157.92
	DGB 0% 11/15/31	3,330,000.00	2,689,293.80
	DGB 1.75% 11/15/25	2,610,000.00	2,535,185.13
	DGB 4.5% 11/15/39	6,130,000.00	7,533,770.00
デンマーククローネ 小計		26,460,000.00	24,738,726.55 (520,255,419)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,430,000.00	1,223,579.50
	POLGB 0.75% 04/25/25	1,830,000.00	1,692,475.50
	POLGB 0% 07/25/24	180,000.00	170,370.00
	POLGB 1.25% 10/25/30	1,760,000.00	1,347,272.96
	POLGB 1.75% 04/25/32	2,310,000.00	1,739,314.50
	POLGB 2.25% 10/25/24	2,470,000.00	2,372,311.50
	POLGB 2.5% 07/25/26	3,600,000.00	3,330,000.00
	POLGB 2.5% 07/25/27	2,010,000.00	1,819,050.00
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,670,000.00	2,402,065.50
	POLGB 2.75% 10/25/29	4,370,000.00	3,816,102.50
	POLGB 3.25% 07/25/25	2,940,000.00	2,826,757.36
	POLGB 3.75% 05/25/27	300,000.00	285,240.00
	POLGB 5.75% 04/25/29	900,000.00	924,570.00
	ポーランドズロチ 小計		26,770,000.00
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	1,440,000.00	1,368,443.76
	ACGB 0.25% 11/21/25	1,190,000.00	1,092,491.87
	ACGB 0.5% 09/21/26	1,030,000.00	926,489.69

	ACGB 1.25% 05/21/32	1,140,000.00	910,259.47	
	ACGB 1.5% 06/21/31	1,190,000.00	993,108.70	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,010,000.00	597,503.16	
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,380,000.00	1,141,051.53	
	ACGB 1% 11/21/31	1,990,000.00	1,574,171.86	
	ACGB 1% 12/21/30	1,480,000.00	1,202,325.99	
	ACGB 2.25% 05/21/28	630,000.00	585,843.50	
	ACGB 2.5% 05/21/30	1,220,000.00	1,116,861.52	
	ACGB 2.75% 05/21/41	810,000.00	660,114.52	
	ACGB 2.75% 06/21/35	630,000.00	553,493.46	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,160,000.00	1,109,023.25	
	ACGB 2.75% 11/21/28	770,000.00	729,012.87	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,230,000.00	1,150,821.62	
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,250,000.00	1,232,953.33	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,180,000.00	1,141,387.39	
	ACGB 3.25% 06/21/39	650,000.00	579,627.46	
	ACGB 3.5% 12/21/34	820,000.00	781,371.89	
	ACGB 3.75% 04/21/37	780,000.00	750,166.30	
	ACGB 3.75% 05/21/34	870,000.00	850,759.93	
	ACGB 3% 03/21/47	780,000.00	632,660.17	
	ACGB 3% 11/21/33	950,000.00	870,870.86	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,200,000.00	1,209,397.32	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,210,000.00	1,259,613.50	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,080,000.00	1,112,133.34	
	オーストラリアドル 小計	29,070,000.00	26,131,958.26 (2,491,159,580)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	370,000.00	300,010.13	
	NZGB 0.5% 05/15/26	360,000.00	318,423.79	
	NZGB 1.5% 05/15/31	540,000.00	431,083.00	
	NZGB 1.75% 05/15/41	260,000.00	165,085.10	
	NZGB 2.75% 04/15/25	490,000.00	469,193.56	
	NZGB 2.75% 04/15/37	350,000.00	280,008.64	
	NZGB 2.75% 05/15/51	300,000.00	207,243.55	
	NZGB 2% 05/15/32	320,000.00	260,338.44	
	NZGB 3.5% 04/14/33	340,000.00	311,296.41	
	NZGB 3% 04/20/29	450,000.00	412,642.71	
	NZGB 4.25% 05/15/34	170,000.00	164,564.44	
	NZGB 4.5% 04/15/27	430,000.00	425,452.74	
	NZGB 4.5% 05/15/30	260,000.00	257,879.69	
	ニュージーランドドル 小計	4,640,000.00	4,003,222.20 (351,242,715)	
シンガポールドドル	SIGB 0.5% 11/01/25	320,000.00	300,288.00	
	SIGB 1.25% 11/01/26	90,000.00	84,609.00	

	SIGB 1.625% 07/01/31	500,000.00	453,500.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	360,000.00	316,800.00	
	SIGB 1.875% 10/01/51	240,000.00	213,727.20	
	SIGB 2.125% 06/01/26	670,000.00	649,230.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	330,000.00	309,540.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	480,000.00	470,786.40	
	SIGB 2.375% 07/01/39	230,000.00	219,865.05	
	SIGB 2.625% 05/01/28	280,000.00	275,574.60	
	SIGB 2.625% 08/01/32	180,000.00	175,292.92	
	SIGB 2.75% 03/01/46	410,000.00	423,530.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	300,000.00	307,294.50	
	SIGB 2.875% 07/01/29	530,000.00	527,350.00	
	SIGB 2.875% 09/01/27	80,000.00	79,576.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	460,000.00	457,700.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	460,000.00	476,964.80	
	SIGB 3.5% 03/01/27	580,000.00	587,772.00	
	SIGB 3% 08/01/72	140,000.00	164,570.00	
	SIGB 3% 09/01/24	510,000.00	507,197.92	
	シンガポールドル 小計	7,150,000.00	7,001,168.39 (744,364,223)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	790,000.00	728,088.96	
	MGS 3.502% 05/31/27	920,000.00	917,819.81	
	MGS 3.582% 07/15/32	150,000.00	146,801.06	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,180,000.00	1,184,578.87	
	MGS 3.757% 05/22/40	1,110,000.00	1,068,950.60	
	MGS 3.828% 07/05/34	250,000.00	247,101.22	
	MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	861,636.66	
	MGS 3.882% 03/14/25	690,000.00	697,641.12	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,890,000.00	1,906,464.73	
	MGS 3.892% 03/15/27	300,000.00	303,221.79	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,960,000.00	1,985,829.27	
	MGS 3.9% 11/30/26	1,140,000.00	1,153,591.53	
	MGS 3.906% 07/15/26	750,000.00	760,426.87	
	MGS 3.955% 09/15/25	1,100,000.00	1,112,639.22	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,060,000.00	1,069,318.35	
	MGS 4.065% 06/15/50	740,000.00	715,063.76	
	MGS 4.232% 06/30/31	850,000.00	873,996.01	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,480,000.00	1,521,247.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,160,000.00	1,188,026.29	
	MGS 4.457% 03/31/53	390,000.00	406,893.66	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,260,000.00	1,315,495.69	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,160,000.00	1,239,897.90	

	MGS 4.696% 10/15/42	530,000.00	572,436.51
	MGS 4.736% 03/15/46	640,000.00	692,175.10
	MGS 4.762% 04/07/37	1,160,000.00	1,251,469.24
	MGS 4.893% 06/08/38	1,490,000.00	1,638,001.25
	MGS 4.921% 07/06/48	1,450,000.00	1,604,617.56
	MGS 4.935% 09/30/43	820,000.00	904,377.42
	マレーシアリングット 小計	27,280,000.00	28,067,807.45 (868,855,820)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	750,000.00	713,343.00
	ILGOV 0.5% 02/27/26	350,000.00	321,610.20
	ILGOV 0.5% 04/30/25	1,240,000.00	1,163,705.14
	ILGOV 1.3% 04/30/32	560,000.00	458,072.72
	ILGOV 1.5% 05/31/37	930,000.00	693,491.42
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,040,000.00	991,456.96
	ILGOV 1% 03/31/30	1,570,000.00	1,318,049.38
	ILGOV 2.25% 09/28/28	1,320,000.00	1,231,599.72
	ILGOV 2.8% 11/29/52	260,000.00	201,309.99
	ILGOV 2% 03/31/27	1,210,000.00	1,135,093.49
	ILGOV 3.75% 03/31/47	1,440,000.00	1,369,702.36
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,060,000.00	1,265,141.90
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,550,000.00	1,658,625.24
		イスラエルシェケル 小計	13,280,000.00
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	63,260,000.00	63,140,606.87
	CGB 2.24% 05/25/25	24,400,000.00	24,463,320.44
	CGB 2.28% 11/25/25	11,420,000.00	11,439,332.91
	CGB 2.3% 05/15/26	12,000,000.00	12,028,646.40
	CGB 2.37% 01/20/27	19,900,000.00	19,922,176.56
	CGB 2.44% 10/15/27	7,000,000.00	7,010,895.50
	CGB 2.47% 09/02/24	14,290,000.00	14,371,847.40
	CGB 2.48% 04/15/27	18,380,000.00	18,467,398.73
	CGB 2.5% 07/25/27	10,000,000.00	10,040,504.00
	CGB 2.6% 09/01/32	7,750,000.00	7,696,290.79
	CGB 2.62% 09/25/29	21,000,000.00	21,042,604.80
	CGB 2.68% 05/21/30	11,650,000.00	11,708,651.92
	CGB 2.69% 08/12/26	11,720,000.00	11,874,914.96
	CGB 2.69% 08/15/32	13,500,000.00	13,511,506.05
	CGB 2.75% 06/15/29	5,000,000.00	5,053,675.50
	CGB 2.79% 12/15/29	9,740,000.00	9,852,653.81
	CGB 2.8% 03/24/29	15,770,000.00	16,003,782.36
	CGB 2.8% 03/25/30	5,000,000.00	5,063,235.50
	CGB 2.8% 11/15/32	6,000,000.00	6,065,100.00
CGB 2.85% 06/04/27	11,760,000.00	11,975,496.12	

	CGB 2.88% 02/25/33	5,100,000.00	5,198,803.32	
	CGB 2.89% 11/18/31	22,500,000.00	22,884,743.25	
	CGB 2.91% 10/14/28	18,300,000.00	18,699,300.51	
	CGB 3.01% 05/13/28	15,960,000.00	16,389,196.32	
	CGB 3.02% 05/27/31	14,720,000.00	15,144,093.50	
	CGB 3.03% 03/11/26	22,150,000.00	22,655,323.45	
	CGB 3.12% 10/25/52	2,500,000.00	2,561,477.50	
	CGB 3.27% 11/19/30	3,430,000.00	3,602,278.95	
	CGB 3.28% 12/03/27	11,140,000.00	11,584,949.41	
	CGB 3.32% 04/15/52	4,790,000.00	5,056,708.15	
	CGB 3.39% 03/16/50	11,760,000.00	12,530,305.87	
	CGB 3.53% 10/18/51	7,010,000.00	7,672,972.85	
	CGB 3.72% 04/12/51	6,850,000.00	7,756,644.76	
	CGB 3.81% 09/14/50	8,230,000.00	9,413,033.69	
	CGB 3.86% 07/22/49	5,810,000.00	6,679,110.92	
	CGB 4.08% 10/22/48	4,780,000.00	5,678,696.88	
	オフショア人民元 小計	464,570,000.00	474,240,279.95	(9,348,366,670)
	合計		163,694,111,935	(163,694,111,935)

## 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 202銘柄	100.0%	48.4%
カナダドル	国債証券 37銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 352銘柄	100.0%	33.7%
イギリスポンド	国債証券 57銘柄	100.0%	4.9%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
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 7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.5%
ニュージーランドドル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリンギット	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券 36銘柄	100.0%	5.7%

(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14期中間計算期間(2023年7月26日から2024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13期 (2023年7月25日現在)	第14期中間計算期間 (2024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	865,235,237	850,830,366
親投資信託受益証券	153,538,872,748	159,437,563,543
未収入金	69,853,061	13,752,353
流動資産合計	154,473,961,046	160,302,146,262
<b>資産合計</b>	<b>154,473,961,046</b>	<b>160,302,146,262</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	85,181,805	100,965,813
未払受託者報酬	16,051,824	17,163,235
未払委託者報酬	96,310,878	102,979,354
未払利息	2,106	349
その他未払費用	1,137,567	1,175,546
流動負債合計	198,684,180	222,284,297
<b>負債合計</b>	<b>198,684,180</b>	<b>222,284,297</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	84,620,917,505	85,779,092,822
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	69,654,359,361	74,300,769,143
(分配準備積立金)	21,218,598,564	20,552,152,791
元本等合計	154,275,276,866	160,079,861,965
<b>純資産合計</b>	<b>154,275,276,866</b>	<b>160,079,861,965</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>154,473,961,046</b>	<b>160,302,146,262</b>



## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期中間計算期間 自 2022年 7月26日 至 2023年 1月25日	第14期中間計算期間 自 2023年 7月26日 至 2024年 1月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	592	2,214
有価証券売買等損益	1,906,466,683	3,829,791,887
<b>営業収益合計</b>	<b>1,906,466,091</b>	<b>3,829,794,101</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	167,816	172,111
受託者報酬	15,323,896	17,163,235
委託者報酬	91,943,332	102,979,354
その他費用	1,131,567	1,175,573
<b>営業費用合計</b>	<b>108,566,611</b>	<b>121,490,273</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>2,015,032,702</b>	<b>3,708,303,828</b>
経常利益又は経常損失（ ）	2,015,032,702	3,708,303,828
<b>中間純利益又は中間純損失（ ）</b>	<b>2,015,032,702</b>	<b>3,708,303,828</b>
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（ ）	26,926,783	11,367,070
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>57,703,589,977</b>	<b>69,654,359,361</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,028,371,438	3,167,966,749
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,028,371,438	3,167,966,749
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,690,416,497	2,241,227,865
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,690,416,497	2,241,227,865
分配金	-	-
<b>中間剰余金又は中間欠損金（ ）</b>	<b>57,053,438,999</b>	<b>74,300,769,143</b>

## (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13期 (2023年 7月25日現在)	第14期中間計算期間 (2024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	84,620,917,505口	85,779,092,822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) 1.8231円 (18,231円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8662円 (18,662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14期中間計算期間 (2024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13期 自 2022年 7月26日 至 2023年 7月25日	第14期中間計算期間 自 2023年 7月26日 至 2024年 1月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	79,705,739,695円	84,620,917,505円
期中追加設定元本額	9,635,639,646円	3,881,831,456円
期中一部解約元本額	4,720,461,836円	2,723,656,139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14期中間計算期間(2023年7月26日から2024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13期 (2023年7月25日現在)	第14期中間計算期間 (2024年1月25日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	181,536,166	171,994,153
親投資信託受益証券	30,927,294,568	33,797,060,660
未収入金	2,579,132	17,290,952
流動資産合計	31,111,409,866	33,986,345,765
<b>資産合計</b>	<b>31,111,409,866</b>	<b>33,986,345,765</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	13,790,438	26,908,696
未払受託者報酬	3,112,472	3,535,649
未払委託者報酬	18,674,753	21,213,787
未払利息	442	70
その他未払費用	773,549	834,856
流動負債合計	36,351,654	52,493,058
<b>負債合計</b>	<b>36,351,654</b>	<b>52,493,058</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	12,682,349,662	13,170,956,088
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	18,392,708,550	20,762,896,619
(分配準備積立金)	6,715,813,286	6,487,814,060
元本等合計	31,075,058,212	33,933,852,707
<b>純資産合計</b>	<b>31,075,058,212</b>	<b>33,933,852,707</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>31,111,409,866</b>	<b>33,986,345,765</b>

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期中間計算期間 自 2022年 7月26日 至 2023年 1月25日	第14期中間計算期間 自 2023年 7月26日 至 2024年 1月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	97	473
有価証券売買等損益	118,949,872	1,684,540,832
営業収益合計	118,949,775	1,684,541,305
<b>営業費用</b>		
支払利息	28,202	35,736
受託者報酬	2,508,694	3,535,649
委託者報酬	15,052,085	21,213,787
その他費用	627,114	834,861
営業費用合計	18,216,095	25,620,033
営業利益又は営業損失（ ）	137,165,870	1,658,921,272
経常利益又は経常損失（ ）	137,165,870	1,658,921,272
中間純利益又は中間純損失（ ）	137,165,870	1,658,921,272
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（ ）	3,282,187	9,434,241
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	12,153,537,789	18,392,708,550
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,074,473,762	1,370,164,051
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,074,473,762	1,370,164,051
剰余金減少額又は欠損金増加額	350,636,076	649,463,013
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	350,636,076	649,463,013
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	12,743,491,792	20,762,896,619

## （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13期 (2023年 7月25日現在)	第14期中間計算期間 (2024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	12,682,349,662口	13,170,956,088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) 2.4503円 (24,503円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.5764円 (25,764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14期中間計算期間 (2024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13期 自 2022年 7月26日 至 2023年 7月25日	第14期中間計算期間 自 2023年 7月26日 至 2024年 1月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	9,907,040,168円	12,682,349,662円
期中追加設定元本額	3,440,793,433円	936,450,118円
期中一部解約元本額	665,483,939円	447,843,692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14期中間計算期間(2023年7月26日から2024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13期 (2023年7月25日現在)	第14期中間計算期間 (2024年1月25日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	111,434,467	132,640,586
親投資信託受益証券	22,302,636,133	25,499,638,457
未収入金	26,538,372	10,000,000
流動資産合計	22,440,608,972	25,642,279,043
資産合計	22,440,608,972	25,642,279,043
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	14,908,657	21,600,869
未払受託者報酬	2,185,014	2,592,473
未払委託者報酬	13,110,017	15,554,812
未払利息	271	54
その他未払費用	546,192	648,056
流動負債合計	30,750,151	40,396,264
負債合計	30,750,151	40,396,264
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,081,779,019	7,518,585,398
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	15,328,079,802	18,083,297,381
(分配準備積立金)	4,996,878,537	4,711,493,101
元本等合計	22,409,858,821	25,601,882,779
純資産合計	22,409,858,821	25,601,882,779
負債純資産合計	22,440,608,972	25,642,279,043

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期中間計算期間 自 2022年 7月26日 至 2023年 1月25日	第14期中間計算期間 自 2023年 7月26日 至 2024年 1月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	75	366
有価証券売買等損益	84,881,605	1,809,876,191
営業収益合計	84,881,680	1,809,876,557
<b>営業費用</b>		
支払利息	21,106	27,919
受託者報酬	1,720,131	2,592,473
委託者報酬	10,320,726	15,554,812
その他費用	429,971	648,060
営業費用合計	12,491,934	18,823,264
営業利益又は営業損失（ ）	72,389,746	1,791,053,293
経常利益又は経常損失（ ）	72,389,746	1,791,053,293
中間純利益又は中間純損失（ ）	72,389,746	1,791,053,293
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（ ）	2,389,361	21,802,330
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	9,551,987,924	15,328,079,802
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,283,276,093	1,915,655,846
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,283,276,093	1,915,655,846
剰余金減少額又は欠損金増加額	524,411,075	929,689,230
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	524,411,075	929,689,230
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	10,380,853,327	18,083,297,381

## (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13期 (2023年 7月25日現在)	第14期中間計算期間 (2024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	7,081,779,019口	7,518,585,398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) 3.1644円 (31,644円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.4051円 (34,051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14期中間計算期間 (2024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13期 自 2022年 7月26日 至 2023年 7月25日	第14期中間計算期間 自 2023年 7月26日 至 2024年 1月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	5,401,807,484円	7,081,779,019円
期中追加設定元本額	2,386,770,370円	866,186,986円
期中一部解約元本額	706,798,835円	429,380,607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



2024年 1月25日現在	
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,247,353,046
株式	391,709,314,180
新株予約権証券	4,432,200
派生商品評価勘定	239,383,300
未収配当金	527,312,120
差入委託証拠金	169,860,959
流動資産合計	395,897,655,805
資産合計	395,897,655,805
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	291,650
前受金	239,145,000
未払解約金	270,361,674
未払利息	1,335
流動負債合計	509,799,659
負債合計	509,799,659
純資産の部	
元本等	
元本	131,039,788,656
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	264,348,067,490
元本等合計	395,387,856,146
純資産合計	395,387,856,146
負債純資産合計	395,897,655,805

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年 1月25日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日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) 新株予約権証券 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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)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）

2024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	131,039,788,656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 3.0173円 (1万口当たり純資産額) (30,173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

	2024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。
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	2024年 1月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月26日
期首元本額	132,331,482,461円
期中追加設定元本額	3,974,702,621円
期中一部解約元本額	5,266,396,426円
期末元本額	131,039,788,656円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	574,063,888円
D C日本株式インデックスファンド	268,588,707円
D C日本株式インデックスファンドL	54,334,053,531円
D C日本株式インデックスファンドA	649,176,900円
D Cバランスファンド30	2,071,279,694円
D Cバランスファンド50	3,374,438,859円
D Cバランスファンド70	2,338,447,499円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	507,852,286円
日本株式インデックスe	1,351,554,113円
インデックスコレクション(国内株式)	23,560,260,490円
インデックスコレクション(バランス株式30)	10,611,439,197円
インデックスコレクション(バランス株式50)	3,438,631,887円
インデックスコレクション(バランス株式70)	3,472,706,324円
私募日本株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	7,985,929,455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)	2,646,952,869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)	602,542,530円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	23,221,103円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	331,180,170円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	45,587,960円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	107,021,403円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	31,239,593円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	412,070,273円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	300,325,577円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	5,395,584,228円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	547,690,716円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	41,488,125円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	864,379,748円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	15,622,003円

区分	2024年 1月25日現在
バランスVA40（適格機関投資家専用）	105,470,342円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,406,058,056円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	35,209,511円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	39,986,492円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	12,016,816円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	366,649,762円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	186,329,002円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	2,817,621,114円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	59,858,707円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	20,182,090円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	6,134,358円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	78,322,428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）	2,620,850円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2024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	3,227,640,000	-	3,466,785,000	239,145,000
合計		3,227,640,000	-	3,466,785,000	239,145,000

## （注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、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

	2024年 1月25日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	368,234,606
国債証券	343,820,260,330
地方債証券	20,986,698,031
特殊債券	22,448,178,958
社債券	18,931,882,000
未収入金	99,377,000
未収利息	752,550,325
前払費用	31,076,579
流動資産合計	407,438,257,829
資産合計	407,438,257,829
負債の部	
流動負債	
未払金	100,000,000
未払解約金	186,160,979
未払利息	151
流動負債合計	286,161,130
負債合計	286,161,130
純資産の部	
元本等	

2024年 1月25日現在	
項目	金額（円）
元本	313,214,366,045
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	93,937,730,654
元本等合計	407,152,096,699
純資産合計	407,152,096,699
負債純資産合計	407,438,257,829

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年 1月25日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

2024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	313,214,366,045口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 99,507,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.2999円 (1万口当たり純資産額) (12,999円)

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

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

2024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)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	2024年 1月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	2023年 7月26日

区分	2024年 1月25日現在
期首元本額	301,735,610,363円
期中追加設定元本額	18,082,597,013円
期中一部解約元本額	6,603,841,331円
期末元本額	313,214,366,045円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	765,739,006円
D C日本債券インデックスファンド	1,794,744,986円
D C日本債券インデックスファンドL	44,551,572,938円
D Cバランスファンド30	13,302,393,023円
D Cバランスファンド50	10,291,257,600円
D Cバランスファンド70	3,041,395,636円
日本債券インデックスe	921,792,207円
インデックスコレクション（国内債券）	38,184,022,061円
インデックスコレクション（バランス株式30）	73,249,504,048円
インデックスコレクション（バランス株式50）	9,913,301,395円
インデックスコレクション（バランス株式70）	4,642,971,694円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	56,591,438,984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）	6,779,904,265円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	123,719,011円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	697,892,148円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	113,168,137円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	87,007,819円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	100,304,173円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	2,303,731,681円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	949,876,472円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	11,120,296,277円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	141,527,778円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	221,987,963円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	2,800,580,381円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	133,741,512円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	351,470,804円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,905,760,030円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	301,447,251円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	769,765,191円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	51,437,942円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	2,742,553,340円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	1,305,037,693円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	20,888,524,456円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	423,277,662円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	104,377,507円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	39,818,658円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	502,894,125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）	4,130,191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

	2024年 1月25日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	4,681,279,747
コール・ローン	1,275,214,376
株式	462,727,742,621
投資信託受益証券	83,493,450
投資証券	9,001,634,612

	2024年 1月25日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	260,967,197
未収入金	1
未収配当金	339,180,343
差入委託証拠金	2,886,868,510
流動資産合計	481,256,380,857
資産合計	481,256,380,857
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,850,479
前受金	230,350,270
未払解約金	95,420,153
未払利息	524
流動負債合計	333,621,426
負債合計	333,621,426
純資産の部	
元本等	
元本	78,540,771,945
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	402,381,987,486
元本等合計	480,922,759,431
純資産合計	480,922,759,431
負債純資産合計	481,256,380,857

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024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) 新株予約権証券 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(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、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>(4) 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>
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</p>

2024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	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。  投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2024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	78,540,771,945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 6.1232円 (1万口当たり純資産額) (61,232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

2024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。
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	2024年 1月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月26日
期首元本額	77,486,252,195円

区分	2024年 1月25日現在
期中追加設定元本額	3,970,699,731円
期中一部解約元本額	2,916,179,981円
期末元本額	78,540,771,945円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,424,685,276円
D C 外国株式インデックスファンド	5,146,847,597円
D C 外国株式インデックスファンド L	29,604,019,832円
D C バランスファンド 3 0	524,208,727円
D C バランスファンド 5 0	1,120,098,569円
D C バランスファンド 7 0	870,725,370円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	254,564,574円
外国株式インデックス e	4,291,521,384円
インデックスコレクション（外国株式）	18,682,571,190円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	2,641,886,696円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	1,175,023,375円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	1,287,661,787円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,149,167,754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）	1,580,151,901円
外国株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	292,307,868円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	11,562,766円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	161,488,237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）	21,924,861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）	51,458,987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）	75,136,885円
バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	138,584,016円
バランス V A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	131,119,877円
バランス V A 5 0 L（適格機関投資家専用）	2,672,046,076円
バランス V A 7 5（適格機関投資家専用）	305,179,673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）	59,854,006円
V A ポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	419,550,834円
V A ポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	7,514,335円
バランス V A 4 0（適格機関投資家専用）	52,342,306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）	50,812,683円
V A バランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	173,003,289円
V A ファンド 2 5（適格機関投資家専用）	5,779,594円
バランス V A 2 5 L（適格機関投資家専用）	39,377,714円
V A バランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	112,999,619円
私募外国株式インデックスファンド A L（適格機関投資家専用）	5,594,287円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2024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	9,093,847,835	-	9,324,198,105	230,350,270
合計		9,093,847,835	-	9,324,198,105	230,350,270

## (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

（2024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	1,415,437,788	-	1,438,204,236	22,766,448
	アメリカドル	1,103,159,428	-	1,121,146,481	17,987,053
	ユーロ	229,218,620	-	232,683,310	3,464,690
	イギリスポンド	83,059,740	-	84,374,445	1,314,705
合計		1,415,437,788	-	1,438,204,236	22,766,448

## (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

2024年 1月25日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	399,240,605
コール・ローン	982,064,321
国債証券	172,771,881,874
派生商品評価勘定	11,016,867
未収利息	1,386,471,749
前払金	4,295,938
前払費用	66,459,795
差入委託証拠金	91,884,865
流動資産合計	175,713,316,014
資産合計	175,713,316,014
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,439,555
未払解約金	93,613,482
未払利息	403
流動負債合計	99,053,440
負債合計	99,053,440
純資産の部	
元本等	
元本	59,062,030,409
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	116,552,232,165
元本等合計	175,614,262,574
純資産合計	175,614,262,574
負債純資産合計	175,713,316,014

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2024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 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</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 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</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。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 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）

2024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	59,062,030,409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 2.9734円 (1万口当たり純資産額) (29,734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

2024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。 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	2024年 1月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月26日
期首元本額	58,940,295,467円
期中追加設定元本額	3,074,533,499円
期中一部解約元本額	2,952,798,557円
期末元本額	59,062,030,409円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	1,861,234,447円
DC外国債券インデックスファンド	1,829,049,771円
DC外国債券インデックスファンドL	14,384,457,821円
DCバランスファンド30	1,001,240,942円
DCバランスファンド50	1,142,533,883円
DCバランスファンド70	240,627,002円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	494,039,493円
外国債券インデックスe	966,509,262円
インデックスコレクション（外国債券）	9,871,542,290円
インデックスコレクション（バランス株式30）	5,389,734,690円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,123,452,296円
インデックスコレクション（バランス株式70）	370,428,502円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,976,995,651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）	3,512,555,429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）	290,571,320円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	55,043,049円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	318,010,885円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	209,632,342円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	164,010,336円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	74,839,080円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	897,668,796円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	475,206,077円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	5,123,216,034円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	298,385,957円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	139,083,471円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,253,607,582円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	59,872,398円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	158,027,042円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	67,475,474円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	38,285,943円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	46,052,806円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	179,607,272円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	58,130,397円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	975,421,129円
私募外国債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	15,481,540円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2024年 1月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	757,963,851	-	753,667,913	4,295,938
合計		757,963,851	-	753,667,913	4,295,938

(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

（2024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	798,557,359	-	808,430,609	9,873,250
	アメリカドル	385,825,132	-	391,708,408	5,883,276
	カナダドル	32,473,413	-	32,668,140	194,727
	ユーロ	262,527,534	-	264,532,125	2,004,591
	イギリスポンド	46,216,600	-	46,799,700	583,100
	オフショア人民元	71,514,680	-	72,722,236	1,207,556
	合計	798,557,359	-	808,430,609	9,873,250

(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】

(2024年 2月29日現在)

資産総額	165,099,807,838円
負債総額	197,506,183円
純資産総額（ - ）	164,902,301,655円
発行済口数	86,492,379,958口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9066円
（1万口当たり純資産額）	（19,066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】

(2024年 2月29日現在)

資産総額	37,134,450,805円
負債総額	34,047,454円
純資産総額（ - ）	37,100,403,351円
発行済口数	13,950,887,451口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6594円
（1万口当たり純資産額）	（26,594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】

(2024年 2月29日現在)

資産総額	28,481,089,106円
負債総額	68,662,354円
純資産総額（ - ）	28,412,426,752円
発行済口数	7,999,996,129口
1口当たり純資産額（ / ）	3.5516円
（1万口当たり純資産額）	（35,516円）

(参考)

日本株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2024年 2月29日現在)

資産総額	419,389,821,324円
負債総額	385,265,466円
純資産総額（ - ）	419,004,555,858円
発行済口数	131,342,357,471口

1口当たり純資産額（ / ）	3.1902円
（1万口当たり純資産額）	（31,902円）

## 日本債券マザーファンド

### 純資産額計算書

（2024年 2月29日現在）

資産総額	424,333,062,948円
負債総額	9,826,050,027円
純資産総額（ - ）	414,507,012,921円
発行済口数	317,402,925,427口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3059円
（1万口当たり純資産額）	（13,059円）

## 外国株式マザーファンド

### 純資産額計算書

（2024年 2月29日現在）

資産総額	513,067,934,346円
負債総額	615,556,436円
純資産総額（ - ）	512,452,377,910円
発行済口数	78,993,548,677口
1口当たり純資産額（ / ）	6.4873円
（1万口当たり純資産額）	（64,873円）

## 外国債券マザーファンド

### 純資産額計算書

（2024年 2月29日現在）

資産総額	178,770,783,120円
負債総額	77,129,801円
純資産総額（ - ）	178,693,653,319円
発行済口数	59,156,781,208口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0207円
（1万口当たり純資産額）	（30,207円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1)名義書換等

該当事項はありません。

### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

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

## 受益権の譲渡

- イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。
- ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

## 受益権の譲渡の対抗要件

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

## 受益権の再分割

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

## 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）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（2024年 2月29日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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、各取締役に對して会日の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2024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。

2024年 2月29日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	536	14,901,081
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	64	218,348
単体型公社債投資信託	51	174,969
合計	651	15,294,398

## 3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第37期事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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38期事業年度の間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）の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 ( 2022年3月31日 )	当事業年度 ( 2023年3月31日 )
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,675	23,067
金銭の信託	14,913	14,693
前払費用	166	198
未収委託者報酬	9,067	9,147
未収運用受託報酬	6,252	5,815
未収収益	179	176
短期差入証拠金	2,528	3,541
その他	2,363	1,566
流動資産合計	57,146	58,207
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 289	1 255
器具備品	1 687	1 560
有形固定資産合計	976	816
無形固定資産		
ソフトウェア	6,292	7,203
その他	31	40
無形固定資産合計	6,324	7,244
投資その他の資産		
投資有価証券	6,607	4,063
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	907	1,181
その他	31	31
投資その他の資産合計	13,182	10,911
固定資産合計	20,482	18,972
資産合計	77,629	77,179

	( 単位：百万円 )	
	前事業年度 ( 2022年3月31日 )	当事業年度 ( 2023年3月31日 )
負債の部		
流動負債		
預り金	47	49

未払金	8,285	7,174
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,561	4,586
その他未払金	3,723	2,588
未払費用	1,049	1,089
未払法人税等	504	726
賞与引当金	578	613
その他	1,958	303
流動負債合計	12,423	9,958
固定負債		
退職給付引当金	820	904
資産除去債務	153	153
その他	12	27
固定負債合計	986	1,086
負債合計	13,410	11,044
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	41,948	44,755
利益剰余金合計	44,548	47,355
株主資本合計	63,788	66,595
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	941	49
繰延ヘッジ損益	509	510
評価・換算差額等合計	431	460
純資産合計	64,219	66,134
負債・純資産合計	77,629	77,179

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：百万円 )

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	41,730	40,724
運用受託報酬	11,883	10,918

その他営業収益	390	351
営業収益合計	54,004	51,993
営業費用		
支払手数料	20,567	20,123
広告宣伝費	286	307
公告費	-	2
調査費	5,567	5,309
調査費	1,062	1,104
委託調査費	4,487	4,191
図書費	17	13
営業雑経費	5,201	5,842
通信費	68	77
印刷費	454	419
協会費	55	58
諸会費	35	38
情報機器関連費	4,473	5,153
その他営業雑経費	112	94
営業費用合計	31,622	31,585
一般管理費		
給料	6,295	6,451
役員報酬	249	318
給料・手当	5,072	5,144
賞与	972	987
退職給付費用	254	252
福利費	632	671
交際費	3	7
旅費交通費	20	122
租税公課	327	289
不動産賃借料	323	327
寄付金	5	-
減価償却費	989	1,698
業務委託費	1,081	1,277
諸経費	1,301	1,454
一般管理費合計	11,234	12,553
営業利益	11,147	7,854

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2	57
収益分配金	16	4
投資有価証券売却益	0	738
投資有価証券償還益	219	121
デリバティブ利益	-	565
その他	8	11

営業外収益合計	247	1,499
営業外費用		
金銭の信託運用損	332	158
投資有価証券売却損	0	16
為替差損	291	1,227
デリバティブ費用	1,191	-
その他	33	32
営業外費用合計	1,848	1,435
経常利益	9,545	7,918
特別損失		
退職給付費用	120	-
特別損失合計	120	-
税引前当期純利益	9,425	7,918
法人税、住民税及び事業税	3,403	2,350
法人税等調整額	465	119
法人税等合計	2,937	2,470
当期純利益	6,487	5,448

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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				株主資本合計
	利益準備金	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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

株主資本				

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

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	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
当期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	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
当期変動額				
剰余金の配当				2,641
当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	891	0	891	891
当期変動額合計	891	0	891	1,915
当期末残高	49	510	460	66,134

## 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. 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）

#### 「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。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-21項に定める経過措置に従って、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。これによる財務諸表への影響はありません。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-3項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

### （表示方法の変更）

#### （貸借対照表関係）

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額の重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた4,891百万円は、「短期差入証拠金」2,528百万円、「その他」2,363百万円として組み替えております。

### （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 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)	
建 物	146	百万円	184	百万円
器具備品	535	"	681	"
計	681	"	866	"

### （株主資本等変動計算書関係）

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

##### (2) 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
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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31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	当事業年度末
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

2023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
2023年6月22日 定時株主総会	普通株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26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（支払期日に支払い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。



## (4) 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。

## 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 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（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
資産計	-	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。

当事業年度（2023年3月31日）

区 分	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)	1,029	12,703	-	13,733
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,844	-	3,844
資産計	1,029	16,547	-	17,577
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	(10)	(48)	-	(58)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(88)	-	(88)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	-	(147)

(\*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（貸借対照表計上額は960百万円）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貸借対照表計上額は14,693百万円であります。

(\*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額218百万円）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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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(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

当事業年度(2023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	23,067	-	-	-
未収委託者報酬	9,147	-	-	-
未収運用受託報酬	5,815	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	594	2,144	38

(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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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(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

当事業年度(2023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	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	292
小計	2,857	3,150	292
合計	3,844	3,772	71

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 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023年3月31日）
非上場株式	0	0
組合出資金等	133	218

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	3,429	738	16

### （デリバティブ取引関係）

#### 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

前事業年度（2022年3月31日）

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)
為替予約取引				
売建				
米ドル	5,498	-	54	54
英ポンド	277	-	1	1
カナダドル	111	-	1	1
スイスフラン	139	-	2	2
香港ドル	190	-	1	1
ユーロ	676	-	18	18
買建				
ユーロ	21	-	0	0
合計	6,915	-	80	80

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2023年3月31日）

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	5,923	-	21	21
	英ポンド	256	-	6	6
	カナダドル	109	-	1	1
	スイスフラン	163	-	2	2
	香港ドル	202	-	0	0
	ユーロ	651	-	19	19
	買建 米ドル	152	-	3	3
合計	7,458	-	48	48	

（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

前事業年度（2022年3月31日）

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。

当事業年度（2023年3月31日）

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	12,195	-	9	9
	債券先物取引 売建	182	-	0	0
合計		12,378	-	10	10

（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

前事業年度（2022年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建				
	米ドル	投資有価証券 関係会社株式	4,422	-	43
	英ポンド		3,297	-	21
	スイスフラン		79	-	1
	香港ドル		119	-	1
	ユーロ		125	-	3
	人民元		13	-	0
合計	8,057		-	71	

当事業年度（2023年3月31日）

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		1,729	-	6
	英ポンド		3,228	-	81
	スイスフラン		20	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		21	-	0
	合計		5,082	-	88

## (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。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	626	820
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
数理計算上の差異の発生額	-	6
退職給付の支払額	81	57
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
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	820	911

## (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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	820	911
未認識数理計算上の差異	-	6
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904
退職給付引当金	820	904
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
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	274	142

## (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	当事業年度
	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.4%	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100百万円、当事業年度109百万円であります。

(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		当事業年度	
	(2022年3月31日)		(2023年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	112	百万円	58	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	177	"	187	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	251	"	277	"
税務上の収益認識差額	74	"	-	"
税務上の費用認識差額	439	"	412	"
繰延ヘッジ損益	224	"	225	"
その他	76	"	75	"
繰延税金資産 合計	1,357	"	1,236	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	415	"	21	"
その他	34	"	32	"
繰延税金負債 合計	450	"	54	"
繰延税金資産の純額	907	"	1,181	"

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。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「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12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(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 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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	9,887百万円

## [ 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 ]

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 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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売 代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

(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（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）

当事業年度（2023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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	21,406,512円22銭	22,044,962円63銭
1株当たり当期純利益金額	2,162,405円20銭	1,816,227円49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いません。

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

### 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第38期中間会計期間末

(2023年9月30日)

#### 資産の部

##### 流動資産

現金及び預金		19,075
金銭の信託		16,243
未収委託者報酬		10,120
未収運用受託報酬		5,852
短期差入証拠金		4,241
その他		2,069
流動資産合計		57,601

##### 固定資産

有形固定資産	1	727
無形固定資産		
ソフトウェア		7,456
その他		45
無形固定資産合計		7,502

##### 投資その他の資産

投資有価証券		4,409
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,136
その他		31
投資その他の資産合計		11,213

固定資産合計		19,443
--------	--	--------

資産合計		77,045
------	--	--------



## 負債の部

## 流動負債

未払金		8,680
未払法人税等		441
賞与引当金		377
その他	2	1,624

流動負債合計		11,124
--------	--	--------

## 固定負債

退職給付引当金		932
資産除去債務		154
その他		35

固定負債合計		1,121
--------	--	-------

負債合計		12,246
------	--	--------

(単位:百万円)

第38期中間会計期間末

(2023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		43,700
---------	--	--------

利益剰余金合計		46,300
---------	--	--------

株主資本合計		65,540
--------	--	--------

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		164
--------------	--	-----

繰延ヘッジ損益		906
---------	--	-----

評価・換算差額等合計		741
------------	--	-----

純資産合計		64,798
-------	--	--------

負債・純資産合計		77,045
----------	--	--------

## 中間損益計算書

(単位:百万円)

第38期中間会計期間

(自 2023年4月1日

至 2023年9月30日)

## 営業収益

委託者報酬		21,671
-------	--	--------

運用受託報酬		5,502
--------	--	-------

その他営業収益		178
---------	--	-----

営業収益合計		27,352
--------	--	--------

営業費用		16,664
------	--	--------

一般管理費	1	6,965
-------	---	-------

営業利益		3,722
営業外収益	2	1,680
営業外費用	3	2,074
経常利益		3,327
税引前中間純利益		3,327
法人税、住民税及び事業税		846
法人税等調整額		169
法人税等合計		1,015
中間純利益		2,312

## 中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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				
	利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当中間期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
中間純利益			2,312	2,312	2,312
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	-	-	1,055	1,055	1,055
当中間期末残高	500	2,100	43,700	46,300	65,540

	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	49	510	460	66,134
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,367
中間純利益				2,312
株主資本以外の項目 の 当中間期変動額（純額）	114	395	280	280
当中間期変動額合計	114	395	280	1,335
当中間期末残高	164	906	741	64,798

## 注記事項

（重要な会計方針）

第38期中間会計期間  
（自 2023年4月1日  
至 2023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。

## （表示方法の変更）

第38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
従来「無形固定資産」に含めていた「ソフトウェア」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38期中間会計期間末 （2023年9月30日）	
1 有形固定資産の減価償却累計額	957百万円
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38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	91百万円
無形固定資産	972百万円
2 営業外収益の主要項目	
金銭の信託運用益	1,589百万円
3 営業外費用の主要項目	
デリバティブ費用	1,269百万円
為替差損	784百万円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26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38期中間会計期間末（2023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)	1,206	13,995	-	15,201
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	-	4,137	-	4,137
資産計	1,206	18,133	-	19,339
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	226	113	-	339
通貨関連取引	-	(134)	-	(134)
デリバティブ取引計	226	(20)	-	205

(\*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1,041百万円）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16,243百万円であります。

(\*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271百万円）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、短期差入証拠金、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。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価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38期中間会計期間末（2023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)

区 分	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	2,711	2,131	580
小計	2,711	2,131	580
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,426	1,769	343
小計	1,426	1,769	343
合計	4,137	3,900	237

(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271百万円）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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,944	-	76	76
	英ポンド	267	-	1	1
	カナダドル	126	-	1	1
	スイスフラン	176	-	0	0
	香港ドル	214	-	2	2
	ユーロ	719	-	3	3
合計		7,449	-	84	84

(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	9,373	-	226	226
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	3,866	-	113	113
合計		13,239	-	339	339

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,935	-	24
	英ポンド		3,612	-	23
	スイスフラン		22	-	0
	香港ドル		90	-	1
	ユーロ		51	-	0
合計			5,713	-	49

(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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,057百万円

## 〔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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）  
該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

第38期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	21,599,648円64銭
1株当たり中間純利益	770,782円86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38期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
中間純利益	2,312百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,312百万円
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

2024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（2023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） （2023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（2023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やSNS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。）、名称や利用上の注意事項等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**

2023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2023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

2023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  
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2022年7月26日から2023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2023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

2023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

## 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2023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

2023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  
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70）の2022年7月26日から2023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2023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**

2023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

田中洋一

**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2023年4月1日から2024年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023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2023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（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務

諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以上

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

2. 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

2024年4月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子

## 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2023年7月26日から2024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2024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（2023年7月26日から2024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

2024年4月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子

## 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2023年7月26日から2024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2024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（2023年7月26日から2024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

2024年4月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子

## 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2023年7月26日から2024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2024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（2023年7月26日から2024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。