

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2024年5月20日
【発行者名】	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ 株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 新原 謙介
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目23番1号
【事務連絡者氏名】	久保 政喜
【電話番号】	03-4530-7297
【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】	A M C / ステート・ストリート・リスクバジェット型 バランス・オープン（ステイブル）
【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】	2兆円を上限とします。
【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】

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

（以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。）

（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受益権です。

委託会社の依頼により、信用格付業者から提供もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供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、後述の「（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または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載また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。

（３）【発行（売出）価額の総額】

2兆円を上限とします。

（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。

収益分配金の再投資を行う場合は、原則として各計算期間終了日の基準価額とします。

基準価額とは、信託財産の純資産総額を受益権総口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当たりの価額で表示されます。

基準価額は、販売会社（後記「（８）申込取扱場所」をご参照ください。）にてご確認いただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の紙面に、「AMC安定型」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

< 照会先 >

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

（受付時間：原則として委託会社の営業日午前9時～午後5時）

ホームページアドレス：www.ssga.com/jp

（５）【申込手数料】

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に2.2%（税抜2.0%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。申込手数料には消費税および地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）がかかります。詳細については、販売会社にお問い合わせください。

（６）【申込単位】

申込単位は、販売会社が定める単位とします。詳細については、販売会社にお問い合わせください。

（ 7 ）【申込期間】

2024年5月21日から2025年5月20日まで

当該申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（ 8 ）【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

販売会社の詳細については、前記「（ 4 ）発行（売出）価格」に記載の＜照会先＞までお問い合わせください。

（ 9 ）【払込期日】

当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日（詳細については、販売会社にお問い合わせください。）までに、取得申込代金を販売会社に支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（ 10 ）【払込取扱場所】

申込みを受付けた販売会社とします（前記「（ 8 ）申込取扱場所」をご参照ください。）。

（ 11 ）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権の振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

（ 12 ）【その他】

申込証拠金

該当事項はありません。

本邦以外の地域での発行

該当事項はありません。

振替受益権について

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かかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「（ 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したがって支払われます。

（参考）

投資信託振替制度とは

- ・ ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。
- ・ ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。

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】

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

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

当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		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。

■ 当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	内外	目論見書又は信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	資産複合	目論見書又は信託約款において、株式、債券、不動産投信及びその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書又は信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)			
	年2回	日本			
	年4回	北米			
債券 一般 国債 社債	年6回 (隔月)	欧州	ファミリー ファンド	あり	日経 225
		アジア		()	

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

■ 当ファンドが該当する属性区分

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

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

ファンドの特色

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

※資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

投資対象とするマザーファンドの概要

日本株式インデックス・マザーファンド

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

日本債券インデックス・マザーファンド

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

外国株式インデックス・オープン・マザーファンド

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

※投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。

外国債券インデックス・マザー・ファンド

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

※投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。

■ ベンチマーク(オリジナル指数)

以下に掲げるベンチマークは、マザーファンドのベンチマークです。

TOPIX

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

NOMURA-BPI総合

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

MSCI コクサイ・インデックス

MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc.の登録商標です。

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

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

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本)

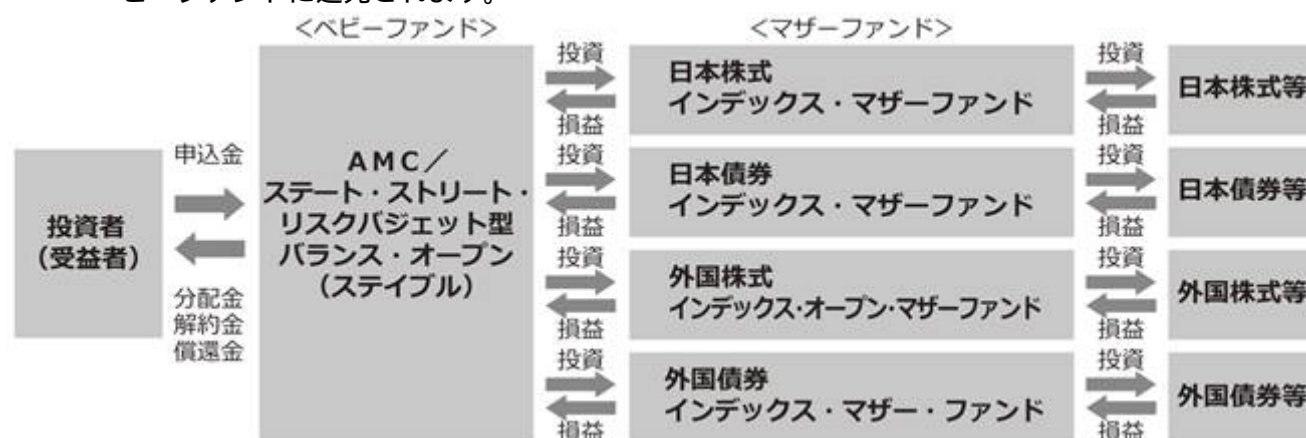
FTSE世界国債インデックス(除く日本)(以下、「WGBI」といいます。))は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、当ファンドのスポンサーではなく、当ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。WGBIのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。WGBIに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属し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

（２）【ファンドの沿革】

2012年３月９日 信託契約締結、設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】

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



ファンドの関係法人

ファンドの関係法人は以下のとおりです。

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

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

- 2) 三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）

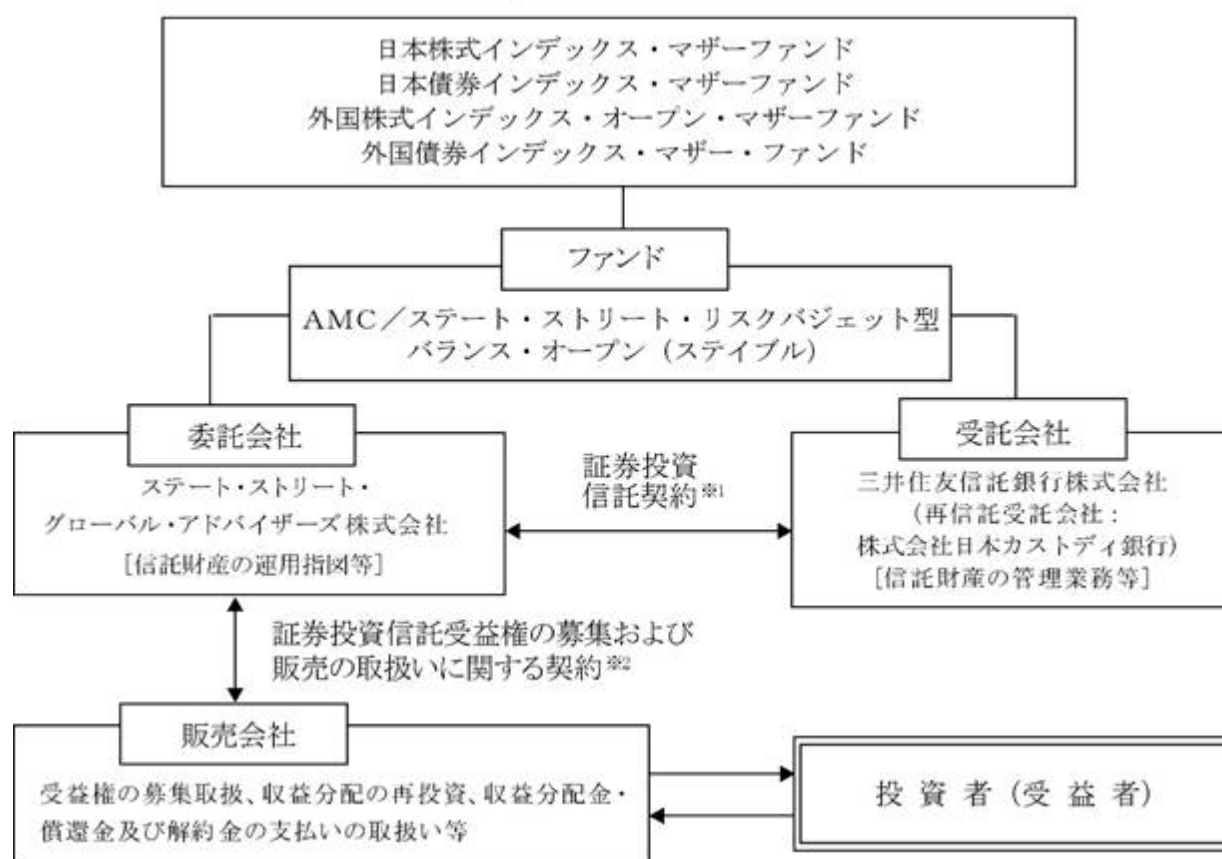
（再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行）

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

- 3) 販売会社

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

ファンド関係法人



1 証券投資信託契約

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

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

2 証券投資信託受益権の募集および販売に関する契約

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

委託会社の概況（本書提出日現在）

1）資本金の額

3 億 1 千万円

2）沿革

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

3）大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

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

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

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

「ＡＭＣリスクバジェット型資産配分モデル指数」をベンチマークとします。

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

日本株式インデックス・マザーファンド

[ベンチマーク：TOPIX（東証株価指数、配当込み）]

日本債券インデックス・マザーファンド

[ベンチマーク：NOMURA - BPI総合]

外国株式インデックス・オープン・マザーファンド

[ベンチマーク：MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）¹]

外国債券インデックス・マザー・ファンド

[ベンチマーク：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）²]

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

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

マザーファンド受益証券の組入れに伴う実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

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

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。

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

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

- （a）為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

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

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14) 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

- 15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 17) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 20) 外国の者に対する権利で19)の有価証券の性質を有するもの
- 21) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 22) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

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

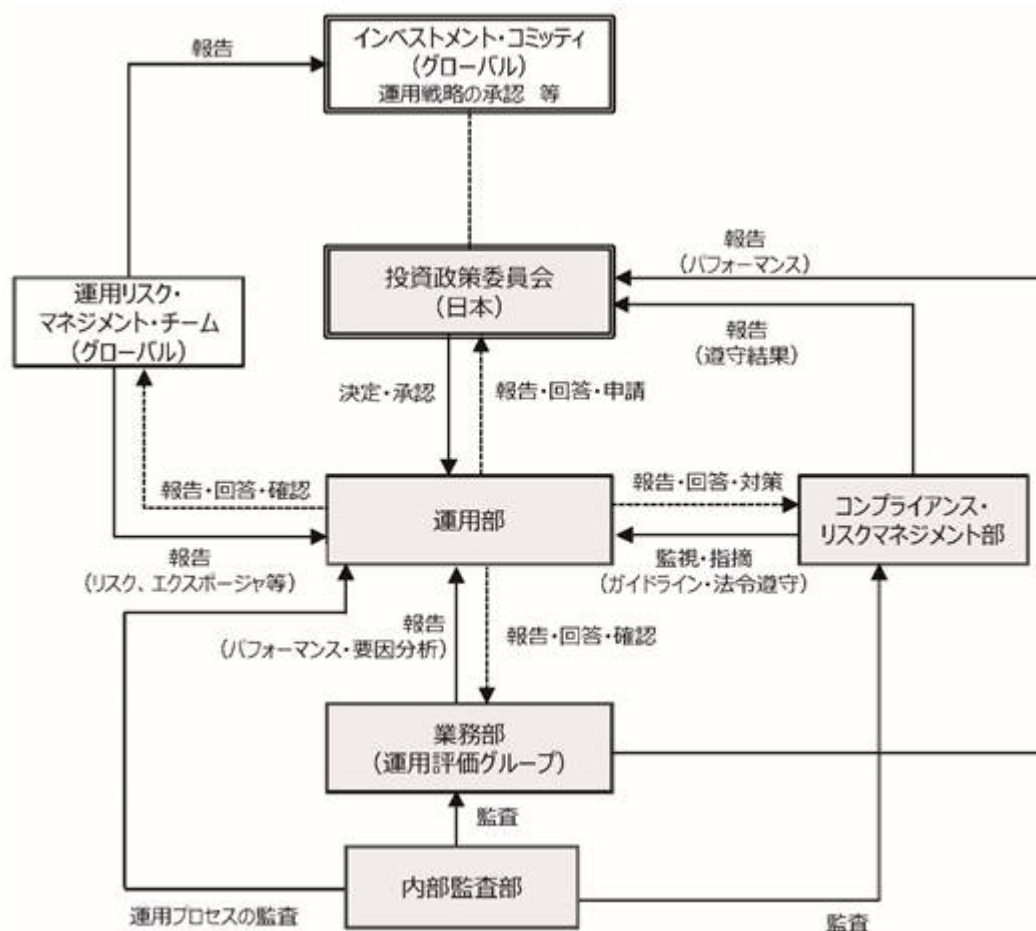
- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形

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

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

上記 において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(3) 【運用体制】



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

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

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

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

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

上記運用体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

毎決算時（原則として2月20日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

分配対象額は経費控除後の利子、配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の範囲内とします。

分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象金額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

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

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

< 分配金に関する留意事項 >

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

（５）【投資制限】

信託約款の「運用の基本方針」に定める主な投資制限

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

信託約款上のその他の投資制限

- 1) 投資する株式等の範囲（信託約款第18条）

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

2）信用取引の指図範囲（信託約款第19条）

- （a）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- （b）上記（a）の信用取引の指図にあたっては、当該売り付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売り付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- （c）信託財産の一部解約等の事由により、上記（b）の売り付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- （d）上記（b）においてマザーファンドの信託財産に属する当該売り付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売り付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- （e）委託会社は、上記（a）の取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

3）先物取引等の運用指図（信託約款第20条）

- （a）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
- （b）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- （c）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

4）スワップ取引の運用指図（信託約款第21条）

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

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

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (b) 上記(a)の指図にあたっては、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (d) 上記(a)の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- 9) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款第26条）
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 10) 外国為替予約取引の指図および範囲（信託約款第27条）
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産の額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額についての為替変動リスクを回避するため、もしくはベンチマークとの連動性を維持するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (b) 上記(a)の予約取引の指図は、原則として信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額の為替変動リスクを回避するため、もしくはベンチマークとの連動性を維持するための当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (c) 上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内にその超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (d) 上記(a)および(b)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 11) デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第22条の2）
- 委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
- 法令に基づく投資制限
- 1) 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）
- 委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- 2) デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）
- 委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定め

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

（参考）「日本株式インデックス・マザーファンド」の概要

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

（１）投資方針

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

日本の金融商品取引所に上場されている株式（これに準ずるものを含む）を主要投資対象とします。

TOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとします。

株式の組入比率は、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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および金利に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引
等」といいます。）の指図をすることができます。

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、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、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもと
に交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

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、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、金利先渡し取引を行うことの指図をすることができます。

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

大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に
入ったときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむをえない事情が発生し
た場合には、上記のような運用が行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合が
あります。

（２）投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

（ａ）有価証券

（ｂ）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第
16条、第17条および第18条に定めるものに限り。）

（ｃ）金銭債権

（ｄ）約束手形

２）次に掲げる特定資産以外の資産

（ａ）為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

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

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12) 投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 13) 投資証券もしくは投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 16) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 18) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

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

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形

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

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

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

（３）主な投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

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

信用取引の指図は、信託約款第１５条の範囲で行います。

有価証券先物取引等は、信託約款第１６条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第１７条の範囲で行います。

金利先渡取引は、信託約款第１８条の範囲で行います。

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、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。

（参考）「日本債券インデックス・マザーファンド」の概要

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

（１）投資方針

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

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

NOMURA-BPI総合をベンチマークとします。

債券組入比率は原則として高位を維持します。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、なら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および金利に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

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、なら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、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

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、なら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の指図をすることができます。

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

（２）投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

（ａ）有価証券

（ｂ）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。）

（ｃ）金銭債権

（ｄ）約束手形

２）次に掲げる特定資産以外の資産

（ａ）為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

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

１）株券または新株引受権証券

２）国債証券

３）地方債証券

４）特別の法律により法人の発行する債券

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

６）特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

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

８）協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

９）特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10）コマーシャル・ペーパー

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

12）投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

13）投資証券もしくは投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

14）オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

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

16）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

18）抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

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

1) 預金

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

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

公社債の投資割合には制限を設けません。

株式への投資は、転換社債の転換請求および新株予約権（会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限り、）の行使により取得可能なものに限り、実質的投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等は、信託約款第15条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第16条の範囲で行います。

金利先渡取引は、信託約款第17条の範囲で行います。

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、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。

(参考)「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の概要

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

(1) 投資方針

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

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

株式への投資にあたっては、日本を除く世界各国の株式（これに準ずるものを含みます。）を主要投資対象とし、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行います。

株式の組入率は、原則として高位を維持します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

信託財産に属する資産の価格変動および金利変動により生じるリスク（為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいう。以下同じ。）を減じるため、ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現するために限定して、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

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、なら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に限定して、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

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、なら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に限定して、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

(2) 投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - (a) 有価証券
 - (b) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款第17条、第18条および第19条に定めるものに限りません。）
 - (c) 金銭債権
 - (d) 約束手形
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
 - (a) 為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

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

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券

- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 8) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から7) までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号定めるものをいいます。）
- 10) 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（クローズド・エンド型の会社型外国投資信託証券を除きます。以下同じ。）（金融商品取引法第2条第1項第11号定めるものをいいます。）
- 11) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 12) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 13) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 14) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 15) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は信託約款第17条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第18条の範囲で行います。

金利先物取引及び為替先渡取引は、信託約款第19条の範囲で行います。

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、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。

（参考）「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の概要

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

（1）投資方針

この投資信託は、主として日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象としFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

公社債への投資は原則として高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。その際の投資比率は、原則として信託財産の純資産総額の100%以内とします。

また、投資比率がこの上限を超過した場合には、速やかに調整するものとします。なお、ここでいう投資比率は、現物資産の時価総額と有価証券先物等の買建玉の時価総額の合計額から売建玉の時価総額を差し引いた額の、純資産総額に対する比率をいいます。

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

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては上記の運用ができないことがあります。

（2）投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

（a）有価証券

（b）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。）

（c）金銭債権

（d）約束手形

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

（a）為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

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

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

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

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

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

公社債の投資割合には制限を設けません。

株式への投資は、転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の転換による取得に限り、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は、信託約款15条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款16条の範囲で行います。

金利先渡取引及び為替先渡取引は、信託約款17条の範囲で行います。

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、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【投資リスク】

(1) ファンドのリスク特性

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

したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

なお、投資信託は預貯金とは異なります。

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

資産配分リスク

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

株価変動リスク

株式の価格は、一般に個々の企業の活動および業績、経営方針、ならびに法令順守の状況等に反応して変動するほか、投資対象国の経済情勢および景気見通し、ならびに金利変動、為替相場およびそれらの見通し等にも反応して変動します。したがって、マザーファンドに組み入れられる株式の価格は短期的または長期的に下落する可能性があります。

信用リスク

当ファンドは、日本および世界主要国の株式や公社債等を実質的な投資対象としていることから、株式の発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。また公社債等の価格は、公社債等の発行体の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等、信用状況によって変動し、特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともあります。）。したがって、このような状態が生じた場合には、当ファンドが実質的に保有する株式や公社債等の価格が下落し、基準価額が下落する要因となります。また、金融商品取引の相手方や受託会社の決済不履行または債務不履行等により損失を被ることがあります。運用資産の規模等によっては、当ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

金利変動リスク

公社債等の価格は、一般に金利が上昇した場合には下落し、金利が下落した場合には上昇します（価格の変動幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。したがって、金利が上昇した場合、当ファンドが実質的に保有する公社債等の価格が下落し、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

当ファンドの実質的な投資対象である世界主要国の株式や公社債等（日本を除く）は外貨建資産であるため、当ファンドの基準価額は為替変動の影響を受けます。

流動性リスク

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

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

投資対象国への投資リスク

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

デリバティブ取引のリスク

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

パッシブ運用のリスク

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

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

ファミリーファンド方式のリスク

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

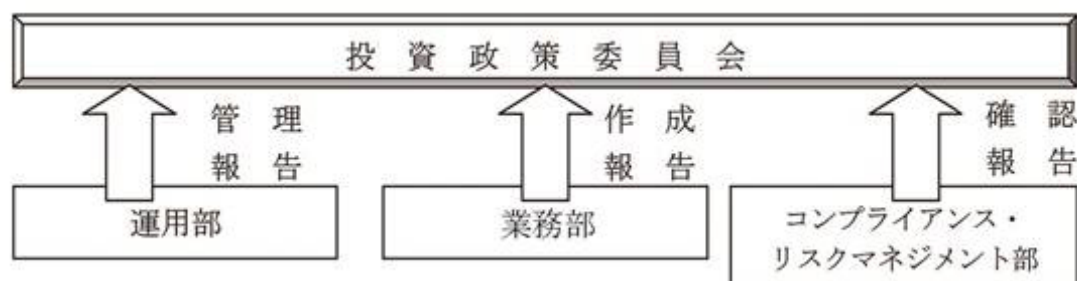
（２）その他の留意点

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

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

ファンドの基準価額と対象インデックスは、費用等の要因により、完全に一致するものではありません。また、ファンドの投資成果が対象インデックスとの連動または上回ることを保証するものではありません。

（３）リスク管理体制



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

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

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

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

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

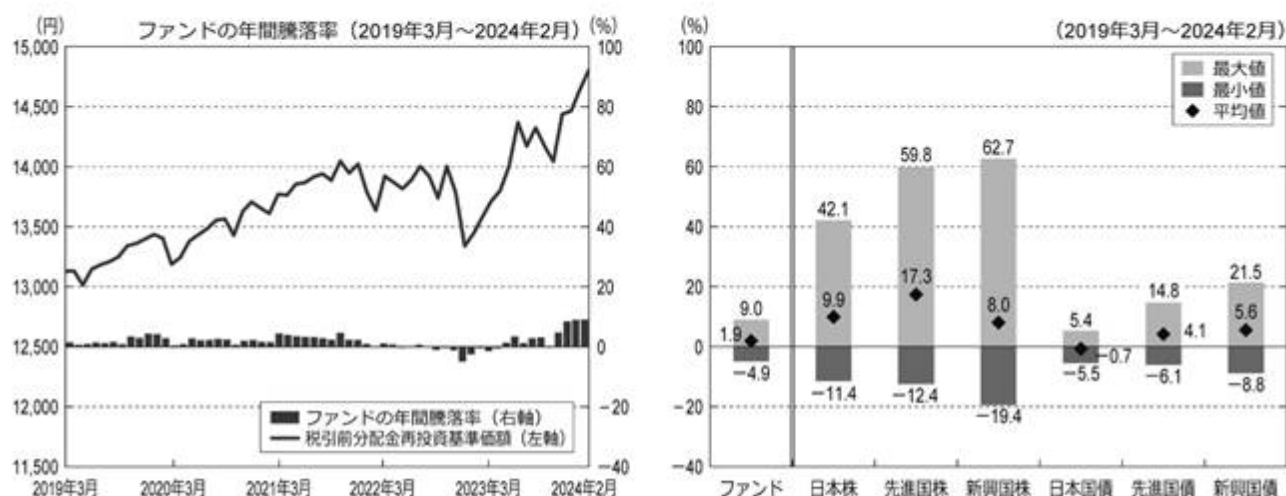
取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

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

＜参考情報＞代表的な資産クラスと騰落率の比較等

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

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



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

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

■「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

日本株:TOPIX(東証株価指数、配当込み)

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

先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

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

新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)

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

日本国債:NOMURA-BPI国債

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

先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

購入時手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の事務等の対価です。

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

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

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

(3)【信託報酬等】

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

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

< 信託報酬率の配分（税抜）>

支払先	信託報酬率（年率）	役務の内容
委託会社	0.60%	委託した資金の運用、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	0.10%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

受託会社	0.05%	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価
------	-------	-------------------------

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

消費税等相当額は、消費税および地方消費税に相当する金額です。

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記のほか、信託約款の規定に基づく運用指図等により生じた費用をご負担いただく場合があります。その他の手数料等は、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することはできません。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われ、日本の居住者（法人を含みます。）である受益者については、以下のような取扱いとなります。なお、税制が改正された場合には、その内容が変更されることがあります。

■個人、法人別の課税について■

個人の投資家に対する課税

<収益分配金に対する課税>

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

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

<換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税>

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

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

金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択した場合に限ります。）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」について

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。当ファンドは、NISAの対象ではありません。

法人の投資者に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

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

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

<注1> 個別元本について

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

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

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

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

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

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

上記は、2024年2月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

（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
0.86%	0.83%	0.03%

※対象期間は2023年2月21日～2024年2月20日です。

※上記は、対象期間の運用報告書に記載されている総経費率（原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含まれていません。）です。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。

※その他費用とは監査費用や有価証券の保管費用等です。

※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】

(1)【投資状況】

(2024年2月29日現在)

種類	国／地域名	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	4,397,749,366	85.66
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		736,414,180	14.34
純資産総額		5,134,163,546	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券（日本株式インデックス・マザーファンド）

(2024年2月29日現在)

種類	国／地域名	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	56,304,771,300	95.44
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		2,688,518,952	4.56
純資産総額		58,993,290,252	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券（日本債券インデックス・マザーファンド）

(2024年2月29日現在)

種類	国／地域名	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	88,894,260,500	83.78
特殊債券	日本	6,341,848,972	5.98
地方債証券	日本	5,633,800,910	5.31
社債券	日本	5,212,631,200	4.91
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		19,646,391	0.02
純資産総額		106,102,187,973	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

(2024年2月29日現在)

種類	国／地域名	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	195,441,794,487	71.42
	イギリス	10,529,962,290	3.85
	フランス	8,874,545,070	3.24
	カナダ	8,513,428,240	3.11
	スイス	7,047,863,036	2.58
	ドイツ	6,365,573,771	2.33
	オーストラリア	5,009,630,926	1.83
	オランダ	3,733,544,503	1.36
	デンマーク	2,652,881,952	0.97
	スウェーデン	2,329,014,685	0.85
	イタリア	2,020,226,017	0.74
	スペイン	1,890,204,764	0.69
	香港	1,432,417,210	0.52
	シンガポール	869,297,764	0.32

	フィンランド	755,256,527	0.28
	ベルギー	667,821,249	0.24
	イスラエル	544,942,973	0.20
	ノルウェー	441,131,372	0.16
	アイルランド	252,685,519	0.09
	ニュージーランド	142,626,345	0.05
	ポルトガル	136,950,456	0.05
	オーストリア	129,656,287	0.05
	小計	259,781,455,443	94.93
投資証券	アメリカ	4,416,276,013	1.61
	オーストラリア	314,833,923	0.12
	シンガポール	95,260,717	0.03
	フランス	93,560,076	0.03
	イギリス	82,159,445	0.03
	香港	57,375,318	0.02
	カナダ	21,420,954	0.01
	ベルギー	20,270,762	0.01
	小計	5,101,157,208	1.86
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		8,774,616,846	3.21
純資産総額		273,657,229,497	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

（2024年2月29日現在）

種類	国 / 地域名	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	43,884,526,403	46.87
	中国	7,856,400,978	8.39
	フランス	7,510,227,967	8.02
	イタリア	6,784,391,916	7.25
	ドイツ	5,864,906,759	6.26
	イギリス	4,822,090,612	5.15
	スペイン	4,488,563,396	4.79
	カナダ	1,847,425,814	1.97
	ベルギー	1,598,383,143	1.71
	オランダ	1,331,052,287	1.42
	オーストラリア	1,248,283,603	1.33
	オーストリア	1,097,586,159	1.17
	メキシコ	801,480,201	0.86
	アイルランド	537,398,487	0.58
	ポーランド	488,428,813	0.52
	フィンランド	476,837,251	0.51
	マレーシア	470,552,303	0.50
	シンガポール	375,537,581	0.40
	イスラエル	317,545,550	0.34
	デンマーク	254,121,917	0.27
	ニュージーランド	228,200,282	0.24
	スウェーデン	194,822,836	0.21
	ノルウェー	164,650,412	0.18

	小計	92,643,414,670	98.94
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		993,617,792	1.06
純資産総額		93,637,032,462	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

（2024年2月29日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 （口）	簿価 単価 （円）	簿価金額 （円）	評価 単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	親投資信託 受益証券	外国債券インデックス・マ ザー・ファンド	—	796,641,718	2.9054	2,314,562,847	2.9209	2,326,910,794	45.32
2	日本	親投資信託 受益証券	日本債券インデックス・マ ザーファンド	—	1,256,992,275	1.2204	1,534,033,372	1.2215	1,535,416,063	29.91
3	日本	親投資信託 受益証券	日本株式インデックス・マ ザーファンド	—	53,886,760	4.893	263,667,916	4.9744	268,054,298	5.22
4	日本	親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・オー プン・マザーファンド	—	41,989,511	6.2832	263,828,495	6.3675	267,368,211	5.21

（注１）投資有価証券は4銘柄です。

（注２）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（％）
親投資信託受益証券	-	85.66
合 計		85.66

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

【投資不動産物件】

該当する事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当する事項はありません。

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（日本株式インデックス・マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2024年2月29日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 （株）	簿価 単価 （円）	簿価金額 （円）	評価 単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	815,300	1,919.71	1,565,142,589	3,621.00	2,952,201,300	5.00
2	日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	890,600	977.63	870,682,643	1,542.00	1,373,305,200	2.33
3	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	105,000	11,852.05	1,244,465,330	12,945.00	1,359,225,000	2.30
4	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	31,400	16,292.68	511,590,152	36,870.00	1,157,718,000	1.96
5	日本	株式	キーエンス	電気機器	14,900	60,979.96	908,601,497	70,040.00	1,043,596,000	1.77
6	日本	株式	三菱商事	卸売業	301,700	1,735.42	523,576,214	3,205.00	966,948,500	1.64
7	日本	株式	日立製作所	電気機器	72,100	7,219.78	520,546,359	12,665.00	913,146,500	1.55
8	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	104,000	6,077.66	632,077,133	8,344.00	867,776,000	1.47
9	日本	株式	信越化学工業	化学	133,400	4,101.93	547,197,462	6,387.00	852,025,800	1.44
10	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,429,700	159.20	705,245,940	182.30	807,534,310	1.37
11	日本	株式	任天堂	その他製品	93,700	5,199.58	487,201,103	8,400.00	787,080,000	1.33
12	日本	株式	三井物産	卸売業	118,400	4,326.52	512,260,701	6,553.00	775,875,200	1.32

13	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	105,600	4,414.92	466,215,932	6,516.00	688,089,600	1.17
14	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	113,000	3,707.89	418,992,221	6,044.00	682,972,000	1.16
15	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	73,500	5,727.82	420,995,154	8,790.00	646,065,000	1.10
16	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	362,100	1,212.74	439,133,948	1,782.00	645,262,200	1.09
17	日本	株式	第一三共	医薬品	129,700	4,422.64	573,616,687	4,974.00	645,127,800	1.09
18	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	144,500	2,877.14	415,747,235	4,376.00	632,332,000	1.07
19	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	131,800	4,271.89	563,036,018	4,387.00	578,206,600	0.98
20	日本	株式	H O Y A	精密機器	29,200	14,110.27	412,019,884	19,485.00	568,962,000	0.96
21	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	197,400	2,154.79	425,355,617	2,801.00	552,917,400	0.94
22	日本	株式	K D D I	情報・通信業	115,100	4,058.84	467,172,902	4,554.00	524,165,400	0.89
23	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	239,700	1,544.15	370,134,399	1,972.50	472,808,250	0.80
24	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	80,800	4,306.74	347,984,760	5,363.00	433,330,400	0.73
25	日本	株式	村田製作所	電気機器	135,100	2,555.49	345,247,750	3,023.00	408,407,300	0.69
26	日本	株式	S M C	機械	4,500	72,775.57	327,490,065	90,150.00	405,675,000	0.69
27	日本	株式	三菱電機	電気機器	166,900	1,587.11	264,889,100	2,381.50	397,472,350	0.67
28	日本	株式	ダイキン工業	機械	17,900	23,716.37	424,523,023	21,175.00	379,032,500	0.64
29	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	162,000	2,084.83	337,743,540	2,230.00	361,260,000	0.61
30	日本	株式	ディスコ	機械	7,200	14,696.39	105,814,008	48,260.00	347,472,000	0.59

（注１）評価金額の上位30銘柄について記載しています。

（注２）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（％）
株式	電気機器	16.67
	輸送用機器	8.95
	情報・通信業	7.20
	卸売業	6.99
	銀行業	6.97
	化学	5.50
	機械	5.22
	サービス業	4.36
	医薬品	4.33
	小売業	3.98
	食料品	2.96
	保険業	2.47
	陸運業	2.46
	精密機器	2.24
	その他製品	2.23
	建設業	1.90
	不動産業	1.81
	電気・ガス業	1.24
	その他金融業	1.12
	鉄鋼	0.92
	証券、商品先物取引業	0.85
	海運業	0.79
	ゴム製品	0.66
	ガラス・土石製品	0.64
	非鉄金属	0.63
	金属製品	0.51

	石油・石炭製品	0.46
	空運業	0.40
	繊維製品	0.33
	鉱業	0.29
	パルプ・紙	0.15
	倉庫・運輸関連業	0.13
	水産・農林業	0.08
合 計		95.44

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

投資不動産物件
該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	TOPIX（先物） （2024年3月限）	大阪取引所	買建	95	2,423,085,200	2,546,950,000	4.32

（注１）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

（注２）先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

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

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（日本債券インデックス・マザーファンド）
投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2024年2月29日現在）

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第150回利付国債 (5年)	0.005	2026/12/20	1,600,000,000	99.73	1,595,760,000	99.48	1,591,728,000	1.50
2	日本	国債証券	第153回利付国債 (5年)	0.005	2027/06/20	1,500,000,000	99.42	1,491,360,000	99.31	1,489,665,000	1.40
3	日本	国債証券	第361回利付国債 (10年)	0.100	2030/12/20	1,400,000,000	97.33	1,362,694,000	97.75	1,368,542,000	1.29
4	日本	国債証券	第359回利付国債 (10年)	0.100	2030/06/20	1,250,000,000	98.05	1,225,666,500	98.15	1,226,937,500	1.16
5	日本	国債証券	第340回利付国債 (10年)	0.400	2025/09/20	1,210,000,000	101.10	1,223,310,000	100.42	1,215,166,700	1.15
6	日本	国債証券	第1回クライメート・ トランジション利付国 債(10年)	0.700	2033/12/20	1,200,000,000	99.62	1,195,440,000	100.00	1,200,000,000	1.13
7	日本	国債証券	第345回利付国債 (10年)	0.100	2026/12/20	1,000,000,000	100.09	1,000,940,000	99.74	997,480,000	0.94
8	日本	国債証券	第149回利付国債 (5年)	0.005	2026/09/20	1,000,000,000	99.85	998,500,000	99.54	995,420,000	0.94
9	日本	国債証券	第360回利付国債 (10年)	0.100	2030/09/20	1,000,000,000	97.12	971,200,000	97.95	979,580,000	0.92
10	日本	国債証券	第362回利付国債 (10年)	0.100	2031/03/20	1,000,000,000	96.49	964,900,000	97.54	975,410,000	0.92
11	日本	国債証券	第366回利付国債 (10年)	0.200	2032/03/20	1,000,000,000	96.77	967,700,000	97.26	972,630,000	0.92
12	日本	国債証券	第339回利付国債 (10年)	0.400	2025/06/20	900,000,000	101.01	909,171,000	100.40	903,627,000	0.85

13	日本	国債証券	第348回利付国債 (10年)	0.100	2027/09/20	900,000,000	99.68	897,156,000	99.50	895,554,000	0.84
14	日本	国債証券	第151回利付国債 (5年)	0.005	2027/03/20	900,000,000	99.59	896,310,000	99.42	894,807,000	0.84
15	日本	国債証券	第358回利付国債 (10年)	0.100	2030/03/20	900,000,000	99.15	892,397,000	98.28	884,565,000	0.83
16	日本	国債証券	第365回利付国債 (10年)	0.100	2031/12/20	900,000,000	95.90	863,100,000	96.70	870,336,000	0.82
17	日本	国債証券	第363回利付国債 (10年)	0.100	2031/06/20	830,000,000	96.24	798,792,000	97.24	807,166,700	0.76
18	日本	国債証券	第341回利付国債 (10年)	0.300	2025/12/20	800,000,000	100.89	807,120,000	100.25	802,016,000	0.76
19	日本	国債証券	第451回利付国債 (2年)	0.005	2025/08/01	800,000,000	99.99	799,942,000	99.86	798,920,000	0.75
20	日本	国債証券	第342回利付国債 (10年)	0.100	2026/03/20	800,000,000	100.31	802,544,000	99.84	798,768,000	0.75
21	日本	国債証券	第346回利付国債 (10年)	0.100	2027/03/20	800,000,000	99.97	799,832,000	99.71	797,688,000	0.75
22	日本	国債証券	第353回利付国債 (10年)	0.100	2028/12/20	800,000,000	98.83	790,640,000	98.79	790,360,000	0.74
23	日本	国債証券	第347回利付国債 (10年)	0.100	2027/06/20	750,000,000	99.82	748,717,500	99.62	747,165,000	0.70
24	日本	国債証券	第355回利付国債 (10年)	0.100	2029/06/20	730,000,000	98.40	718,320,000	98.59	719,743,500	0.68
25	日本	国債証券	第144回利付国債 (5年)	0.100	2025/06/20	700,000,000	100.33	702,310,000	100.01	700,091,000	0.66
26	日本	国債証券	第450回利付国債 (2年)	0.005	2025/07/01	700,000,000	100.00	700,065,000	99.88	699,202,000	0.66
27	日本	国債証券	第343回利付国債 (10年)	0.100	2026/06/20	700,000,000	100.27	701,890,000	99.81	698,712,000	0.66
28	日本	国債証券	第344回利付国債 (10年)	0.100	2026/09/20	700,000,000	100.19	701,330,000	99.78	698,481,000	0.66
29	日本	国債証券	第373回利付国債 (10年)	0.600	2033/12/20	700,000,000	98.83	691,866,000	98.99	692,937,000	0.65
30	日本	国債証券	第163回利付国債 (20年)	0.600	2037/12/20	700,000,000	94.72	663,068,000	94.46	661,220,000	0.62

（注1）評価金額の上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（％）
国債証券	-	83.78
特殊債券	-	5.98
地方債証券	-	5.31
社債券	-	4.91
合 計		99.98

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

投資不動産物件

該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当する事項はありません。

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	209,432	57,081.32	11,954,657,000	61,431.17	12,865,653,298	4.70
2	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	463,868	28,532.37	13,235,257,072	27,334.55	12,679,623,689	4.63
3	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	73,280	72,526.51	5,314,742,741	117,014.84	8,574,847,629	3.13
4	アメリカ	株式	AMAZON COM INC	一般消費財・サービス 流通・小売り	275,560	22,044.52	6,074,590,053	26,090.01	7,189,365,140	2.63
5	アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-A	メディア・娯楽	65,952	50,045.04	3,300,570,511	72,927.29	4,809,700,854	1.76
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	176,040	20,338.94	3,580,467,579	20,548.37	3,617,335,865	1.32
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	154,920	20,551.38	3,183,821,029	20,706.57	3,207,863,079	1.17
8	アメリカ	株式	ELI LILLY AND COMPANY	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	23,939	89,174.03	2,134,737,331	114,153.61	2,732,723,480	1.00
9	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	84,800	36,781.56	3,119,076,322	30,441.36	2,581,427,905	0.94
10	アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	13,166	141,747.32	1,866,245,249	194,276.91	2,557,849,815	0.93
11	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	38,834	54,045.32	2,098,796,306	62,097.13	2,411,480,094	0.88
12	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	86,190	23,251.39	2,004,037,683	27,780.53	2,394,404,277	0.87
13	アメリカ	株式	UNITED HEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	27,481	80,605.43	2,215,118,003	75,075.84	2,063,159,368	0.75
14	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	47,695	38,304.83	1,826,949,063	43,035.87	2,052,595,920	0.75
15	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	118,851	15,419.56	1,832,631,052	15,717.89	1,868,087,467	0.68
16	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	24,914	61,747.57	1,538,379,193	72,148.32	1,797,503,481	0.66
17	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	96,818	15,098.07	1,461,765,812	18,266.78	1,768,554,074	0.65
18	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	71,466	22,918.41	1,637,887,354	24,340.73	1,739,535,218	0.64
19	オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	11,960	102,712.00	1,228,435,550	141,929.55	1,697,477,418	0.62
20	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	69,939	22,770.75	1,592,563,981	24,114.73	1,686,560,346	0.62
21	アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス 流通・小売り	29,639	46,861.38	1,388,924,543	56,894.49	1,686,296,047	0.62
22	アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	13,137	88,572.86	1,163,581,743	112,695.13	1,480,475,965	0.54
23	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	75,260	15,237.25	1,146,755,969	19,314.38	1,453,600,788	0.53
24	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	52,357	20,870.80	1,092,732,916	26,819.26	1,404,175,996	0.51
25	アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	28,827	34,706.83	1,000,493,918	45,166.34	1,302,010,253	0.48
26	アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	47,942	18,657.46	894,476,240	26,599.28	1,275,222,768	0.47

27	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	79,212	16,997.82	1,346,431,405	15,783.81	1,250,267,435	0.46
28	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	53,795	21,682.91	1,166,432,665	22,953.06	1,234,760,282	0.45
29	アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	131,748	7,838.85	1,032,753,847	8,982.94	1,183,485,091	0.43
30	アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	13,107	71,898.21	942,369,934	89,871.64	1,177,947,606	0.43

（注１）評価金額の上位30銘柄について記載しています。

（注２）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（％）
株式	ソフトウェア・サービス	10.06
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.86
	半導体・半導体製造装置	7.65
	資本財	6.76
	金融サービス	6.59
	メディア・娯楽	6.04
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.03
	銀行	5.18
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.73
	エネルギー	4.33
	ヘルスケア機器・サービス	4.20
	素材	3.61
	食品・飲料・タバコ	3.20
	保険	3.03
	公益事業	2.38
	消費者サービス	2.01
	運輸	1.75
	自動車・自動車部品	1.73
	生活必需品流通・小売り	1.71
	商業・専門サービス	1.58
	家庭用品・パーソナル用品	1.56
	耐久消費財・アパレル	1.53
	電気通信サービス	1.10
	不動産管理・開発	0.31
	小 計	94.93
投資証券	-	1.86
合 計		96.79

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

投資不動産物件

該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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

株価指数 先物取引	MINI S&P 500	シカゴ商業取引 所	買建	アメリ カ・ドル	169	40,827,725.11	42,934,450.00	6,468,933,572	2.36
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ ドイツ金融先物 取引所	買建	ユーロ	115	5,306,193.43	5,626,950.00	918,599,585	0.34
	S&P 60	モントリオール 取引所	買建	カナダ・ ドル	12	3,026,644.00	3,079,680.00	341,505,709	0.12
	FTSE100INDEX	インターコンチ ネンタル取引所	買建	イギリ ス・ポンド	23	1,752,385.00	1,749,035.00	333,628,421	0.12
	SPI 200	シドニー先物取 引所	買建	オースト ラリア・ ドル	16	2,996,725.00	3,051,600.00	298,690,608	0.11
	FSMI INDEX	ユーレックス・ チューリッヒ取 引所	買建	スイス・ フラン	12	1,340,350.00	1,361,640.00	233,480,405	0.09

（注１）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

（注２）先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

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

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）
投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2024年2月29日現在）

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2029/08/15	8,000,000	13,150.66	1,052,053,275	13,165.96	1,053,277,463	1.12
2	中国	国債証券	CHINESE GOVERNMENT BOND	2.910	2028/10/14	42,000,000	2,151.04	903,437,073	2,155.03	905,116,452	0.97
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.875	2025/04/30	5,800,000	14,886.31	863,406,192	14,883.95	863,269,647	0.92
4	中国	国債証券	CHINESE GOVERNMENT BOND	2.690	2026/08/12	39,100,000	2,119.77	828,831,102	2,122.26	829,805,313	0.89
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2029/02/15	5,800,000	13,940.50	808,549,371	13,954.04	809,334,496	0.86
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2025/05/15	5,200,000	14,571.43	757,714,724	14,576.14	757,959,563	0.81
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2025/03/31	5,000,000	14,692.09	734,604,535	14,693.26	734,663,387	0.78
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.500	2025/03/31	5,000,000	14,351.90	717,595,301	14,361.32	718,066,144	0.77
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2027/11/30	5,300,000	13,123.00	695,519,201	13,135.95	696,205,461	0.74
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2025/07/31	4,600,000	14,663.84	674,536,643	14,661.48	674,428,349	0.72
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2027/01/31	4,800,000	13,858.69	665,217,468	13,863.40	665,443,473	0.71
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2025/08/15	4,500,000	14,466.67	651,000,339	14,470.79	651,185,735	0.70
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2027/05/15	4,200,000	14,147.08	594,177,737	14,151.79	594,375,491	0.63
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2025/11/15	4,000,000	14,451.37	578,054,869	14,453.72	578,149,044	0.62
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2026/11/15	4,050,000	14,115.89	571,693,773	14,122.36	571,955,975	0.61
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	4,000,000	14,131.78	565,271,466	14,135.31	565,412,716	0.60

17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.250	2025/08/31	4,000,000	14,067.04	562,681,822	14,077.63	563,105,584	0.60
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/09/30	4,000,000	14,021.72	560,869,075	14,028.20	561,128,041	0.60
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2027/02/28	4,100,000	13,675.06	560,677,794	13,680.95	560,919,100	0.60
20	中国	国債証券	CHINESE GOVERNMENT BOND	2.890	2031/11/18	25,800,000	2,158.55	556,908,435	2,161.83	557,754,183	0.60
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2031/05/15	4,400,000	12,584.47	553,716,961	12,612.13	554,934,087	0.59
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2030/08/15	4,600,000	11,951.78	549,781,883	11,981.79	551,162,633	0.59
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2032/05/15	3,900,000	13,572.07	529,310,772	13,596.79	530,274,828	0.57
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2029/01/31	3,800,000	13,364.89	507,866,194	13,379.61	508,425,318	0.54
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2032/02/15	4,000,000	12,605.66	504,226,568	12,630.97	505,238,884	0.54
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2027/02/15	3,500,000	14,155.32	495,436,508	14,158.86	495,560,103	0.53
27	中国	国債証券	CHINESE GOVERNMENT BOND	2.260	2025/02/24	23,500,000	2,100.36	493,585,559	2,102.22	494,021,943	0.53
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2026/08/15	3,500,000	14,008.77	490,307,251	14,011.13	490,389,654	0.52
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2026/08/31	3,500,000	13,952.27	488,329,707	13,955.22	488,432,708	0.52
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2031/11/15	4,000,000	12,180.13	487,205,572	12,210.74	488,429,766	0.52

（注１）評価金額の上位30銘柄について記載しています。

（注２）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（％）
国債証券	-	98.94
合 計		98.94

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

投資不動産物件

該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当する事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

2024年2月29日及び同日前１年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

計算期間・月末		純資産総額（円）		１口当たりの 純資産額（円）	
第3期	（2015年 2月20日）	分配付：	1,749,455,838	分配付：	1.2424
		分配落：	1,726,925,712	分配落：	1.2264
第4期	（2016年 2月22日）	分配付：	2,799,520,026	分配付：	1.1999
		分配落：	2,783,188,603	分配落：	1.1929
第5期	（2017年 2月20日）	分配付：	3,353,263,422	分配付：	1.2368
		分配落：	3,315,305,934	分配落：	1.2228

第6期	(2018年 2月20日)	分配付 : 4,218,203,352 分配落 : 4,167,563,611	分配付 : 1.2495 分配落 : 1.2345
第7期	(2019年 2月20日)	分配付 : 4,251,424,588 分配落 : 4,213,813,566	分配付 : 1.2434 分配落 : 1.2324
第8期	(2020年 2月20日)	分配付 : 4,636,953,719 分配落 : 4,582,572,120	分配付 : 1.2790 分配落 : 1.2640
第9期	(2021年 2月22日)	分配付 : 4,734,124,014 分配落 : 4,697,113,247	分配付 : 1.2791 分配落 : 1.2691
第10期	(2022年 2月21日)	分配付 : 4,854,785,226 分配落 : 4,835,634,300	分配付 : 1.2675 分配落 : 1.2625
第11期	(2023年 2月20日)	分配付 : 4,805,659,775 分配落 : 4,774,926,222	分配付 : 1.2509 分配落 : 1.2429
第12期	(2024年 2月20日)	分配付 : 5,134,866,475 分配落 : 5,096,929,136	分配付 : 1.3535 分配落 : 1.3435
2023年 2月末日		4,816,575,654	1.2467
3月末日		4,842,743,456	1.2589
4月末日		4,869,575,911	1.2666
5月末日		4,935,137,797	1.2853
6月末日		5,065,783,375	1.3188
7月末日		5,000,770,157	1.3008
8月末日		5,047,955,649	1.3147
9月末日		4,990,104,768	1.3008
10月末日		4,942,799,425	1.2890
11月末日		5,076,587,595	1.3252
12月末日		5,048,562,764	1.3277
2024年 1月末日		5,103,852,095	1.3442
2月末日		5,134,163,546	1.3489

【分配の推移】

計算期間		一口当たりの分配金
第3期	自2014年 2月21日 至2015年 2月20日	0.0160円
第4期	自2015年 2月21日 至2016年 2月22日	0.0070円
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	0.0140円
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	0.0150円
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	0.0110円
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	0.0150円
第9期	自2020年 2月21日 至2021年 2月22日	0.0100円
第10期	自2021年 2月23日 至2022年 2月21日	0.0050円
第11期	自2022年 2月22日 至2023年 2月20日	0.0080円

第12期	自2023年 2月21日 至2024年 2月20日	0.0100円
------	------------------------------	---------

【収益率の推移】

計算期間		収益率
第3期	自2014年 2月21日 至2015年 2月20日	7.7%
第4期	自2015年 2月21日 至2016年 2月22日	2.2%
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	3.7%
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	2.2%
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	0.7%
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	3.8%
第9期	自2020年 2月21日 至2021年 2月22日	1.2%
第10期	自2021年 2月23日 至2022年 2月21日	0.1%
第11期	自2022年 2月22日 至2023年 2月20日	0.9%
第12期	自2023年 2月21日 至2024年 2月20日	8.9%

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

（４）【設定及び解約の実績】

計算期間		設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第3期	自2014年 2月21日 至2015年 2月20日	12,384,800	5,554,258	1,408,132,937
第4期	自2015年 2月21日 至2016年 2月22日	932,006,609	7,079,090	2,333,060,456
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	468,679,521	90,490,774	2,711,249,203
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	757,459,918	92,726,355	3,375,982,766
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	128,819,369	85,618,294	3,419,183,841
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	271,844,830	65,588,688	3,625,439,983
第9期	自2020年 2月21日 至2021年 2月22日	129,832,227	54,195,439	3,701,076,771
第10期	自2021年 2月23日 至2022年 2月21日	321,813,640	192,705,055	3,830,185,356
第11期	自2022年 2月22日 至2023年 2月20日	50,649,746	39,140,907	3,841,694,195

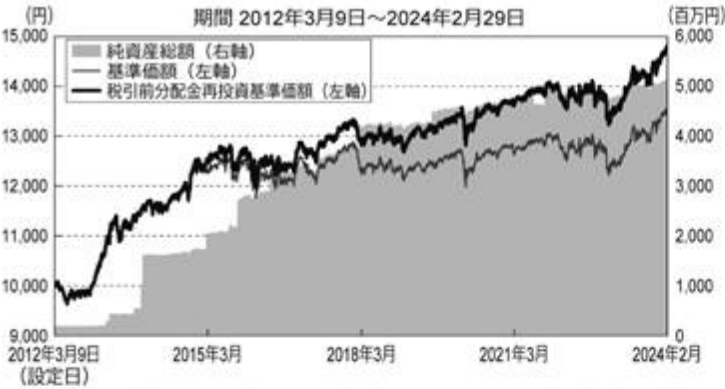
第12期	自2023年 2月21日 至2024年 2月20日	68,655,295	116,615,517	3,793,733,973
------	------------------------------	------------	-------------	---------------

（注）日本国外における設定、解約はありません。

（参考情報）運用実績

（2024年2月29日現在）

基準価額・純資産の推移



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

<基準価額・純資産総額>

基準価額	13,489円
純資産総額	5,134百万円

分配の推移

決算期	分配金
第8期（2020年2月20日）	150円
第9期（2021年2月22日）	100円
第10期（2022年2月21日）	50円
第11期（2023年2月20日）	80円
第12期（2024年2月20日）	100円
設定来累計	1,160円

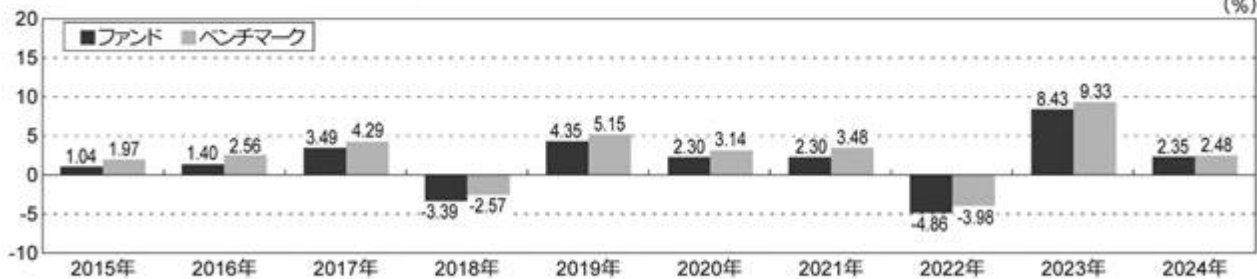
※分配金は1万口当たり、税引前です。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	投資銘柄（上位3銘柄）	国／地域名	種類	業種	利率	償還日	投資比率
外国債券 インデックス・マザー・ファンド	45.32%	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	1.625%	2029/08/15	1.12%
		CHINESE GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	—	2.910%	2028/10/14	0.97%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	3.875%	2025/04/30	0.92%
日本債券 インデックス・マザー・ファンド	29.91%	第150回利付国債（5年）	日本	国債証券	—	0.005%	2026/12/20	1.50%
		第153回利付国債（5年）	日本	国債証券	—	0.005%	2027/06/20	1.40%
		第361回利付国債（10年）	日本	国債証券	—	0.100%	2030/12/20	1.29%
日本株式 インデックス・マザー・ファンド	5.22%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	5.00%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	—	—	2.33%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	—	—	2.30%
外国株式 インデックス・オープン・マザー・ファンド	5.21%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	—	—	4.70%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	—	—	4.63%
		NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	—	—	3.13%

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

年間収益率の推移（暦年ベース）



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

※2024年のファンドとベンチマークの年間収益率は年初から2月末までで算出しています。

※年間収益率の推移は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- 1) 当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社に所定の方法で取引口座を開設のうえ、当ファンドの取得申込みを行ってください。なお、確定拠出年金制度のご利用による取得申込みの場合は、確定拠出年金制度にかかる手続きが必要となります。
- 2) 当ファンドには「分配金再投資コース」と「分配金受取コース」があります。なお、取扱い可能なコースおよびコース名については異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。その際、「分配金再投資コース」をお申し込みいただく方は、ご購入に際して、当ファンドに係る「自動けいぞく投資契約」（別の名称で同様の内容を有する契約を含みます。）を販売会社との間で結んでいただきます。ただし、「分配金再投資コース」を申し込まれた場合でも、分配金を定期的に受け取る旨の契約を締結することもできます。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- 3) 当ファンドの取得申込みの申込締切時間は、原則として販売会社の営業日の午後3時までとし、この受付時刻を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、2024年11月5日より東京証券取引所の取引時間が午後3時30分までに変更される予定です。これにより、ファンドの申込締切時間が変更される場合があります。詳しくは販売会社にお問合せください。
- 4) 申込単位（購入単位）は、販売会社が定める単位にて受付けます。なお、1億円または1億口を超える大口の取得申込みには、制限を設けることがあります。
- 5) 取得申込価額（購入価額）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。基準価額は、販売会社または委託会社においてご確認ください。基準価額の照会方法については、後記「3 資産管理等の概要（1）資産の評価 3）基準価額の公表」をご参照ください。
- 6) 取得申込代金（購入代金）は、購入価額に取得申込の口数を乗じて得た金額に申込手数料（購入時手数料）および当該手数料に係る消費税等相当額を加えた金額です。
- 7) 購入代金は販売会社が定める期日までにお支払いください。
- 8) 購入時手数料は前記「4 手数料等及び税金（1）申込手数料」をご参照ください。
- 9) 購入申込不可日は、原則として、米国もしくは英国の取引所または銀行の休業日、またはフランスおよびドイツ両国の取引所または銀行の休業日に該当する日です。
- 10) 取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更、クーデター等政変、テロリズム、戦争、天災地変等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）があるときは、委託会社の判断により、受益権の取得申込の受付を中止することおよび既に受付けた受益権の取得申込の受付けを取り消すことがあります。
- 11) 当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社に取得申込と同時にまたはあらかじめ、当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。販売会社は、当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

2【換金（解約）手続等】

- 1) 受益者（当ファンドの受益権を取得した者）は、自己に帰属する受益権につき、取得申込みを行った販売会社を通じ、委託会社に一部解約の実行の請求を行うことにより、当ファンドを換金することができます。
- 2) 当ファンドの換金申込みの申込締切時間は、原則として販売会社の営業日の午後3時までとし、この受付時刻を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、2024年11月5日より東京証券取引所の取引時間が午後3時30分までに変更される予定です。これにより、ファンドの申込締切時間が変更される場合があります。詳しくは販売会社にお問合せください。

- 3) 解約単位（換金単位）は、販売会社が定める単位にて受付けます。なお、1億円または1億口を超える大口の換金申込みには、制限を設けることがあります。
- 4) 解約価額（換金価額）は、換金申込受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を控除した価額です。換金価額は、販売会社または委託会社においてご確認いただけます。換金価額の照会方法については、後記「3 資産管理等の概要（1）資産の評価 3）基準価額の公表」をご参照ください。
- 5) 信託財産留保額は、上記4)の基準価額に0.05%の率を乗じて得た額とします。
上記金額は1口当たりの金額です。換金口数に応じてご負担いただきます。
- 6) 換金代金（換金価額に換金する口数を乗じて得た金額）は、原則として換金申込受付日から起算して5営業日目以降にお支払いします。
- 7) 換金申込不可日は、原則として、米国もしくは英国の取引所または銀行の休業日、またはフランスおよびドイツ両国の取引所または銀行の休業日に該当する日です。
- 8) 取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更、クーデター等政変、テロリズム、戦争、天災地変等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）があるときは、委託会社の判断により、受益権の換金申込の受付を中止することおよび既に受けた受益権の換金申込の受け取りを中止することがあります。
- 9) 換金申込みを行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して、当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

1）基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」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（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。投資対象とするマザーファンド受益証券は、当該マザーファンド受益証券の基準価額で評価します。

なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本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するものとします。また、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

< 主要投資対象の評価方法 >

主要投資対象	有価証券等の評価方法
株式、投資証券、債券等	(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の最終相場で評価します。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 原則として、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価します。
市場デリバティブ取引	原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の発表する清算値段または最終相場で評価します。

国内で取引される資産については原則として基準価額計算日の値、外国で取引される資産については原則として基準価額計算日に知りうる直近の日の値で評価します。

2) 基準価額の算出頻度

基準価額は原則として委託会社の営業日において日々算出されます。

3) 基準価額の公表

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

委託会社に対する照会は下記においてできます。

< 照会先 >

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

（受付時間：原則として委託会社の営業日午前9時～午後5時）

ホームページアドレス：www.ssga.com/jp

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

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

2) 上記1)の規定にかかわらず、上記1)の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のときは、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、後記(5)の1)2)3)5)に定める信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

1) 信託契約の解約

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

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

(c) 委託会社は、上記(a)の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドに係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

(d) 上記(c)の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本(d)において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。な

お、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

(f) 上記(c)から上記(e)までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記(c)から上記(e)までに規定するこの信託契約の解約の手続を行うことが困難な場合には適用しません。

2) 信託契約に関する監督官庁の命令

(a) 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

(b) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後記6)の規定にしたがいます。

3) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

(a) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

(b) 上記(a)の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、後記6)の書面決議が否決となる場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

4) 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

(a) 委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

(b) 委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

5) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

(a) 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、後記6)の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

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

6) 信託約款の変更等

(a) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本6)に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

(b) 委託会社は、上記(a)の事項（信託約款の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあってはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大

な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドに係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- (c) 上記(b)の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本(c)において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (d) 上記(b)の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行います。
- (e) 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- (f) 上記(b)から上記(e)までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (g) 上記(a)から上記(f)までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合に係る一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

7) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

8) 運用報告書の交付

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

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

9) 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

10) 関係法人との契約の更改に関する手続き等

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

分配金請求権

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

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている

受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払われます。

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

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

償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

一部解約実行請求権

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

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

書面決議における議決権

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

帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- （２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期計算期間（2023年2月21日から2024年2月20日まで）の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

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

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 (2023年2月20日現在)	第12期 (2024年2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,572,657	5,991,439
コール・ローン	731,293,434	774,194,644
親投資信託受益証券	4,093,196,702	4,376,092,630
流動資産合計	4,826,062,793	5,156,278,713
資産合計	4,826,062,793	5,156,278,713
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	30,733,553	37,937,339
未払解約金	1,947	160,981
未払受託者報酬	1,342,033	1,397,943
未払委託者報酬	18,788,444	19,571,190
未払利息	1,956	2,080
その他未払費用	268,638	280,044
流動負債合計	51,136,571	59,349,577
負債合計	51,136,571	59,349,577
純資産の部		
元本等		
元本	3,841,694,195	3,793,733,973
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	933,232,027	1,303,195,163
（分配準備積立金）	255,741,063	521,396,228
元本等合計	4,774,926,222	5,096,929,136
純資産合計	4,774,926,222	5,096,929,136
負債純資産合計	4,826,062,793	5,156,278,713

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期 自 2022年2月22日 至 2023年2月20日	第12期 自 2023年2月21日 至 2024年2月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	2,843,582	465,795,928
営業収益合計	2,843,582	465,795,928
営業費用		
支払利息	723,621	715,237
受託者報酬	2,682,988	2,740,308
委託者報酬	37,561,617	38,364,292
その他費用	545,277	560,408
営業費用合計	41,513,503	42,380,245
営業利益又は営業損失（ ）	44,357,085	423,415,683
経常利益又は経常損失（ ）	44,357,085	423,415,683
当期純利益又は当期純損失（ ）	44,357,085	423,415,683
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（ ）	365,699	6,624,817
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,005,448,944	933,232,027
剰余金増加額又は欠損金減少額	13,496,656	19,446,350
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	13,496,656	19,446,350
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,257,236	28,336,741
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	10,257,236	28,336,741
分配金	30,733,553	37,937,339
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	933,232,027	1,303,195,163

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
-------------------	--

（重要な会計上の見積りに関する注記）

第11期 (2023年2月20日現在)	第12期 (2024年2月20日現在)
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	第11期 (2023年2月20日現在)	第12期 (2024年2月20日現在)
1 期首元本額	3,830,185,356円	3,841,694,195円
期中追加設定元本額	50,649,746円	68,655,295円
期中一部解約元本額	39,140,907円	116,615,517円
2 受益権の総数	3,841,694,195口	3,793,733,973口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第11期 自 2022年2月22日 至 2023年2月20日	第12期 自 2023年2月21日 至 2024年2月20日
1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（32,629,734円）、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（677,490,964円）及び分配準備積立金（253,844,882円）より分配対象収益は963,965,580円（1万口当たり2,509円）であり、うち30,733,553円（1万口当たり80円）を分配金額としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（71,779,786円）、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（239,437,323円）、収益調整金（781,798,935円）及び分配準備積立金（248,116,458円）より分配対象収益は1,341,132,502円（1万口当たり3,535円）であり、うち37,937,339円（1万口当たり100円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

--	--

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第11期 (2023年2月20日現在)	第12期 (2024年2月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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る場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	第11期 （2023年2月20日現在）	第12期 （2024年2月20日現在）
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額	当計算期間の損益に 含まれた評価差額
親投資信託受益証券	8,832,681	432,420,583
合 計	8,832,681	432,420,583

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

該当する事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当する事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第11期 （2023年2月20日現在）	第12期 （2024年2月20日現在）
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2429円 （12,429円）	1.3435円 （13,435円）

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・オープン・マザーファンド	41,989,511	263,828,495	
	外国債券インデックス・マザー・ファンド	796,641,718	2,314,562,847	
	日本株式インデックス・マザー・ファンド	53,886,760	263,667,916	
	日本債券インデックス・マザー・ファンド	1,256,992,275	1,534,033,372	
合 計		2,149,510,264	4,376,092,630	

（注）親投資信託受益証券における券面総額は、証券数です。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当する事項はありません。

< 参考 >

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

受益証券であります。

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「日本株式インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2023年2月20日現在)	(2024年2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		2,716,528	23,474,113
コール・ローン		1,263,199,054	3,033,250,058
株式		52,071,981,740	55,391,483,170
派生商品評価勘定		11,415,120	117,560,660
未収入金		166,180	—
未収配当金		94,775,972	86,036,255
差入委託証拠金		55,890,000	158,028,707
流動資産合計		53,500,144,594	58,809,832,963
資産合計		53,500,144,594	58,809,832,963
負債の部			
流動負債			
前受金		4,392,500	125,305,000
未払解約金		33,915,000	95,023,780
未払利息		3,378	8,149
その他未払費用		493	1,872
流動負債合計		38,311,371	220,338,801
負債合計		38,311,371	220,338,801
純資産の部			
元本等			
元本	1	14,752,340,035	11,974,166,189
剰余金			
剰余金又は欠損金()		38,709,493,188	46,615,327,973
元本等合計		53,461,833,223	58,589,494,162
純資産合計		53,461,833,223	58,589,494,162
負債純資産合計		53,500,144,594	58,809,832,963

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
-------------------	--

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

（2023年2月20日現在）	（2024年2月20日現在）
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（2023年2月20日現在）	（2024年2月20日現在）
1 期首元本額	25,294,590,585円	14,752,340,035円
期中追加設定元本額	1,753,907,266円	2,145,538,404円
期中一部解約元本額	12,296,157,816円	4,923,712,250円
元本の内訳		
ファンド名		
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	68,981,331円	53,886,760円
日本株式インデックス・ファンド（年金1）＜適格機関投資家限定＞	710,778,676円	666,472,742円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	2,911,390円	866,334円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	23,988,398円	13,362,439円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	95,561円	80,268円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	2,369,752円	803,084円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	4,168,214円	2,571,702円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	4,061,655,987円	3,243,815,419円
日本株式インデックス・ファンドVA1＜適格機関投資家限定＞	293,758,056円	248,946,524円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	2,111,954円	1,844,809円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	529,744,420円	357,684,242円

バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	439,072,406円	340,075,903円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	31,673,865円	21,414,604円
日本株式インデックス・ファンドM＜適格機関投資家限定＞	73,118,849円	71,338,398円
日本株式インデックス・ファンドS＜適格機関投資家限定＞	76,780,705円	74,786,285円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	95,893,393円	63,969,931円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	1,452,987,603円	1,116,836,741円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	198,988,819円	132,345,274円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	954,113,869円	691,982,054円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	32,221,168円	23,885,879円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	10,627,900円	7,397,551円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	14,305,109円	11,376,333円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	5,287,440円	3,568,313円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	341,221,323円	247,746,630円
バランスファンドVA20A＜適格機関投資家限定＞	1,210,294円	814,418円
バランスファンドVA35B＜適格機関投資家限定＞	2,213,592円	1,095,031円
日本株式インデックス・ファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	41,848,936円	46,907,714円
4資産インデックスバランスVA20＜適格機関投資家限定＞	203,449,609円	151,789,389円
世界分散ファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	890,829,665円	645,739,582円
Ta dリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）年金＜適格機関投資家限定＞	68,530,913円	55,548,166円
フレックス資産配分戦略ファンド＜適格機関投資家限定＞	430,650,499円	375,226,082円
Ta dリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）＜適格機関投資家限定＞	45,838,046円	52,570,779円
ステート・ストリート日本株式インデックス・オープン	3,320,174,162円	3,023,298,897円
ステート・ストリートTOPIXインデックス・オープン	—円	216,607円
世界バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	2,834,577円	1,850,770円

世界バランス 60 V A < 適格機関投資家限定 >	3,825,689円	1,572,894円
グローバルバランス 40 V A < 適格機関投資家限定 >	200,823円	106,829円
グローバルバランス 40 V A 2 < 適格機関投資家限定 >	299,633,386円	211,967,447円
グローバルバランス 40 V A 3 < 適格機関投資家限定 >	10,512,704円	5,290,952円
グローバルバランス 50 V A < 適格機関投資家限定 >	3,730,952円	3,112,413円
計	14,752,340,035円	11,974,166,189円
2 受益権の総数	14,752,340,035口	11,974,166,189口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「（３）附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク等の市場リスクに晒されております。 デリバティブ取引には、ファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、ファンドの効率的な運用に資することを目的に利用している株価指数先物取引があり、株価変動リスクに晒されております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	（2023年2月20日現在）	（2024年2月20日現在）
-----	----------------	----------------

1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。	同左

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	（2023年2月20日現在）	（2024年2月20日現在）
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	5,264,641,195	12,413,031,273
合計	5,264,641,195	12,413,031,273

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までを指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

（単位：円）

有価証券届出書（F）					
区 分	種 類	（ 2023年2月20日現在 ）			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX（先物）	1,347,860,000	—	1,359,320,000	11,460,000
合 計		1,347,860,000	—	1,359,320,000	11,460,000

(単位：円)

区 分	種 類	(2024年2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX (先物)	3,155,957,500	—	3,273,600,000	117,642,500
合 計		3,155,957,500	—	3,273,600,000	117,642,500

(注) 1 . 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2 . 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 . 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4 . 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

5 . ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(2023年2月20日現在)	(2024年2月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.6240円 (36,240円)	4.8930円 (48,930円)

(3) 附属明細表

第 1 有価証券明細表

株式

銘 柄	株 数	評価額		備考
		単価 (円)	金額 (円)	
極洋	800	3,560.00	2,848,000	
ニッスイ	20,700	929.30	19,236,510	
マルハニチロ	3,000	2,900.00	8,700,000	
雪国まいたけ	1,700	960.00	1,632,000	
カネコ種苗	800	1,457.00	1,165,600	
サカタのタネ	2,300	3,740.00	8,602,000	
ホクト	1,700	1,848.00	3,141,600	
ホクリヨウ	200	1,029.00	205,800	
ショーボンドホールディングス	2,800	6,189.00	17,329,200	
ミライト・ワン	6,800	1,760.50	11,971,400	
タマホーム	1,300	3,970.00	5,161,000	

サンヨーホームズ	100	760.00	76,000	
日本アクア	500	1,077.00	538,500	
ファーストコーポレーション	400	790.00	316,000	
ベステラ	400	1,094.00	437,600	
R o b o t H o m e	4,600	161.00	740,600	
キャンディル	600	583.00	349,800	
住石ホールディングス	2,100	2,129.00	4,470,900	
日鉄鉱業	800	5,160.00	4,128,000	
三井松島ホールディングス	1,100	3,010.00	3,311,000	
I N P E X	76,800	2,019.00	155,059,200	
石油資源開発	2,400	6,110.00	14,664,000	
K & Oエナジーグループ	1,000	2,463.00	2,463,000	
ダイセキ環境ソリューション	300	1,043.00	312,900	
第一カッター興業	700	1,328.00	929,600	
明豊ファシリティワークス	400	947.00	378,800	
安藤・間	12,000	1,229.00	14,748,000	
東急建設	6,200	810.00	5,022,000	
コムシスホールディングス	6,600	3,321.00	21,918,600	
ピーアールホールディングス	3,700	377.00	1,394,900	
高松コンストラクショングループ	1,500	2,716.00	4,074,000	
東建コーポレーション	600	9,590.00	5,754,000	
ソネック	200	925.00	185,000	
ヤマウラ	1,000	1,500.00	1,500,000	
オリエンタル白石	7,400	384.00	2,841,600	
大成建設	13,600	4,796.00	65,225,600	
大林組	51,900	1,418.50	73,620,150	
清水建設	41,100	893.40	36,718,740	
飛鳥建設	1,400	1,470.00	2,058,000	
長谷工コーポレーション	13,300	1,878.00	24,977,400	
松井建設	1,400	875.00	1,225,000	
銭高組	100	4,155.00	415,500	
鹿島建設	32,200	2,788.50	89,789,700	
不動テトラ	1,100	2,211.00	2,432,100	
大末建設	400	1,636.00	654,400	
鉄建建設	1,000	2,471.00	2,471,000	
西松建設	2,700	4,570.00	12,339,000	
三井住友建設	11,100	429.00	4,761,900	
大豊建設	500	3,200.00	1,600,000	
佐田建設	600	717.00	430,200	
ナカノフドー建設	800	645.00	516,000	
奥村組	2,300	5,050.00	11,615,000	
東鉄工業	1,900	3,040.00	5,776,000	
イチケン	300	2,428.00	728,400	
富士ビー・エス	400	454.00	181,600	
浅沼組	1,100	4,165.00	4,581,500	
戸田建設	19,600	960.30	18,821,880	
熊谷組	2,400	3,845.00	9,228,000	
北野建設	200	3,090.00	618,000	

植木組	400	1,817.00	726,800	
矢作建設工業	1,900	1,598.00	3,036,200	
ピーエス三菱	2,100	1,052.00	2,209,200	
日本ハウスホールディングス	3,400	307.00	1,043,800	
大東建託	5,300	17,175.00	91,027,500	
新日本建設	2,300	1,242.00	2,856,600	
東亜道路工業	600	6,460.00	3,876,000	
日本道路	1,500	2,022.00	3,033,000	
東亜建設工業	1,100	4,655.00	5,120,500	
日本国土開発	4,400	522.00	2,296,800	
若築建設	500	3,140.00	1,570,000	
東洋建設	3,800	1,316.00	5,000,800	
五洋建設	20,500	762.10	15,623,050	
世紀東急工業	2,000	1,936.00	3,872,000	
福田組	600	5,330.00	3,198,000	
日本ドライケミカル	300	2,633.00	789,900	
住友林業	12,500	4,083.00	51,037,500	
日本基礎技術	800	452.00	361,600	
巴コーポレーション	1,500	660.00	990,000	
大和ハウス工業	40,200	4,342.00	174,548,400	
ライト工業	2,900	1,883.00	5,460,700	
積水ハウス	44,100	3,290.00	145,089,000	
日特建設	1,300	1,161.00	1,509,300	
北陸電気工事	900	1,248.00	1,123,200	
ユアテック	3,400	1,263.00	4,294,200	
日本リーテック	1,300	1,260.00	1,638,000	
四電工	700	3,995.00	2,796,500	
中電工	2,200	2,957.00	6,505,400	
関電工	9,000	1,566.00	14,094,000	
きんでん	10,200	2,620.00	26,724,000	
東京エネシス	1,700	1,156.00	1,965,200	
トーエネック	500	5,380.00	2,690,000	
住友電設	1,400	3,105.00	4,347,000	
日本電設工業	2,700	2,090.00	5,643,000	
エクシオグループ	7,100	3,124.00	22,180,400	
新日本空調	800	2,851.00	2,280,800	
九電工	3,100	5,559.00	17,232,900	
三機工業	3,100	1,931.00	5,986,100	
日揮ホールディングス	14,300	1,398.50	19,998,550	
中外炉工業	400	2,826.00	1,130,400	
ヤマト	800	981.00	784,800	
太平電業	900	4,290.00	3,861,000	
高砂熱学工業	3,900	4,370.00	17,043,000	
三晃金属工業	100	4,990.00	499,000	
N E C ネットズエスアイ	5,700	2,400.00	13,680,000	
朝日工業社	600	3,050.00	1,830,000	
明星工業	2,600	1,227.00	3,190,200	
大気社	1,700	4,840.00	8,228,000	

ダイダン	1,800	1,816.00	3,268,800	
日比谷総合設備	1,000	2,563.00	2,563,000	
ニッポン	4,300	2,375.00	10,212,500	
日清製粉グループ本社	13,400	2,124.00	28,461,600	
日東富士製粉	300	5,300.00	1,590,000	
昭和産業	1,400	3,420.00	4,788,000	
鳥越製粉	1,100	723.00	795,300	
中部飼料	2,300	1,261.00	2,900,300	
フィード・ワン	2,200	1,042.00	2,292,400	
東洋精糖	200	2,698.00	539,600	
日本甜菜製糖	900	2,122.00	1,909,800	
D M三井製糖ホールディングス	1,400	3,245.00	4,543,000	
塩水港精糖	1,400	311.00	435,400	
ウェルネオシュガー	800	2,257.00	1,805,600	
L I F U L L	6,000	167.00	1,002,000	
M I X I	3,200	2,411.00	7,715,200	
ジェイエイシーリクルートメント	5,600	753.00	4,216,800	
日本M & A センターホールディングス	24,100	1,045.50	25,196,550	
メンバーズ	600	939.00	563,400	
中広	500	407.00	203,500	
U T グループ	2,000	3,380.00	6,760,000	
アイティメディア	700	1,966.00	1,376,200	
ケアネット	2,700	685.00	1,849,500	
E ・ J ホールディングス	800	1,682.00	1,345,600	
オープンアップグループ	4,500	2,197.00	9,886,500	
コシダカホールディングス	4,500	911.00	4,099,500	
アルトナー	300	2,527.00	758,100	
パソナグループ	1,800	2,742.00	4,935,600	
C D S	300	1,705.00	511,500	
リンクアンドモチベーション	4,400	612.00	2,692,800	
エス・エム・エス	5,300	2,575.00	13,647,500	
サニーサイドアップグループ	300	670.00	201,000	
パーソルホールディングス	154,700	221.80	34,312,460	
リニカル	600	461.00	276,600	
クックパッド	4,500	131.00	589,500	
エスクリ	300	315.00	94,500	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	400	720.00	288,000	
森永製菓	6,200	2,701.00	16,746,200	
中村屋	400	3,135.00	1,254,000	
江崎グリコ	4,200	4,668.00	19,605,600	
名糖産業	600	1,845.00	1,107,000	
井村屋グループ	900	2,463.00	2,216,700	
不二家	1,100	2,510.00	2,761,000	
山崎製パン	9,700	3,821.00	37,063,700	
第一屋製パン	500	689.00	344,500	
モロゾフ	500	4,145.00	2,072,500	
亀田製菓	800	4,400.00	3,520,000	
寿スピリッツ	6,800	1,952.50	13,277,000	

カルビー	6,600	3,149.00	20,783,400	
森永乳業	5,100	3,182.00	16,228,200	
六甲バター	1,200	1,382.00	1,658,400	
ヤクルト本社	20,800	3,164.00	65,811,200	
明治ホールディングス	17,900	3,418.00	61,182,200	
雪印メグミルク	3,500	2,259.00	7,906,500	
プリマハム	1,900	2,298.00	4,366,200	
日本ハム	6,300	5,258.00	33,125,400	
林兼産業	300	567.00	170,100	
丸大食品	1,400	1,664.00	2,329,600	
S F o o d s	1,600	3,195.00	5,112,000	
柿安本店	500	2,631.00	1,315,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	2,200	4,200.00	9,240,000	
学情	800	1,858.00	1,486,400	
スタジオアリス	900	2,060.00	1,854,000	
クロスキャット	1,000	1,210.00	1,210,000	
エプロ	500	920.00	460,000	
システナ	23,400	285.00	6,669,000	
N J S	400	2,717.00	1,086,800	
デジタルアーツ	1,000	4,710.00	4,710,000	
日鉄ソリューションズ	2,500	4,970.00	12,425,000	
総合警備保障	25,300	812.40	20,553,720	
キューブシステム	1,000	1,119.00	1,119,000	
いちご	16,500	405.00	6,682,500	
日本駐車場開発	14,900	181.00	2,696,900	
コア	700	1,839.00	1,287,300	
カカクコム	10,000	1,739.50	17,395,000	
アイロムグループ	700	1,835.00	1,284,500	
セントケア・ホールディング	1,300	933.00	1,212,900	
サイネックス	400	845.00	338,000	
ルネサンス	1,400	1,092.00	1,528,800	
ディップ	2,400	2,700.00	6,480,000	
S B Sホールディングス	1,300	2,407.00	3,129,100	
デジタルホールディングス	800	1,160.00	928,000	
新日本科学	1,400	1,641.00	2,297,400	
キャリアデザインセンター	300	1,782.00	534,600	
ベネフィット・ワン	5,200	2,169.00	11,278,800	
エムスリー	30,100	2,100.00	63,210,000	
ツカダ・グローバルホールディング	1,100	405.00	445,500	
プラス	200	676.00	135,200	
アウトソーシング	9,700	1,732.50	16,805,250	
ウェルネット	1,100	539.00	592,900	
ワールドホールディングス	600	2,500.00	1,500,000	
ディー・エヌ・エー	5,600	1,257.50	7,042,000	
博報堂D Yホールディングス	19,300	1,445.00	27,888,500	
ぐるなび	3,100	303.00	939,300	
タカミヤ	2,300	524.00	1,205,200	
ファンコミュニケーションズ	2,100	406.00	852,600	

ライク	700	1,567.00	1,096,900	
A o b a - B B T	600	391.00	234,600	
エスプール	4,600	315.00	1,449,000	
W D Bホールディングス	900	2,317.00	2,085,300	
手間いらず	300	2,900.00	870,000	
ティア	1,100	468.00	514,800	
C D G	100	1,269.00	126,900	
アドウェイズ	2,300	467.00	1,074,100	
バリューコマース	1,400	1,161.00	1,625,400	
インフォマート	15,600	392.00	6,115,200	
サッポロホールディングス	4,800	6,729.00	32,299,200	
アサヒグループホールディングス	33,700	5,325.00	179,452,500	
麒麟ホールディングス	60,800	2,150.50	130,750,400	
宝ホールディングス	9,900	1,193.00	11,810,700	
オエノンホールディングス	4,700	349.00	1,640,300	
養命酒製造	600	1,868.00	1,120,800	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	11,400	1,949.50	22,224,300	
ライフドリンク カンパニー	200	5,010.00	1,002,000	
サントリー食品インターナショナル	10,300	4,822.00	49,666,600	
ダイドーグループホールディングス	1,600	3,045.00	4,872,000	
伊藤園	4,900	4,226.00	20,707,400	
キーコーヒー	1,600	2,052.00	3,283,200	
ユニカフェ	400	906.00	362,400	
ジャパンフーズ	100	1,405.00	140,500	
日清オイリオグループ	2,000	5,000.00	10,000,000	
不二製油グループ本社	3,400	2,382.50	8,100,500	
かどや製油	100	3,850.00	385,000	
J - オイルミルズ	1,700	1,936.00	3,291,200	
ローソン	3,300	10,255.00	33,841,500	
サンエー	1,200	4,545.00	5,454,000	
カワチ薬品	1,200	2,744.00	3,292,800	
エービーシー・マート	6,800	2,531.50	17,214,200	
ハードオフコーポレーション	600	1,766.00	1,059,600	
高千穂交易	400	3,930.00	1,572,000	
アスクル	3,200	2,049.00	6,556,800	
ゲオホールディングス	1,600	2,025.00	3,240,000	
アダストリア	1,900	3,485.00	6,621,500	
ジーフット	500	300.00	150,000	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	100	746.00	74,600	
オルパヘルスケアホールディングス	200	1,852.00	370,400	
伊藤忠食品	300	7,710.00	2,313,000	
くら寿司	1,800	4,035.00	7,263,000	
キャンドゥ	600	2,723.00	1,633,800	
エレマテック	1,500	1,799.00	2,698,500	
I Kホールディングス	800	380.00	304,000	
パルグループホールディングス	3,000	2,224.00	6,672,000	
エディオン	6,100	1,497.00	9,131,700	
あらた	2,400	3,170.00	7,608,000	

サーラコーポレーション	3,200	813.00	2,601,600	
ワッツ	700	613.00	429,100	
トーメンデバイス	200	5,110.00	1,022,000	
ハローズ	700	4,290.00	3,003,000	
J Pホールディングス	3,800	475.00	1,805,000	
フジオフードグループ本社	1,700	1,365.00	2,320,500	
あみやき亭	400	4,345.00	1,738,000	
東京エレクトロン デバイス	1,600	6,770.00	10,832,000	
ひらまつ	2,800	253.00	708,400	
円谷フィールズホールディングス	2,600	1,598.00	4,154,800	
双日	17,400	3,773.00	65,650,200	
アルフレッサ ホールディングス	15,700	2,319.00	36,408,300	
大黒天物産	500	8,670.00	4,335,000	
ハニーズホールディングス	1,400	1,612.00	2,256,800	
ファーマライズホールディングス	200	652.00	130,400	
キッコーマン	9,700	9,261.00	89,831,700	
味の素	34,700	5,788.00	200,843,600	
ブルドックソース	800	2,130.00	1,704,000	
キューピー	7,800	2,723.50	21,243,300	
ハウス食品グループ本社	5,000	3,140.00	15,700,000	
カゴメ	6,200	3,582.00	22,208,400	
焼津水産化学工業	500	1,350.00	675,000	
アリアケジャパン	1,400	5,420.00	7,588,000	
ピエトロ	100	1,825.00	182,500	
エバラ食品工業	300	2,914.00	874,200	
やまみ	100	4,305.00	430,500	
ニチレイ	6,700	3,802.00	25,473,400	
横浜冷凍	4,200	1,065.00	4,473,000	
東洋水産	7,400	8,419.00	62,300,600	
イートアンドホールディングス	800	2,137.00	1,709,600	
大冷	100	1,934.00	193,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	600	1,224.00	734,400	
日清食品ホールディングス	15,400	4,474.00	68,899,600	
永谷園ホールディングス	700	2,227.00	1,558,900	
一正蒲鉾	300	744.00	223,200	
フジッコ	1,600	1,943.00	3,108,800	
ロック・フィールド	1,600	1,668.00	2,668,800	
日本たばこ産業	88,700	3,905.00	346,373,500	
ケンコーマヨネーズ	1,100	2,100.00	2,310,000	
わらべや日洋ホールディングス	900	2,835.00	2,551,500	
なとり	1,000	2,169.00	2,169,000	
イフジ産業	200	1,452.00	290,400	
ファーマフーズ	2,400	990.00	2,376,000	
北の達人コーポレーション	7,200	227.00	1,634,400	
ユーグレナ	8,900	631.00	5,615,900	
紀文食品	1,300	1,172.00	1,523,600	
ピククルスホールディングス	1,000	1,264.00	1,264,000	
スター・マイカ・ホールディングス	1,500	542.00	813,000	

S R Eホールディングス	600	3,460.00	2,076,000	
A Dワークスグループ	2,200	237.00	521,400	
片倉工業	1,300	1,826.00	2,373,800	
ゲンゼ	1,100	5,580.00	6,138,000	
ヒューリック	34,000	1,515.50	51,527,000	
神栄	100	1,662.00	166,200	
ラサ商事	500	1,797.00	898,500	
アルベン	1,200	1,995.00	2,394,000	
ハブ	400	724.00	289,600	
ラクーンホールディングス	1,400	696.00	974,400	
クオールホールディングス	2,100	1,646.00	3,456,600	
アルコニックス	2,000	1,388.00	2,776,000	
神戸物産	12,100	3,763.00	45,532,300	
ソリトンシステムズ	700	1,390.00	973,000	
ジンズホールディングス	1,000	3,820.00	3,820,000	
ビックカメラ	8,300	1,300.00	10,790,000	
D C Mホールディングス	8,200	1,399.00	11,471,800	
ベッパーフードサービス	2,800	147.00	411,600	
ハイパー	600	308.00	184,800	
M o n o t a R O	22,200	1,540.00	34,188,000	
東京一番フーズ	100	523.00	52,300	
D Dグループ	700	1,531.00	1,071,700	
あい ホールディングス	2,500	2,445.00	6,112,500	
ディーブイエックス	400	1,083.00	433,200	
きちりホールディングス	300	1,015.00	304,500	
J . フロント リテイリング	17,900	1,562.00	27,959,800	
ドトール・日レスホールディングス	2,700	2,082.00	5,621,400	
マツキヨココカラ&カンパニー	28,500	2,676.50	76,280,250	
ブロンコピリー	1,000	3,275.00	3,275,000	
Z O Z O	10,000	3,426.00	34,260,000	
トレジャー・ファクトリー	800	1,491.00	1,192,800	
物語コーポレーション	2,600	4,590.00	11,934,000	
三越伊勢丹ホールディングス	26,400	2,139.50	56,482,800	
東洋紡	6,300	1,087.00	6,848,100	
ユニチカ	5,600	158.00	884,800	
富士紡ホールディングス	700	4,475.00	3,132,500	
日清紡ホールディングス	11,200	1,248.50	13,983,200	
倉敷紡績	1,100	3,135.00	3,448,500	
ダイワボウホールディングス	6,900	2,674.00	18,450,600	
シキボウ	700	1,207.00	844,900	
日東紡績	1,900	5,400.00	10,260,000	
トヨタ紡織	6,200	2,428.00	15,053,600	
マクニカホールディングス	3,700	8,160.00	30,192,000	
H a m e e	500	1,095.00	547,500	
マーケットエンタープライズ	200	879.00	175,800	
ラクト・ジャパン	700	2,223.00	1,556,100	
ウエルシアホールディングス	8,100	2,647.50	21,444,750	
クリエイト S Dホールディングス	2,600	3,185.00	8,281,000	

グリムス	700	1,931.00	1,351,700	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,000	1,298.00	2,596,000	
八洲電機	1,500	1,334.00	2,001,000	
メディアスホールディングス	1,200	742.00	890,400	
レスターホールディングス	1,400	2,971.00	4,159,400	
ジオリーブグループ	400	1,332.00	532,800	
丸善ＣＨＩホールディングス	1,400	328.00	459,200	
大光	500	626.00	313,000	
ＯＣＨＩホールディングス	100	1,590.00	159,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	8,400	1,003.00	8,425,200	
黒谷	700	607.00	424,900	
ミサワ	500	626.00	313,000	
ティーライフ	200	1,402.00	280,400	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	200	852.00	170,400	
エー・ピーホールディングス	100	992.00	99,200	
三洋貿易	2,000	1,335.00	2,670,000	
チムニー	400	1,439.00	575,600	
シュッピン	1,300	1,043.00	1,355,900	
ビューティガレージ	600	2,249.00	1,349,400	
オイシックス・ラ・大地	2,000	1,379.00	2,758,000	
ウイン・パートナーズ	1,200	1,273.00	1,527,600	
ネクステージ	3,500	2,180.00	7,630,000	
ジョイフル本田	4,500	2,012.00	9,054,000	
鳥貴族ホールディングス	600	4,075.00	2,445,000	
ホットランド	1,300	1,830.00	2,379,000	
すかいらくホールディングス	21,400	2,186.50	46,791,100	
ＳＦＰホールディングス	1,000	2,093.00	2,093,000	
綿半ホールディングス	1,100	1,472.00	1,619,200	
日本毛織	4,100	1,352.00	5,543,200	
ダイトウボウ	1,000	91.00	91,000	
トーア紡コーポレーション	300	421.00	126,300	
ダイドーリミテッド	1,200	600.00	720,000	
ヨシックスホールディングス	200	2,831.00	566,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	4,500	997.00	4,486,500	
野村不動産ホールディングス	8,100	3,705.00	30,010,500	
三重交通グループホールディングス	3,500	604.00	2,114,000	
サムディ	2,300	2,496.00	5,740,800	
ディア・ライフ	2,600	926.00	2,407,600	
コーセーアールイー	500	894.00	447,000	
地主	1,100	2,111.00	2,322,100	
プレサンスコーポレーション	2,300	1,664.00	3,827,200	
フィル・カンパニー	500	930.00	465,000	
ＴＨＥグローバル社	400	453.00	181,200	
ハウスコム	400	966.00	386,400	
ＪＰＭＣ	1,000	1,228.00	1,228,000	
サンセイランディック	300	1,035.00	310,500	
エストラスト	100	656.00	65,600	
フージャースホールディングス	2,200	1,065.00	2,343,000	

オープンハウスグループ	5,300	4,907.00	26,007,100	
東急不動産ホールディングス	43,800	977.70	42,823,260	
飯田グループホールディングス	13,900	1,936.00	26,910,400	
イーランド	200	1,577.00	315,400	
ムゲンエステート	800	1,395.00	1,116,000	
帝国繊維	1,800	2,147.00	3,864,600	
日本コークス工業	14,200	117.00	1,661,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,000	602.00	602,000	
ミタチ産業	400	1,165.00	466,000	
B E E N O S	700	1,413.00	989,100	
あさひ	1,400	1,278.00	1,789,200	
日本調剤	1,200	1,441.00	1,729,200	
コスモス薬品	1,300	15,030.00	19,539,000	
シップヘルスケアホールディングス	5,600	2,197.50	12,306,000	
トーエル	500	799.00	399,500	
ソフトクリエイイトホールディングス	1,400	1,917.00	2,683,800	
セブン&アイ・ホールディングス	54,000	6,382.00	344,628,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	10,500	1,084.00	11,382,000	
明治電機工業	600	1,493.00	895,800	
ツルハホールディングス	3,300	11,045.00	36,448,500	
デリカフーズホールディングス	500	583.00	291,500	
スターティアホールディングス	200	1,573.00	314,600	
サンマルクホールディングス	1,400	2,208.00	3,091,200	
フェリシモ	400	925.00	370,000	
トリドールホールディングス	4,400	4,151.00	18,264,400	
帝人	14,200	1,252.50	17,785,500	
東レ	99,400	690.20	68,605,880	
クラレ	21,600	1,504.50	32,497,200	
旭化成	100,400	1,052.00	105,620,800	
T O K Y O B A S E	1,600	295.00	472,000	
稲葉製作所	800	1,511.00	1,208,800	
宮地エンジニアリンググループ	800	3,980.00	3,184,000	
トーカロ	4,400	1,667.00	7,334,800	
アルファ C o	400	1,625.00	650,000	
S U M C O	27,100	2,246.50	60,880,150	
川田テクノロジーズ	400	8,980.00	3,592,000	
R S T e c h n o l o g i e s	1,000	2,651.00	2,651,000	
ジェイテックコーポレーション	100	2,037.00	203,700	
信和	600	747.00	448,200	
ビーロッド	700	954.00	667,800	
ファーストブラザーズ	100	1,282.00	128,200	
A n d D o ホールディングス	1,000	1,101.00	1,101,000	
シーアールイー	800	1,323.00	1,058,400	
ケイアイスター不動産	700	3,725.00	2,607,500	
アグレ都市デザイン	200	1,634.00	326,800	
グッドコムアセット	1,400	752.00	1,052,800	
ジェイ・エス・ビー	800	2,750.00	2,200,000	
ロードスターキャピタル	700	2,192.00	1,534,400	

テンポイノベーション	500	917.00	458,500	
グローバル・リンク・マネジメント	100	2,978.00	297,800	
フェイスネットワーク	400	1,453.00	581,200	
霞ヶ関キャピタル	400	13,310.00	5,324,000	
住江織物	200	2,360.00	472,000	
日本フェルト	600	438.00	262,800	
イチカワ	200	1,727.00	345,400	
エコナックホールディングス	2,200	135.00	297,000	
日東製網	100	1,629.00	162,900	
芦森工業	200	2,763.00	552,600	
アツギ	500	598.00	299,000	
ウイルプラスホールディングス	100	976.00	97,600	
J Mホールディングス	1,100	2,437.00	2,680,700	
コメダホールディングス	3,800	2,749.00	10,446,200	
サッドラホールディングス	400	808.00	323,200	
アレンザホールディングス	1,100	1,145.00	1,259,500	
串カツ田中ホールディングス	500	1,771.00	885,500	
パロックジャパンリミテッド	1,000	823.00	823,000	
クスリのアオキホールディングス	4,500	3,050.00	13,725,000	
ダイニック	300	754.00	226,200	
共和レザー	700	826.00	578,200	
ピーバンドットコム	400	386.00	154,400	
力の源ホールディングス	600	1,687.00	1,012,200	
FOOD & LIFE COMPANIE	8,300	3,045.00	25,273,500	
アセンテック	400	617.00	246,800	
セーレン	2,800	2,450.00	6,860,000	
ソトー	400	693.00	277,200	
東海染工	300	824.00	247,200	
小松マテーレ	2,000	788.00	1,576,000	
ワコールホールディングス	3,000	3,638.00	10,914,000	
ホギメディカル	2,000	3,560.00	7,120,000	
クラウディアホールディングス	100	408.00	40,800	
T S Iホールディングス	4,900	697.00	3,415,300	
マツオカコーポレーション	400	1,543.00	617,200	
ワールド	2,100	1,978.00	4,153,800	
T I S	16,200	3,369.00	54,577,800	
テクミラホールディングス	800	470.00	376,000	
グリー	3,800	523.00	1,987,400	
G M Oペパボ	300	1,326.00	397,800	
コーエーテクモホールディングス	9,300	1,851.50	17,218,950	
三菱総合研究所	700	4,950.00	3,465,000	
バルテージ	900	270.00	243,000	
電算	200	1,511.00	302,200	
A G S	400	893.00	357,200	
ファインデックス	1,200	1,130.00	1,356,000	
ブレインパッド	1,200	1,398.00	1,677,600	
K L a b	3,700	365.00	1,350,500	
ポールトゥウィンホールディングス	3,000	520.00	1,560,000	

ネクソン	33,200	2,538.50	84,278,200	
アイスタイル	4,700	458.00	2,152,600	
エムアップホールディングス	2,100	1,030.00	2,163,000	
エイチーム	1,300	582.00	756,600	
エニグモ	2,200	349.00	767,800	
テクノスジャパン	900	606.00	545,400	
e n i s h	800	223.00	178,400	
コロブラ	5,600	585.00	3,276,000	
オルトプラス	500	139.00	69,500	
ブロードリーフ	6,900	580.00	4,002,000	
クロス・マーケティンググループ	700	585.00	409,500	
デジタルハーツホールディングス	900	1,052.00	946,800	
メディアドゥ	700	1,274.00	891,800	
じげん	4,900	529.00	2,592,100	
バイキューブ	2,100	325.00	682,500	
エンカレッジ・テクノロジー	500	634.00	317,000	
サイバーリンクス	600	821.00	492,600	
ディー・エル・イー	700	191.00	133,700	
フィックスターズ	1,800	1,819.00	3,274,200	
C A R T A H O L D I N G S	800	1,456.00	1,164,800	
オブティム	1,400	1,078.00	1,509,200	
セレス	800	1,643.00	1,314,400	
S H I F T	1,000	26,635.00	26,635,000	
特種東海製紙	700	3,810.00	2,667,000	
ティーガイア	1,500	2,126.00	3,189,000	
セック	200	5,450.00	1,090,000	
テクマトリックス	2,800	2,044.00	5,723,200	
プロシップ	700	1,470.00	1,029,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,800	2,263.00	8,599,400	
GMOペイメントゲートウェイ	3,000	8,504.00	25,512,000	
ザッパラス	200	433.00	86,600	
システムリサーチ	500	3,425.00	1,712,500	
インターネットイニシアティブ	7,100	2,925.00	20,767,500	
さくらインターネット	1,600	5,290.00	8,464,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	2,765.00	1,382,500	
S R Aホールディングス	800	3,955.00	3,164,000	
システムインテグレータ	800	436.00	348,800	
朝日ネット	1,800	636.00	1,144,800	
e B A S E	2,400	739.00	1,773,600	
アバントグループ	1,800	1,363.00	2,453,400	
アドソル日進	700	1,683.00	1,178,100	
ODKソリューションズ	600	602.00	361,200	
フリービット	700	1,637.00	1,145,900	
コムチュア	2,100	1,958.00	4,111,800	
アステリア	1,500	655.00	982,500	
アイル	700	3,690.00	2,583,000	
王子ホールディングス	61,700	554.50	34,212,650	
日本製紙	8,300	1,141.00	9,470,300	

三菱製紙	1,600	539.00	862,400	
北越コーポレーション	7,200	1,307.00	9,410,400	
中越パルプ工業	400	1,796.00	718,400	
巴川コーポレーション	100	840.00	84,000	
大王製紙	6,500	1,085.50	7,055,750	
阿波製紙	300	500.00	150,000	
マークラインズ	900	3,305.00	2,974,500	
メディカル・データ・ビジョン	1,800	583.00	1,049,400	
g u m i	2,300	399.00	917,700	
ショーケース	600	318.00	190,800	
モバイルファクトリー	400	747.00	298,800	
テラスカイ	700	1,562.00	1,093,400	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	900	1,900.00	1,710,000	
P C Iホールディングス	400	941.00	376,400	
アイビーシー	200	428.00	85,600	
ネオジャパン	700	1,100.00	770,000	
P R T I M E S	400	2,062.00	824,800	
ラクス	7,000	2,164.00	15,148,000	
ランドコンピュータ	600	872.00	523,200	
ダブルスタンダード	600	1,856.00	1,113,600	
オーブンドア	1,200	801.00	961,200	
マイネット	900	429.00	386,100	
アカツキ	700	2,461.00	1,722,700	
ベネフィットジャパン	200	1,252.00	250,400	
U b i c o mホールディングス	500	1,413.00	706,500	
カナミックネットワーク	2,200	517.00	1,137,400	
ノムラシステムコーポレーション	2,400	113.00	271,200	
レンゴー	13,400	1,006.00	13,480,400	
トーモク	800	2,315.00	1,852,000	
ザ・パックス	1,100	3,815.00	4,196,500	
チェンジホールディングス	3,300	1,517.00	5,006,100	
シンクロ・フード	800	716.00	572,800	
オークネット	600	2,086.00	1,251,600	
キャピタル・アセット・プランニング	100	754.00	75,400	
セグエグループ	300	2,000.00	600,000	
エイトレッド	200	1,443.00	288,600	
マクロミル	2,900	802.00	2,325,800	
ビーグリー	100	1,162.00	116,200	
オロ	600	2,747.00	1,648,200	
ユーザーローカル	600	2,343.00	1,405,800	
テモナ	500	234.00	117,000	
ニーズウェル	600	913.00	547,800	
マネーフォワード	3,300	5,749.00	18,971,700	
サインポスト	600	564.00	338,400	
レゾナック・ホールディングス	14,300	3,254.00	46,532,200	
住友化学	109,900	312.00	34,288,800	
住友精化	700	5,050.00	3,535,000	
日産化学	7,000	6,282.00	43,974,000	

ラサ工業	700	2,341.00	1,638,700	
クレハ	3,200	2,681.00	8,579,200	
多木化学	600	3,630.00	2,178,000	
テイカ	1,100	1,390.00	1,529,000	
石原産業	2,400	1,513.00	3,631,200	
片倉コープアグリ	300	1,063.00	318,900	
日本曹達	1,700	5,930.00	10,081,000	
東ソー	19,800	2,016.00	39,916,800	
トクヤマ	4,800	2,349.00	11,275,200	
セントラル硝子	1,500	2,884.00	4,326,000	
東亜合成	7,400	1,523.50	11,273,900	
大阪ソーダ	1,000	11,430.00	11,430,000	
関東電化工業	2,800	929.00	2,601,200	
Sun Asterisk	900	1,077.00	969,300	
デンカ	5,400	2,523.00	13,624,200	
イビデン	7,800	7,350.00	57,330,000	
信越化学工業	134,700	6,126.00	825,172,200	
日本カーバイド工業	500	1,845.00	922,500	
プラスアルファ・コンサルティング	800	2,537.00	2,029,600	
電算システムホールディングス	600	2,672.00	1,603,200	
堺化学工業	1,200	1,969.00	2,362,800	
第一稀元素化学工業	1,500	923.00	1,384,500	
エア・ウォーター	14,000	2,177.00	30,478,000	
日本酸素ホールディングス	14,400	4,124.00	59,385,600	
日本化学工業	600	2,158.00	1,294,800	
東邦アセチレン	1,500	406.00	609,000	
日本パーカライジング	6,500	1,266.00	8,229,000	
高圧ガス工業	2,500	882.00	2,205,000	
チタン工業	200	1,075.00	215,000	
四国化成ホールディングス	1,800	1,783.00	3,209,400	
戸田工業	400	1,679.00	671,600	
ステラ ケミファ	800	3,805.00	3,044,000	
保土谷化学工業	500	3,585.00	1,792,500	
日本触媒	2,100	5,669.00	11,904,900	
大日精化工業	1,000	2,754.00	2,754,000	
カネカ	3,700	3,691.00	13,656,700	
協和キリン	17,900	2,894.50	51,811,550	
Appier Group	5,000	1,896.00	9,480,000	
三菱瓦斯化学	11,000	2,625.00	28,875,000	
三井化学	12,200	4,051.00	49,422,200	
J S R	16,200	4,079.00	66,079,800	
東京応化工業	7,100	4,163.00	29,557,300	
大阪有機化学工業	1,300	2,985.00	3,880,500	
三菱ケミカルグループ	108,500	864.50	93,798,250	
K H ネオケム	2,200	2,280.00	5,016,000	
ビジョナル	1,100	9,370.00	10,307,000	
ダイセル	19,000	1,444.50	27,445,500	
住友ベークライト	2,100	8,125.00	17,062,500	

積水化学工業	29,800	2,085.50	62,147,900	
日本ゼオン	10,100	1,286.00	12,988,600	
アイカ工業	3,700	3,550.00	13,135,000	
U B E	7,000	2,573.00	18,011,000	
積水樹脂	2,200	2,531.00	5,568,200	
タキロンシーアイ	3,600	631.00	2,271,600	
旭有機材	1,000	4,125.00	4,125,000	
ニチバン	700	1,857.00	1,299,900	
リケンテクノス	3,100	965.00	2,991,500	
大倉工業	800	3,180.00	2,544,000	
積水化成品工業	2,600	463.00	1,203,800	
群栄化学工業	400	3,615.00	1,446,000	
タイガースポリマー	400	1,162.00	464,800	
ミライアル	400	1,471.00	588,400	
ダイキアクシス	700	698.00	488,600	
ダイキョーニシカワ	3,700	734.00	2,715,800	
竹本容器	700	769.00	538,300	
森六ホールディングス	700	2,761.00	1,932,700	
恵和	1,200	1,195.00	1,434,000	
日本化薬	11,300	1,297.00	14,656,100	
カーリットホールディングス	1,400	990.00	1,386,000	
ソルクシーズ	800	345.00	276,000	
C L ホールディングス	600	1,027.00	616,200	
プレステージ・インターナショナル	7,000	606.00	4,242,000	
フェイス	200	462.00	92,400	
プロトコーポレーション	1,600	1,310.00	2,096,000	
ハイマックス	500	1,398.00	699,000	
アミューズ	900	1,514.00	1,362,600	
野村総合研究所	32,900	4,082.00	134,297,800	
ドリームインキュベータ	500	3,080.00	1,540,000	
クイック	1,100	2,405.00	2,645,500	
T A C	300	191.00	57,300	
C E ホールディングス	400	545.00	218,000	
日本システム技術	400	3,370.00	1,348,000	
電通グループ	15,000	4,313.00	64,695,000	
インテージホールディングス	1,800	1,807.00	3,252,600	
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,124.00	562,000	
東邦システムサイエンス	400	1,268.00	507,200	
びあ	600	3,140.00	1,884,000	
イオンファンタジー	500	2,488.00	1,244,000	
ソースネクスト	6,100	138.00	841,800	
シーティーエス	1,800	732.00	1,317,600	
N E X Y Z . G r o u p	300	645.00	193,500	
インフォコム	1,900	2,257.00	4,288,300	
メディカルシステムネットワーク	1,400	625.00	875,000	
日本精化	1,000	2,635.00	2,635,000	
扶桑化学工業	1,500	4,605.00	6,907,500	
トリケミカル研究所	1,800	4,165.00	7,497,000	

シンプレクス・ホールディングス	2,300	2,552.00	5,869,600	
HEROZ	500	1,865.00	932,500	
ラクスル	3,500	1,083.00	3,790,500	
メルカリ	7,200	2,144.50	15,440,400	
I P S	400	2,318.00	927,200	
F I G	1,600	312.00	499,200	
システムサポート	600	1,934.00	1,160,400	
A D E K A	5,100	2,924.50	14,914,950	
日油	4,500	6,964.00	31,338,000	
ミヨシ油脂	200	1,249.00	249,800	
新日本理化	1,300	210.00	273,000	
ハリマ化成グループ	1,000	912.00	912,000	
イーソル	1,200	1,030.00	1,236,000	
東海ソフト	100	1,160.00	116,000	
ウイングアーク 1 s t	1,500	3,020.00	4,530,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン	400	1,169.00	467,600	
サーバーワークス	300	4,045.00	1,213,500	
東名	100	2,444.00	244,400	
ヴィッツ	200	758.00	151,600	
トビラシステムズ	500	850.00	425,000	
S a n s a n	4,800	1,514.00	7,267,200	
L i n k - U	100	684.00	68,400	
ギフトィ	1,400	1,519.00	2,126,600	
花王	33,600	5,641.00	189,537,600	
第一工業製薬	700	3,260.00	2,282,000	
石原ケミカル	700	1,914.00	1,339,800	
日華化学	200	890.00	178,000	
ニイタカ	200	1,910.00	382,000	
三洋化成工業	900	4,165.00	3,748,500	
メドレー	2,000	4,880.00	9,760,000	
ベース	600	3,605.00	2,163,000	
J M D C	2,600	3,700.00	9,620,000	
武田薬品工業	131,600	4,472.00	588,515,200	
アステラス製薬	130,400	1,685.00	219,724,000	
住友ファーマ	11,500	367.00	4,220,500	
塩野義製薬	18,700	7,144.00	133,592,800	
わかもと製薬	800	212.00	169,600	
日本新薬	3,900	4,950.00	19,305,000	
中外製薬	46,500	5,842.00	271,653,000	
科研製薬	2,500	3,584.00	8,960,000	
エーザイ	18,100	6,268.00	113,450,800	
理研ビタミン	1,300	2,388.00	3,104,400	
ロート製薬	14,400	2,943.00	42,379,200	
小野薬品工業	31,500	2,457.50	77,411,250	
久光製薬	3,300	4,030.00	13,299,000	
有機合成薬品工業	1,300	302.00	392,600	
持田製薬	1,700	3,190.00	5,423,000	
参天製薬	27,000	1,524.50	41,161,500	

扶桑薬品工業	500	2,206.00	1,103,000	
日本ケミファ	100	1,626.00	162,600	
ツムラ	4,600	2,762.00	12,705,200	
テルモ	41,400	5,608.00	232,171,200	
H．U．グループホールディングス	4,400	2,730.00	12,012,000	
キッセイ薬品工業	2,400	3,310.00	7,944,000	
生化学工業	2,500	758.00	1,895,000	
栄研化学	2,700	1,874.00	5,059,800	
鳥居薬品	800	4,040.00	3,232,000	
J C Rファーマ	5,300	927.00	4,913,100	
東和薬品	2,400	3,000.00	7,200,000	
富士製薬工業	1,200	1,771.00	2,125,200	
ゼリア新薬工業	2,000	2,178.00	4,356,000	
ソーせいグループ	4,800	1,439.00	6,907,200	
第一三共	129,500	4,924.00	637,658,000	
杏林製薬	3,200	1,784.00	5,708,800	
大幸薬品	3,200	338.00	1,081,600	
ダイト	1,300	1,993.00	2,590,900	
大塚ホールディングス	30,900	5,559.00	171,773,100	
大正製薬ホールディングス	3,300	8,594.00	28,360,200	
ベプチドリーム	7,100	1,614.00	11,459,400	
大日本塗料	1,500	1,088.00	1,632,000	
日本ペイントホールディングス	78,800	1,122.50	88,453,000	
関西ペイント	14,500	2,318.50	33,618,250	
神東塗料	2,000	126.00	252,000	
中国塗料	3,000	2,090.00	6,270,000	
日本特殊塗料	600	1,366.00	819,600	
藤倉化成	1,500	456.00	684,000	
太陽ホールディングス	2,600	3,145.00	8,177,000	
D I C	5,800	2,950.00	17,110,000	
サカタインクス	3,200	1,381.00	4,419,200	
a r t i e n c e	3,300	3,000.00	9,900,000	
T & K T O K A	1,600	1,409.00	2,254,400	
アルプス技研	1,500	2,941.00	4,411,500	
サニックス	2,300	302.00	694,600	
日本空調サービス	1,500	897.00	1,345,500	
オリエンタルランド	80,600	5,391.00	434,514,600	
フォーカスシステムズ	1,300	1,077.00	1,400,100	
ダスキン	3,400	3,379.00	11,488,600	
パーク 2 4	9,400	1,725.00	16,215,000	
明光ネットワークジャパン	1,700	731.00	1,242,700	
ファルコホールディングス	700	2,298.00	1,608,600	
クレスコ	1,300	1,927.00	2,505,100	
フジ・メディア・ホールディングス	14,200	1,940.00	27,548,000	
秀英予備校	100	308.00	30,800	
田谷	100	422.00	42,200	
ラウンドワン	14,200	694.00	9,854,800	
リゾートトラスト	6,600	2,535.50	16,734,300	

オービック	5,000	22,200.00	111,000,000	
ジャストシステム	2,200	2,575.00	5,665,000	
TDCソフト	1,400	2,116.00	2,962,400	
LINEヤフー	211,500	422.70	89,401,050	
ビー・エム・エル	1,800	2,744.00	4,939,200	
トレンドマイクロ	7,000	7,269.00	50,883,000	
IDホールディングス	1,000	1,645.00	1,645,000	
リソー教育	7,800	233.00	1,817,400	
日本オラクル	2,800	11,600.00	32,480,000	
早稲田アカデミー	900	1,628.00	1,465,200	
アルファシステムズ	400	3,500.00	1,400,000	
フューチャー	3,100	1,657.00	5,136,700	
CAC Holdings	700	1,800.00	1,260,000	
SBテクノロジー	700	2,130.00	1,491,000	
トーセ	200	712.00	142,400	
ユー・エス・エス	17,100	2,607.00	44,579,700	
オービックビジネスコンサルタント	2,100	6,939.00	14,571,900	
アイティフォー	2,100	1,398.00	2,935,800	
東京個別指導学院	1,700	449.00	763,300	
東計電算	400	3,505.00	1,402,000	
サイバーエージェント	33,600	1,052.00	35,347,200	
楽天グループ	130,500	749.70	97,835,850	
エクスネット	100	1,115.00	111,500	
クリーク・アンド・リバー社	700	1,937.00	1,355,900	
SBIグローバルアセットマネジメント	2,800	738.00	2,066,400	
テー・オー・ダブリュー	3,300	361.00	1,191,300	
大塚商会	7,400	6,478.00	47,937,200	
サイボウズ	2,000	2,029.00	4,058,000	
山田コンサルティンググループ	800	1,720.00	1,376,000	
セントラルスポーツ	500	2,445.00	1,222,500	
パラカ	600	1,974.00	1,184,400	
電通総研	1,800	5,540.00	9,972,000	
ACCESS	1,900	939.00	1,784,100	
デジタルガレージ	2,300	3,370.00	7,751,000	
EMシステムズ	2,300	745.00	1,713,500	
ウェザーニューズ	500	5,130.00	2,565,000	
CIJ	2,600	708.00	1,840,800	
ビジネスエンジニアリング	200	3,900.00	780,000	
日本エンタープライズ	500	123.00	61,500	
WOWOW	900	1,133.00	1,019,700	
スカラ	1,700	716.00	1,217,200	
インテリジェント ウェイブ	600	1,190.00	714,000	
フルキャストホールディングス	1,400	1,478.00	2,069,200	
エン・ジャパン	2,600	2,762.00	7,181,200	
セルソース	400	1,298.00	519,200	
あすか製薬ホールディングス	1,500	2,051.00	3,076,500	
サワイグループホールディングス	3,400	6,006.00	20,420,400	
富士フイルムホールディングス	27,600	9,367.00	258,529,200	

コニカミノルタ	33,200	470.80	15,630,560	
資生堂	31,000	4,148.00	128,588,000	
ライオン	19,400	1,320.00	25,608,000	
高砂香料工業	1,100	3,470.00	3,817,000	
マンダム	3,300	1,325.00	4,372,500	
ミルボン	2,000	3,418.00	6,836,000	
ファンケル	6,500	2,145.00	13,942,500	
コーセー	3,000	8,573.00	25,719,000	
コタ	1,300	1,590.00	2,067,000	
シーボン	100	1,484.00	148,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	7,600	1,462.50	11,115,000	
ノエビアホールディングス	1,300	5,230.00	6,799,000	
アジュバンホールディングス	300	942.00	282,600	
新日本製薬	900	1,738.00	1,564,200	
I - n e	300	2,158.00	647,400	
アクシージア	700	855.00	598,500	
エステー	1,300	1,562.00	2,030,600	
アグロ カネショウ	700	1,292.00	904,400	
コニシ	4,400	1,388.00	6,107,200	
長谷川香料	2,800	3,185.00	8,918,000	
小林製薬	4,300	6,101.00	26,234,300	
荒川化学工業	1,200	1,117.00	1,340,400	
メック	1,200	4,215.00	5,058,000	
日本高純度化学	400	2,747.00	1,098,800	
タカラバイオ	3,900	1,086.00	4,235,400	
J C U	1,600	4,135.00	6,616,000	
新田ゼラチン	700	674.00	471,800	
O A T アグリオ	300	1,700.00	510,000	
デクセリアルズ	3,700	5,850.00	21,645,000	
アース製薬	1,300	4,225.00	5,492,500	
北興化学工業	1,400	1,064.00	1,489,600	
大成ラミック	500	3,070.00	1,535,000	
クミアイ化学工業	6,200	829.00	5,139,800	
日本農薬	2,600	707.00	1,838,200	
富士興産	200	2,098.00	419,600	
ニチレキ	2,000	2,404.00	4,808,000	
コシロ化学工業	700	2,139.00	1,497,300	
ビーピー・カストロール	300	927.00	278,100	
富士石油	3,300	337.00	1,112,100	
M O R E S C O	400	1,442.00	576,800	
出光興産	82,400	926.80	76,368,320	
E N E O S ホールディングス	235,200	646.40	152,033,280	
コスモエネルギーホールディングス	4,400	6,548.00	28,811,200	
A N Y C O L O R	1,600	3,110.00	4,976,000	
テスホールディングス	3,600	453.00	1,630,800	
インフロニア・ホールディングス	16,700	1,497.00	24,999,900	
横浜ゴム	7,500	4,002.00	30,015,000	
T O Y O T I R E	8,500	2,891.00	24,573,500	

ブリヂストン	43,500	6,300.00	274,050,000	
住友ゴム工業	14,500	1,762.00	25,549,000	
藤倉コンポジット	700	1,429.00	1,000,300	
オカモト	700	4,855.00	3,398,500	
アキレス	1,000	1,478.00	1,478,000	
フコク	900	1,620.00	1,458,000	
ニッタ	1,500	3,715.00	5,572,500	
クリエートメディック	600	949.00	569,400	
住友理工	2,300	1,096.00	2,520,800	
三ツ星ベルト	1,800	4,920.00	8,856,000	
パンドー化学	2,100	1,725.00	3,622,500	
A G C	13,200	5,424.00	71,596,800	
日本板硝子	6,900	539.00	3,719,100	
石塚硝子	200	3,180.00	636,000	
有沢製作所	2,700	1,159.00	3,129,300	
日本山村硝子	300	1,485.00	445,500	
日本電気硝子	6,000	3,572.00	21,432,000	
オハラ	800	1,177.00	941,600	
住友大阪セメント	2,400	3,599.00	8,637,600	
太平洋セメント	8,800	3,195.00	28,116,000	
リソルホールディングス	100	5,960.00	596,000	
日本ヒューム	1,400	882.00	1,234,800	
日本コンクリート工業	2,900	454.00	1,316,600	
三谷セキサン	600	5,840.00	3,504,000	
アジアパイルホールディングス	2,000	790.00	1,580,000	
東海カーボン	13,600	1,021.00	13,885,600	
日本カーボン	800	5,420.00	4,336,000	
東洋炭素	1,100	7,170.00	7,887,000	
ノリタケカンパニーリミテド	800	8,030.00	6,424,000	
T O T O	9,800	3,728.00	36,534,400	
日本碍子	17,200	1,905.50	32,774,600	
日本特殊陶業	12,400	4,316.00	53,518,400	
ダントーホールディングス	600	950.00	570,000	
M A R U W A	500	30,900.00	15,450,000	
品川リフラクトリーズ	1,800	2,046.00	3,682,800	
黒崎播磨	300	13,820.00	4,146,000	
ヨータイ	800	1,451.00	1,160,800	
東京窯業	900	471.00	423,900	
ニッカトー	800	582.00	465,600	
フジインコーポレーテッド	4,000	3,320.00	13,280,000	
クニミネ工業	200	1,012.00	202,400	
エーアンドエーマテリアル	300	1,335.00	400,500	
ニチアス	3,700	3,775.00	13,967,500	
日本製鉄	68,500	3,610.00	247,285,000	
神戸製鋼所	30,700	2,048.50	62,888,950	
中山製鋼所	3,100	926.00	2,870,600	
合同製鐵	800	5,920.00	4,736,000	
J F E ホールディングス	42,500	2,351.00	99,917,500	

東京製鐵	4,200	1,690.00	7,098,000	
共英製鋼	1,700	2,291.00	3,894,700	
大和工業	2,900	8,480.00	24,592,000	
東京鐵鋼	700	5,260.00	3,682,000	
大阪製鐵	800	2,370.00	1,896,000	
淀川製鋼所	1,700	4,275.00	7,267,500	
中部鋼鈑	1,000	2,509.00	2,509,000	
丸一鋼管	4,600	4,046.00	18,611,600	
モリ工業	300	4,835.00	1,450,500	
大同特殊鋼	9,600	1,788.00	17,164,800	
日本高周波鋼業	100	595.00	59,500	
日本冶金工業	1,100	4,630.00	5,093,000	
山陽特殊製鋼	1,500	2,223.00	3,334,500	
愛知製鋼	900	3,530.00	3,177,000	
日本金属	100	852.00	85,200	
ミガロホールディングス	200	1,443.00	288,600	
大平洋金属	1,300	1,407.00	1,829,100	
新日本電工	8,000	302.00	2,416,000	
栗本鐵工所	700	3,340.00	2,338,000	
虹技	100	1,510.00	151,000	
日本鑄鉄管	300	1,153.00	345,900	
日本製鋼所	4,100	2,536.00	10,397,600	
三菱製鋼	1,000	1,444.00	1,444,000	
日亜鋼業	1,100	338.00	371,800	
日本精線	200	5,800.00	1,160,000	
エンビプロ・ホールディングス	800	497.00	397,600	
大紀アルミニウム工業所	1,800	1,235.00	2,223,000	
日本軽金属ホールディングス	4,500	1,728.00	7,776,000	
三井金属鉱業	4,400	4,423.00	19,461,200	
東邦亜鉛	1,100	1,078.00	1,185,800	
三菱マテリアル	10,900	2,619.00	28,547,100	
住友金属鉱山	17,700	4,153.00	73,508,100	
DOWAホールディングス	3,800	5,594.00	21,257,200	
古河機械金属	2,000	1,753.00	3,506,000	
エス・サイエンス	5,700	21.00	119,700	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,600	2,704.00	7,030,400	
東邦チタニウム	3,100	1,749.00	5,421,900	
UACJ	2,100	4,170.00	8,757,000	
CKサンエツ	400	3,895.00	1,558,000	
古河電気工業	5,100	2,822.00	14,392,200	
住友電気工業	57,200	2,148.50	122,894,200	
フジクラ	18,000	1,745.00	31,410,000	
SWCC	1,800	3,320.00	5,976,000	
タツタ電線	2,700	695.00	1,876,500	
カナレ電気	100	1,751.00	175,100	
平河ヒューテック	1,100	1,318.00	1,449,800	
いよぎんホールディングス	17,300	1,081.00	18,701,300	
しずおかフィナンシャルグループ	32,400	1,444.00	46,785,600	

ちゅうぎんフィナンシャルグループ	12,200	1,127.50	13,755,500	
楽天銀行	5,000	2,665.00	13,325,000	
京都フィナンシャルグループ	18,500	2,524.00	46,694,000	
リョービ	1,600	2,561.00	4,097,600	
アーレスティ	1,100	779.00	856,900	
A R Eホールディングス	5,700	1,962.00	11,183,400	
東洋製罐グループホールディングス	9,100	2,468.00	22,458,800	
ホッカホールディングス	900	1,839.00	1,655,100	
コロナ	1,100	974.00	1,071,400	
横河ブリッジホールディングス	2,400	2,739.00	6,573,600	
駒井ハルテック	300	2,087.00	626,100	
高田機工	100	3,445.00	344,500	
三和ホールディングス	15,300	2,587.00	39,581,100	
文化シャッター	4,100	1,585.00	6,498,500	
三協立山	1,900	891.00	1,692,900	
アルインコ	1,400	1,050.00	1,470,000	
東洋シャッター	600	732.00	439,200	
L I X I L	23,800	1,958.50	46,612,300	
日本ファイルコン	300	548.00	164,400	
ノーリツ	2,500	1,650.00	4,125,000	
長府製作所	1,600	2,096.00	3,353,600	
リンナイ	7,500	3,534.00	26,505,000	
ユニプレス	2,800	1,064.00	2,979,200	
ダイニチ工業	700	698.00	488,600	
日東精工	2,500	580.00	1,450,000	
三洋工業	100	3,585.00	358,500	
岡部	2,900	806.00	2,337,400	
ジーテクト	1,900	2,010.00	3,819,000	
東プレ	2,600	2,330.00	6,058,000	
高周波熱錬	2,300	1,075.00	2,472,500	
東京製綱	900	1,544.00	1,389,600	
サンコール	1,300	471.00	612,300	
モリテック スチール	900	264.00	237,600	
パイオラックス	2,000	2,708.00	5,416,000	
エイチワン	1,900	688.00	1,307,200	
日本発條	13,400	1,448.50	19,409,900	
中央発條	1,000	733.00	733,000	
アドバネクス	200	1,042.00	208,400	
三浦工業	6,200	2,939.00	18,221,800	
タクマ	5,000	1,887.00	9,435,000	
テクノプロ・ホールディングス	8,900	3,290.00	29,281,000	
アトラグループ	700	180.00	126,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	900	1,395.00	1,255,500	
K e e P e r 技研	900	6,620.00	5,958,000	
ファーストロジック	100	516.00	51,600	
三機サービス	300	1,376.00	412,800	
G u n o s y	1,100	700.00	770,000	
デザインワン・ジャパン	600	136.00	81,600	

イー・ガーディアン	600	1,376.00	825,600	
リブセンス	500	241.00	120,500	
ジャパンマテリアル	4,600	2,643.00	12,157,800	
ベクトル	1,800	1,256.00	2,260,800	
ウチヤマホールディングス	200	366.00	73,200	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,500	1,374.00	2,061,000	
キャリアリンク	500	2,652.00	1,326,000	
I B J	1,000	599.00	599,000	
アサンテ	900	1,684.00	1,515,600	
バリューHR	1,300	1,366.00	1,775,800	
M & Aキャピタルパートナーズ	1,200	2,493.00	2,991,600	
ライドオンエクスプレスホールディングス	800	1,066.00	852,800	
E R Iホールディングス	200	1,891.00	378,200	
アピスト	200	3,165.00	633,000	
シグマクシス・ホールディングス	2,000	1,657.00	3,314,000	
ウィルグループ	1,500	1,147.00	1,720,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,800	142.00	255,600	
メドピア	1,500	818.00	1,227,000	
レアジョブ	200	963.00	192,600	
リクルートホールディングス	112,800	5,890.00	664,392,000	
エラン	1,900	956.00	1,816,400	
ツガミ	3,200	1,154.00	3,692,800	
オークマ	1,300	7,192.00	9,349,600	
芝浦機械	1,500	3,455.00	5,182,500	
アマダ	23,800	1,630.50	38,805,900	
アイダエンジニアリング	3,400	838.00	2,849,200	
F U J I	7,000	2,625.50	18,378,500	
牧野フライス製作所	1,600	5,890.00	9,424,000	
オーエスジー	6,500	2,136.50	13,887,250	
ダイジェット工業	100	840.00	84,000	
旭ダイヤモンド工業	3,500	871.00	3,048,500	
D M G森精機	9,000	3,351.00	30,159,000	
ソディック	3,900	726.00	2,831,400	
ディスコ	7,200	44,100.00	317,520,000	
日東工器	800	1,935.00	1,548,000	
日進工具	1,300	1,005.00	1,306,500	
パンチ工業	1,000	428.00	428,000	
富士ダイス	600	680.00	408,000	
土木管理総合試験所	1,200	328.00	393,600	
日本郵政	179,000	1,406.00	251,674,000	
ベルシステム24ホールディングス	1,600	1,787.00	2,859,200	
鎌倉新書	1,100	576.00	633,600	
S M N	400	379.00	151,600	
一蔵	400	575.00	230,000	
グローバルキッズCOMPANY	400	630.00	252,000	
エアトリ	1,100	1,608.00	1,768,800	
アトラエ	900	490.00	441,000	
ストライク	700	5,180.00	3,626,000	

ソラスト	4,500	537.00	2,416,500	
セラク	600	1,144.00	686,400	
インソース	3,200	800.00	2,560,000	
豊田自動織機	12,600	14,615.00	184,149,000	
豊和工業	600	768.00	460,800	
石川製作所	300	1,228.00	368,400	
リケンN P R	1,700	2,863.00	4,867,100	
東洋機械金属	900	723.00	650,700	
津田駒工業	100	382.00	38,200	
エンシュウ	400	685.00	274,000	
島精機製作所	2,300	1,403.00	3,226,900	
オプトラン	2,400	1,845.00	4,428,000	
N C ホールディングス	300	1,565.00	469,500	
イワキポンプ	1,000	2,382.00	2,382,000	
フリュー	1,400	1,240.00	1,736,000	
ヤマシンフィルタ	3,800	358.00	1,360,400	
日阪製作所	1,700	984.00	1,672,800	
やまびこ	2,400	1,803.00	4,327,200	
野村マイクロ・サイエンス	500	14,510.00	7,255,000	
平田機工	700	7,600.00	5,320,000	
P E G A S U S	2,100	459.00	963,900	
マルマエ	800	1,869.00	1,495,200	
タツモ	900	3,785.00	3,406,500	
ナプテスコ	9,400	2,476.00	23,274,400	
三井海洋開発	2,000	2,934.00	5,868,000	
レオン自動機	1,800	1,428.00	2,570,400	
S M C	4,500	86,860.00	390,870,000	
ホソカワミクロン	1,000	4,240.00	4,240,000	
ユニオンツール	700	3,965.00	2,775,500	
瑞光	1,200	1,762.00	2,114,400	
オイレス工業	2,000	2,052.00	4,104,000	
日精エー・エス・ピー機械	600	4,405.00	2,643,000	
サトーホールディングス	2,100	2,262.00	4,750,200	
技研製作所	1,400	2,071.00	2,899,400	
日本エアーテック	900	1,155.00	1,039,500	
カワタ	300	1,062.00	318,600	
日精樹脂工業	1,000	1,140.00	1,140,000	
オカダアイヨン	400	2,889.00	1,155,600	
ワイエイシーホールディングス	400	2,326.00	930,400	
小松製作所	70,200	4,321.00	303,334,200	
住友重機械工業	8,800	4,553.00	40,066,400	
日立建機	5,900	4,229.00	24,951,100	
日工	2,300	771.00	1,773,300	
巴工業	600	3,795.00	2,277,000	
井関農機	1,500	1,009.00	1,513,500	
T O W A	1,700	7,770.00	13,209,000	
丸山製作所	200	2,331.00	466,200	
北川鉄工所	600	1,566.00	939,600	

シンニッタン	1,000	276.00	276,000	
ローツェ	800	20,260.00	16,208,000	
タカキタ	200	496.00	99,200	
クボタ	78,500	2,221.00	174,348,500	
荏原実業	800	3,120.00	2,496,000	
東洋エンジニアリング	2,100	826.00	1,734,600	
三菱化工機	600	3,755.00	2,253,000	
月島ホールディングス	1,900	1,320.00	2,508,000	
帝国電機製作所	1,000	2,747.00	2,747,000	
東京機械製作所	300	436.00	130,800	
新東工業	3,100	1,170.00	3,627,000	
澁谷工業	1,400	3,110.00	4,354,000	
アイチ コーポレーション	2,000	1,099.00	2,198,000	
小森コーポレーション	3,900	1,294.00	5,046,600	
鶴見製作所	1,100	3,365.00	3,701,500	
日本ギア工業	200	645.00	129,000	
酒井重工業	200	6,440.00	1,288,000	
荏原製作所	6,100	11,270.00	68,747,000	
石井鐵工所	100	2,758.00	275,800	
西島製作所	1,200	2,527.00	3,032,400	
北越工業	1,600	2,455.00	3,928,000	
ダイキン工業	17,900	21,450.00	383,955,000	
オルガノ	1,800	6,900.00	12,420,000	
トーヨーカネツ	500	4,475.00	2,237,500	
栗田工業	8,400	5,882.00	49,408,800	
椿本チエイン	2,100	4,705.00	9,880,500	
大同工業	400	746.00	298,400	
日機装	3,600	1,183.00	4,258,800	
木村化工機	1,200	712.00	854,400	
レイズネクスト	2,000	2,361.00	4,722,000	
アネスト岩田	2,300	1,333.00	3,065,900	
ダイフク	25,200	3,377.00	85,100,400	
サムコ	400	4,995.00	1,998,000	
加藤製作所	600	1,422.00	853,200	
油研工業	200	2,420.00	484,000	
タダノ	8,500	1,328.00	11,288,000	
フジテック	3,500	3,693.00	12,925,500	
C K D	4,100	2,789.00	11,434,900	
平和	4,400	2,092.00	9,204,800	
理想科学工業	1,200	3,230.00	3,876,000	
S A N K Y O	3,400	8,904.00	30,273,600	
日本金銭機械	1,800	1,423.00	2,561,400	
マースグループホールディングス	700	2,865.00	2,005,500	
フクシマガリレイ	1,000	5,790.00	5,790,000	
オーイズミ	900	411.00	369,900	
ダイコク電機	700	4,250.00	2,975,000	
竹内製作所	2,700	5,140.00	13,878,000	
アマノ	4,200	3,739.00	15,703,800	

J U K I	2,900	502.00	1,455,800	
サンデン	1,900	180.00	342,000	
ジャノメ	1,700	687.00	1,167,900	
ブラザー工業	20,000	2,479.00	49,580,000	
マックス	2,100	3,135.00	6,583,500	
モリタホールディングス	2,700	1,632.00	4,406,400	
グローリー	3,600	2,920.50	10,513,800	
新晃工業	1,500	3,145.00	4,717,500	
大和冷機工業	2,200	1,486.00	3,269,200	
セガサミーホールディングス	13,300	1,801.00	23,953,300	
T P R	1,900	2,113.00	4,014,700	
ツバキ・ナカシマ	3,200	780.00	2,496,000	
ホシザキ	8,800	5,313.00	46,754,400	
大豊工業	1,300	832.00	1,081,600	
日本精工	27,600	806.60	22,262,160	
N T N	32,100	294.80	9,463,080	
ジェイテクト	13,200	1,371.00	18,097,200	
不二越	1,100	3,385.00	3,723,500	
ミネベアミツミ	26,000	3,034.00	78,884,000	
日本トムソン	3,900	615.00	2,398,500	
T H K	8,600	3,194.00	27,468,400	
ユーシン精機	1,600	683.00	1,092,800	
前澤給装工業	1,100	1,291.00	1,420,100	
イーグル工業	1,600	1,779.00	2,846,400	
前澤工業	400	1,060.00	424,000	
日本ピラー工業	1,400	5,460.00	7,644,000	
キッツ	4,900	1,321.00	6,472,900	
日立製作所	72,000	12,265.00	883,080,000	
三菱電機	166,600	2,312.00	385,179,200	
富士電機	9,100	8,895.00	80,944,500	
東洋電機製造	300	1,070.00	321,000	
安川電機	16,200	5,616.00	90,979,200	
シンフォニアテクノロジー	1,600	2,565.00	4,104,000	
明電舎	2,700	2,672.00	7,214,400	
オリジン	300	1,218.00	365,400	
山洋電気	600	6,130.00	3,678,000	
デンヨー	1,100	2,318.00	2,549,800	
P H Cホールディングス	3,000	1,296.00	3,888,000	
K O K U S A I E L E C T R I C	5,800	4,650.00	26,970,000	
ソシオネクスト	10,800	3,811.00	41,158,800	
ベイカレント・コンサルティング	11,200	3,178.00	35,593,600	
O r c h e s t r a H o l d i n g s	400	1,131.00	452,400	
アイモバイル	2,400	466.00	1,118,400	
キャリアインデックス	600	180.00	108,000	
M S - J a p a n	500	1,194.00	597,000	
船場	100	1,259.00	125,900	
ジャパンエレベーターサービスホールディン	4,900	2,276.00	11,152,400	
フルテック	100	1,147.00	114,700	

グリーンズ	400	2,239.00	895,600	
ツナググループ・ホールディングス	400	810.00	324,000	
GameWith	700	307.00	214,900	
MS&Consulting	100	598.00	59,800	
ウェルビー	600	1,085.00	651,000	
エル・ティー・エス	200	2,765.00	553,000	
ミダックホールディングス	900	1,646.00	1,481,400	
キュービーネットホールディングス	900	1,342.00	1,207,800	
RPAホールディングス	2,200	263.00	578,600	
三櫻工業	2,400	1,051.00	2,522,400	
マキタ	17,100	3,878.00	66,313,800	
東芝テック	2,000	3,075.00	6,150,000	
芝浦メカトロニクス	800	6,600.00	5,280,000	
マブチモーター	7,300	2,735.50	19,969,150	
ニデック	33,000	5,792.00	191,136,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	600	362.00	217,200	
トレックス・セミコンダクター	800	1,876.00	1,500,800	
東光高岳	1,000	2,390.00	2,390,000	
ダブル・スコープ	4,600	774.00	3,560,400	
宮越ホールディングス	800	1,103.00	882,400	
ダイヘン	1,500	7,150.00	10,725,000	
ヤーマン	2,800	1,011.00	2,830,800	
JVCケンウッド	11,700	707.00	8,271,900	
ミマキエンジニアリング	1,500	1,010.00	1,515,000	
I - P E X	1,000	1,840.00	1,840,000	
大崎電気工業	3,700	677.00	2,504,900	
オムロン	11,400	5,721.00	65,219,400	
日東工業	2,000	4,265.00	8,530,000	
I D E C	2,300	2,869.00	6,598,700	
正興電機製作所	300	1,158.00	347,400	
不二電機工業	200	1,144.00	228,800	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,800	2,712.50	15,732,500	
サクサホールディングス	300	3,170.00	951,000	
メルコホールディングス	400	3,215.00	1,286,000	
テクノメディカ	500	1,774.00	887,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	600	684.00	410,400	
日本電気	19,700	9,754.00	192,153,800	
富士通	13,800	23,095.00	318,711,000	
沖電気工業	6,700	1,091.00	7,309,700	
岩崎通信機	600	644.00	386,400	
電気興業	700	2,108.00	1,475,600	
サンケン電気	1,400	7,780.00	10,892,000	
ナカヨ	300	1,161.00	348,300	
アイホン	800	2,824.00	2,259,200	
ルネサスエレクトロニクス	97,700	2,452.50	239,609,250	
セイコーエプソン	19,200	2,438.00	46,809,600	
ワコム	11,200	656.00	7,347,200	
アルバック	3,500	8,706.00	30,471,000	

アクセル	300	1,968.00	590,400	
E I Z O	1,100	5,060.00	5,566,000	
ジャパンディスプレイ	62,800	21.00	1,318,800	
日本信号	3,300	973.00	3,210,900	
京三製作所	3,500	460.00	1,610,000	
能美防災	2,000	2,235.00	4,470,000	
ホーチキ	1,200	2,249.00	2,698,800	
星和電機	400	517.00	206,800	
エレコム	3,500	1,623.00	5,680,500	
パナソニック ホールディングス	176,800	1,424.50	251,851,600	
シャープ	25,100	825.20	20,712,520	
アンリツ	10,500	1,168.00	12,264,000	
富士通ゼネラル	4,200	1,994.50	8,376,900	
ソニーグループ	104,900	13,315.00	1,396,743,500	
T D K	23,700	7,796.00	184,765,200	
帝国通信工業	700	1,899.00	1,329,300	
タムラ製作所	5,800	567.00	3,288,600	
アルプスアルパイン	13,300	1,051.50	13,984,950	
池上通信機	600	830.00	498,000	
日本電波工業	1,700	1,364.00	2,318,800	
鈴木	1,000	1,161.00	1,161,000	
メイコー	1,500	4,560.00	6,840,000	
日本トリム	400	3,200.00	1,280,000	
ローランド ディー . ジー .	900	5,020.00	4,518,000	
フォスター電機	1,000	1,088.00	1,088,000	
S M K	400	2,437.00	974,800	
ヨコオ	1,300	1,581.00	2,055,300	
ティアック	3,000	99.00	297,000	
ホシデン	3,500	1,986.00	6,951,000	
ヒロセ電機	2,200	16,090.00	35,398,000	
日本航空電子工業	3,500	2,681.00	9,383,500	
T O A	1,800	1,129.00	2,032,200	
マクセル	3,300	1,585.00	5,230,500	
古野電気	1,900	2,153.00	4,090,700	
スミダコーポレーション	1,900	1,203.00	2,285,700	
アイコム	600	3,480.00	2,088,000	
リオン	600	2,700.00	1,620,000	
横河電機	16,300	3,037.00	49,503,100	
新電元工業	500	3,085.00	1,542,500	
アズビル	10,200	4,574.00	46,654,800	
東亜ディーケーケー	500	1,020.00	510,000	
日本光電工業	6,300	4,149.00	26,138,700	
チノー	600	2,327.00	1,396,200	
共和電業	700	425.00	297,500	
日本電子材料	1,000	1,988.00	1,988,000	
堀場製作所	2,800	13,945.00	39,046,000	
アドバンテスト	42,500	6,727.00	285,897,500	
小野測器	600	577.00	346,200	

エスベック	1,200	2,719.00	3,262,800	
キーエンス	14,800	69,040.00	1,021,792,000	
日置電機	700	6,900.00	4,830,000	
シスメックス	12,800	7,989.00	102,259,200	
日本マイクロニクス	2,600	5,990.00	15,574,000	
メガチップス	1,200	4,245.00	5,094,000	
O B A R A G R O U P	800	3,720.00	2,976,000	
I M A G I C A G R O U P	1,600	716.00	1,145,600	
澤藤電機	100	1,299.00	129,900	
デンソー	122,300	2,704.50	330,760,350	
原田工業	600	760.00	456,000	
コーセル	1,700	1,525.00	2,592,500	
イリソ電子工業	1,300	3,140.00	4,082,000	
オブテックスグループ	2,800	1,837.00	5,143,600	
千代田インテグレ	600	2,647.00	1,588,200	
レーザーテック	6,800	39,770.00	270,436,000	
スタンレー電気	9,500	2,572.50	24,438,750	
ウシオ電機	7,500	2,025.50	15,191,250	
岡谷電機産業	1,300	276.00	358,800	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,100	548.00	602,800	
エノモト	400	1,597.00	638,800	
日本セラミック	1,300	2,594.00	3,372,200	
遠藤照明	300	1,519.00	455,700	
古河電池	1,200	963.00	1,155,600	
双信電機	900	296.00	266,400	
山一電機	1,300	2,201.00	2,861,300	
図研	1,300	4,390.00	5,707,000	
日本電子	3,700	6,454.00	23,879,800	
カシオ計算機	10,600	1,192.50	12,640,500	
ファナック	72,300	4,218.00	304,961,400	
日本シイエムケイ	3,300	607.00	2,003,100	
エンプラス	400	8,730.00	3,492,000	
大真空	2,100	882.00	1,852,200	
ローム	27,400	2,645.50	72,486,700	
浜松ホトニクス	11,900	5,400.00	64,260,000	
三井ハイテック	1,300	8,041.00	10,453,300	
新光電気工業	5,200	5,500.00	28,600,000	
京セラ	92,100	2,215.50	204,047,550	
協栄産業	100	2,995.00	299,500	
太陽誘電	7,200	3,389.00	24,400,800	
村田製作所	134,900	2,957.50	398,966,750	
双葉電子工業	2,900	519.00	1,505,100	
日東電工	9,500	13,850.00	131,575,000	
北陸電気工業	300	1,396.00	418,800	
東海理化電機製作所	4,100	2,350.00	9,635,000	
ニチコン	3,800	1,227.00	4,662,600	
日本ケミコン	1,700	1,351.00	2,296,700	
K O A	2,300	1,511.00	3,475,300	

三井 E & S	7,600	1,155.00	8,778,000	
日立造船	13,100	1,082.00	14,174,200	
三菱重工業	26,200	11,480.00	300,776,000	
川崎重工業	12,100	3,888.00	47,044,800	
I H I	11,100	3,146.00	34,920,600	
名村造船所	3,200	1,803.00	5,769,600	
サノヤスホールディングス	1,400	149.00	208,600	
スプリックス	300	804.00	241,200	
マネジメントソリューションズ	700	2,990.00	2,093,000	
プロレド・パートナーズ	600	356.00	213,600	
a n d f a c t o r y	300	318.00	95,400	
テノ・ホールディングス	300	522.00	156,600	
フロンティア・マネジメント	300	1,880.00	564,000	
ピアラ	200	322.00	64,400	
コプロ・ホールディングス	400	1,776.00	710,400	
ギークス	400	475.00	190,000	
アンビスホールディングス	1,600	2,605.00	4,168,000	
カーブスホールディングス	4,000	739.00	2,956,000	
フォーラムエンジニアリング	1,800	962.00	1,731,600	
F a s t F i t n e s s J a p a n	500	1,008.00	504,000	
日本車輛製造	400	2,309.00	923,600	
三菱ロジスネクスト	2,500	1,466.00	3,665,000	
近畿車輛	100	2,389.00	238,900	
一家ホールディングス	400	702.00	280,800	
フルサト・マルカホールディングス	1,500	2,251.00	3,376,500	
ヤマエグループホールディングス	900	2,517.00	2,265,300	
ジャパングラフトホールディングス	600	168.00	100,800	
F P G	4,900	1,842.00	9,025,800	
島根銀行	700	521.00	364,700	
じもとホールディングス	500	546.00	273,000	
全国保証	3,800	5,501.00	20,903,800	
めぶきフィナンシャルグループ	72,200	439.10	31,703,020	
ジャパンインベストメントアドバイザー	2,600	898.00	2,334,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,800	4,115.00	7,407,000	
九州フィナンシャルグループ	28,100	964.70	27,108,070	
かんぽ生命保険	14,800	2,678.50	39,641,800	
ゆうちょ銀行	160,400	1,536.00	246,374,400	
あんしん保証	1,300	256.00	332,800	
富山第一銀行	4,500	868.00	3,906,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	78,200	729.00	57,007,800	
ジェイリース	300	2,644.00	793,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	8,200	1,623.00	13,308,600	
イントラスト	400	808.00	323,200	
日本モーゲージサービス	600	532.00	319,200	
C a s a	300	824.00	247,200	
S B I アルヒ	1,300	906.00	1,177,800	
プレミアグループ	2,400	1,774.00	4,257,600	
日産自動車	200,200	566.20	113,353,240	

いすゞ自動車	43,100	2,153.50	92,815,850	
トヨタ自動車	814,100	3,414.00	2,779,337,400	
日野自動車	22,100	473.10	10,455,510	
三菱自動車工業	57,600	451.70	26,017,920	
エフテック	800	705.00	564,000	
レシップホールディングス	400	639.00	255,600	
G M B	100	1,180.00	118,000	
ファルテック	100	538.00	53,800	
武蔵精密工業	3,600	1,622.00	5,839,200	
日産車体	1,700	972.00	1,652,400	
新明和工業	4,400	1,191.00	5,240,400	
極東開発工業	2,500	2,371.00	5,927,500	
トピー工業	1,200	2,928.00	3,513,600	
ティラド	300	3,850.00	1,155,000	
曙ブレーキ工業	11,400	114.00	1,299,600	
タチエス	2,600	2,014.00	5,236,400	
N O K	5,700	2,088.00	11,901,600	
フタバ産業	4,300	1,033.00	4,441,900	
カヤバ	1,400	4,915.00	6,881,000	
市光工業	2,500	532.00	1,330,000	
大同メタル工業	3,200	553.00	1,769,600	
プレス工業	6,000	654.00	3,924,000	
ミクニ	1,300	463.00	601,900	
太平洋工業	3,500	1,456.00	5,096,000	
河西工業	1,100	242.00	266,200	
アイシン	11,400	5,457.00	62,209,800	
マツダ	49,000	1,732.00	84,868,000	
今仙電機製作所	1,000	669.00	669,000	
本田技研工業	361,500	1,748.00	631,902,000	
スズキ	27,200	6,579.00	178,948,800	
S U B A R U	45,900	3,359.00	154,178,100	
安永	300	744.00	223,200	
ヤマハ発動機	64,000	1,382.50	88,480,000	
小糸製作所	15,300	1,971.50	30,163,950	
T B K	1,000	398.00	398,000	
エクセディ	2,500	2,883.00	7,207,500	
ミツバ	2,700	1,334.00	3,601,800	
豊田合成	4,300	2,956.50	12,712,950	
愛三工業	2,400	1,457.00	3,496,800	
盟和産業	100	1,026.00	102,600	
日本プラスト	600	517.00	310,200	
ヨロズ	1,400	935.00	1,309,000	
エフ・シー・シー	2,600	2,116.00	5,501,600	
新家工業	100	3,575.00	357,500	
シマノ	6,000	20,245.00	121,470,000	
テイ・エス テック	5,200	1,961.50	10,199,800	
三十三フィナンシャルグループ	1,300	1,932.00	2,511,600	
第四北越フィナンシャルグループ	2,300	4,215.00	9,694,500	

ひろぎんホールディングス	20,700	1,037.00	21,465,900	
マーキュリアホールディングス	400	758.00	303,200	
おきなわフィナンシャルグループ	1,200	2,453.00	2,943,600	
ダイレクトマーケティングミックス	2,100	339.00	711,900	
ポピンズ	200	1,437.00	287,400	
L I T A L I C O	1,100	2,125.00	2,337,500	
コンフィデンス・インターワークス	100	1,660.00	166,000	
十六フィナンシャルグループ	1,900	4,250.00	8,075,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,500	4,710.00	7,065,000	
ネットプロテクションズホールディングス	5,500	195.00	1,072,500	
プロクレアホールディングス	1,700	1,831.00	3,112,700	
F P パートナー	300	6,880.00	2,064,000	
あいちフィナンシャルグループ	2,200	2,615.00	5,753,000	
ジャムコ	500	1,368.00	684,000	
小野建	1,700	1,762.00	2,995,400	
はるやまホールディングス	500	598.00	299,000	
南陽	200	2,458.00	491,600	
ノジマ	4,500	1,660.00	7,470,000	
佐島電機	800	2,563.00	2,050,400	
カップ・クリエイト	2,400	1,668.00	4,003,200	
エコートレーディング	100	1,263.00	126,300	
伯東	900	5,950.00	5,355,000	
コンドーテック	1,100	1,215.00	1,336,500	
中山福	1,000	365.00	365,000	
ライトオン	900	413.00	371,700	
ナガイレーベン	1,900	2,364.00	4,491,600	
三菱食品	1,400	5,030.00	7,042,000	
良品計画	17,100	2,325.00	39,757,500	
パリミキホールディングス	1,400	427.00	597,800	
松田産業	1,300	2,400.00	3,120,000	
第一興商	6,000	1,915.50	11,493,000	
メディカルホールディングス	16,200	2,370.50	38,402,100	
アドヴァングループ	1,600	1,166.00	1,865,600	
S P K	800	2,058.00	1,646,400	
萩原電気ホールディングス	700	4,930.00	3,451,000	
アルビス	600	2,631.00	1,578,600	
アズワン	2,400	5,289.00	12,693,600	
スズデン	500	2,217.00	1,108,500	
尾家産業	300	1,718.00	515,400	
シモジマ	1,200	1,278.00	1,533,600	
ドウシシャ	1,500	2,128.00	3,192,000	
小津産業	200	1,675.00	335,000	
コナカ	1,300	413.00	536,900	
高速	900	2,412.00	2,170,800	
ハウス オブ ローゼ	100	1,628.00	162,800	
G - 7ホールディングス	1,700	1,439.00	2,446,300	
たけびし	700	1,974.00	1,381,800	
イオン北海道	4,500	930.00	4,185,000	

コジマ	2,900	752.00	2,180,800	
ヒマラヤ	300	943.00	282,900	
コーナン商事	2,000	3,890.00	7,780,000	
ネットワンシステムズ	6,000	2,577.50	15,465,000	
エコス	700	2,370.00	1,659,000	
ワタミ	1,600	1,034.00	1,654,400	
マルシェ	700	244.00	170,800	
リックス	300	3,805.00	1,141,500	
システムソフト	6,200	58.00	359,600	
パン・パシフィック・インターナショナルホ	31,600	3,476.00	109,841,600	
丸文	1,400	1,515.00	2,121,000	
西松屋チェーン	3,200	2,088.00	6,681,600	
ゼンショーホールディングス	8,000	6,628.00	53,024,000	
ハピネット	1,300	3,275.00	4,257,500	
幸楽苑ホールディングス	1,300	1,395.00	1,813,500	
ハークスレイ	300	894.00	268,200	
橋本総業ホールディングス	800	1,301.00	1,040,800	
日本ライフライン	4,800	1,272.00	6,105,600	
サイゼリヤ	2,300	4,940.00	11,362,000	
タカショー	1,400	513.00	718,200	
V Tホールディングス	6,400	514.00	3,289,600	
アルゴグラフィックス	1,300	4,315.00	5,609,500	
魚力	600	2,380.00	1,428,000	
I D O M	4,200	888.00	3,729,600	
日本エム・ディ・エム	1,200	702.00	842,400	
ポブラ	700	303.00	212,100	
フジ・コーポレーション	800	1,742.00	1,393,600	
ユナイテッドアローズ	1,900	1,790.00	3,401,000	
進和	1,000	2,428.00	2,428,000	
エスケイジャパン	200	708.00	141,600	
ダイترون	700	2,925.00	2,047,500	
ハイデイ日高	2,400	2,711.00	6,506,400	
シークス	2,300	1,621.00	3,728,300	
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i	500	146.00	73,000	
コロワイド	6,700	2,235.00	14,974,500	
田中商事	200	821.00	164,200	
オーハシテクニカ	800	1,736.00	1,388,800	
壱番屋	1,200	6,090.00	7,308,000	
白銅	400	2,632.00	1,052,800	
トップカルチャー	400	153.00	61,200	
P L A N T	200	1,647.00	329,400	
スギホールディングス	3,100	7,265.00	22,521,500	
ダイコー通産	300	1,250.00	375,000	
薬王堂ホールディングス	700	2,840.00	1,988,000	
島津製作所	19,700	3,845.00	75,746,500	
J M S	1,700	514.00	873,800	
クボテック	300	228.00	68,400	
長野計器	1,200	2,214.00	2,656,800	

ブイ・テクノロジー	800	2,664.00	2,131,200	
スター精密	2,700	1,671.00	4,511,700	
東京計器	1,300	2,275.00	2,957,500	
愛知時計電機	600	2,565.00	1,539,000	
インターアクション	800	1,132.00	905,600	
オーバル	1,200	520.00	624,000	
東京精密	3,000	9,631.00	28,893,000	
マニー	5,900	2,070.00	12,213,000	
ニコン	21,400	1,530.00	32,742,000	
トプコン	7,100	1,771.50	12,577,650	
オリンパス	91,200	2,170.00	197,904,000	
理研計器	1,000	7,830.00	7,830,000	
S C R E E Nホールディングス	5,100	18,450.00	94,095,000	
キヤノン電子	1,600	2,246.00	3,593,600	
タムロン	900	6,290.00	5,661,000	
H O Y A	29,200	18,495.00	540,054,000	
シード	600	718.00	430,800	
ノーリツ鋼機	1,400	3,040.00	4,256,000	
A & Dホロンホールディングス	2,100	2,105.00	4,420,500	
朝日インテック	18,100	2,868.00	51,910,800	
キヤノン	73,900	4,206.00	310,823,400	
リコー	37,100	1,273.00	47,228,300	
シチズン時計	13,500	1,068.00	14,418,000	
リズム	100	3,670.00	367,000	
大研医器	1,000	522.00	522,000	
メニコン	5,100	1,746.50	8,907,150	
シンシア	400	523.00	209,200	
K Y O R I T S U	2,600	195.00	507,000	
中本パックス	400	1,731.00	692,400	
スノーピーク	2,300	1,138.00	2,617,400	
パラマウントベッドホールディングス	3,000	2,484.00	7,452,000	
トランザクション	1,000	2,549.00	2,549,000	
粧美堂	400	698.00	279,200	
ニホンフラッシュ	1,700	956.00	1,625,200	
前田工織	1,200	3,360.00	4,032,000	
永大産業	2,200	283.00	622,600	
アートネイチャー	1,200	789.00	946,800	
フルヤ金属	400	9,840.00	3,936,000	
バンダイナムコホールディングス	40,600	2,919.00	118,511,400	
アイフィスジャパン	300	619.00	185,700	
S H O E I	3,300	2,098.00	6,923,400	
フランスベッドホールディングス	1,800	1,305.00	2,349,000	
マーベラス	2,700	740.00	1,998,000	
パイロットコーポレーション	2,100	3,890.00	8,169,000	
萩原工業	1,000	1,500.00	1,500,000	
エイベックス	2,500	1,295.00	3,237,500	
フジシールインターナショナル	2,900	2,025.00	5,872,500	
タカラトミー	6,700	2,327.50	15,594,250	

広済堂ホールディングス	3,500	669.00	2,341,500	
エステールホールディングス	400	648.00	259,200	
レック	2,200	1,091.00	2,400,200	
タカノ	400	1,066.00	426,400	
三光合成	2,300	638.00	1,467,400	
プロネクス	1,300	1,221.00	1,587,300	
ホクシン	200	116.00	23,200	
ウッドワン	300	1,050.00	315,000	
きもと	1,400	208.00	291,200	
TOPPANホールディングス	18,200	3,512.00	63,918,400	
大日本印刷	16,200	4,497.00	72,851,400	
共同印刷	400	3,155.00	1,262,000	
NISSHA	2,700	1,507.00	4,068,900	
光村印刷	100	1,685.00	168,500	
藤森工業	1,100	3,895.00	4,284,500	
ヴィア・ホールディングス	2,400	148.00	355,200	
TAKARA & COMPANY	900	2,812.00	2,530,800	
前澤化成工業	1,100	1,588.00	1,746,800	
未来工業	600	5,220.00	3,132,000	
アシックス	12,600	5,849.00	73,697,400	
ツツミ	300	2,096.00	628,800	
ウェーブロックホールディングス	300	687.00	206,100	
JSP	1,200	2,189.00	2,626,800	
ニチハ	1,900	3,455.00	6,564,500	
ローランド	1,100	4,905.00	5,395,500	
エフピコ	2,800	2,835.50	7,939,400	
小松ウオール工業	600	3,340.00	2,004,000	
ヤマハ	9,300	3,220.00	29,946,000	
河合楽器製作所	400	3,390.00	1,356,000	
クリナップ	1,300	758.00	985,400	
ビジョン	9,400	1,595.50	14,997,700	
天馬	1,100	2,400.00	2,640,000	
キングジム	1,200	880.00	1,056,000	
象印マホービン	4,000	1,438.00	5,752,000	
リンテック	2,900	3,020.00	8,758,000	
信越ポリマー	3,100	1,595.00	4,944,500	
東リ	1,400	393.00	550,200	
イトーキ	3,000	1,996.00	5,988,000	
任天堂	93,600	8,263.00	773,416,800	
三菱鉛筆	2,100	2,439.00	5,121,900	
松風	600	2,681.00	1,608,600	
タカラスタANDARD	3,100	1,847.00	5,725,700	
コクヨ	6,000	2,474.50	14,847,000	
ナカバヤシ	1,700	533.00	906,100	
ニフコ	4,400	3,732.00	16,420,800	
立川ブラインド工業	900	1,463.00	1,316,700	
グローブライド	1,400	2,027.00	2,837,800	
オカムラ	4,400	2,187.00	9,622,800	

バルカー	1,300	4,505.00	5,856,500	
MUTOHホールディングス	200	2,296.00	459,200	
伊藤忠商事	105,400	6,595.00	695,113,000	
丸紅	130,700	2,462.50	321,848,750	
スクロール	2,600	929.00	2,415,400	
高島	800	1,368.00	1,094,400	
ヨンドシーホールディングス	1,400	1,947.00	2,725,800	
三陽商会	500	2,734.00	1,367,000	
長瀬産業	7,100	2,453.50	17,419,850	
ナイガイ	1,200	255.00	306,000	
蝶理	900	2,987.00	2,688,300	
豊田通商	13,700	9,174.00	125,683,800	
オンワードホールディングス	9,000	524.00	4,716,000	
三共生興	2,000	769.00	1,538,000	
兼松	6,500	2,355.00	15,307,500	
美津濃	1,400	5,250.00	7,350,000	
ツカモトコーポレーション	200	1,290.00	258,000	
ルックホールディングス	400	2,440.00	976,000	
三井物産	118,200	6,370.00	752,934,000	
日本紙パルプ商事	800	5,020.00	4,016,000	
東京エレクトロン	31,400	34,650.00	1,088,010,000	
カメイ	1,800	1,878.00	3,380,400	
東都水産	100	6,270.00	627,000	
OUGホールディングス	200	2,656.00	531,200	
スターゼン	1,100	2,762.00	3,038,200	
セイコーグループ	2,100	3,080.00	6,468,000	
山善	4,600	1,288.00	5,924,800	
椿本興業	300	6,870.00	2,061,000	
住友商事	94,900	3,569.00	338,698,100	
BIPROGY	4,800	4,627.00	22,209,600	
内田洋行	600	7,870.00	4,722,000	
三菱商事	310,800	3,129.00	972,493,200	
第一実業	1,500	1,982.00	2,973,000	
キヤノンマーケティングジャパン	3,600	4,265.00	15,354,000	
西華産業	700	2,980.00	2,086,000	
佐藤商事	1,000	1,760.00	1,760,000	
菱洋エレクトロ	1,500	3,980.00	5,970,000	
東京産業	1,800	738.00	1,328,400	
ユアサ商事	1,200	5,050.00	6,060,000	
神鋼商事	400	7,210.00	2,884,000	
トルク	400	285.00	114,000	
阪和興業	2,800	5,620.00	15,736,000	
正栄食品工業	1,100	4,650.00	5,115,000	
カナデン	1,100	1,553.00	1,708,300	
RYODEN	1,200	2,633.00	3,159,600	
ニプロ	12,300	1,275.00	15,682,500	
岩谷産業	3,600	7,345.00	26,442,000	
ナイス	400	1,600.00	640,000	

ニチモウ	400	2,122.00	848,800	
極東貿易	1,000	2,141.00	2,141,000	
アステナホールディングス	2,800	475.00	1,330,000	
三愛オブリ	3,900	1,923.00	7,499,700	
稲畑産業	3,100	3,160.00	9,796,000	
G S I クレオス	800	2,402.00	1,921,600	
明和産業	1,900	708.00	1,345,200	
クワザワホールディングス	300	790.00	237,000	
キムラタン	14,500	18.00	261,000	
ゴールドウイン	2,600	8,917.00	23,184,200	
ユニ・チャーム	31,000	5,172.00	160,332,000	
デサント	2,500	3,195.00	7,987,500	
キング	300	700.00	210,000	
ワキタ	2,700	1,595.00	4,306,500	
ヤマトインターナショナル	900	305.00	274,500	
東邦ホールディングス	4,300	3,236.00	13,914,800	
サンゲツ	3,600	3,585.00	12,906,000	
ミツウロコグループホールディングス	2,100	1,512.00	3,175,200	
シナネンホールディングス	400	4,175.00	1,670,000	
伊藤忠エネクス	3,800	1,515.00	5,757,000	
サンリオ	4,400	7,474.00	32,885,600	
サンワテクノス	900	2,282.00	2,053,800	
リョーサン	1,100	5,150.00	5,665,000	
新光商事	2,100	1,228.00	2,578,800	
トーヨー	700	2,871.00	2,009,700	
三信電気	700	2,317.00	1,621,900	
東陽テクニカ	1,700	1,500.00	2,550,000	
モスフードサービス	2,300	3,475.00	7,992,500	
加賀電子	1,400	6,480.00	9,072,000	
三益半導体工業	1,100	3,120.00	3,432,000	
都築電気	900	2,393.00	2,153,700	
ソーダニッカ	700	1,177.00	823,900	
立花エレテック	1,100	3,110.00	3,421,000	
木曽路	2,300	2,589.00	5,954,700	
S R S ホールディングス	2,500	1,178.00	2,945,000	
千趣会	3,700	296.00	1,095,200	
タカキュー	3,300	69.00	227,700	
リテールパートナーズ	2,300	1,765.00	4,059,500	
上新電機	1,500	2,364.00	3,546,000	
日本瓦斯	8,300	2,343.50	19,451,050	
ロイヤルホールディングス	2,700	2,406.00	6,496,200	
東天紅	300	854.00	256,200	
いなげや	1,400	1,294.00	1,811,600	
チヨダ	1,500	886.00	1,329,000	
ライフコーポレーション	1,600	3,715.00	5,944,000	
リンガーハット	2,100	2,370.00	4,977,000	
M r M a x H D	1,800	630.00	1,134,000	
デンアライド	1,400	318.00	445,200	

A O K Iホールディングス	3,300	1,152.00	3,801,600	
オークワ	2,200	868.00	1,909,600	
コメリ	2,500	3,320.00	8,300,000	
青山商事	3,500	1,633.00	5,715,500	
しまむら	3,600	8,157.00	29,365,200	
はせがわ	500	354.00	177,000	
高島屋	10,800	2,284.00	24,667,200	
松屋	2,500	963.00	2,407,500	
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,900	1,826.00	12,599,400	
近鉄百貨店	600	2,523.00	1,513,800	
丸井グループ	10,400	2,475.00	25,740,000	
クレディセゾン	9,200	2,820.00	25,944,000	
アクシアル リテイリング	1,000	4,035.00	4,035,000	
井筒屋	500	351.00	175,500	
イオン	53,100	3,588.00	190,522,800	
イズミ	2,800	3,755.00	10,514,000	
フォーバル	700	1,405.00	983,500	
平和堂	2,600	2,064.00	5,366,400	
フジ	2,400	1,984.00	4,761,600	
ヤオコー	1,800	8,260.00	14,868,000	
ゼビオホールディングス	2,400	968.00	2,323,200	
ケーズホールディングス	11,000	1,234.50	13,579,500	
P A L T A C	2,100	4,359.00	9,153,900	
三谷産業	2,800	394.00	1,103,200	
O l y m p i c グループ	300	556.00	166,800	
日産東京販売ホールディングス	1,800	500.00	900,000	
あおぞら銀行	10,500	2,215.00	23,257,500	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	889,200	1,487.50	1,322,685,000	
りそなホールディングス	170,100	817.70	139,090,770	
三井住友トラスト・ホールディングス	52,400	2,969.50	155,601,800	
三井住友フィナンシャルグループ	103,800	8,068.00	837,458,400	
千葉銀行	40,600	1,176.00	47,745,600	
群馬銀行	28,200	776.50	21,897,300	
武蔵野銀行	2,100	2,769.00	5,814,900	
千葉興業銀行	2,400	833.00	1,999,200	
筑波銀行	6,700	247.00	1,654,900	
七十七銀行	4,200	3,685.00	15,477,000	
秋田銀行	1,100	2,047.00	2,251,700	
山形銀行	1,800	1,099.00	1,978,200	
岩手銀行	900	2,523.00	2,270,700	
東邦銀行	12,400	312.00	3,868,800	
東北銀行	500	1,203.00	601,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,700	3,672.00	46,634,400	
スルガ銀行	12,700	778.00	9,880,600	
八十二銀行	31,200	876.30	27,340,560	
山梨中央銀行	1,700	1,715.00	2,915,500	
大垣共立銀行	2,700	2,068.00	5,583,600	
福井銀行	1,200	1,776.00	2,131,200	

清水銀行	600	1,566.00	939,600	
富山銀行	100	1,797.00	179,700	
滋賀銀行	2,400	3,955.00	9,492,000	
南都銀行	2,300	2,693.00	6,193,900	
百五銀行	13,600	605.00	8,228,000	
紀陽銀行	5,200	1,855.00	9,646,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,000	1,679.00	15,111,000	
山陰合同銀行	9,000	1,015.00	9,135,000	
鳥取銀行	400	1,412.00	564,800	
百十四銀行	1,500	2,698.00	4,047,000	
四国銀行	2,000	1,060.00	2,120,000	
阿波銀行	2,000	2,437.00	4,874,000	
大分銀行	800	2,628.00	2,102,400	
宮崎銀行	800	2,724.00	2,179,200	
佐賀銀行	900	1,906.00	1,715,400	
琉球銀行	3,200	1,130.00	3,616,000	
セブン銀行	45,400	299.00	13,574,600	
みずほフィナンシャルグループ	197,100	2,736.00	539,265,600	
高知銀行	300	986.00	295,800	
山口フィナンシャルグループ	14,200	1,498.00	21,271,600	
芙蓉総合リース	1,300	13,755.00	17,881,500	
みずほリース	2,400	5,360.00	12,864,000	
東京センチュリー	10,800	1,599.50	17,274,600	
S B Iホールディングス	21,400	4,000.00	85,600,000	
日本証券金融	5,300	1,632.00	8,649,600	
アイフル	21,200	432.00	9,158,400	
日本アジア投資	800	246.00	196,800	
名古屋銀行	1,000	5,890.00	5,890,000	
北洋銀行	21,800	346.00	7,542,800	
大光銀行	300	1,398.00	419,400	
愛媛銀行	1,900	1,110.00	2,109,000	
トマト銀行	300	1,210.00	363,000	
京葉銀行	6,300	711.00	4,479,300	
栃木銀行	7,900	305.00	2,409,500	
北日本銀行	600	2,127.00	1,276,200	
東和銀行	2,800	659.00	1,845,200	
福島銀行	1,300	233.00	302,900	
大東銀行	400	744.00	297,600	
リコーリース	1,400	5,100.00	7,140,000	
イオンフィナンシャルサービス	8,300	1,342.00	11,138,600	
アコム	25,800	397.50	10,255,500	
ジャックス	1,500	5,540.00	8,310,000	
オリエントコーポレーション	4,700	1,068.00	5,019,600	
オリックス	89,000	3,082.00	274,298,000	
三菱H C キャピタル	65,000	1,041.00	67,665,000	
ジャフコ グループ	4,500	1,746.50	7,859,250	
九州リースサービス	400	1,278.00	511,200	
トモニホールディングス	13,600	401.00	5,453,600	

大和証券グループ本社	113,000	1,082.50	122,322,500	
野村ホールディングス	245,400	831.20	203,976,480	
岡三証券グループ	12,700	731.00	9,283,700	
丸三証券	4,700	973.00	4,573,100	
東洋証券	3,600	359.00	1,292,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	17,100	575.00	9,832,500	
光世証券	100	650.00	65,000	
水戸証券	4,100	470.00	1,927,000	
いちよし証券	3,100	788.00	2,442,800	
松井証券	7,400	853.00	6,312,200	
S O M P Oホールディングス	22,000	8,833.00	194,326,000	
日本取引所グループ	38,100	3,800.00	144,780,000	
マネックスグループ	14,200	881.00	12,510,200	
極東証券	2,000	1,018.00	2,036,000	
岩井コスモホールディングス	1,800	2,184.00	3,931,200	
アイザワ証券グループ	2,000	1,175.00	2,350,000	
フィデアホールディングス	1,600	1,589.00	2,542,400	
池田泉州ホールディングス	20,200	355.00	7,171,000	
アニコム ホールディングス	4,800	598.00	2,870,400	
M S & A D インシュアランスグループホール	32,700	7,361.00	240,704,700	
マネーパートナーズグループ	700	298.00	208,600	
スパークス・グループ	1,600	1,821.00	2,913,600	
小林洋行	1,300	279.00	362,700	
第一生命ホールディングス	71,300	3,402.00	242,562,600	
東京海上ホールディングス	144,300	4,391.00	633,621,300	
アドバンテッジリスクマネジメント	400	419.00	167,600	
イー・ギャランティ	2,300	1,886.00	4,337,800	
アサックス	600	749.00	449,400	
N E C キャピタルソリューション	800	3,700.00	2,960,000	
T & Dホールディングス	39,200	2,526.00	99,019,200	
アドバンスクリエイト	900	1,042.00	937,800	
三井不動産	67,500	4,072.00	274,860,000	
三菱地所	95,400	2,133.00	203,488,200	
平和不動産	2,300	4,020.00	9,246,000	
東京建物	12,700	2,158.00	27,406,600	
京阪神ビルディング	2,700	1,583.00	4,274,100	
住友不動産	21,100	4,596.00	96,975,600	
太平洋興発	200	834.00	166,800	
テーオーシー	2,900	681.00	1,974,900	
レオパレス 2 1	15,100	423.00	6,387,300	
スターツコーポレーション	2,100	3,035.00	6,373,500	
フジ住宅	1,700	711.00	1,208,700	
空港施設	2,000	604.00	1,208,000	
明和地所	700	1,066.00	746,200	
ゴールドクレスト	1,200	2,246.00	2,695,200	
リログループ	7,600	1,308.50	9,944,600	
エスリード	700	3,410.00	2,387,000	
日神グループホールディングス	2,600	508.00	1,320,800	

日本エスコン	2,900	987.00	2,862,300	
MIRARTHホールディングス	6,800	492.00	3,345,600	
AVANTIA	500	892.00	446,000	
イオンモール	7,500	1,826.50	13,698,750	
毎日コムネット	400	746.00	298,400	
ファースト住建	300	1,101.00	330,300	
ランド	110,100	7.00	770,700	
カチタス	3,900	1,982.00	7,729,800	
東祥	1,300	803.00	1,043,900	
トーセイ	2,400	2,058.00	4,939,200	
穴吹興産	200	2,118.00	423,600	
サンフロンティア不動産	2,200	1,710.00	3,762,000	
FJネクストホールディングス	1,600	1,180.00	1,888,000	
インテリックス	600	553.00	331,800	
ランドビジネス	200	264.00	52,800	
サンネクスタグループ	300	958.00	287,400	
グランディハウス	700	649.00	454,300	
東武鉄道	16,300	3,870.00	63,081,000	
相鉄ホールディングス	5,300	2,723.00	14,431,900	
東急	41,500	1,773.00	73,579,500	
京浜急行電鉄	18,300	1,304.00	23,863,200	
小田急電鉄	24,500	2,107.00	51,621,500	
京王電鉄	7,100	4,208.00	29,876,800	
京成電鉄	9,500	7,452.00	70,794,000	
富士急行	1,800	3,880.00	6,984,000	
東日本旅客鉄道	27,200	8,949.00	243,412,800	
西日本旅客鉄道	17,600	6,215.00	109,384,000	
東海旅客鉄道	57,100	3,754.00	214,353,400	
西武ホールディングス	17,900	2,161.50	38,690,850	
鴻池運輸	2,600	1,802.00	4,685,200	
西日本鉄道	3,900	2,404.00	9,375,600	
ハマキョウレックス	1,300	3,895.00	5,063,500	
サカイ引越センター	1,600	2,583.00	4,132,800	
近鉄グループホールディングス	14,800	4,500.00	66,600,000	
阪急阪神ホールディングス	19,700	4,306.00	84,828,200	
南海電気鉄道	6,600	2,918.00	19,258,800	
京阪ホールディングス	8,100	3,474.00	28,139,400	
神戸電鉄	500	2,851.00	1,425,500	
名古屋鉄道	15,200	2,132.50	32,414,000	
山陽電気鉄道	1,100	2,124.00	2,336,400	
アルプス物流	1,100	1,900.00	2,090,000	
トランコム	400	6,340.00	2,536,000	
ヤマトホールディングス	18,900	2,403.50	45,426,150	
山九	3,700	5,353.00	19,806,100	
日新	1,100	2,855.00	3,140,500	
丸運	700	279.00	195,300	
丸全昭和運輸	900	4,430.00	3,987,000	
センコーグループホールディングス	7,700	1,078.00	8,300,600	

トナミホールディングス	300	4,420.00	1,326,000	
ニッコンホールディングス	4,700	3,174.00	14,917,800	
日本石油輸送	100	2,840.00	284,000	
福山通運	1,700	4,215.00	7,165,500	
セイノーホールディングス	8,300	2,233.00	18,533,900	
エスライングループ本社	500	876.00	438,000	
神奈川中央交通	500	3,035.00	1,517,500	
A Z - C O M丸和ホールディングス	3,900	1,430.00	5,577,000	
C & F ロジホールディングス	1,600	1,804.00	2,886,400	
日本郵船	42,400	4,824.00	204,537,600	
商船三井	32,100	5,324.00	170,900,400	
川崎汽船	11,900	7,146.00	85,037,400	
N S ユナイテッド海運	800	5,260.00	4,208,000	
明海グループ	900	788.00	709,200	
飯野海運	5,400	1,348.00	7,279,200	
共栄タンカー	100	1,131.00	113,100	
九州旅客鉄道	10,400	3,353.00	34,871,200	
S G ホールディングス	24,800	1,925.00	47,740,000	
N I P P O N E X P R E S S ホールディン	5,000	8,061.00	40,305,000	
I D & E ホールディングス	1,000	3,720.00	3,720,000	
日本航空	36,300	2,790.00	101,277,000	
A N A ホールディングス	40,200	3,229.00	129,805,800	
ビーウィズ	300	1,860.00	558,000	
パスコ	200	1,860.00	372,000	
T R E ホールディングス	2,800	1,231.00	3,446,800	
人・夢・技術グループ	600	1,763.00	1,057,800	
西本W i s m e t t a c ホールディングス	400	6,730.00	2,692,000	
シルバーライフ	500	848.00	424,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	2,402.00	480,400	
G e n k y D r u g S t o r e s	700	6,220.00	4,354,000	
コア商事ホールディングス	800	715.00	572,000	
K P P グループホールディングス	4,100	632.00	2,591,200	
ナルミヤ・インターナショナル	100	1,242.00	124,200	
ブックオフグループホールディングス	900	1,236.00	1,112,400	
ギフトホールディングス	600	2,929.00	1,757,400	
三菱倉庫	3,600	4,604.00	16,574,400	
三井倉庫ホールディングス	1,400	4,645.00	6,503,000	
住友倉庫	4,000	2,610.00	10,440,000	
澁澤倉庫	600	3,065.00	1,839,000	
ヤマタネ	700	2,555.00	1,788,500	
東陽倉庫	300	1,529.00	458,700	
乾汽船	1,700	1,052.00	1,788,400	
日本トランスシティ	3,300	623.00	2,055,900	
ケイヒン	300	1,956.00	586,800	
中央倉庫	800	1,145.00	916,000	
川西倉庫	300	1,154.00	346,200	
安田倉庫	1,100	1,199.00	1,318,900	
ファイズホールディングス	100	1,305.00	130,500	

N I S S Oホールディングス	1,500	824.00	1,236,000	
大栄環境	2,700	2,649.00	7,152,300	
日本管財ホールディングス	1,600	2,583.00	4,132,800	
東洋埠頭	200	1,381.00	276,200	
上組	6,800	3,443.00	23,412,400	
サンリツ	200	774.00	154,800	
キムラユニティー	600	1,569.00	941,400	
キューソー流通システム	400	928.00	371,200	
東海運	1,000	297.00	297,000	
エーアイティー	1,000	1,856.00	1,856,000	
内外トランスライン	600	2,421.00	1,452,600	
ショーエイコーポレーション	700	614.00	429,800	
日本コンセプト	600	1,908.00	1,144,800	
T B Sホールディングス	7,400	4,254.00	31,479,600	
日本テレビホールディングス	13,100	2,185.00	28,623,500	
朝日放送グループホールディングス	1,400	690.00	966,000	
テレビ朝日ホールディングス	3,600	2,096.00	7,545,600	
スカパーJ S A Tホールディングス	11,400	896.00	10,214,400	
テレビ東京ホールディングス	1,000	3,015.00	3,015,000	
日本B S 放送	500	894.00	447,000	
ビジョン	2,300	1,116.00	2,566,800	
スマートバリュー	100	420.00	42,000	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	1,600	4,495.00	7,192,000	
ワイヤレスゲート	1,100	223.00	245,300	
日本通信	15,900	219.00	3,482,100	
クロップス	300	1,033.00	309,900	
日本電信電話	4,422,700	181.60	803,162,320	
K D D I	114,900	4,622.00	531,067,800	
ソフトバンク	239,200	1,969.00	470,984,800	
光通信	1,500	25,465.00	38,197,500	
エムティーアイ	1,000	755.00	755,000	
G M Oインターネットグループ	5,500	2,569.00	14,129,500	
ファイバーゲート	1,000	1,018.00	1,018,000	
アйдママーケティングコミュニケーション	200	234.00	46,800	
K A D O K A W A	7,800	3,133.00	24,437,400	
学研ホールディングス	2,400	995.00	2,388,000	
ゼンリン	2,400	851.00	2,042,400	
昭文社ホールディングス	400	367.00	146,800	
インプレスホールディングス	900	175.00	157,500	
東京電力ホールディングス	133,500	795.00	106,132,500	
中部電力	54,600	1,916.00	104,613,600	
関西電力	57,200	1,949.00	111,482,800	
中国電力	25,700	989.60	25,432,720	
北陸電力	15,000	720.50	10,807,500	
東北電力	38,900	988.90	38,468,210	
四国電力	13,700	1,041.00	14,261,700	
九州電力	34,100	1,128.00	38,464,800	
北海道電力	14,200	635.40	9,022,680	

沖縄電力	3,600	1,094.00	3,938,400	
電源開発	12,100	2,469.00	29,874,900	
エフオン	1,200	411.00	493,200	
イーレックス	2,900	750.00	2,175,000	
レノバ	3,900	1,237.00	4,824,300	
東京瓦斯	31,300	3,249.00	101,693,700	
大阪瓦斯	30,000	3,089.00	92,670,000	
東邦瓦斯	6,400	2,976.00	19,046,400	
北海道瓦斯	1,000	2,274.00	2,274,000	
広島ガス	3,800	385.00	1,463,000	
西部ガスホールディングス	1,600	1,885.00	3,016,000	
静岡ガス	3,200	908.00	2,905,600	
メタウォーター	1,900	2,211.00	4,200,900	
M & A 総研ホールディングス	700	6,770.00	4,739,000	
アイネット	1,000	2,182.00	2,182,000	
松竹	800	10,060.00	8,048,000	
東宝	8,200	4,950.00	40,590,000	
エイチ・アイ・エス	4,400	1,685.00	7,414,000	
東映	500	19,910.00	9,955,000	
ラックランド	600	2,592.00	1,555,200	
N T T データグループ	38,800	2,336.00	90,636,800	
共立メンテナンス	2,400	6,306.00	15,134,400	
イチネンホールディングス	1,800	1,663.00	2,993,400	
建設技術研究所	800	6,050.00	4,840,000	
スペース	1,000	986.00	986,000	
アインホールディングス	2,100	4,698.00	9,865,800	
燦ホールディングス	1,400	1,038.00	1,453,200	
ピー・シー・エー	1,000	1,613.00	1,613,000	
スバル興業	500	3,145.00	1,572,500	
東京テアトル	400	1,141.00	456,400	
タナベコンサルティンググループ	300	1,034.00	310,200	
ビジネスブレイン太田昭和	600	2,294.00	1,376,400	
ナガワ	500	7,150.00	3,575,000	
東京都競馬	1,300	4,200.00	5,460,000	
常磐興産	400	1,247.00	498,800	
カナモト	2,300	2,954.00	6,794,200	
D T S	3,100	3,885.00	12,043,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,800	6,614.00	44,975,200	
シーイーシー	1,900	1,815.00	3,448,500	
カプコン	13,300	5,877.00	78,164,100	
ニシオホールディングス	1,400	3,845.00	5,383,000	
アイ・エス・ビー	900	1,403.00	1,262,700	
アゴーラ ホスピタリティー グループ	9,000	28.00	252,000	
日本空港ビルデング	5,100	5,853.00	29,850,300	
トランス・コスモス	1,900	2,990.00	5,681,000	
乃村工藝社	7,000	878.00	6,146,000	
ジャステック	900	1,366.00	1,229,400	
S C S K	10,400	2,693.50	28,012,400	

藤田観光	600	6,590.00	3,954,000	
KNT - CTホールディングス	1,000	1,226.00	1,226,000	
トーカイ	1,300	2,138.00	2,779,400	
白洋舎	100	2,679.00	267,900	
セコム	15,500	11,050.00	171,275,000	
NSW	600	2,948.00	1,768,800	
セントラル警備保障	900	2,612.00	2,350,800	
アイネス	1,100	1,488.00	1,636,800	
丹青社	3,300	799.00	2,636,700	
メイテックグループホールディングス	5,500	3,026.00	16,643,000	
TKC	2,300	3,700.00	8,510,000	
富士ソフト	3,000	6,140.00	18,420,000	
応用地質	1,400	2,345.00	3,283,000	
船井総研ホールディングス	3,100	2,661.00	8,249,100	
NSD	5,300	2,710.00	14,363,000	
進学会ホールディングス	200	263.00	52,600	
丸紅建材リース	100	2,782.00	278,200	
オオバ	700	1,006.00	704,200	
コナミグループ	5,600	9,598.00	53,748,800	
いであ	200	2,334.00	466,800	
学究社	600	2,090.00	1,254,000	
ベネッセホールディングス	5,100	2,595.50	13,237,050	
イオンディライト	1,600	3,535.00	5,656,000	
ナック	1,800	529.00	952,200	
福井コンピュータホールディングス	900	2,639.00	2,375,100	
ダイセキ	3,100	4,005.00	12,415,500	
ステップ	700	2,059.00	1,441,300	
泉州電業	800	3,760.00	3,008,000	
元気寿司	900	3,490.00	3,141,000	
トラスコ中山	3,300	2,339.00	7,718,700	
ヤマダホールディングス	48,000	433.40	20,803,200	
オートバックスセブン	5,400	1,644.00	8,877,600	
モリト	1,200	1,417.00	1,700,400	
アー克蘭ズ	4,600	1,657.00	7,622,200	
ニトリホールディングス	5,700	21,655.00	123,433,500	
グルメ杵屋	1,200	1,107.00	1,328,400	
愛眼	1,300	184.00	239,200	
ケーユーホールディングス	600	1,182.00	709,200	
吉野家ホールディングス	5,700	3,267.00	18,621,900	
加藤産業	1,900	4,805.00	9,129,500	
北恵	200	861.00	172,200	
イノテック	900	1,911.00	1,719,900	
イエローハット	2,600	1,891.00	4,916,600	
松屋フーズホールディングス	700	5,570.00	3,899,000	
JBC Cホールディングス	1,000	3,815.00	3,815,000	
JKホールディングス	1,300	1,031.00	1,340,300	
サガミホールディングス	2,400	1,494.00	3,585,600	
日伝	1,000	2,796.00	2,796,000	

関西フードマーケット	1,000	1,624.00	1,624,000	
ミロク情報サービス	1,500	1,994.00	2,991,000	
北沢産業	500	337.00	168,500	
杉本商事	800	2,256.00	1,804,800	
因幡電機産業	4,000	3,530.00	14,120,000	
王将フードサービス	1,200	7,720.00	9,264,000	
ミニストップ	1,200	1,631.00	1,957,200	
アークス	2,800	3,040.00	8,512,000	
パローホールディングス	3,000	2,459.00	7,377,000	
東テク	500	6,990.00	3,495,000	
ミスミグループ本社	23,600	2,095.00	49,442,000	
アルテック	1,000	264.00	264,000	
ベルク	800	6,570.00	5,256,000	
大庄	700	1,317.00	921,900	
タキヒヨー	300	1,226.00	367,800	
ファーストリテイリング	7,100	41,700.00	296,070,000	
ソフトバンクグループ	73,300	8,539.00	625,908,700	
蔵王産業	200	2,630.00	526,000	
スズケン	5,900	4,924.00	29,051,600	
サンドラッグ	5,300	4,530.00	24,009,000	
サックスパー ホールディングス	1,500	858.00	1,287,000	
ジェコス	1,000	1,162.00	1,162,000	
ヤマザワ	100	1,265.00	126,500	
やまや	100	3,370.00	337,000	
グローセル	1,100	748.00	822,800	
ペルーナ	4,000	616.00	2,464,000	
合 計	23,068,200		55,391,483,170	

株式以外の有価証券

該当する事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

「日本債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

（1）貸借対照表

（単位：円）

区 分	注記 番号	（2023年2月20日現在）	（2024年2月20日現在）
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		1,029,969	4,363,507
コール・ローン		140,858,383	460,255,773
国債証券		140,386,338,900	88,095,172,800
地方債証券		9,935,478,787	5,628,682,707

特殊債券		12,329,223,538	6,341,628,960
社債券		7,624,656,700	5,208,525,700
未収利息		390,721,831	272,199,137
前払費用		4,727,609	6,298,399
流動資産合計		170,813,035,717	106,017,126,983
資産合計		170,813,035,717	106,017,126,983
負債の部			
流動負債			
未払解約金		25,235,916	5,672,928
未払利息		376	1,236
その他未払費用		646	1,073
流動負債合計		25,236,938	5,675,237
負債合計		25,236,938	5,675,237
純資産の部			
元本等			
元本	1	139,970,293,356	86,862,860,040
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		30,817,505,423	19,148,591,706
元本等合計		170,787,798,779	106,011,451,746
純資産合計		170,787,798,779	106,011,451,746
負債純資産合計		170,813,035,717	106,017,126,983

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

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
-------------------	---

（重要な会計上の見積りに関する注記）

（2023年2月20日現在）	（2024年2月20日現在）
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（2023年2月20日現在）	（2024年2月20日現在）
1 期首元本額	142,408,879,533円	139,970,293,356円
期中追加設定元本額	12,527,561,921円	11,204,124,907円
期中一部解約元本額	14,966,148,098円	64,311,558,223円

元本の内訳		
ファンド名		
A M C / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	1,164,208,743円	1,256,992,275円
日本債券インデックス・ファンド（年金1）＜適格機関投資家限定＞	3,880,671,890円	3,923,162,539円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	20,756,181円	8,076,021円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	158,848,419円	115,223,071円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	501,257円	558,080円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	10,060,868円	4,456,764円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	16,002,289円	13,727,068円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	11,663,119,305円	12,147,684,211円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	6,059,994円	6,911,762円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	4,160,935,398円	3,752,423,134円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	1,907,390,852円	1,931,644,835円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	12,917,978円	11,592,305円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	1,125,244,883円	997,275,984円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	6,305,197,688円	6,359,165,654円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	1,347,912,026円	1,194,013,604円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	4,883,052,281円	4,662,335,855円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	139,027,117円	139,952,553円
日本債券インデックス・ファンドVA1＜適格機関投資家限定＞	84,694,304円	75,079,747円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	60,740,056円	56,600,225円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	40,658,164円	42,417,053円
日本債券インデックス・ファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	21,845,079,042円	27,640,735,898円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	46,549,248円	42,663,703円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	3,297,609,591円	3,139,145,159円

バランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家限定 >	15,010,274円	13,146,832円
バランスファンドV A 3 5 B < 適格機関投資家限定 >	12,663,406円	8,229,421円
日本債券インデックス・ファンドV A 3 < 適格機関投資家限定 >	259,120,757円	369,819,479円
日本債券インデックス・ファンド< 適格機関投資家限定 >	714,552,790円	1,538,595,538円
4 資産インデックスバランスV A 2 0 < 適格機関投資家限定 >	2,367,985,908円	2,316,325,068円
世界分散ファンドV A 2 5 A < 適格機関投資家限定 >	8,589,297,655円	8,211,332,584円
4 資産インデックスバランスV A 5 0 < 適格機関投資家限定 >	14,162,034円	17,009,042円
T a d リスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）年金< 適格機関投資家限定 >	321,228,379円	359,211,553円
債券マルチ・ファクター戦略ファンド（年金）< 適格機関投資家限定 >	1,100,556,491円	1,104,776,885円
T a d リスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）< 適格機関投資家限定 >	214,965,344円	346,789,222円
ステート・ストリート日本債券インデックス・オープン	3,243,408,716円	1,666,450,167円
日本債券インデックス・ファンドF < 適格機関投資家限定 >	57,331,301,564円	—円
ステート・ストリート国内債券インデックス・オープン（隔月分配型）	—円	811,147円
世界バランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	19,787,946円	17,510,761円
世界バランス6 0 V A < 適格機関投資家限定 >	16,872,994円	9,020,589円
グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	1,392,721円	1,022,412円
グローバルバランス4 0 V A 2 < 適格機関投資家限定 >	3,462,057,948円	3,274,354,492円
グローバルバランス4 0 V A 3 < 適格機関投資家限定 >	77,575,032円	51,465,436円
グローバルバランス5 0 V A < 適格機関投資家限定 >	31,115,823円	35,151,912円
計	139,970,293,356円	86,862,860,040円
2 受益権の総数	139,970,293,356口	86,862,860,040口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

--	--

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	（ 2023年2月20日現在 ）	（ 2024年2月20日現在 ）
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。	同左

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	（ 2023年2月20日現在 ）	（ 2024年2月20日現在 ）
	当期間の損益に 含まれた評価差額	当期間の損益に 含まれた評価差額
国債証券	7,643,983,300	1,250,918,900
地方債証券	396,177,964	27,420,630
特殊債券	435,275,253	57,083,034
社債券	408,500,800	431,800
合計	8,883,937,317	1,335,854,364

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までを指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

該当する事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当する事項はありません。

（１口当たり情報に関する注記）

	（ 2023年2月20日現在 ）	（ 2024年2月20日現在 ）
1口当たり純資産額	1.2202円	1.2204円
（1万口当たり純資産額）	（ 12,202円 ）	（ 12,204円 ）

（３）附属明細表

第１ 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額（円）	備考
-----	-----	------	--------	----

国債証券	第 1 0 0 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	215,770,000	
	第 1 0 1 回利付国債（ 2 0 年）	100,000,000	108,692,000	
	第 1 0 2 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	218,216,000	
	第 1 0 3 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	217,360,000	
	第 1 0 4 回利付国債（ 2 0 年）	150,000,000	161,737,500	
	第 1 0 5 回利付国債（ 2 0 年）	100,000,000	108,080,000	
	第 1 0 6 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	217,062,000	
	第 1 0 7 回利付国債（ 2 0 年）	100,000,000	108,384,000	
	第 1 0 8 回利付国債（ 2 0 年）	100,000,000	107,434,000	
	第 1 0 9 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	215,616,000	
	第 1 0 回利付国債（ 4 0 年）	150,000,000	118,332,000	
	第 1 1 0 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	217,610,000	
	第 1 1 1 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	219,460,000	
	第 1 1 2 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	218,414,000	
	第 1 1 3 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	219,208,000	
	第 1 1 4 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	329,982,000	
	第 1 1 5 回利付国債（ 2 0 年）	500,000,000	552,825,000	
	第 1 1 6 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	221,806,000	
	第 1 1 8 回利付国債（ 2 0 年）	600,000,000	659,838,000	
	第 1 1 回利付国債（ 4 0 年）	90,000,000	68,113,800	
	第 1 2 2 回利付国債（ 2 0 年）	500,000,000	544,690,000	
	第 1 2 3 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	333,450,000	
	第 1 2 6 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	332,106,000	
	第 1 2 7 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	220,032,000	
	第 1 2 8 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	330,381,000	
	第 1 2 回利付国債（ 3 0 年）	300,000,000	338,916,000	
	第 1 2 回利付国債（ 4 0 年）	200,000,000	134,282,000	
	第 1 3 0 回利付国債（ 2 0 年）	400,000,000	438,124,000	
	第 1 3 2 回利付国債（ 2 0 年）	400,000,000	435,500,000	
	第 1 3 3 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	328,881,000	
	第 1 3 5 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	326,922,000	
	第 1 3 6 回利付国債（ 2 0 年）	250,000,000	270,397,500	
	第 1 3 7 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	218,050,000	
	第 1 3 9 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	216,460,000	
	第 1 3 回利付国債（ 3 0 年）	100,000,000	112,056,000	
	第 1 3 回利付国債（ 4 0 年）	460,000,000	304,865,000	
	第 1 4 0 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	327,321,000	
	第 1 4 1 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	327,390,000	
	第 1 4 2 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	330,039,000	
	第 1 4 3 回利付国債（ 2 0 年）	400,000,000	433,300,000	
	第 1 4 3 回利付国債（ 5 年）	400,000,000	400,408,000	
	第 1 4 4 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	322,401,000	
	第 1 4 4 回利付国債（ 5 年）	700,000,000	700,504,000	
	第 1 4 5 回利付国債（ 2 0 年）	250,000,000	273,200,000	
	第 1 4 6 回利付国債（ 2 0 年）	220,000,000	240,394,000	
	第 1 4 7 回利付国債（ 2 0 年）	260,000,000	281,645,000	
	第 1 4 8 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	321,978,000	
	第 1 4 9 回利付国債（ 2 0 年）	130,000,000	139,410,700	

第149回利付国債（5年）	1,000,000,000	996,660,000	
第14回利付国債（30年）	100,000,000	116,052,000	
第14回利付国債（40年）	510,000,000	360,789,300	
第150回利付国債（5年）	1,600,000,000	1,593,904,000	
第151回利付国債（20年）	350,000,000	364,129,500	
第151回利付国債（5年）	900,000,000	896,004,000	
第152回利付国債（20年）	450,000,000	467,595,000	
第152回利付国債（5年）	300,000,000	299,541,000	
第153回利付国債（20年）	450,000,000	471,892,500	
第153回利付国債（5年）	1,500,000,000	1,491,315,000	
第154回利付国債（20年）	340,000,000	352,355,600	
第155回利付国債（20年）	500,000,000	506,155,000	
第155回利付国債（5年）	100,000,000	100,265,000	
第156回利付国債（20年）	420,000,000	395,404,800	
第156回利付国債（5年）	250,000,000	249,715,000	
第157回利付国債（20年）	400,000,000	365,888,000	
第157回利付国債（5年）	500,000,000	498,890,000	
第158回利付国債（20年）	370,000,000	350,112,500	
第158回利付国債（5年）	650,000,000	645,937,500	
第159回利付国債（20年）	500,000,000	477,260,000	
第15回利付国債（30年）	200,000,000	234,328,000	
第15回利付国債（40年）	400,000,000	312,188,000	
第160回利付国債（20年）	550,000,000	530,002,000	
第160回利付国債（5年）	400,000,000	398,632,000	
第161回利付国債（20年）	550,000,000	521,367,000	
第161回利付国債（5年）	200,000,000	200,128,000	
第162回利付国債（20年）	600,000,000	566,562,000	
第162回利付国債（5年）	450,000,000	449,590,500	
第163回利付国債（20年）	700,000,000	658,385,000	
第163回利付国債（5年）	300,000,000	301,080,000	
第164回利付国債（20年）	400,000,000	369,624,000	
第164回利付国債（5年）	300,000,000	297,861,000	
第165回利付国債（20年）	450,000,000	414,022,500	
第166回利付国債（20年）	410,000,000	386,720,200	
第167回利付国債（20年）	500,000,000	456,230,000	
第168回利付国債（20年）	400,000,000	357,780,000	
第169回利付国債（20年）	370,000,000	324,164,400	
第16回利付国債（30年）	200,000,000	234,646,000	
第16回利付国債（40年）	460,000,000	393,691,000	
第170回利付国債（20年）	420,000,000	366,298,800	
第171回利付国債（20年）	400,000,000	347,036,000	
第172回利付国債（20年）	500,000,000	439,000,000	
第173回利付国債（20年）	400,000,000	349,396,000	
第174回利付国債（20年）	500,000,000	434,475,000	
第175回利付国債（20年）	480,000,000	422,313,600	
第176回利付国債（20年）	400,000,000	350,148,000	
第177回利付国債（20年）	420,000,000	359,427,600	
第178回利付国債（20年）	250,000,000	216,882,500	

第179回利付国債（20年）	120,000,000	103,704,000	
第17回利付国債（30年）	200,000,000	232,930,000	
第181回利付国債（20年）	120,000,000	110,684,400	
第182回利付国債（20年）	100,000,000	95,225,000	
第183回利付国債（20年）	50,000,000	49,962,500	
第186回利付国債（20年）	560,000,000	564,698,400	
第187回利付国債（20年）	20,000,000	19,433,200	
第18回利付国債（30年）	200,000,000	231,104,000	
第19回利付国債（30年）	200,000,000	231,274,000	
第1回クライメート・トランジション利付国債（10年）	1,200,000,000	1,200,540,000	
第1回利付国債（30年）	300,000,000	340,398,000	
第1回利付国債（40年）	160,000,000	185,632,000	
第20回利付国債（30年）	100,000,000	117,951,000	
第21回利付国債（30年）	200,000,000	231,538,000	
第22回利付国債（30年）	200,000,000	236,264,000	
第23回利付国債（30年）	100,000,000	118,211,000	
第24回利付国債（30年）	120,000,000	141,933,600	
第25回利付国債（30年）	100,000,000	115,899,000	
第26回メキシコ合衆国円貨債券（2018）	100,000,000	99,792,000	
第26回利付国債（30年）	150,000,000	175,702,500	
第27回利付国債（30年）	320,000,000	378,966,400	
第28回利付国債（30年）	300,000,000	355,299,000	
第29回利付国債（30年）	200,000,000	234,282,000	
第2回メキシコ合衆国円貨債券（2022）（SDG債）	100,000,000	99,014,000	
第2回利付国債（30年）	380,000,000	425,505,000	
第2回利付国債（40年）	300,000,000	335,511,000	
第30回利付国債（30年）	350,000,000	404,827,500	
第31回利付国債（30年）	400,000,000	456,692,000	
第32回利付国債（30年）	500,000,000	577,220,000	
第338回利付国債（10年）	650,000,000	652,756,000	
第339回利付国債（10年）	900,000,000	904,230,000	
第33回利付国債（30年）	400,000,000	443,020,000	
第340回利付国債（10年）	1,210,000,000	1,216,098,400	
第341回利付国債（10年）	800,000,000	802,696,000	
第342回利付国債（10年）	800,000,000	799,584,000	
第343回利付国債（10年）	700,000,000	699,510,000	
第344回利付国債（10年）	700,000,000	699,370,000	
第345回利付国債（10年）	1,000,000,000	998,870,000	
第346回利付国債（10年）	800,000,000	798,648,000	
第347回利付国債（10年）	750,000,000	748,012,500	
第348回利付国債（10年）	900,000,000	896,643,000	
第349回利付国債（10年）	500,000,000	497,530,000	
第34回利付国債（30年）	350,000,000	397,064,500	
第350回利付国債（10年）	600,000,000	596,250,000	
第351回利付国債（10年）	500,000,000	496,150,000	
第352回利付国債（10年）	260,000,000	257,475,400	
第353回利付国債（10年）	800,000,000	790,880,000	

第 3 5 4 回利付国債（ 1 0 年）	650,000,000	641,894,500	
第 3 5 5 回利付国債（ 1 0 年）	730,000,000	720,269,100	
第 3 5 6 回利付国債（ 1 0 年）	650,000,000	640,757,000	
第 3 5 8 回利付国債（ 1 0 年）	900,000,000	884,772,000	
第 3 5 9 回利付国債（ 1 0 年）	1,250,000,000	1,226,475,000	
第 3 5 回利付国債（ 3 0 年）	220,000,000	242,380,600	
第 3 6 0 回利付国債（ 1 0 年）	1,000,000,000	979,200,000	
第 3 6 1 回利付国債（ 1 0 年）	800,000,000	781,712,000	
第 3 6 2 回利付国債（ 1 0 年）	1,000,000,000	975,000,000	
第 3 6 3 回利付国債（ 1 0 年）	830,000,000	806,818,100	
第 3 6 4 回利付国債（ 1 0 年）	600,000,000	581,412,000	
第 3 6 5 回利付国債（ 1 0 年）	900,000,000	869,607,000	
第 3 6 6 回利付国債（ 1 0 年）	1,000,000,000	971,440,000	
第 3 6 7 回利付国債（ 1 0 年）	200,000,000	193,732,000	
第 3 6 8 回利付国債（ 1 0 年）	280,000,000	270,421,200	
第 3 6 回利付国債（ 3 0 年）	180,000,000	198,149,400	
第 3 7 0 回利付国債（ 1 0 年）	260,000,000	256,547,200	
第 3 7 1 回利付国債（ 1 0 年）	200,000,000	195,088,000	
第 3 7 2 回利付国債（ 1 0 年）	150,000,000	151,413,000	
第 3 7 3 回利付国債（ 1 0 年）	200,000,000	197,614,000	
第 3 7 回利付国債（ 3 0 年）	330,000,000	357,489,000	
第 3 8 回利付国債（ 3 0 年）	200,000,000	212,682,000	
第 3 9 回利付国債（ 3 0 年）	180,000,000	194,131,800	
第 3 回利付国債（ 3 0 年）	100,000,000	111,739,000	
第 3 回利付国債（ 4 0 年）	250,000,000	278,880,000	
第 4 0 回利付国債（ 3 0 年）	150,000,000	158,974,500	
第 4 1 回利付国債（ 3 0 年）	100,000,000	104,010,000	
第 4 2 回利付国債（ 3 0 年）	130,000,000	135,053,100	
第 4 3 回利付国債（ 3 0 年）	140,000,000	145,265,400	
第 4 4 6 回利付国債（ 2 年）	350,000,000	350,000,000	
第 4 4 7 回利付国債（ 2 年）	200,000,000	199,966,000	
第 4 4 8 回利付国債（ 2 年）	100,000,000	99,970,000	
第 4 4 9 回利付国債（ 2 年）	150,000,000	149,932,500	
第 4 4 回利付国債（ 3 0 年）	150,000,000	155,449,500	
第 4 5 0 回利付国債（ 2 年）	700,000,000	699,573,000	
第 4 5 1 回利付国債（ 2 年）	800,000,000	799,304,000	
第 4 5 2 回利付国債（ 2 年）	400,000,000	399,512,000	
第 4 5 6 回利付国債（ 2 年）	100,000,000	99,935,000	
第 4 5 回利付国債（ 3 0 年）	220,000,000	219,824,000	
第 4 6 回利付国債（ 3 0 年）	350,000,000	349,160,000	
第 4 7 回利付国債（ 3 0 年）	250,000,000	253,627,500	
第 4 8 回利付国債（ 3 0 年）	300,000,000	292,959,000	
第 4 9 回利付国債（ 3 0 年）	420,000,000	409,390,800	
第 4 回利付国債（ 4 0 年）	250,000,000	278,335,000	
第 5 0 回利付国債（ 3 0 年）	350,000,000	301,616,000	
第 5 1 回利付国債（ 3 0 年）	250,000,000	191,190,000	
第 5 2 回利付国債（ 3 0 年）	400,000,000	319,856,000	
第 5 3 回利付国債（ 3 0 年）	400,000,000	326,296,000	

第54回利付国債（30年）	410,000,000	349,131,400	
第55回利付国債（30年）	390,000,000	331,094,400	
第56回利付国債（30年）	450,000,000	380,866,500	
第57回利付国債（30年）	340,000,000	286,888,600	
第58回利付国債（30年）	480,000,000	403,785,600	
第59回利付国債（30年）	300,000,000	245,622,000	
第5回利付国債（30年）	100,000,000	112,232,000	
第5回利付国債（40年）	130,000,000	138,862,100	
第60回利付国債（30年）	340,000,000	291,080,800	
第61回利付国債（30年）	120,000,000	97,516,800	
第62回利付国債（30年）	250,000,000	192,190,000	
第63回利付国債（30年）	250,000,000	186,197,500	
第64回利付国債（30年）	310,000,000	229,958,000	
第65回利付国債（30年）	310,000,000	229,037,300	
第66回利付国債（30年）	290,000,000	213,222,500	
第67回利付国債（30年）	400,000,000	309,832,000	
第68回利付国債（30年）	400,000,000	308,712,000	
第69回利付国債（30年）	200,000,000	158,054,000	
第6回利付国債（30年）	180,000,000	205,500,600	
第6回利付国債（40年）	150,000,000	156,598,500	
第70回利付国債（30年）	360,000,000	283,528,800	
第71回利付国債（30年）	330,000,000	259,000,500	
第72回利付国債（30年）	280,000,000	218,996,400	
第73回利付国債（30年）	220,000,000	171,630,800	
第74回利付国債（30年）	220,000,000	185,961,600	
第75回利付国債（30年）	100,000,000	91,132,000	
第76回利付国債（20年）	200,000,000	204,070,000	
第76回利付国債（30年）	210,000,000	195,810,300	
第77回利付国債（20年）	300,000,000	306,426,000	
第77回利付国債（30年）	160,000,000	156,299,200	
第78回利付国債（20年）	250,000,000	256,145,000	
第78回利付国債（30年）	160,000,000	148,777,600	
第79回利付国債（30年）	150,000,000	132,471,000	
第7回利付国債（30年）	300,000,000	341,523,000	
第7回利付国債（40年）	160,000,000	159,206,400	
第80回利付国債（20年）	100,000,000	102,723,000	
第80回利付国債（30年）	290,000,000	295,707,200	
第81回利付国債（20年）	200,000,000	206,052,000	
第81回利付国債（30年）	130,000,000	126,301,500	
第83回利付国債（20年）	300,000,000	310,857,000	
第85回利付国債（20年）	200,000,000	208,170,000	
第88回利付国債（20年）	400,000,000	420,128,000	
第89回利付国債（20年）	400,000,000	419,200,000	
第8回利付国債（30年）	100,000,000	109,976,000	
第8回利付国債（40年）	100,000,000	92,120,000	
第90回利付国債（20年）	300,000,000	315,915,000	
第91回利付国債（20年）	300,000,000	316,686,000	
第92回利付国債（20年）	340,000,000	358,764,600	

	第 9 3 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	317,028,000	
	第 9 4 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	317,946,000	
	第 9 5 回利付国債（ 2 0 年）	150,000,000	160,539,000	
	第 9 6 回利付国債（ 2 0 年）	100,000,000	106,365,000	
	第 9 7 回利付国債（ 2 0 年）	150,000,000	160,657,500	
	第 9 8 回利付国債（ 2 0 年）	100,000,000	106,750,000	
	第 9 9 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	214,230,000	
	第 9 回利付国債（ 3 0 年）	100,000,000	106,572,000	
	第 9 回利付国債（ 4 0 年）	390,000,000	262,431,000	
	国債証券 小計		88,095,172,800	
地方債証券	第 1 0 回静岡県公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	109,620,000	
	第 1 0 回千葉県公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	108,563,000	
	第 1 1 回静岡県公募公債（ 2 0 年）	50,000,000	54,218,000	
	第 1 2 回埼玉県公募公債（ 3 0 年）	100,000,000	73,265,000	
	第 1 2 回東京都公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	107,029,000	
	第 1 3 回千葉県公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	108,082,000	
	第 1 3 回大阪市公募公債（ 2 0 年）	50,000,000	54,817,500	
	第 1 4 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,533,000	
	第 1 4 回川崎市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	108,662,000	
	第 1 5 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,654,000	
	第 1 5 回千葉県公募公債（ 2 0 年・定時償還）	90,000,000	84,634,200	
	第 1 6 0 回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	85,655,000	
	第 1 8 1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,157,000	
	第 1 8 4 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,986,000	
	第 1 8 8 回共同発行市場公募地方債	30,000,000	29,762,700	
	第 1 8 回神奈川県公募公債（ 2 0 年）	50,000,000	54,405,000	
	第 2 0 6 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,701,000	
	第 2 0 9 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,457,000	
	第 2 1 1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,265,000	
	第 2 4 回群馬県公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	96,064,000	
	第 2 4 回千葉県公募公債	100,000,000	91,580,000	
	第 2 6 回東京都公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	108,307,000	
	第 2 7 回神奈川県公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	104,759,000	
	第 2 9 回埼玉県公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	84,598,000	
	第 2 回横浜市公募公債（ 3 0 年）	100,000,000	116,015,000	
	第 2 回兵庫県公募公債（ 3 0 年）	100,000,000	113,991,000	
	第 2 回名古屋市公募公債（ 1 5 年）	100,000,000	102,372,000	
	第 3 6 回神奈川県公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	92,900,000	
	第 3 8 7 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	44,040,000	44,146,576	
	第 3 9 2 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	100,234,000	
	第 3 回神奈川県公募公債（ 3 0 年）	100,000,000	117,911,000	
	第 3 回兵庫県公募公債（ 1 5 年）	100,000,000	103,501,000	
	第 4 6 9 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	96,507,000	
	第 4 7 9 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	4,000,000	3,867,240	
	第 4 回横浜市公募公債（ 3 0 年）	100,000,000	116,896,000	
	第 5 回大阪市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	109,218,000	
	第 6 回京都市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	107,239,000	
	第 6 回札幌市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	109,259,000	

第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	104,041,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	99,641,000	
第800回東京都公募公債	100,000,000	97,730,000	
平成24年度第12回愛知県公募公債（30年）	10,000,000	10,979,100	
平成24年度第14回愛知県公募公債（15年）	100,000,000	103,645,000	
平成25年度第10回京都府公募公債（15年）	100,000,000	103,203,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	103,031,000	
平成26年度第9回静岡県公募公債	20,000,000	20,066,600	
平成27年度第12回愛知県公募公債（15年）	100,000,000	101,380,000	
平成27年度第13回北海道公募公債	100,000,000	100,438,000	
平成27年度第1回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	100,337,000	
平成27年度第4回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,477,000	
平成27年度第9回北海道公募公債	100,000,000	100,464,000	
平成28年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,640,000	
平成28年度第5回広島市公募公債	100,000,000	99,925,000	
平成28年度第6回福岡県公募公債	100,000,000	99,774,000	
平成29年度第1回秋田県公募公債	45,900,000	45,576,405	
平成29年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	99,689,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,656,000	
平成30年度第18回北海道公募公債	20,000,000	19,681,800	
平成30年度第1回熊本市公募公債	100,000,000	99,181,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	81,197,000	
平成30年度第6回広島市公募公債	45,000,000	44,308,350	
令和2年度第3回長崎県公募公債（10年）	12,400,000	12,107,236	
令和2年度第9回静岡県公募公債	100,000,000	97,336,000	
令和3年度第6回福岡県公募公債	100,000,000	96,347,000	
地方債証券 小計		5,628,682,707	

特殊債券	F 1 4 9 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,609,000	
	F 1 8 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,986,000	
	F 3 0 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,026,000	
	F 4 3 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,662,000	
	い第8 5 3 号商工債	100,000,000	99,267,000	
	い第8 5 5 号商工債	100,000,000	99,183,000	
	い第8 5 6 号商工債	100,000,000	99,155,000	
	第1 0 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,381,000	52,086,618	
	第1 0 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,962,000	56,201,694	
	第1 0 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,581,000	
	第1 1 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,545,000	61,438,449	
	第1 1 4 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,144,000	
	第1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,015,000	64,303,573	
	第1 1 8 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	91,650,000	
	第1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,696,000	65,086,996	
	第1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,725,000	66,611,081	
	第1 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,115,000	
	第1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,359,000	67,900,942	
	第1 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,675,000	69,222,210	
	第1 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,498,000	69,760,626	
	第1 3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,914,000	70,706,132	
	第1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,406,000	70,933,471	
	第1 3 回公営企業債券（20年）	10,000,000	10,259,700	
	第1 4 5 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,183,000	
	第1 5 7 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,274,000	
	第1 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,788,000	81,523,439	
	第1 7 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,185,000	
	第1 7 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,914,000	
	第1 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,445,000	83,415,512	
	第1 7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,796,000	84,538,339	
	第1 9 1 回都市再生債券	100,000,000	98,200,000	
	第1 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,360,000	96,119,100	
	第2 1 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,517,000	
	第2 1 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2,000,000	2,002,060	
	第2 1 回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	100,389,000	
	第2 2 回公営企業債券（20年）	100,000,000	106,475,000	
	第2 3 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	13,000,000	13,044,720	
	第2 3 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,597,000	
	第2 3 回国際協力銀行債券	100,000,000	103,309,000	
	第2 3 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	20,000,000	21,368,600	
	第2 5 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,152,000	
	第2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,649,000	15,264,258	

第 2 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	10,000,000	11,721,500	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,907,000	17,634,677	
第 2 9 回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人	100,000,000	99,990,000	
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,297,000	19,148,725	
第 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,114,000	19,158,153	
第 3 1 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,547,000	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,355,000	19,163,170	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,767,000	18,457,247	
第 3 3 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	92,718,000	
第 3 4 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	13,000,000	12,899,900	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,163,000	10,245,625	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,194,000	17,853,733	
第 3 7 8 回信金中金債（ 5 年 ）	100,000,000	99,393,000	
第 3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,365,000	
第 3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,385,000	20,071,229	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,839,000	19,432,051	
第 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,889,000	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	32,016,000	31,797,330	
第 4 0 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	70,063,000	
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,511,000	23,233,377	
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,384,000	23,265,705	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,557,000	18,232,593	
第 4 9 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,536,000	
第 4 回公営企業債券（ 3 0 年 ）	100,000,000	119,176,000	
第 5 3 回政府保証日本政策金融公庫債券	62,000,000	61,536,860	
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,404,000	25,181,999	
第 5 回国際協力機構債券	100,000,000	108,395,000	
第 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,093,000	25,833,494	
第 6 4 回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人	100,000,000	99,262,000	
第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,299,000	31,852,679	
第 6 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	14,000,000	14,032,620	
第 6 8 回地方公共団体金融機構債券（ 2 0 年 ）	100,000,000	90,123,000	
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,977,000	34,809,776	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,375,000	30,087,050	
第 7 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,802,000	28,262,679	
第 7 6 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,427,000	
第 7 8 回株式会社日本政策投資銀行無担保社債（社債間限定同順位	100,000,000	99,658,000	
第 7 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,576,000	30,044,779	
第 7 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	102,709,000	
第 8 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,812,000	33,301,883	
第 8 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,002,000	

第 8 5 回中日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人	100,000,000	99,643,000	
第 8 9 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,415,000	
第 8 回公営企業債券（ 3 0 年 ）	10,000,000	11,539,200	
第 9 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,107,000	
第 9 6 回株式会社日本政策投資銀行無担保社債（社債間限定同順位	100,000,000	98,843,000	
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,831,000	50,222,044	
第 9 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,665,000	
第 9 9 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,605,000	
第 9 回新関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,179,000	
第 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	9,516,000	9,538,362	
特殊債券 小計		6,341,628,960	

社債券	第１０回九州旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約	100,000,000	83,066,000	
	第１１回電源開発株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,902,000	
	第１１回東急株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	96,208,000	
	第１２２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同	100,000,000	75,757,000	
	第１３回東京地下鉄株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	106,368,000	
	第１４回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（２０１７）	100,000,000	98,383,000	
	第１４回ソフトバンク株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約	100,000,000	98,623,000	
	第１５２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同	100,000,000	99,733,000	
	第１５回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債（社債間	100,000,000	96,790,000	
	第１８回イオンモール株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約	100,000,000	87,946,000	
	第１８回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債（２０１８	100,000,000	99,618,000	
	第２１回キリンホールディングス株式会社無担保社債（社債間限定	100,000,000	99,292,000	
	第２１回株式会社オリエンタルランド無担保社債（社債間限定同順	100,000,000	99,847,000	
	第２１回三井住友信託銀行株式会社無担保社債（社債間限定同順位	100,000,000	99,068,000	
	第２２回三菱瓦斯化学株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約	100,000,000	99,606,000	
	第２５回日本郵船株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	104,867,000	
	第２６回トヨタ自動車株式会社無担保社債（社債間限定同等特約付	100,000,000	99,321,000	
	第２６回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	97,701,000	
	第２９８回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	86,950,000	
	第３０回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０１	100,000,000	98,893,000	
	第３０回大和ハウス工業株式会社無担保社債（特定社債間限定同順	100,000,000	99,933,000	
	第３１回株式会社光通信無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	85,583,000	
	第３１回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,805,000	
	第３２回ＡＮＡホールディングス株式会社無担保社債（社債間限定	100,000,000	88,656,000	
	第３５０回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	89,091,000	

第36回フランス相互信用連合銀行（BFCM）円貨社債（202	100,000,000	96,530,000	
第3回NTTファイナンス株式会社無担保社債（社債間限定同順位	100,000,000	97,007,000	
第3回韓国輸出入銀行保証株式会社大韓航空円貨社債（2023）	100,000,000	99,480,000	
第426回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	96,951,000	
第432回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,818,000	
第44回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債（相模鉄道株式	100,000,000	99,305,000	
第45回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位	100,000,000	108,714,000	
第45回東邦瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	94,939,000	
第465回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	98,676,000	
第47回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債（阪急電鉄	100,000,000	102,846,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債（社債間限	100,000,000	97,240,000	
第4回東京地下鉄株式会社社債（一般担保付）	10,000,000	10,464,700	
第506回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,554,000	
第510回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,733,000	
第519回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	94,206,000	
第524回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,036,000	
第52回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特	100,000,000	75,826,000	
第534回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	85,795,000	
第540回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,190,000	
第545回中部電力株式会社社債（一般担保付）（グリーンボンド	100,000,000	95,822,000	
第58回電源開発株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	88,243,000	
第59回日本電気株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,537,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債（担保提供制限等財務上特約	100,000,000	108,407,000	
第67回三菱UFJリース株式会社無担保社債（社債間限定同順位	100,000,000	97,846,000	
第67回東京瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	74,184,000	

第6回東京電力パワーグリッド株式会社社債 （一般担保付）	100,000,000	100,245,000	
第73回株式会社ホンダファイナンス無担保社債 （社債間限定同順）	100,000,000	99,041,000	
第83回三井不動産株式会社無担保社債（社債 間限定同順位特約付）	100,000,000	97,407,000	
第8回ビー・エヌ・ピー・パリパ円貨社債（2 023）	100,000,000	99,560,000	
第8回楽天株式会社無担保社債（社債間限定同 順位特約付）	100,000,000	98,916,000	
社債券 小計		5,208,525,700	
合 計	106,503,728,000	105,274,010,167	

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当する事項はありません。

「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2023年2月20日現在)	(2024年2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		4,748,045,867	4,074,092,376
金銭信託		8,390,656	26,232,609
コール・ローン		3,901,696,407	3,389,694,041
株式		197,187,704,503	256,434,914,393
投資証券		4,608,256,742	5,042,834,702
派生商品評価勘定		457,879,306	354,474,253
未収入金		21,956,109	47,900,186
未収配当金		232,055,540	227,801,729
差入委託証拠金		1,257,017,904	785,510,593
流動資産合計		212,423,003,034	270,383,454,882
資産合計		212,423,003,034	270,383,454,882
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		10,932,262	488,957
未払解約金		198,094,000	96,116,060
未払利息		10,436	9,107
その他未払費用		1,689	1,977
流動負債合計		209,038,387	96,616,101
負債合計		209,038,387	96,616,101
純資産の部			
元本等			
元本	1	45,434,848,844	43,017,386,757
剰余金			

剰余金又は欠損金（ ）		166,779,115,803	227,269,452,024
元本等合計		212,213,964,647	270,286,838,781
純資産合計		212,213,964,647	270,286,838,781
負債純資産合計		212,423,003,034	270,383,454,882

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

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 外国先物の評価においては、個別法に基づき、原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定しております。 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。
4 その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

（2023年2月20日現在）	（2024年2月20日現在）
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（2023年2月20日現在）	（2024年2月20日現在）
1 期首元本額	47,184,065,744円	45,434,848,844円
期中追加設定元本額	5,183,763,132円	3,084,782,535円
期中一部解約元本額	6,932,980,032円	5,502,244,622円
元本の内訳		
ファンド名		
ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン	5,144,133,854円	4,902,195,317円
ステート・ストリートDC外国株式インデックス・オープン	6,286,284,543円	6,134,045,367円
ステート・ストリートDCグローバル株式インデックス・オープン	81,163,684円	91,383,905円
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	53,544,059円	41,989,511円
外国株式インデックス・ファンドVA1（適格機関投資家専用）	73,047,510円	55,523,463円
外国株式インデックス・ファンドVA2（適格機関投資家専用）	24,203,309円	18,104,991円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	1,133,923円	341,926円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	19,217,219円	10,336,078円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	44,957円	37,742円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	1,863,710円	621,187円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	2,221,353円	1,328,585円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	3,168,663,038円	2,511,960,322円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	720,976円	620,494円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	273,504,384円	185,717,110円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	299,920,621円	231,542,261円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	28,280,249円	19,047,532円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	74,746,045円	49,514,428円

4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	1,142,808,320円	864,100,268円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	155,096,945円	101,927,155円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	555,875,883円	403,907,553円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	25,048,283円	18,507,195円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	16,841,652円	11,498,815円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	22,751,598円	17,608,078円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	8,287,055円	5,554,045円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	113,172,139円	83,717,311円
バランスファンドVA20A＜適格機関投資家限定＞	310,551円	215,623円
バランスファンドVA35B＜適格機関投資家限定＞	693,530円	345,441円
外国株式インデックス・ファンドVA3＜適格機関投資家限定＞	178,075,657円	196,460,408円
4資産インデックスバランスVA20＜適格機関投資家限定＞	105,834,281円	79,457,078円
4資産インデックスバランスVA50＜適格機関投資家限定＞	17,803,847円	15,616,424円
Ta dリスクバジェット型マルチ配分戦略 ファンド（ステイブル）年金＜適格機関投資家限定＞	18,153,238円	14,610,590円
Ta dリスクバジェット型マルチ配分戦略 ファンド（ステイブル）＜適格機関投資家限定＞	11,926,274円	13,520,577円
ステート・ストリート先進国株式インデックス・オープン	317,795,282円	255,901,784円
ステート・ストリート先進国株式インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	2,648,273,659円	1,384,925,665円
全世界株式インデックス・ファンド	1,976,640,969円	2,565,952,981円
ステート・ストリート・グローバル株式インデックス・オープン	—円	170,851円
ステート・ストリート全世界株式インデックス・オープン	—円	143,854円
世界バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	6,566,440円	4,285,653円
世界バランス60VA＜適格機関投資家限定＞	15,282,464円	6,102,896円
グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	462,508円	248,375円
グローバルバランス40VA2＜適格機関投資家限定＞	705,426,207円	499,346,335円
グローバルバランス40VA3＜適格機関投資家限定＞	24,812,496円	12,380,747円
グローバルバランス50VA＜適格機関投資家限定＞	11,431,915円	9,558,261円

ワールドエクイティ・ファンドV L <適格機関投資家限定>	21,822,784,217円	22,197,012,575円
計	45,434,848,844円	43,017,386,757円
2 受益権の総数	45,434,848,844口	43,017,386,757口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	（2023年2月20日現在）	（2024年2月20日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左

2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。	同左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(2023年2月20日現在)	(2024年2月20日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	7,565,823,047	21,952,060,112
投資証券	168,591,981	201,047,894
合計	7,734,415,028	22,153,108,006

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までを指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

(単位：円)

区 分	種 類	(2023年2月20日現在)		
		契 約 額 等	時 価	評 価 損 益
		うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MINI S&P 500	7,321,630,697	—	7,556,510,132	234,879,435
	S&P 60	433,536,909	—	443,689,632	10,152,723
	SPI 200	361,668,148	—	369,384,629	7,716,481
	FTSE100INDEX	449,605,329	—	476,212,950	26,607,621
	FSMI INDEX	350,516,404	—	356,784,962	6,268,558
	EURO STOXX 50	1,123,842,764	—	1,216,330,632	92,487,868
合 計		10,040,800,251	—	10,418,912,937	378,112,686

(単位：円)

区 分	種 類	(2024年2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MINI S&P 500	6,349,933,038	—	6,605,112,536	255,179,498
	S&P 60	337,107,604	—	343,255,333	6,147,729
	SPI 200	294,308,361	—	298,872,672	4,564,311
	FTSE100INDEX	346,046,077	—	349,962,696	3,916,619
	FSMI INDEX	228,275,005	—	231,410,412	3,135,407
	EURO STOXX 50	888,871,182	—	920,568,980	31,697,798
合 計		8,444,541,267	—	8,749,182,629	304,641,362

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

通貨関連

(単位：円)

区 分	種 類	(2023年2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	3,421,595,060	—	3,487,174,600	65,579,540
	カナダ・ドル	148,299,818	—	150,122,086	1,822,268
	オーストラリア・ドル	89,317,102	—	90,313,272	996,170
	イギリス・ポンド	190,356,840	—	193,523,160	3,166,320
	ユーロ	332,828,496	—	335,424,024	2,595,528
	売建				
	アメリカ・ドル	421,661,860	—	426,622,867	4,961,007
	カナダ・ドル	8,950,410	—	8,947,674	2,736

	オーストラリア・ドル	16,472,852	—	16,588,152	115,300
	香港・ドル	8,553,000	—	8,569,300	16,300
	ユーロ	52,854,335	—	53,089,932	235,597
	合 計	4,690,889,773	—	4,770,375,067	68,834,358

(単位：円)

区 分	種 類	(2024年2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	2,750,611,725	—	2,791,189,213	40,577,488
	カナダ・ドル	111,925,995	—	113,335,974	1,409,979
	オーストラリア・ドル	67,359,632	—	68,600,210	1,240,578
	イギリス・ポンド	151,059,015	—	152,942,823	1,883,808
	ユーロ	332,447,279	—	336,971,445	4,524,166
	売建				
	アメリカ・ドル	11,996,800	—	12,028,536	31,736
	カナダ・ドル	7,749,000	—	7,777,959	28,959
	ユーロ	43,405,200	—	43,636,590	231,390
	合 計	3,476,554,646	—	3,526,482,750	49,343,934

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

4. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(2023年2月20日現在)	(2024年2月20日現在)
1口当たり純資産額	4.6707円	6.2832円
(1万口当たり純資産額)	(46,707円)	(62,832円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	APA CORPORATION	9,100	31.57	287,287.00	
	BAKER HUGHES COMPANY	29,949	29.15	873,013.35	
	CHENIERE ENERGY INC	7,111	160.37	1,140,391.07	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	3,300	78.73	259,809.00	
	CHEVRON CORPORATION	53,795	154.63	8,318,320.85	
	CONOCOPHILLIPS	35,488	110.57	3,923,908.16	
	COTERRA ENERGY INC	22,400	24.68	552,832.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	19,000	43.46	825,740.00	
	DIAMONDBACK ENERGY	5,000	179.42	897,100.00	
	EOG RESOURCES INC	17,306	113.56	1,965,269.36	
	EQT CORP	11,900	34.70	412,930.00	
	EXXON MOBIL CORPORATION	118,851	103.73	12,328,414.23	
	HALLIBURTON CO	26,614	35.31	939,740.34	
	HESS CORP	8,200	148.43	1,217,126.00	
	HF SINCLAIR CORP	4,900	60.11	294,539.00	
	KINDER MORGAN INC	59,472	17.11	1,017,565.92	
	MARATHON OIL CORP	17,900	23.38	418,502.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	11,830	170.01	2,011,218.30	
	OCCIDENTAL PETROLEUM	19,624	60.52	1,187,644.48	
	ONEOK INC NEW	17,300	71.99	1,245,427.00	
	OVINTIV INC	7,600	44.83	340,708.00	
	PHILLIPS 66	13,183	143.81	1,895,847.23	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	6,924	231.57	1,603,390.68	
	SCHLUMBERGER LTD	42,162	48.57	2,047,808.34	
	TARGA RESOURCES CORP	6,300	96.94	610,722.00	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	180	1,511.81	272,125.80	
	VALERO ENERGY CORP	10,503	139.54	1,465,588.62	
	WILLIAMS COS	36,041	34.31	1,236,566.71	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	6,547	226.85	1,485,186.95	
	ALBEMARLE CORP	3,500	122.59	429,065.00	
	AMCOR PLC	21,100	9.04	190,744.00	
	AVERY DENNISON CORP	2,357	208.83	492,212.31	
	BALL CORPORATION	9,504	62.09	590,103.36	
	CELANESE CORPORATION	3,072	151.06	464,056.32	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,700	77.70	442,890.00	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	15,700	19.87	311,959.00	
	CORTEVA INC	21,068	54.80	1,154,526.40	
	CROWN HOLDINGS INC	3,700	72.26	267,362.00	
	DOW INC	20,835	55.48	1,155,925.80	
	DUPONT DE NEMOURS INC	13,569	68.45	928,798.05	
	EASTMAN CHEMICAL CO	3,555	85.19	302,850.45	
	ECOLAB INC	7,626	215.38	1,642,487.88	
	FMC CORP	3,700	52.34	193,658.00	
	FREEMPORT MCMORAN INC	42,466	38.83	1,648,954.78	

INT'L FLAVORS FRAGRANCES	7,539	81.19	612,091.41	
INT'L PAPER CO	9,690	35.80	346,902.00	
LINDE PLC	14,514	431.63	6,264,677.82	
LYONDELLBASELL INDU CL A	7,745	97.70	756,686.50	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,830	539.87	987,962.10	
MOSAIC CO/THE	9,801	30.55	299,420.55	
NEWMONT CORPORATION	21,947	33.43	733,688.21	
NUCOR CORP	7,371	185.58	1,367,910.18	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,700	167.98	453,546.00	
PPG INDUSTRIES	6,947	141.91	985,848.77	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	1,700	326.43	554,931.00	
RPM INTERNATIONAL INC	3,900	108.44	422,916.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO	7,289	309.08	2,252,884.12	
STEEL DYNAMICS INC	4,700	123.34	579,698.00	
VULCAN MATERIALS CO	3,956	255.15	1,009,373.40	
WESTLAKE CORP	1,100	144.15	158,565.00	
WESTROCK COMPANY	7,625	43.71	333,288.75	
3M CO	16,382	91.25	1,494,857.50	
AECOM	4,000	89.19	356,760.00	
AERCAP HOLDINGS NV	5,900	77.64	458,076.00	
ALLEGION PLC W/I	2,600	132.42	344,292.00	
AMETEK INC	6,800	173.89	1,182,452.00	
AXON ENTERPRISE INC	2,100	269.80	566,580.00	
BOEING CO	16,970	203.89	3,460,013.30	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	3,700	183.79	680,023.00	
CARLISLE COS INC	1,500	341.92	512,880.00	
CARRIER GLOBAL CORP	24,856	54.00	1,342,224.00	
CATERPILLAR	15,171	321.91	4,883,696.61	
CNH INDUSTRIAL NV	29,616	12.15	359,834.40	
CUMMINS ENGINE CO	4,212	266.48	1,122,413.76	
DEERE & CO	8,095	360.68	2,919,704.60	
DOVER CORP	4,214	161.46	680,392.44	
EATON CORP PLC	11,861	277.52	3,291,664.72	
EMERSON ELECTRIC CO	16,949	106.15	1,799,136.35	
FASTENAL CO	17,000	70.24	1,194,080.00	
FORTIVE CORPORATION	10,434	84.32	879,794.88	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	3,800	79.31	301,378.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	6,860	269.44	1,848,358.40	
GENERAL ELECTRIC CO	32,300	149.16	4,817,868.00	
GRACO INC	5,100	88.15	449,565.00	
GRAINGER (WW)	1,337	935.80	1,251,164.60	
HEICO CORP	1,300	194.01	252,213.00	
HEICO CORP-CLASS A	2,300	157.19	361,537.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	19,717	197.17	3,887,600.89	
HOWMET AEROSPACE INC	11,629	62.82	730,533.78	
HUBBELL INC	1,600	358.88	574,208.00	
HUNTINGTON INGALLS IND	1,200	285.09	342,108.00	

IDEX CORP	2,300	227.47	523,181.00	
ILLINOIS TOOL WORKS	9,018	253.92	2,289,850.56	
INGERSOLL-RAND INC	12,027	89.47	1,076,055.69	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,700	41.28	194,016.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	20,124	56.86	1,144,250.64	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	5,670	211.98	1,201,926.60	
LENNOX INTERNATIONAL	900	448.41	403,569.00	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	6,598	424.07	2,798,013.86	
MASCO CORP	6,690	73.16	489,440.40	
NORDSON CORP	1,500	264.07	396,105.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,240	450.96	1,912,070.40	
OTIS WORLDWIDE CORP	12,178	91.24	1,111,120.72	
OWENS CORNING	2,700	139.95	377,865.00	
PACCAR INC	15,459	107.77	1,666,016.43	
PARKER HANNIFIN CORP	3,828	520.06	1,990,789.68	
PENTAIR PLC	4,834	74.92	362,163.28	
QUANTA SERVICES INC	4,300	211.44	909,192.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,422	279.72	957,201.84	
RTX CORP	43,163	91.01	3,928,264.63	
SMITH (A.O.) CORP	3,700	80.09	296,333.00	
SNAP-ON	1,604	267.24	428,652.96	
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,460	88.35	394,041.00	
TEXTRON	5,852	85.69	501,457.88	
TORO CO	3,100	93.76	290,656.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	6,731	272.17	1,831,976.27	
TRANSDIGM GROUP INC	1,640	1,146.39	1,880,079.60	
UNITED RENTALS INC	2,026	650.31	1,317,528.06	
VERTIV HOLDINGS CO	10,100	62.97	635,997.00	
WABTEC CORPORATION	5,406	134.28	725,917.68	
WATSCO INC	1,000	381.46	381,460.00	
XYLEM INC	7,154	123.79	885,593.66	
AUTOMATIC DATA PROCESS	12,263	252.97	3,102,171.11	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	3,900	145.59	567,801.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	3,500	197.92	692,720.00	
CINTAS CORP	2,719	614.66	1,671,260.54	
COPART INC	25,500	48.96	1,248,480.00	
DAYFORCE INC	4,200	73.26	307,692.00	
EQUIFAX INC	3,603	258.08	929,862.24	
JACOBS SOLUTIONS INC	3,700	147.54	545,898.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	3,900	123.83	482,937.00	
PAYCHEX INC	9,651	123.38	1,190,740.38	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,600	190.82	305,312.00	
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,400	177.39	248,346.00	
REPUBLIC SERVICES INC	6,602	180.43	1,191,198.86	
ROBERT HALF INC	3,240	80.84	261,921.60	
ROLLINS	8,825	41.05	362,266.25	
SS&C TECHNOLOGIES HLDGS	6,800	63.46	431,528.00	

TRANSUNION	5,900	75.07	442,913.00	
VERALTO CORP	7,089	86.09	610,292.01	
VERISK ANALYTICS INC	4,300	244.70	1,052,210.00	
WASTE CONNECTIONS INC	7,663	167.87	1,286,387.81	
WASTE MANAGEMENT (NEW)	12,020	201.54	2,422,510.80	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,400	72.25	245,650.00	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	6,616	85.38	564,874.08	
CSX CORP	59,515	36.72	2,185,390.80	
DELTA AIR LINES INC	4,900	40.12	196,588.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,384	124.16	544,317.44	
FEDEX CORP	7,040	237.59	1,672,633.60	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	56,500	3.53	199,445.00	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,457	211.70	520,146.90	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	4,900	56.82	278,418.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,769	252.04	1,706,058.76	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,950	423.45	1,249,177.50	
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,310	33.93	146,238.30	
UBER TECHNOLOGIES INC	54,600	78.41	4,281,186.00	
U-HAUL HOLDING CO	2,700	65.35	176,445.00	
UNION PACIFIC CORP	18,066	246.59	4,454,894.94	
UNITED PARCEL SERVICE -CL B	21,497	148.41	3,190,369.77	
APTIV PLC	8,412	78.96	664,211.52	
BORGWARNER INC	6,900	30.61	211,209.00	
FORD MOTOR COMPANY	116,525	12.30	1,433,257.50	
GENERAL MOTORS CO	40,799	38.70	1,578,921.30	
LEAR CORP	1,750	136.30	238,525.00	
LUCID GROUP INC	27,300	3.71	101,283.00	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	19,400	16.30	316,220.00	
TESLA INC	84,800	199.95	16,955,760.00	
DECKERS OUTDOOR CORP	770	862.98	664,494.60	
DR HORTON INC	9,066	141.27	1,280,753.82	
GARMIN LTD	4,500	122.20	549,900.00	
HASBRO INC	4,000	50.78	203,120.00	
LENNAR CORP-CL A	7,412	150.22	1,113,430.64	
LULULEMON ATHLETICA INC	3,400	449.60	1,528,640.00	
NIKE B	36,304	103.51	3,757,827.04	
NVR INC	97	7,390.65	716,893.05	
PULTE GROUP INC	6,463	101.45	655,671.35	
VF CORP	9,898	16.65	164,801.70	
AIRBNB INC-CLASS A	12,600	152.51	1,921,626.00	
BOOKING HOLDINGS INC	1,063	3,716.84	3,951,000.92	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	6,500	42.51	276,315.00	
CARNIVAL CORP	30,466	14.80	450,896.80	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	821	2,598.43	2,133,311.03	
DARDEN RESTAURANTS	3,519	162.46	571,696.74	
DOMINO'S PIZZA INC	1,000	421.85	421,850.00	

DOORDASH INC - A	7,700	116.01	893,277.00	
DRAFTKINGS INC-CL A	12,600	44.57	561,582.00	
EXPEDIA GROUP INC	4,127	135.25	558,176.75	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	7,717	197.57	1,524,647.69	
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,400	132.83	185,962.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	11,500	55.25	635,375.00	
MARRIOTT INT'L A	7,544	241.63	1,822,856.72	
MCDONALD'S CORP	21,628	292.02	6,315,808.56	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	8,300	42.54	353,082.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,200	116.09	835,848.00	
STARBUCKS CORP	33,952	93.22	3,165,005.44	
VAIL RESORTS	1,100	225.48	248,028.00	
WYNN RESORTS LTD	3,000	105.13	315,390.00	
YUM! BRANDS INC	8,258	134.55	1,111,113.90	
ALPHABET INC-CL A	176,040	140.52	24,737,140.80	
ALPHABET INC-CL C	154,920	141.76	21,961,459.20	
CHARTER COMMUNICATION-A	2,925	293.00	857,025.00	
COMCAST CORP-CL A	122,112	41.24	5,035,898.88	
DISCOVERY INC-W/T	68,653	9.83	674,858.99	
DISNEY (WALT) CO NEW	54,264	111.60	6,055,862.40	
ELECTRONIC ARTS	7,624	142.28	1,084,742.72	
FOX CORP	4,338	27.95	121,247.10	
FOX CORPORATION-CLASS A	7,369	30.44	224,312.36	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	11,539	32.45	374,440.55	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	3,500	60.37	211,295.00	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	4,862	30.01	145,908.62	
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	5,900	69.18	408,162.00	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	4,800	93.25	447,600.00	
MATCH GROUP INC	8,194	37.59	308,012.46	
META PLATFORMS INC-A	65,952	473.32	31,216,400.64	
NETFLIX INC	13,107	583.95	7,653,832.65	
NEWS CORP - CLASS A	11,256	26.24	295,357.44	
OMNICOM GROUP	5,888	87.51	515,258.88	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	14,815	12.00	177,780.00	
PINTEREST INC- CLASS A	17,200	35.28	606,816.00	
ROBLOX CORP -CLASS A	12,700	42.91	544,957.00	
ROKU INC	3,500	72.00	252,000.00	
SEA LTD-ADR	10,900	44.99	490,391.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	23,364	4.80	112,147.20	
SNAP INC - A	30,400	11.17	339,568.00	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,100	153.38	782,238.00	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	13,400	88.93	1,191,662.00	
AMAZON COM INC	275,560	169.51	46,710,175.60	
AUTOZONE INC	531	2,727.83	1,448,477.73	
BATH & BODY WORKS INC	6,400	45.40	290,560.00	
BEST BUY COMPANY INC	5,786	73.75	426,717.50	
BURLINGTON STORES INC	1,900	195.17	370,823.00	

CARMAX INC	4,650	71.88	334,242.00	
DICK'S SPORTING GOODS INC	1,900	169.15	321,385.00	
EBAY INC	15,722	43.45	683,120.90	
ETSY INC	3,700	76.57	283,309.00	
GENUINE PARTS CO	4,200	142.93	600,306.00	
GLOBAL-E ONLINE LTD	2,700	40.98	110,646.00	
HOME DEPOT	29,639	362.35	10,739,691.65	
LKQ CORP	7,965	50.04	398,568.60	
LOWE'S COMPANIES	17,106	226.85	3,880,496.10	
MERCADOLIBRE	1,340	1,768.78	2,370,165.20	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,788	1,051.05	1,879,277.40	
POOL CORP	1,200	387.30	464,760.00	
ROSS STORES INC	10,012	144.08	1,442,528.96	
TJX COMPANIES INC	33,922	98.04	3,325,712.88	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,244	236.49	767,173.56	
ULTA BEAUTY INC	1,416	532.09	753,439.44	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	9,600	21.58	207,168.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	13,137	723.99	9,511,056.63	
DOLLAR GENERAL CORP	6,509	141.50	921,023.50	
DOLLAR TREE INC	6,203	143.37	889,324.11	
KROGER CO	20,292	47.64	966,710.88	
SYSCO CORP	14,903	79.50	1,184,788.50	
TARGET CORP	13,705	149.61	2,050,405.05	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	21,729	21.98	477,603.42	
WALMART INC	43,916	170.36	7,481,529.76	
ALTRIA GROUP INC	52,632	40.18	2,114,753.76	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND	15,884	53.65	852,176.60	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,380	57.87	542,820.60	
BUNGE GLOBAL SA	4,575	91.68	419,436.00	
CAMPBELL SOUP CO (US)	5,710	41.45	236,679.50	
CELSIUS HOLDINGS INC	4,600	64.41	296,286.00	
COCA-COLA CO	121,907	59.39	7,240,056.73	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	1,500	67.60	101,400.00	
CONAGRA BRANDS INC	14,527	27.21	395,279.67	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,916	243.84	1,198,717.44	
DARLING INGREDIENTS INC	4,800	42.61	204,528.00	
GENERAL MILLS	17,261	64.10	1,106,430.10	
HORMEL FOODS CORP	9,000	28.99	260,910.00	
JM SMUCKER CO	3,088	124.09	383,189.92	
KELLOGG CO	8,287	55.47	459,679.89	
KEURIG DR PEPPER INC	31,100	30.97	963,167.00	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	4,300	101.23	435,289.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,598	66.15	502,607.70	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY- B	5,700	62.15	354,255.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	40,361	71.98	2,905,184.78	

MONSTER BEVERAGE CORP	23,480	55.02	1,291,869.60	
PEPSICO INC	40,836	166.32	6,791,843.52	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	46,051	89.65	4,128,472.15	
THE HERSHEY COMPANY	4,400	191.16	841,104.00	
THE KRAFT HEINZ CO/THE	25,455	34.81	886,088.55	
TYSON FOODS INC-CL A	8,626	53.12	458,213.12	
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,200	97.78	704,016.00	
CLOROX CO	3,683	151.05	556,317.15	
COLGATE-PALMOLIVE CO	23,262	83.48	1,941,911.76	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	6,913	146.37	1,011,855.81	
KENVUE INC	51,048	19.05	972,464.40	
KIMBERLY-CLARK CORP	10,057	118.29	1,189,642.53	
PROCTER & GAMBLE CO	69,939	157.51	11,016,091.89	
ABBOTT LABORATORIES	51,477	114.01	5,868,892.77	
ALIGN TECHNOLOGY	2,200	308.77	679,294.00	
BAXTER INTERNATIONAL	15,243	41.22	628,316.46	
BECTON DICKINSON	8,609	240.76	2,072,702.84	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	43,448	65.82	2,859,747.36	
CARDINAL HEALTH INC	7,271	104.45	759,455.95	
CENCORA INC	5,042	231.72	1,168,332.24	
CENTENE CORP	16,022	78.74	1,261,572.28	
CVS HEALTH CORPORATION	38,121	77.10	2,939,129.10	
DAVITA INC	1,700	122.22	207,774.00	
DEXCOM INC	11,500	117.05	1,346,075.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	18,000	86.10	1,549,800.00	
ELEVANCE HEALTH INC	6,955	512.63	3,565,341.65	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	12,166	86.02	1,046,519.32	
HCA HEALTHCARE INC	6,033	308.55	1,861,482.15	
HENRY SCHEIN INC	3,900	75.65	295,035.00	
HOLOGIC INC	7,216	73.79	532,468.64	
HUMANA	3,649	366.92	1,338,891.08	
IDEXX LABORATORIES	2,460	555.54	1,366,628.40	
INSULET CORP	2,100	191.01	401,121.00	
INTUITIVE SURGICAL INC COM NEW	10,414	378.63	3,943,052.82	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,644	216.64	572,796.16	
MCKESSON CORP	3,958	511.06	2,022,775.48	
MEDTRONIC PLC	39,505	84.42	3,335,012.10	
MOLINA HEALTHCARE INC	1,700	401.72	682,924.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,346	124.00	414,904.00	
RESMED INC	4,333	180.46	781,933.18	
STERIS PLC	2,900	231.23	670,567.00	
STRYKER CORP	10,167	349.30	3,551,333.10	
TELEFLEX	1,400	251.07	351,498.00	
THE CIGNA GROUP	8,828	341.09	3,011,142.52	
THE COOPER COS INC	1,431	372.01	532,346.31	
UNITED HEALTH GROUP INC	27,481	521.55	14,332,715.55	

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,820	162.16	295,131.20	
VEEVA SYSTEMS A	4,500	219.35	987,075.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	6,231	124.71	777,068.01	
ABBVIE INC	52,357	177.49	9,292,843.93	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	8,720	134.84	1,175,804.80	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,700	147.00	543,900.00	
AMGEN INC	15,914	283.70	4,514,801.80	
AVANTOR INC	20,200	23.76	479,952.00	
BIOGEN INC	4,301	219.08	942,263.08	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5,621	88.77	498,976.17	
BIO-RAD LABORATORIES-A	600	340.52	204,312.00	
BIO-TECHNE CORP	4,800	71.61	343,728.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	61,976	49.86	3,090,123.36	
CATALENT INC	5,200	58.14	302,328.00	
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,500	244.96	367,440.00	
DANAHER CORP	20,769	250.00	5,192,250.00	
ELI LILLY AND COMPANY	23,939	782.06	18,721,734.34	
EXACT SCIENCES CORP	5,400	60.97	329,238.00	
GILEAD SCIENCES INC	36,910	71.58	2,642,017.80	
ILLUMINA INC	4,700	143.41	674,027.00	
INCYTE CORP	5,608	57.96	325,039.68	
IQVIA HOLDINGS INC	5,432	238.60	1,296,075.20	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,801	126.78	228,330.78	
JOHNSON & JOHNSON	71,466	156.55	11,188,002.30	
MERCK & CO	75,260	127.79	9,617,475.40	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	647	1,187.44	768,273.68	
MODERNA INC	9,600	88.37	848,352.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,900	132.31	383,699.00	
PFIZER	167,488	27.62	4,626,018.56	
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,167	948.05	3,002,474.35	
REPLIGEN CORP	1,600	208.42	333,472.00	
REVVITY INC	3,700	102.46	379,102.00	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	11,400	29.92	341,088.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	10,200	13.02	132,804.00	
THERMO ELECTRON CORP	11,451	547.84	6,273,315.84	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,400	214.73	300,622.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,610	422.20	3,212,942.00	
VIATRIS INC	35,471	13.06	463,251.26	
WATERS CORPORATION	1,727	325.21	561,637.67	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,150	362.05	778,407.50	
ZOETIS INC	13,695	188.39	2,580,001.05	
BANK OF AMERICA CORP	212,187	34.09	7,233,454.83	
CITIGROUP INC	57,151	54.85	3,134,732.35	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	14,000	31.56	441,840.00	
FIFTH THIRD BANCORP	20,220	33.93	686,064.60	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	320	1,514.99	484,796.80	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	42,415	12.87	545,881.05	

JPMORGAN CHASE & CO	86,190	179.03	15,430,595.70	
KEYCORP	27,891	14.07	392,426.37	
M & T BANK CORP	4,891	138.31	676,474.21	
PNC BANK CORP	11,787	148.85	1,754,494.95	
REGIONS FINANCIAL CORP	27,645	18.48	510,879.60	
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	39,538	36.10	1,427,321.80	
US BANCORP	45,435	41.49	1,885,098.15	
WELLS FARGO COMPANY	108,497	51.91	5,632,079.27	
ALLY FINANCIAL INC.	8,175	35.98	294,136.50	
AMERICAN EXPRESS	18,615	212.56	3,956,804.40	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,996	397.80	1,191,808.80	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	11,766	112.71	1,326,145.86	
ARES MANAGEMENT CORP - A	4,900	134.97	661,353.00	
BANK NEW YORK MELLO CORP	23,057	55.15	1,271,593.55	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	38,834	405.99	15,766,215.66	
BLACKROCK INC	4,430	794.00	3,517,420.00	
BLACKSTONE INC	21,100	127.89	2,698,479.00	
BLOCK INC-A	13,900	65.64	912,396.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	11,299	137.23	1,550,561.77	
CARLYLE GROUP INC/THE	6,600	44.58	294,228.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,100	186.69	578,739.00	
CME GROUP INC	10,689	212.26	2,268,847.14	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	5,000	180.31	901,550.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	7,432	110.49	821,161.68	
EQUITABLE HOLDINGS INC	10,300	34.21	352,363.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,100	458.42	504,262.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	17,596	63.65	1,119,985.40	
FISERV INC	18,102	148.04	2,679,820.08	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,081	271.62	565,241.22	
FRANKLIN RESOURCES INC	9,205	27.27	251,020.35	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	1,600	52.29	83,656.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	7,678	134.19	1,030,310.82	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	9,784	384.44	3,761,360.96	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	16,925	137.12	2,320,756.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES, INC.	2,200	172.48	379,456.00	
KKR & CO INC	17,000	95.66	1,626,220.00	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	2,200	257.66	566,852.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,100	219.04	240,944.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	24,914	468.13	11,662,990.82	
MOODY'S CORPORATION	4,849	370.76	1,797,815.24	
MORGAN STANLEY	36,899	86.50	3,191,763.50	
MSCI INC	2,350	568.75	1,336,562.50	
NASDAQ INC	10,320	55.42	571,934.40	
NORTHERN TRUST CORP	6,105	79.95	488,094.75	
PAYPAL HOLDINGS INC	30,922	59.14	1,828,727.08	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,872	118.49	695,773.28	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	12,900	14.00	180,600.00	

S&P GLOBAL INC	9,642	423.57	4,084,061.94	
SCHWAB (CHARLES) CORP	44,635	64.40	2,874,494.00	
SEI INVESTMENTS CO COM	3,300	65.87	217,371.00	
STATE STREET CORP	9,431	72.49	683,653.19	
SYNCHRONY FINANCIAL	12,415	39.56	491,137.40	
T ROWE PRICE GROUP INC	6,693	108.86	728,599.98	
TOAST INC-CLASS A	9,200	22.42	206,264.00	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	3,200	101.51	324,832.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	47,695	278.56	13,285,919.20	
AFLAC	16,710	79.38	1,326,439.80	
ALLSTATE CORP	7,728	161.78	1,250,235.84	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,100	123.44	259,224.00	
AMERICAN INT'L GROUP	21,117	70.04	1,479,034.68	
AON PLC	6,034	311.24	1,878,022.16	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	11,050	86.11	951,515.50	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6,400	239.22	1,531,008.00	
ASSURANT INC	1,600	173.72	277,952.00	
BROWN & BROWN INC	7,200	82.69	595,368.00	
CHUBB LTD	12,184	250.90	3,056,965.60	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,637	111.86	518,694.82	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	800	359.81	287,848.00	
EVEREST GROUP LTD	1,300	367.87	478,231.00	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	7,902	52.39	413,985.78	
GLOBE LIFE INC	2,850	125.53	357,760.50	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	9,109	93.06	847,683.54	
LOEWS CORP	5,705	74.34	424,109.70	
MARKEL GROUP INC	375	1,461.50	548,062.50	
MARSH & MCLENNAN COS	14,675	200.30	2,939,402.50	
METLIFE INC	18,971	68.77	1,304,635.67	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7,186	80.04	575,167.44	
PROGRESSIVE CORP	17,389	189.09	3,288,086.01	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	10,735	107.28	1,151,650.80	
TRAVELERS COS INC/THE ST.PAUL TRAVELERS	6,834	217.53	1,486,600.02	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,128	277.31	867,425.68	
WR BERKLEY CORP	6,222	82.61	513,999.42	
ACCENTURE PLC-CL A	18,597	369.48	6,871,219.56	
ADOBE INC	13,508	546.66	7,384,283.28	
AKAMAI TECHNOLOGIES	4,472	109.19	488,297.68	
ANSYS INC	2,600	329.85	857,610.00	
ASPEN TECHNOLOGY INC	900	182.75	164,475.00	
ATLASSIAN CORP-CL A	4,600	207.84	956,064.00	
AUTODESK INC	6,337	258.30	1,636,847.10	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	6,300	53.16	334,908.00	
BILL HOLDINGS INC	2,800	63.49	177,772.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	8,100	290.30	2,351,430.00	

CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	2,803	162.77	456,244.31	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	8,200	98.52	807,864.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	14,955	77.00	1,151,535.00	
CONFLUENT INC-CLASS A	5,000	33.96	169,800.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	6,700	329.24	2,205,908.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,200	260.43	312,516.00	
DATADOG INC - CLASS A	7,600	129.74	986,024.00	
DOCUSIGN INC	5,900	50.22	296,298.00	
DROPBOX INC-CLASS A	7,700	25.08	193,116.00	
DYNATRACE INC	7,500	51.09	383,175.00	
EPAM SYSTEMS INC	1,700	311.98	530,366.00	
FAIR ISAAC CORP	740	1,282.06	948,724.40	
FORTINET INC	19,900	68.48	1,362,752.00	
GARTNER INC	2,300	448.61	1,031,803.00	
GEN DIGITAL INC	17,500	21.36	373,800.00	
GODADDY INC-CLASS A	4,100	109.98	450,918.00	
HUBSPOT INC	1,400	613.50	858,900.00	
IBM CORP	27,061	187.64	5,077,726.04	
INTUIT CORP	8,316	655.74	5,453,133.84	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	1,800	243.81	438,858.00	
MICROSOFT CORP	209,432	404.06	84,623,093.92	
MONDAY.COM LTD	777	225.30	175,058.10	
MONGODB INC	2,100	465.06	976,626.00	
OKTA INC	4,500	88.86	399,870.00	
ORACLE CORP	48,759	111.31	5,427,364.29	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	54,700	24.44	1,336,868.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	9,120	366.41	3,341,659.20	
PTC INC	3,500	178.19	623,665.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,160	545.57	1,724,001.20	
SALESFORCE INC	28,827	289.72	8,351,758.44	
SERVICENOW INC	6,064	765.00	4,638,960.00	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	8,300	230.31	1,911,573.00	
SPLUNK INC	4,800	155.37	745,776.00	
SYNOPSYS INC	4,515	552.91	2,496,388.65	
TWILIO INC - A	5,100	58.59	298,809.00	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,200	440.98	529,176.00	
UIPATH INC - CLASS A	10,800	24.96	269,568.00	
UNITY SOFTWARE INC	7,400	33.90	250,860.00	
VERISIGN INC	2,799	194.24	543,677.76	
WIX.COM LTD	1,600	127.26	203,616.00	
WORKDAY INC CLASS A	6,172	302.67	1,868,079.24	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	7,200	62.12	447,264.00	
ZSCALER INC	2,600	252.75	657,150.00	
AMPHENOL CORP-CL A	17,700	105.52	1,867,704.00	
APPLE INC	463,868	182.31	84,567,775.08	
ARISTA NETWORKS	7,800	261.75	2,041,650.00	

CDW CORP/DE	4,000	241.37	965,480.00	
CISCO SYSTEMS	120,182	48.44	5,821,616.08	
CORNING	24,428	31.91	779,497.48	
DELL TECHNOLOGIES INC-C	7,577	84.21	638,059.17	
F5 INC	1,800	182.35	328,230.00	
HEWLETT-PACKARD CO	26,403	28.58	754,597.74	
HP ENTERPRISE CO	37,976	14.93	566,981.68	
JABIL INC	3,900	138.50	540,150.00	
JUNIPER NETWORKS INC	9,508	36.92	351,035.36	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	5,300	155.22	822,666.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,943	320.49	1,584,182.07	
NETAPP INC	6,148	85.71	526,945.08	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	5,578	87.52	488,186.56	
SUPER MICRO COMPUTER INC	1,400	803.32	1,124,648.00	
TE CONNECTIVITY LTD	9,262	142.40	1,318,908.80	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,400	432.26	605,164.00	
TRIMBLE INC	7,443	60.29	448,738.47	
WESTERN DIGITAL CORP	9,492	54.00	512,568.00	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,500	275.46	413,190.00	
AT & T INC	212,083	16.97	3,599,048.51	
LIBERTY GLOBAL LTD-C	6,680	18.95	126,586.00	
T MOBILE US INC	15,690	160.41	2,516,832.90	
VERIZON COMMUNICATIONS	124,684	40.49	5,048,455.16	
AES CORPORATION	20,062	16.77	336,439.74	
ALLIANT ENERGY CORP	7,590	48.35	366,976.50	
AMEREN CORPORATION	7,777	69.51	540,579.27	
AMERICAN ELECTRIC POWER	15,285	81.35	1,243,434.75	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,800	122.82	712,356.00	
ATMOS ENERGY CORP	4,358	113.95	496,594.10	
CENTERPOINT ENERGY INC	19,056	27.88	531,281.28	
CMS ENERGY CORP	8,700	57.27	498,249.00	
CONSOLIDATED EDISON	10,259	87.32	895,815.88	
CONSTELLATION ENERGY	9,536	131.16	1,250,741.76	
DOMINION ENERGY INC	24,960	45.86	1,144,665.60	
DTE ENERGY	6,066	107.80	653,914.80	
DUKE ENERGY CORP	22,865	91.88	2,100,836.20	
EDISON INTERNATIONAL	11,416	66.31	756,994.96	
ENTERGY CORP	6,220	100.15	622,933.00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	7,400	36.19	267,806.00	
EVERGY INC	6,700	50.03	335,201.00	
EVERSOURCE ENERGY	10,371	58.87	610,540.77	
EXELON CORP	29,709	34.91	1,037,141.19	
FIRSTENERGY CORP	16,316	37.39	610,055.24	
NEXTERA ENERGY INC	60,860	57.03	3,470,845.80	
NISOURCE INC	11,900	25.90	308,210.00	
NRG ENERGY INC	6,800	51.90	352,920.00	
P G & E CORP	60,100	16.43	987,443.00	

PPL CORPORATION	22,166	26.64	590,502.24	
PUBLIC SV ENTERPRISE CO	14,802	59.79	885,011.58	
SEMPRA	18,682	70.49	1,316,894.18	
SOUTHERN CO	32,339	66.48	2,149,896.72	
VISTRA CORP	9,800	45.58	446,684.00	
WEC ENERGY GROUP INC	9,386	78.07	732,765.02	
XCEL ENERGY INC	16,444	59.07	971,347.08	
ADVANCED MICRO DEVICES	47,942	173.87	8,335,675.54	
ANALOG DEVICES	14,766	188.24	2,779,551.84	
APPLIED MATERIALS	24,841	199.57	4,957,518.37	
BROADCOM INC	13,166	1,245.48	16,397,989.68	
ENPHASE ENERGY INC	4,100	131.87	540,667.00	
ENTEGRIS INC	4,500	136.81	615,645.00	
FIRST SOLAR INC	3,000	156.98	470,925.00	
INTEL CORP	124,228	43.51	5,405,160.28	
KLA CORPORATION	4,048	661.35	2,677,144.80	
LAM RESEARCH CORP	3,920	926.03	3,630,037.60	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	4,200	73.24	307,608.00	
MARVELL TECHNOLOGY INC	25,600	66.29	1,697,024.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	16,120	81.61	1,315,553.20	
MICRON TECHNOLOGY	32,530	79.50	2,586,135.00	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,350	730.50	986,175.00	
NVIDIA CORP	73,280	726.13	53,210,806.40	
NXP SEMICONDUCTORS NV	7,691	232.16	1,785,542.56	
ON SEMICONDUCTOR CORP	12,800	78.64	1,006,592.00	
QORVO INC	2,925	112.17	328,097.25	
QUALCOMM	33,118	152.69	5,056,787.42	
SKYWORKS SOLUTIONS INC.	4,751	103.75	492,916.25	
TERADYNE INC	4,600	102.24	470,304.00	
TEXAS INSTRUMENTS	26,886	160.38	4,311,976.68	
CBRE GROUP INC-A	9,184	93.13	855,305.92	
COSTAR GROUP	12,200	81.40	993,080.00	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	34,700	3.24	112,428.00	
ZILLOW GROUP INC-C	4,500	54.80	246,600.00	
アメリカ・ドル小計	10,012,150		1,282,958,211.74 (192,931,255,880)	

カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	17,900	22.40	400,960.00	
	CAMECO CORP	12,922	56.86	734,744.92	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	32,390	85.16	2,758,332.40	
	CENOVUS ENERGY INC	42,148	23.50	990,478.00	
	ENBRIDGE INC	63,071	46.46	2,930,278.66	
	IMPERIAL OIL LTD	5,885	80.75	475,213.75	
	KEYERA CORP	6,842	32.74	224,007.08	
	MEG ENERGY CORP	8,700	25.87	225,069.00	
	PARKLAND CORPORATION	4,200	45.71	191,982.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	16,549	45.91	759,764.59	
	SUNCOR ENERGY INC	38,530	44.58	1,717,667.40	
	TC ENERGY CORP	30,528	53.32	1,627,752.96	
	TOURMALINE OIL CORP	9,400	57.23	537,962.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	14,678	64.46	946,143.88	
	BARRICK GOLD CORP	52,580	19.74	1,037,929.20	
	CCL INDUSTRIES INC	4,400	58.38	256,872.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	17,628	12.12	213,651.36	
	FRANCO NEV CORP	5,762	147.12	847,705.44	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	17,900	14.47	259,013.00	
	KINROSS GOLD CORP	36,963	6.83	252,457.29	
	LUNDIN MINING CORP	20,600	11.69	240,814.00	
	NEWMONT CORPORATION	1,688	45.04	76,027.52	
	NUTRIEN LTD	14,653	68.92	1,009,884.76	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	10,900	17.67	192,603.00	
	TECK RESOURCES LTD	13,608	52.22	710,609.76	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,700	107.53	182,801.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	13,447	59.91	805,609.77	
	CAE Inc.	9,550	25.66	245,053.00	
	STANTEC INC	3,300	112.57	371,481.00	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	2,500	124.58	311,450.00	
	WSP GLOBAL INC	3,700	207.95	769,415.00	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	11,800	22.59	266,562.00	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	6,500	49.85	324,025.00	
	RB GLOBAL INC	5,400	92.98	502,092.00	
	THOMSON REUTERS CORP	4,679	216.26	1,011,880.54	
	AIR CANADA	4,800	18.00	86,400.00	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	16,525	175.06	2,892,866.50	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	20,965	115.19	2,414,958.35	
	TFI INTERNATIONAL INC	2,400	197.06	472,944.00	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	8,038	74.11	595,696.18	
	BRP INC/CA- SUB VOTING	1,100	89.79	98,769.00	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,215	46.56	242,810.40	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	8,533	104.11	888,370.63	
	CANADIAN TIRE CORP.	1,531	140.01	214,355.31	
	DOLLARAMA INC	8,385	103.34	866,505.90	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	22,900	82.00	1,877,800.00	
	EMPIRE CO LTD 'A'	4,266	34.66	147,859.56	

LOBLAW COMPANIES LTD	4,672	137.76	643,614.72	
METRO INC	6,818	71.02	484,214.36	
WESTON (GEORGE)	1,890	173.65	328,198.50	
SAPUTO INC	7,407	28.22	209,025.54	
BANK OF MONTREAL	21,394	127.03	2,717,679.82	
BANK OF NOVA SCOTIA	36,354	63.86	2,321,566.44	
CANADIAN IMPERIAL BANK	27,428	61.93	1,698,616.04	
NATIONAL BANK OF CANADA	10,046	103.71	1,041,870.66	
ROYAL BANK OF CANADA	41,342	131.94	5,454,663.48	
TRONTO-DOMINION BANK	53,962	80.87	4,363,906.94	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	10,536	55.08	580,322.88	
BROOKFIELD CORP	41,345	54.43	2,250,408.35	
IGM FINANCIAL INC	2,433	35.10	85,398.30	
ONEX CORPORATION	2,009	102.74	206,404.66	
TMX GROUP LTD	8,000	34.18	273,440.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	632	1,374.97	868,981.04	
GREAT-WEST LIFE CO INC	8,246	41.78	344,517.88	
IA FINANCIAL CORP INC	2,993	92.64	277,271.52	
INTACT FINANCIAL CORP	5,200	228.67	1,189,084.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	53,920	33.30	1,795,536.00	
POWER CORP OF CANADA	17,033	38.32	652,704.56	
SUN LIFE FINANCIAL INC	17,391	72.77	1,265,543.07	
CGI INC	6,184	154.80	957,283.20	
CONSTELLATION SOFTWARE	595	3,710.83	2,207,943.85	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	2,500	117.05	292,625.00	
OPEN TEXT CORP	8,084	53.93	435,970.12	
SHOPIFY INC - CLASS A	35,700	109.62	3,913,434.00	
BCE INC	2,115	50.83	107,505.45	
QUEBECOR INC -CL B	4,800	31.77	152,496.00	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	10,704	61.55	658,831.20	
TELUS CORP	14,294	23.94	342,198.36	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	20,000	8.12	162,400.00	
ALTAGAS LTD	8,313	28.25	234,842.25	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	4,050	34.20	138,510.00	
CANADIAN UTILITIES LTD A	3,800	30.18	114,684.00	
EMERA	8,200	48.38	396,716.00	
FORTIS INC	14,390	52.95	761,950.50	
HYDRO ONE	9,800	40.58	397,684.00	
NORTHLAND POWER INC	7,100	24.00	170,400.00	
FIRSTSERVICE CORP	1,100	222.99	245,289.00	
カナダ・ドル小計	1,210,439		75,951,360.80 (8,459,462,566)	

オーストラリア・ドル	AMPOL LIMITED	7,072	37.88	267,887.36	
	SANTOS	96,195	7.33	705,109.35	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	46,419	30.53	1,417,172.07	
	AMCOR PLC-CDI	21,750	13.80	300,150.00	
	BHP GROUP LIMITED	93,760	46.04	4,316,710.40	
	BLUESCOPE STEEL LTD	13,346	22.33	298,016.18	
	FORTESCUE LTD	50,199	28.40	1,425,651.60	
	IGO LTD	20,435	7.25	148,153.75	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	13,036	56.57	737,446.52	
	MINERAL RESOURCES LTD	5,201	60.10	312,580.10	
	NEWMONT CORP-CDI	10,739	50.91	546,722.49	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	33,945	13.13	445,697.85	
	ORICA	13,454	16.89	227,238.06	
	PILBARA MINERALS LTD	81,556	3.62	295,232.72	
	RIO TINTO LTD	11,004	130.96	1,441,083.84	
	SOUTH32 LTD	136,871	2.94	402,400.74	
	REECE LTD	6,565	23.29	152,898.85	
	BRAMBLES LTD	41,143	15.27	628,253.61	
	COMPUTERSHARE LIMITED	16,072	26.37	423,818.64	
	AURIZON HOLDINGS LTD	54,267	3.91	212,183.97	
	QANTAS AIRWAYS LTD	26,005	5.73	149,008.65	
	TRANSURBAN GROUP	91,519	13.17	1,205,305.23	
	ARISTOCRAT LEISURE LIMITED	17,289	44.13	762,963.57	
	IDP EDUCATION LTD	7,572	19.56	148,108.32	
	LOTTERY CORP LTD/THE	65,777	5.03	330,858.31	
	CAR GROUP LTD	10,876	34.55	375,765.80	
	REA GROUP LTD	1,584	188.28	298,235.52	
	SEEK LTD	10,386	25.38	263,596.68	
	WESFARMERS LIMITED	33,639	63.99	2,152,559.61	
	COLES GROUP LTD	40,130	16.03	643,283.90	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	43,042	5.41	232,857.22	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	36,210	35.70	1,292,697.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	23,718	11.69	277,263.42	
	COCHLEAR LIMITED	1,940	327.82	635,970.80	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,357	50.82	272,242.74	
	SONIC HEALTHCARE LIMITED	13,655	31.71	433,000.05	
	CSL LIMITED	14,328	281.03	4,026,597.84	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	89,120	28.50	2,539,920.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	49,722	117.13	5,823,937.86	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	92,797	33.17	3,078,076.49	
	WESTPAC BANKING	104,062	25.24	2,626,524.88	
	AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	5,672	63.97	362,837.84	
	BLOCK INC - CDI	2,469	103.13	254,627.97	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	10,887	192.01	2,090,412.87	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	7,092	34.15	242,191.80	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	73,535	6.17	453,710.95	
	MEDIBANK PRIVATE LTD.	81,879	3.80	311,140.20	

	QBE INSURANCE GROUP	44,700	16.71	746,937.00	
	SUNCORP GROUP LTD	37,797	14.43	545,410.71	
	WISETECH GLOBAL LTD	5,015	78.59	394,128.85	
	XERO LTD	4,338	114.80	498,002.40	
	TELSTRA GROUP LTD	119,667	3.90	466,701.30	
	APA GROUP	38,066	8.04	306,050.64	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	50,957	8.69	442,816.33	
	オーストラリア・ドル小計	2,033,831		49,388,150.85 (4,850,410,295)	
イギリス・ポ ンド	BP PLC	506,221	4.75	2,403,537.30	
	SHELL PLC	196,308	25.08	4,923,404.64	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	9,876	15.86	156,633.36	
	ANGLO AMERICAN PLC	38,100	17.78	677,418.00	
	ANTOFAGASTA PLC	11,659	17.65	205,781.35	
	BHP GROUP LTD	56,604	23.78	1,346,043.12	
	CRH PLC	20,980	61.56	1,291,528.80	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	4,092	49.85	203,986.20	
	ENDEAVOUR MINING PLC	5,611	13.02	73,055.22	
	GLENCORE PLC	310,410	3.95	1,227,361.14	
	MONDI PLC	12,901	13.79	177,969.29	
	RIO TINTO PLC REG	33,397	54.28	1,812,789.16	
	ASHTAD GROUP PLC	13,125	53.76	705,600.00	
	BAE SYSTEMS PLC	90,162	12.48	1,125,221.76	
	BUNZL PLC	10,109	32.26	326,116.34	
	DCC (GB)	2,866	57.60	165,081.60	
	FERGUSON PLC	6,083	157.40	957,464.20	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	40,936	6.19	253,230.09	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	249,506	3.34	833,849.05	
	SMITHS GROUP PLC	10,271	16.44	168,906.59	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,202	104.25	229,558.50	
	EXPERIAN PLC	27,270	34.05	928,543.50	
	INTERTEK GROUP PLC	4,716	44.79	211,229.64	
	RELX PLC	48,945	34.12	1,670,003.40	
	RENTOKIL INITIAL PLC	74,714	4.21	314,545.94	
	BARRATT DEVELOPMENTS	28,791	4.78	137,563.39	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,143	47.48	149,229.64	
	BURBERRY GROUP PLC	10,730	13.20	141,582.35	
	PERSIMMON PLC	9,537	14.20	135,425.40	
	TAYLOR WIMPEY PLC	108,410	1.46	158,441.21	
	COMPASS GROUP PLC	50,824	21.91	1,113,553.84	
	ENTAIN PLC	19,347	9.22	178,379.34	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	5,238	168.65	883,388.70	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	4,896	79.10	387,273.60	
	PEARSON	18,899	9.65	182,450.94	
	WHITBREAD PLC	5,715	35.14	200,825.10	
	AUTO TRADER GROUP PLC	27,055	7.26	196,527.52	

INFORMA PLC	40,967	8.20	335,765.53	
WPP PLC	32,172	7.83	251,906.76	
JD SPORTS FASHION PLC	78,700	1.13	89,009.70	
KINGFISHER PLC	55,838	2.23	124,295.38	
NEXT PLC	3,566	85.00	303,110.00	
OCADO GROUP PLC	17,313	5.35	92,555.29	
SAINSBURY (J) PLC	50,437	2.54	128,109.98	
TESCO PLC	210,627	2.81	592,072.49	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	10,197	22.91	233,613.27	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	63,008	23.70	1,492,974.56	
COCA COLA HBC AG CDI	6,210	24.78	153,883.80	
DIAGEO	66,673	29.40	1,960,519.56	
IMPERIAL BRANDS PLC	25,231	18.42	464,755.02	
HALEON PLC	164,189	3.23	530,248.37	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	21,280	57.70	1,227,856.00	
UNILEVER PLC	40,016	40.46	1,619,047.36	
SMITH&NEOHEW PLC	25,854	11.33	292,796.55	
ASTRAZENECA PLC	45,980	104.18	4,790,196.40	
GSK PLC	121,458	16.69	2,027,376.93	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,103	19.87	101,422.12	
BARCLAYS PLC	447,751	1.49	667,148.99	
HSBC HOLDINGS PLC	578,034	6.38	3,689,012.98	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,883,900	0.43	807,816.32	
NATWEST GROUP PLC	173,329	2.25	389,990.25	
STANDARD CHARTERED PLC	67,886	6.00	407,044.45	
3I GROUP PLC	28,851	24.64	710,888.64	
ABRDN PLC	55,571	1.61	89,274.81	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,488	8.17	85,645.00	
LONDON STOCK EXCAHNGE GROUP	12,350	88.64	1,094,704.00	
M&G PLC	67,005	2.24	150,292.21	
SCHRODERS PLC	22,611	4.04	91,438.88	
ST JAMES'S PLACE PLC	16,327	6.57	107,235.73	
WISE PLC - A	18,583	8.47	157,323.67	
ADMIRAL GROUP PLC	7,908	25.67	202,998.36	
AVIVA PLC	81,098	4.30	348,964.69	
LEGAL & GENERAL GROUP	175,951	2.39	419,995.03	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	22,489	5.03	113,029.71	
PRUDENTIAL PLC	81,607	8.21	670,156.68	
SAGE GROUP PLC/THE	30,397	11.84	360,052.46	
HALMA PLC	11,365	22.75	258,553.75	
BT GROUP PLC	191,188	1.07	204,093.19	
VODAFONE GROUP PLC	681,918	0.67	457,566.97	
CENTRICA PLC	162,102	1.31	212,029.41	
NATIONAL GRID PLC	109,364	10.22	1,117,153.26	
SEVERN TRENT PLC	7,480	25.43	190,216.40	
SSE PLC	32,790	15.98	523,984.20	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	19,909	10.41	207,352.23	

イギリス・ボンド小計		8,162,720		56,798,976.56 (10,752,046,263)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	6,335	11.00	69,685.00	
	EMS CHEMIE HOLDING AG RE	212	628.00	133,136.00	
	GIVAUDAN-REG	274	3,704.00	1,014,896.00	
	HOLCIM LTD	15,453	68.40	1,056,985.20	
	SIG GROUP AG	9,107	18.07	164,563.49	
	SIKA AG-BEARER	4,520	258.00	1,166,160.00	
	ABB LTD	47,443	40.03	1,899,143.29	
	GEBERIT AG-REG	990	509.60	504,504.00	
	SCHINDLER HLDG AG	704	221.80	156,147.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,205	230.50	277,752.50	
	VAT GROUP AG	818	431.10	352,639.80	
	ADECCO GROUP AG-REG	4,626	36.42	168,478.92	
	SGS SA-REG	4,438	84.66	375,721.08	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,630	284.40	463,572.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON REG	15,482	135.90	2,104,003.80	
	THE SWATCH GROUP	1,542	42.30	65,226.60	
	THE SWATCH GROUP AG-B	855	219.20	187,416.00	
	AVOLTA AG(REGD)	2,700	35.51	95,877.00	
	BARRY CALLEBAUT AG REG	107	1,306.00	139,742.00	
	LINDT SPRUENGLI PTG CERT CHF10	29	11,300.00	327,700.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	3	112,000.00	336,000.00	
	NESTLE SA-REG	79,212	98.61	7,811,095.32	
	ALCON INC	14,815	68.42	1,013,642.30	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,501	285.60	428,685.60	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	3,347	144.95	485,147.65	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	925	66.00	61,050.00	
	LOMZA AG-REG	2,208	456.00	1,006,848.00	
	NOVARTIS AG-REG SHS	60,809	89.56	5,446,054.04	
	ROCHE HOLDING AG GENUSS	20,842	232.00	4,835,344.00	
	ROCHE HOLDING AG-BR	967	246.20	238,075.40	
	SANDOZ GROUP AG	12,391	28.96	358,843.36	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	903	106.90	96,530.70	
	JULIUS BAER GROUP LTD	6,096	48.77	297,301.92	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	673	1,241.00	835,193.00	
	UBS GROUP AG	97,556	24.50	2,390,122.00	
	BALOISE HOLDING AG REG	1,366	143.30	195,747.80	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	1,122	123.20	138,230.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG	875	640.60	560,525.00	
	SWISS RE LTD	9,016	100.15	902,952.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,341	440.50	1,912,210.50	
	TEMENOS GROUP AG-REG	1,889	65.96	124,598.44	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	4,870	77.12	375,574.40	
	SWISSCOM	782	516.40	403,824.80	
	BKW AG	633	133.50	84,505.50	
	SWISS PRIME SITE REG	2,268	85.75	194,481.00	

スイス・フラン小計		447,880		41,255,933.41 (7,026,298,018)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED	79,623	41.70	3,320,279.10	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	40,500	82.35	3,335,175.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	56,000	6.88	385,280.00	
	MTR CORP	45,246	25.20	1,140,199.20	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	40,000	12.78	511,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	65,000	44.25	2,876,250.00	
	SANDS CHINA LTD	71,744	23.60	1,693,158.40	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	53,700	13.08	702,396.00	
	WH GROUP LIMITED	249,500	4.70	1,172,650.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	111,989	19.28	2,159,147.92	
	HANG SENG BANK	22,500	81.00	1,822,500.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	35,741	246.20	8,799,434.20	
	AIA GROUP LTD	340,484	64.20	21,859,072.80	
	HKT TRUST AND HKT LTD	112,000	9.13	1,022,560.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	18,500	46.20	854,700.00	
	CLP HOLDINGS	49,317	64.10	3,161,219.70	
	HONGKONG CHINA GAS	335,197	5.94	1,991,070.18	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	41,000	46.00	1,886,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LIMITED	58,633	35.55	2,084,403.15	
	ESR GROUP LTD	57,800	9.34	539,852.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	53,000	8.21	435,130.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	43,308	21.10	913,798.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT COMPANY LIMITED	45,293	9.39	425,301.27	
	SINO LAND	104,997	8.09	849,425.73	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	43,108	71.80	3,095,154.40	
	SWIRE PACIFIC A	12,500	63.20	790,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	35,677	15.20	542,290.40	
	WHARF HOLDINGS LTD	32,000	26.55	849,600.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	49,125	25.40	1,247,775.00	
香港・ドル小計		2,303,482		70,465,023.25 (1,355,042,396)	

シンガポール・ドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	3,000	26.33	78,990.00	
	KEPPEL LTD	43,400	7.33	318,122.00	
	SEATRUM LTD	1,390,490	0.09	125,144.10	
	SINGAPORE TECH ENGR.	47,700	3.90	186,030.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	45,100	7.30	329,230.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	178,300	1.06	188,998.00	
	WILMAR INTERL LTD SGD0.5	56,600	3.25	183,950.00	
	DBS GROUP HOLDING	53,701	34.13	1,832,815.13	
	OVERSEA-CHINESE BANKING	100,424	13.33	1,338,651.92	
	UNITED OVERSEAS BANK	37,443	29.42	1,101,573.06	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	25,300	9.37	237,061.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	247,874	2.37	587,461.38	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	27,100	5.75	155,825.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	77,575	2.88	223,416.00	
	CITY DEVELOPMENTS	15,100	6.11	92,261.00	
	UOL GROUP LIMITED	13,000	6.15	79,950.00	
シンガポール・ドル小計		2,362,107		7,059,478.59 (788,331,973)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	37,840	8.15	308,396.00	
	EBOS GROUP LTD	4,868	36.71	178,704.28	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	16,809	23.95	402,575.55	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	54,085	5.10	275,833.50	
	MERCURY NZ LTD	20,427	6.68	136,554.49	
	MERIDIAN ENERGY LTD	39,492	5.62	221,945.04	
ニュージーランド・ドル小計		173,521		1,524,008.86 (140,711,738)	

スウェーデン・クローナ	BOLIDEN AB	8,018	276.05	2,213,368.90	
	HOLMEN AB-B SHARES	2,240	404.40	905,856.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	18,203	142.15	2,587,556.45	
	ALFA LAVAL AB	8,757	377.30	3,304,016.10	
	ASSA ABLOY AB-B	29,707	288.90	8,582,352.30	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	79,644	176.80	14,081,059.20	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	46,251	152.95	7,074,090.45	
	BEIJER REF AB	11,659	145.40	1,695,218.60	
	EPIROC AB-A	19,757	194.80	3,848,663.60	
	EPIROC AB-B	11,519	173.80	2,002,002.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	10,262	78.50	805,567.00	
	INDUTRADE AB	8,119	279.10	2,266,012.90	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	4,596	265.80	1,221,616.80	
	LIFCO AB-B SHS	7,001	276.50	1,935,776.50	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	45,455	58.44	2,656,390.20	
	SAAB AB-B	2,420	797.00	1,928,740.00	
	SANDVIK AB	31,594	223.40	7,058,099.60	
	SKANSKA AB-B	10,043	185.00	1,857,955.00	
	SKF AB-B SHARES	10,066	217.70	2,191,368.20	
	VOLVO AB-A SHS	6,004	277.40	1,665,509.60	
	VOLVO AB-B SHS	44,738	270.85	12,117,287.30	
	SECURITAS B	15,183	107.35	1,629,895.05	
	VOLVO CAR AB-B	17,636	38.70	682,513.20	
	EVOLUTION AB	5,430	1,300.80	7,063,344.00	
	HENNES & MAURITZ B	19,109	142.06	2,714,624.54	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	18,283	240.40	4,395,233.20	
	GETINGE AB-B SHS	6,907	205.90	1,422,151.30	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	5,666	260.00	1,473,160.00	
	NORDEA BANK ABP	94,926	124.56	11,823,982.56	
	SKAND. ENSKILDA BANKEN A	47,020	152.10	7,151,742.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	42,868	123.50	5,294,198.00	
	SWEDBANK AB	25,146	218.40	5,491,886.40	
	EQT AB	10,680	280.30	2,993,604.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	3,703	342.90	1,269,758.70	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,402	342.80	1,509,005.60	
	INVESTOR AB-B SHS	51,318	256.20	13,147,671.60	
	LUNDBERGFÖRETAGEN B	2,238	560.00	1,253,280.00	
	"ERICSSON (LM) TEL, SEK1 SER B"	86,147	56.09	4,831,985.23	
	HEXAGON AB-B SHS	61,523	117.90	7,253,561.70	
	TELE2 AB-B SHS	15,684	83.44	1,308,672.96	
	TELIA COMPANY AB	69,673	24.62	1,715,349.26	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	18,870	65.94	1,244,287.80	
	SAGAX AB-B	5,717	255.90	1,462,980.30	
スウェーデン・クローナ小計		1,044,182		169,131,394.30 (2,445,639,962)	

ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	9,402	262.30	2,466,144.60	
	EQUINOR ASA	26,701	267.60	7,145,187.60	
	NORSK HYDRO	39,225	57.04	2,237,394.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,989	354.70	1,769,598.30	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	2,618	662.50	1,734,425.00	
	ADEVINTA ASA	10,622	114.00	1,210,908.00	
	MOWI ASA	13,314	201.70	2,685,433.80	
	ORKLA ASA	20,692	75.52	1,562,659.84	
	SALMAR ASA	2,193	628.60	1,378,519.80	
	DNB BANK ASA	27,407	206.80	5,667,767.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6,150	171.80	1,056,570.00	
	TELENOR ASA	18,612	115.10	2,142,241.20	
ノルウェー・クローネ小計		181,925		31,056,849.74 (445,044,657)	
デンマーク・クローネ	NOVOZYMES A/S B SHARES	10,738	372.40	3,998,831.20	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	285	2,207.00	628,995.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	29,933	184.50	5,522,638.50	
	A P MOLLER MAERSK A/S	143	10,740.00	1,535,820.00	
	A.P. MOLLER-MAERSK A DKK1000	95	10,550.00	1,002,250.00	
	DSV A/S	5,519	1,146.00	6,324,774.00	
	PANDORA A/S	2,503	1,144.50	2,864,683.50	
	CARLSBERG B	2,915	947.80	2,762,837.00	
	COLOPLAST B	4,139	885.20	3,663,842.80	
	DEMANT A/S	2,833	364.50	1,032,628.50	
	GENMAB A/S	1,973	2,033.00	4,011,109.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	96,818	858.00	83,069,844.00	
	DANSKE BANK A/S	20,212	193.50	3,911,022.00	
	TRYG A/S	10,320	144.60	1,492,272.00	
	ORSTED A/S	5,578	397.60	2,217,812.80	
デンマーク・クローネ小計		194,004		124,039,360.30 (2,694,134,906)	
イスラエル・シェケル	ICL GROUP LIMITED	23,381	18.20	425,534.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	786	742.20	583,369.20	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	22,893	47.50	1,087,417.50	
	BANK HAPOLIM BM	38,036	32.29	1,228,182.44	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	45,974	27.92	1,283,594.08	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	35,010	17.92	627,379.20	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,624	137.60	636,262.40	
	NICE LTD	1,853	820.50	1,520,386.50	
	AZRIELI GROUP	1,403	247.10	346,681.30	
イスラエル・シェケル小計		173,960		7,738,806.82 (320,291,415)	

ユーロ	ENI SPA	70,062	14.17	992,778.54	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	13,421	14.52	194,940.02	
	NESTE OYJ	12,471	27.33	340,832.43	
	OMV AG	4,297	40.97	176,048.09	
	REPSOL SA	37,841	13.81	522,584.21	
	TENARIS SA	14,277	14.92	213,084.22	
	TOTAL SE	67,981	59.69	4,057,785.89	
	AIR LIQUIDE	15,535	171.68	2,667,048.80	
	AKZO NOBEL	5,050	68.72	347,036.00	
	ARKEMA	1,729	97.12	167,920.48	
	BASF SE	26,464	45.78	1,211,389.60	
	COVESTRO	5,723	46.98	268,866.54	
	DSM-FIRMENICH AG	5,633	103.90	585,268.70	
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,222	17.13	106,551.75	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	4,134	85.80	354,697.20	
	NLG) ARCELORMITTAL	15,151	24.85	376,578.10	
	OCI NV	3,093	25.68	79,428.24	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	7,863	38.38	301,781.94	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	17,584	11.17	196,325.36	
	SYENSQO SA	2,156	84.01	181,125.56	
	SYMRISE AG	3,907	98.32	384,136.24	
	UMICORE	6,243	20.34	126,982.62	
	UPM-KYMMENE	15,813	29.07	459,683.91	
	VOESTALPINE AG	3,551	25.46	90,408.46	
	WACKER CHEMIE AG	552	102.30	56,469.60	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	6,253	36.45	227,921.85	
	AIRBUS SE	17,583	144.30	2,537,226.90	
	ALSTOM	8,486	11.35	96,316.10	
	BOUYGUES SA	5,775	34.26	197,851.50	
	BRENTAG SE	4,116	80.80	332,572.80	
	CIE DE SAINT-GOBAIN	13,511	68.55	926,179.05	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	15,847	35.16	557,180.52	
	DASSAULT AVIATION SA	595	180.90	107,635.50	
	EIFFAGE EUR4 (POST SUBDIV ISIO	2,222	96.68	214,822.96	
	FERROVIAL SE	15,391	35.16	541,147.56	
	GEA GROUP AG NPV	4,733	37.49	177,440.17	
	IMCD NV	1,726	142.50	245,955.00	
	KINGSPAN GROUP PLC	4,524	83.04	375,672.96	
	KNORR-BREMSE AG	2,182	58.80	128,301.60	
	KONE OYJ	10,273	46.23	474,920.79	
	LEGRAND PROMESSES EUR4	7,856	89.68	704,526.08	
	LEONARDO SPA	12,292	19.19	235,883.48	
	METSO CORPORATION	19,923	10.16	202,517.29	
	MTU AERO ENGINES AG	1,600	225.10	360,160.00	
	PRYSMIAN SPA EURO.10	7,952	43.24	343,844.48	
	RATIONAL AG	151	758.50	114,533.50	
	RHEINMETALL AG	1,302	404.10	526,138.20	

SAFRAN SA	10,137	189.12	1,917,109.44	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	16,142	203.00	3,276,826.00	
SIEMENS AG	22,545	169.58	3,823,181.10	
SIEMENS ENERGY AG	15,607	14.00	218,498.00	
THALES SA	3,113	134.00	417,142.00	
VINCI SA	15,057	114.12	1,718,304.84	
WARTSILA OYJ	13,590	14.56	197,870.40	
BUREAU VERITAS	8,577	25.28	216,826.56	
RANDSTAD NV	3,260	51.60	168,216.00	
RELX PLC	7,093	39.86	282,726.98	
TELEPERFORMANCE	1,786	134.75	240,663.50	
WOLTERS KLUWER CVA	7,368	145.80	1,074,254.40	
ADP	906	124.70	112,978.20	
AENA SME SA	2,249	168.25	378,394.25	
DHL GROUP-REG	29,393	42.99	1,263,752.03	
GETLINK SE	10,806	15.33	165,601.95	
LUFTHANSA	18,612	7.34	136,556.24	
BAYER MOTOREN WERKEUR1	9,453	102.82	971,957.46	
BAYER MOTOREN WERKNON-VTG PRF EUR1	1,799	96.95	174,413.05	
CONTINENTAL	3,284	74.02	243,081.68	
DR ING HC F PORSCHE AG	3,391	79.64	270,059.24	
FERRARI NV	3,737	361.60	1,351,299.20	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	23,794	67.63	1,609,188.22	
MICHELIN (CGDE)	20,380	33.00	672,540.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE (PREF)	4,638	46.06	213,626.28	
RENAULT SA	5,681	38.08	216,360.88	
STELLANTIS NV	22,121	23.61	522,387.41	
STELLANTIS NV	43,482	23.62	1,026,827.43	
VOLKSWAGEN STAMM	878	136.10	119,495.80	
VOLKSWAGEN VORZUG	6,111	119.98	733,197.78	
ADIDAS AG	4,802	179.72	863,015.44	
HERMES INTERNATIONAL	939	2,212.50	2,077,537.50	
KERING	2,207	428.00	944,596.00	
LVMH	8,192	821.90	6,733,004.80	
MONCLER SPA	6,166	62.56	385,744.96	
PUMA SE	3,065	42.58	130,507.70	
SEB	804	112.50	90,450.00	
ACCOR SA	5,565	37.25	207,296.25	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	13,354	60.72	810,854.88	
DELIVERY HERO SE	5,241	22.60	118,446.60	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,150	38.92	122,598.00	
SODEXO	2,617	75.70	198,106.90	
BOLLORE SE	21,754	6.22	135,201.11	
PUBLICIS GROUPE	6,782	98.10	665,314.20	
SCOUT24 SE	2,214	66.28	146,743.92	

UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	24,294	27.07	657,638.58	
VIVENDI SE	19,783	10.23	202,479.00	
D'IETEREN GROUP	633	171.00	108,243.00	
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA	32,345	39.67	1,283,126.15	
PROSUS NV	43,372	28.72	1,245,643.84	
ZALANDO SE	6,728	19.59	131,767.88	
CARREFOUR	17,040	15.33	261,223.20	
HELLOFRESH SE	4,629	12.10	56,034.04	
JERONIMO MARTINS	8,284	21.96	181,916.64	
KESKO OYJ-B SHS	8,375	17.90	149,912.50	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	28,476	27.45	781,666.20	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	25,758	58.23	1,499,888.34	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	4,700	62.00	291,400.00	
DANONE	19,092	61.52	1,174,539.84	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	15,854	9.82	155,686.28	
HEINEKEN HOLDING EUR1.6	3,926	73.95	290,327.70	
HEINEKEN NV	8,537	89.46	763,720.02	
JDE PEET'S BV	2,858	23.00	65,734.00	
KERRY GROUP A	4,780	78.68	376,090.40	
LOTUS BAKERIES	12	9,080.00	108,960.00	
PERNOD RICARD	6,062	157.45	954,461.90	
REMY COINTREAU	683	99.34	67,849.22	
BEIERSDORF	3,016	136.45	411,533.20	
HENKEL AG & CO KGAA (PREF)	5,011	70.58	353,676.38	
HENKEL KGAA	3,071	63.32	194,455.72	
L'OREAL	7,155	441.30	3,157,501.50	
UNILEVER PLC	34,155	47.32	1,616,214.60	
AMPLIFON SPA	3,732	31.48	117,483.36	
BIOMERIEUX	1,223	103.80	126,947.40	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,212	111.40	135,016.80	
DIASORIN ITALIA SPA	655	89.44	58,583.20	
ESSILORLUXOTTICA	8,744	188.84	1,651,216.96	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	6,072	39.46	239,601.12	
FRESENIUS SE & CO KGaA	12,707	26.67	338,895.69	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	23,384	18.86	441,022.24	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	8,300	55.40	459,820.00	
ARGENX SE	1,751	369.00	646,119.00	
BAYER AG	29,125	28.90	841,712.50	
EUROFINS SCIENTIFIC	3,948	57.82	228,273.36	
GRIFOLS SA	9,432	10.97	103,469.04	
IPSEN	1,163	106.10	123,394.30	
MERCK KGAA	3,829	155.75	596,366.75	
ORION OYJ	3,271	39.10	127,896.10	
QIAGEN N.V.	6,702	39.59	265,332.18	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,263	51.24	167,196.12	
SANOFI	33,765	86.22	2,911,218.30	

SARTORIUS AG-VORZUG	792	331.60	262,627.20	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	827	255.70	211,463.90	
UCB SA	3,817	95.40	364,141.80	
ABN AMRO BANK NV-CVA	12,519	14.82	185,594.17	
AIB GROUP PLC	47,724	4.22	201,299.83	
BANCA INTESA SPA	460,809	2.84	1,308,236.75	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT	176,902	9.03	1,596,717.45	
BANCO BPM SPA	36,816	4.92	181,134.72	
BANCO SANTANDER SA	479,979	3.74	1,793,921.51	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	32,092	8.52	273,552.20	
BNP PARIBAS	31,155	54.77	1,706,359.35	
CAIXABANK	122,226	4.04	493,548.58	
COMMERZBANK AG	31,163	10.73	334,378.99	
CREDIT AGRICOLE SA	31,643	12.36	391,234.05	
ERSTE GROUP BANK AG	10,073	39.00	392,847.00	
FINECOBANK SPA	17,792	13.01	231,473.92	
ING GROUP N.V.	107,332	12.46	1,337,142.05	
KBC BANCASSURANCE HOLDING NV	7,510	62.90	472,379.00	
MEDIOBANCA	16,313	11.78	192,167.14	
SOCIETE GENERALE-A	21,986	21.93	482,043.05	
UNICREDIT SPA	47,627	29.81	1,419,760.87	
ADYEN NV	650	1,494.80	971,620.00	
AMUNDI SA	1,867	60.35	112,673.45	
DEUTSCHE BANK AG-REG	57,443	12.00	689,086.22	
DEUTSCHE BOERSE AG	5,633	187.10	1,053,934.30	
EDENRED	7,473	55.14	412,061.22	
EURAZEO	1,267	78.40	99,332.80	
EURONEXT NV	2,584	81.45	210,466.80	
EXOR NV	2,768	98.64	273,035.52	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	2,600	70.90	184,340.00	
NEXI SPA	17,698	7.12	125,938.96	
SOFINA	454	215.20	97,700.80	
WORLDLINE SA	6,974	11.81	82,362.94	
AEGON LTD	48,037	5.36	257,382.24	
AGEAS	4,846	39.01	189,042.46	
ALLIANZ	11,963	248.65	2,974,599.95	
ASR NEDERLAND NV	4,842	43.03	208,351.26	
ASSICURAZIONI GENERALI	30,034	20.80	624,707.20	
AXA SA	53,500	31.01	1,659,035.00	
HANNOVER RUECK SE	1,786	227.80	406,850.80	
MUENCHENER RUECK AG-REG	4,047	407.40	1,648,747.80	
NN GROUP NV	7,998	37.20	297,525.60	
POSTE ITALIANE	16,160	10.10	163,216.00	
SAMPO OYJ-A SHS	13,374	41.29	552,145.59	
TALANX AG	1,914	65.15	124,697.10	
BECHTLE AG	2,430	46.51	113,019.30	
CAPGEMINI SA	4,631	221.50	1,025,766.50	

DASSAULT SYSTEMES SE	20,023	43.54	871,801.42	
NEMETSCHEK SE	1,704	85.98	146,509.92	
SAP SE	30,978	164.24	5,087,826.72	
NOKIA OYJ	159,839	3.27	522,753.44	
CELLNEX TELECOM SA	16,747	33.15	555,163.05	
DEUTSCHE TELEKOM	96,134	22.27	2,140,904.18	
ELISA CORP-A SHARES	4,146	42.26	175,209.96	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	9,879	10.72	105,952.27	
KPN (KON. PTT NEDERLAND	96,873	3.34	323,749.56	
ORANGE S.A.	55,179	10.85	598,471.43	
TELECOM ITALIA SPA	299,334	0.29	88,153.86	
TELEFONICA S.A.	144,822	3.63	525,124.57	
ACCIONA SA	730	107.50	78,475.00	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOV	1,974	20.90	41,256.60	
E.ON SE	66,551	11.84	787,963.84	
EDP ELERGIAS DE PORTUGAL	95,049	3.75	356,813.94	
EDP RENOVAVEIS SA	8,865	14.06	124,686.22	
ELIA GROUP SA/NV	866	104.30	90,323.80	
ENAGAS	7,199	14.55	104,745.45	
ENDESA SA	9,460	16.58	156,846.80	
ENEL SPA	241,197	5.86	1,413,655.61	
ENGIE	54,141	14.32	775,299.12	
FORTUM OYJ	12,949	10.98	142,244.76	
IBERDROLA SA	182,010	10.80	1,964,797.95	
NATURGY ENERGY GROUP SA	3,710	22.90	84,959.00	
REDEIA CORPORACION SA	12,113	14.82	179,514.66	
RWE AG	18,738	31.21	584,812.98	
SNAM SPA	59,662	4.43	264,183.33	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	41,249	7.46	307,552.54	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	20,155	29.00	584,495.00	
VERBUND AG	2,100	63.00	132,300.00	
ASM INTERNATIONAL NV	1,392	568.90	791,908.80	
ASML HOLDING NV	11,960	859.50	10,279,620.00	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	2,335	158.55	370,214.25	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	38,725	33.14	1,283,346.50	
STMICROELECTRONICS NV	20,493	41.76	855,787.68	
LEG IMMOBILIEN SE	2,254	70.82	159,628.28	
VONOVIA SE	21,724	26.74	580,899.76	
ユーロ小計	5,337,124		149,600,125.51 (24,226,244,324)	
合 計	33,637,325		256,434,914,393 (256,434,914,393)	

（注）１．通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

２．合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
-----	-----	-----	------	-----	----

投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE	4,900.00	584,472.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	9,400.00	323,642.00	
		AMERICAN TOWER CORP	13,792.00	2,580,896.96	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	14,050.00	262,173.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,215.00	746,560.80	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,550.00	306,488.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,206.00	308,288.96	
		CROWN CASTLE INC	12,966.00	1,403,180.52	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	9,000.00	1,225,980.00	
		EQUINIX INC	2,777.00	2,377,750.71	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5,300.00	350,754.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	10,743.00	644,902.29	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,937.00	455,911.69	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,300.00	891,891.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	7,600.00	343,444.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	15,900.00	272,844.00	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	21,048.00	415,066.56	
		INVITATION HOMES INC	18,300.00	598,410.00	
		IRON MOUNTAIN INC	8,757.00	595,300.86	
		KIMCO REALTY CORP	18,900.00	371,007.00	
		MID AMERICA APARTMENT COMM	3,437.00	443,957.29	
		PROLOGIS INC	27,428.00	3,658,620.92	
		PUBLIC STORAGE	4,730.00	1,331,589.60	
		REALTY INCOME CORP	24,638.00	1,289,306.54	
		REGENCY CENTERS CORP	5,000.00	304,050.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,200.00	661,760.00	
		SIMON PPTY (SIMON DEBART	9,680.00	1,451,612.80	
		SUN COMMUNITIES INC	3,700.00	481,000.00	
		UDR INC	9,300.00	335,544.00	
		VENTAS INC COM	12,100.00	529,496.00	
		VICI PROPERTIES INC	30,400.00	897,712.00	
		WELLTOWER INC	15,391.00	1,433,363.83	
		WEYERHAEUSER CO	21,660.00	714,563.40	
		WP CAREY INC	6,200.00	355,880.00	
	アメリカ・ドル小計		370,505.00	28,947,420.73 (4,353,113,129)	
	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,400.00	120,840.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,300.00	79,679.00	
	カナダ・ドル小計		6,700.00	200,519.00 (22,333,806)	

オーストラ リア・ドル	DEXUS/AU	31,342.00	239,766.30	
	GOODMAN GROUP	50,662.00	1,422,588.96	
	GPT GROUP	55,573.00	241,186.82	
	MIRVAC GROUP	116,457.00	259,699.11	
	SCENTRE GROUP	155,373.00	466,119.00	
	STOCKLAND	71,820.00	330,372.00	
	VINCINITY CENTERS	117,781.00	239,095.43	
オーストラリア・ドル小計		599,008.00	3,198,827.62 (314,156,861)	
イギリス・ ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	21,473.00	138,543.79	
	SEGRO PLC	35,390.00	306,052.72	
イギリス・ポンド小計		56,863.00	444,596.51 (84,162,119)	
香港・ドル	LINK REIT	76,424.00	2,888,827.20	
香港・ドル小計		76,424.00	2,888,827.20 (55,552,147)	
シンガポ ール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	113,085.00	309,852.90	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	154,021.00	301,881.16	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	101,167.00	154,785.51	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	71,600.00	100,956.00	
シンガポール・ドル小計		439,873.00	867,475.57 (96,870,997)	
ユーロ	COVIVIO	1,463.00	61,065.62	
	GECINA SA	1,365.00	128,378.25	
	KLEPIERRE	6,452.00	153,428.56	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,517.00	248,440.88	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	5,019.00	128,988.30	
ユーロ小計		17,816.00	720,301.61 (116,645,643)	
投資証券合計			5,042,834,702 (5,042,834,702)	
合 計			5,042,834,702 (5,042,834,702)	

（注）１．通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

２．合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

３．投資証券における券面総額は、証券数です。

外貨建有価証券の内訳

通 貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の合計 額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 588銘柄	97.8%	—	75.6%
	投資証券 34銘柄	—	2.2%	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	99.7%	—	3.2%
	投資証券 2銘柄	—	0.3%	
オーストラリア・ドル	株式 54銘柄	93.9%	—	2.0%
	投資証券 7銘柄	—	6.1%	

イギリス・ポンド	株式	84銘柄	99.2%	—	4.1%
	投資証券	2銘柄	—	0.8%	
スイス・フラン	株式	45銘柄	100.0%	—	2.7%
香港・ドル	株式	29銘柄	96.1%	—	0.5%
	投資証券	1銘柄	—	3.9%	
シンガポール・ドル	株式	16銘柄	89.1%	—	0.3%
	投資証券	4銘柄	—	10.9%	
ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	100.0%	—	0.1%
スウェーデン・クローナ	株式	43銘柄	100.0%	—	0.9%
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	15銘柄	100.0%	—	1.0%
イスラエル・シェケル	株式	9銘柄	100.0%	—	0.1%
ユーロ	株式	223銘柄	99.5%	—	9.3%
	投資証券	5銘柄	—	0.5%	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

（1）貸借対照表

（単位：円）

区 分	注記 番号	（2023年2月20日現在）	（2024年2月20日現在）
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		331,423,291	456,460,285
金銭信託		58,881	625,559
コール・ローン		27,379,779	80,832,760
国債証券		98,967,020,992	92,206,308,892
派生商品評価勘定		—	47,940
未収利息		693,324,926	677,680,675
前払費用		43,024,725	35,779,517
流動資産合計		100,062,232,594	93,457,735,628
資産合計		100,062,232,594	93,457,735,628
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		98,765	—
未払金		—	211,471,183
未払解約金		55,948,622	17,668,896
未払利息		73	217
その他未払費用		18	219
流動負債合計		56,047,478	229,140,515
負債合計		56,047,478	229,140,515
純資産の部			

元本等 元本 剰余金 剰余金又は欠損金（ ）	1	39,505,032,684 60,501,152,432	32,087,499,983 61,141,095,130
元本等合計		100,006,185,116	93,228,595,113
純資産合計		100,006,185,116	93,228,595,113
負債純資産合計		100,062,232,594	93,457,735,628

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

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3 その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

（2023年 2月20日現在）	（2024年2月20日現在）
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（2023年2月20日現在）	（2024年2月20日現在）
-----	----------------	----------------

1 期首元本額	44,829,220,968円	39,505,032,684円
期中追加設定元本額	6,861,120,999円	3,568,386,896円
期中一部解約元本額	12,185,309,283円	10,985,919,597円
元本の内訳		
ファンド名		
ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン	6,573,053,611円	6,522,141,699円
ステート・ストリートDCグローバル債券インデックス・オープン	27,914,213円	29,972,360円
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	858,207,630円	796,641,718円
外国債券インデックス・ファンド／為替ヘッジ付き（年金1）＜適格機関投資家限定＞	3,522,109,524円	2,648,325,399円
外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	731,180,349円	517,318,076円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	3,965,865円	1,365,542円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	77,880,401円	49,349,187円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	79,545円	79,545円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	4,841,917円	1,907,466円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	1,950,052円	1,436,172円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	5,649,737,183円	5,226,113,526円
外国債券インデックス・ファンドVA1＜適格機関投資家限定＞	73,245,212円	65,074,366円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	1,234,781円	1,259,139円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	1,770,620,355円	1,389,443,841円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	999,215,937円	901,135,728円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	25,180,532円	19,758,715円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	547,267,577円	422,909,834円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	3,057,943,620円	2,726,042,591円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	657,500,727円	508,872,030円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	2,036,207,903円	1,718,423,064円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	66,481,698円	59,284,371円

グローバル４資産３０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	74,087,159円	60,485,928円
グローバル４資産４５ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	53,201,916円	48,955,179円
４資産バランス３０ＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	30,342,970円	23,931,189円
バランスファンドＶＡ２５Ｂ＜適格機関投資家限定＞	483,144,559円	409,339,503円
バランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家限定＞	1,653,331円	1,291,345円
バランスファンドＶＡ３５Ｂ＜適格機関投資家限定＞	1,825,877円	1,051,916円
外国債券インデックス・ファンドＶＡ３＜適格機関投資家限定＞	505,687,107円	643,266,255円
４資産インデックスバランスＶＡ２０＜適格機関投資家限定＞	762,368,435円	663,700,649円
世界分散ファンドＶＡ２５Ａ＜適格機関投資家限定＞	1,261,385,716円	1,073,298,832円
外国債券インデックス・ファンドＡ／為替ヘッジ付き＜適格機関投資家限定＞	410,575,814円	178,832,429円
４資産インデックスバランスＶＡ５０＜適格機関投資家限定＞	27,738,807円	28,574,469円
T a dリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）年金＜適格機関投資家限定＞	188,469,837円	182,418,457円
フレックス資産配分戦略ファンド＜適格機関投資家限定＞	214,783,410円	64,152,607円
T a dリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）＜適格機関投資家限定＞	126,400,166円	174,506,643円
ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン	200,353,653円	271,289,355円
ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	5,805,670,470円	2,341,135,762円
世界国債タームスブレッド・プレミア戦略ファンド／為替ヘッジ付＜適格機関投資家限定＞	1,746,137,311円	1,564,858,301円
ステート・ストリート・グローバル債券インデックス・オープン（隔月分配型）	—円	349,518円
世界バランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	13,481,149円	10,472,898円
世界バランス６０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	13,639,600円	6,432,090円
グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	949,115円	608,168円
グローバルバランス４０ＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	834,530,442円	691,277,057円

グローバルバランス４０ＶＡ３＜適格機関投資家限定＞	52,778,605円	30,445,613円
グローバルバランス５０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	10,008,603円	9,971,451円
計	39,505,032,684円	32,087,499,983円
2 受益権の総数	39,505,032,684口	32,087,499,983口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「（３）附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスクに晒されております。 デリバティブ取引には、保有外貨建資産の売却代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払い目的に関連して利用している為替予約取引があり、為替変動リスク等の市場リスク及びカウンターパーティーリスク等の信用リスクに晒されております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	（ 2023年2月20日現在 ）	（ 2024年2月20日現在 ）
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左

2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。	同左

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	（2023年2月20日現在）	（2024年2月20日現在）
	当期間の損益に 含まれた評価差額	当期間の損益に 含まれた評価差額
国債証券	13,481,187,186	261,111,573
合計	13,481,187,186	261,111,573

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までを指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

（単位：円）

区 分	種 類	（2023年2月20日現在）		
		契 約 額 等	時 価	評 価 損 益
		うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	46,949,635	—	47,048,400	98,765
合 計		46,949,635	—	47,048,400	98,765

(単位：円)

区 分	種 類	(2024年2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	30,023,400	—	30,071,340	47,940
合 計		30,023,400	—	30,071,340	47,940

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

4. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(2023年2月20日現在)	(2024年2月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5315円 (25,315円)	2.9054円 (29,054円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
-----	-----	-----	------	-----	----

国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY N/B 0.25% 25/05/31	2,500,000.00	2,358,105.47	
		US TREASURY N/B 0.25% 25/08/31	4,000,000.00	3,734,531.24	
		US TREASURY N/B 0.38% 27/07/31	3,500,000.00	3,053,750.00	
		US TREASURY N/B 0.38% 27/09/30	3,200,000.00	2,776,249.98	
		US TREASURY N/B 0.5% 25/03/31	5,000,000.00	4,762,695.30	
		US TREASURY N/B 0.5% 27/06/30	2,000,000.00	1,758,671.88	
		US TREASURY N/B 0.5% 27/10/31	2,000,000.00	1,738,203.12	
		US TREASURY N/B 0.63% 27/11/30	5,300,000.00	4,616,175.76	
		US TREASURY N/B 0.63% 27/12/31	2,950,000.00	2,561,314.46	
		US TREASURY N/B 0.63% 30/05/15	2,800,000.00	2,240,437.50	
		US TREASURY N/B 0.63% 30/08/15	4,600,000.00	3,648,914.07	
		US TREASURY N/B 0.75% 26/03/31	1,200,000.00	1,108,453.12	
		US TREASURY N/B 0.88% 26/06/30	2,600,000.00	2,390,679.69	
		US TREASURY N/B 0.88% 26/09/30	2,200,000.00	2,007,671.86	
		US TREASURY N/B 0.88% 30/11/15	4,000,000.00	3,209,375.00	
		US TREASURY N/B 1.13% 27/02/28	4,100,000.00	3,721,230.47	
		US TREASURY N/B 1.13% 31/02/15	3,650,000.00	2,968,333.99	
		US TREASURY N/B 1.13% 40/05/15	1,000,000.00	609,296.88	
		US TREASURY N/B 1.13% 40/08/15	1,700,000.00	1,025,910.15	
		US TREASURY N/B 1.25% 26/11/30	3,000,000.00	2,750,976.57	
		US TREASURY N/B 1.25% 28/03/31	1,400,000.00	1,238,015.63	
		US TREASURY N/B 1.25% 28/05/31	2,800,000.00	2,464,656.26	
		US TREASURY N/B 1.25% 28/06/30	2,600,000.00	2,283,734.38	
		US TREASURY N/B 1.25% 28/09/30	600,000.00	523,617.18	
		US TREASURY N/B 1.25% 31/08/15	4,000,000.00	3,226,250.00	
		US TREASURY N/B 1.25% 50/05/15	1,500,000.00	748,769.53	
		US TREASURY N/B 1.38% 26/08/31	3,500,000.00	3,241,054.67	
		US TREASURY N/B 1.38% 28/10/31	1,400,000.00	1,226,367.18	
		US TREASURY N/B 1.38% 28/12/31	1,000,000.00	872,460.94	
		US TREASURY N/B 1.38% 31/11/15	4,000,000.00	3,233,593.76	
		US TREASURY N/B 1.38% 40/11/15	1,700,000.00	1,067,281.25	
		US TREASURY N/B 1.38% 50/08/15	2,700,000.00	1,392,925.78	
		US TREASURY N/B 1.5% 26/08/15	3,500,000.00	3,254,179.67	
		US TREASURY N/B 1.5% 27/01/31	4,800,000.00	4,415,062.51	
		US TREASURY N/B 1.5% 28/11/30	2,400,000.00	2,110,781.24	
		US TREASURY N/B 1.5% 30/02/15	1,500,000.00	1,279,628.91	
		US TREASURY N/B 1.63% 26/02/15	3,000,000.00	2,829,609.36	
		US TREASURY N/B 1.63% 26/05/15	4,000,000.00	3,751,718.76	
		US TREASURY N/B 1.63% 26/09/30	4,000,000.00	3,722,500.00	
		US TREASURY N/B 1.63% 29/08/15	8,000,000.00	6,982,500.00	
		US TREASURY N/B 1.63% 31/05/15	4,400,000.00	3,675,031.27	
		US TREASURY N/B 1.63% 50/11/15	800,000.00	441,718.75	
		US TREASURY N/B 1.75% 29/01/31	3,800,000.00	3,370,718.75	
		US TREASURY N/B 1.75% 29/11/15	3,000,000.00	2,625,000.00	
		US TREASURY N/B 1.88% 32/02/15	4,000,000.00	3,346,562.48	
		US TREASURY N/B 1.88% 41/02/15	1,400,000.00	954,679.68	
		US TREASURY N/B 1.88% 51/02/15	3,650,000.00	2,148,652.36	

US TREASURY N/B 1.88% 51/11/15	2,400,000.00	1,404,562.51	
US TREASURY N/B 2.0% 25/02/15	100,000.00	97,093.75	
US TREASURY N/B 2.0% 25/08/15	4,500,000.00	4,320,703.12	
US TREASURY N/B 2.0% 26/11/15	4,050,000.00	3,794,343.75	
US TREASURY N/B 2.0% 41/11/15	800,000.00	549,156.24	
US TREASURY N/B 2.0% 50/02/15	2,200,000.00	1,348,960.93	
US TREASURY N/B 2.0% 51/08/15	1,600,000.00	969,062.49	
US TREASURY N/B 2.13% 25/05/15	5,200,000.00	5,028,968.77	
US TREASURY N/B 2.25% 25/11/15	4,000,000.00	3,836,562.48	
US TREASURY N/B 2.25% 26/03/31	2,300,000.00	2,193,085.92	
US TREASURY N/B 2.25% 27/02/15	3,500,000.00	3,288,222.66	
US TREASURY N/B 2.25% 27/08/15	2,000,000.00	1,862,500.00	
US TREASURY N/B 2.25% 27/11/15	2,800,000.00	2,596,890.63	
US TREASURY N/B 2.25% 41/05/15	1,250,000.00	903,466.80	
US TREASURY N/B 2.25% 46/08/15	200,000.00	134,234.37	
US TREASURY N/B 2.25% 49/08/15	1,000,000.00	653,007.81	
US TREASURY N/B 2.25% 52/02/15	2,100,000.00	1,350,890.62	
US TREASURY N/B 2.38% 27/05/15	4,200,000.00	3,943,570.30	
US TREASURY N/B 2.38% 29/05/15	3,000,000.00	2,731,289.06	
US TREASURY N/B 2.38% 49/11/15	1,700,000.00	1,140,726.55	
US TREASURY N/B 2.38% 51/05/15	4,000,000.00	2,657,031.24	
US TREASURY N/B 2.5% 26/02/28	3,000,000.00	2,877,539.07	
US TREASURY N/B 2.5% 45/02/15	900,000.00	645,785.15	
US TREASURY N/B 2.5% 46/05/15	1,000,000.00	707,656.25	
US TREASURY N/B 2.63% 25/03/31	5,000,000.00	4,875,585.95	
US TREASURY N/B 2.63% 25/12/31	3,000,000.00	2,891,718.75	
US TREASURY N/B 2.63% 26/01/31	2,300,000.00	2,214,199.21	
US TREASURY N/B 2.63% 27/05/31	1,800,000.00	1,702,265.61	
US TREASURY N/B 2.63% 29/02/15	5,800,000.00	5,366,359.40	
US TREASURY N/B 2.75% 25/02/28	1,200,000.00	1,173,281.25	
US TREASURY N/B 2.75% 25/06/30	2,900,000.00	2,821,269.52	
US TREASURY N/B 2.75% 28/02/15	2,300,000.00	2,166,222.66	
US TREASURY N/B 2.75% 32/08/15	3,100,000.00	2,756,699.21	
US TREASURY N/B 2.75% 42/08/15	1,200,000.00	924,937.50	
US TREASURY N/B 2.75% 42/11/15	1,000,000.00	768,125.00	
US TREASURY N/B 2.75% 47/08/15	500,000.00	367,285.15	
US TREASURY N/B 2.75% 47/11/15	1,000,000.00	733,398.44	
US TREASURY N/B 2.88% 25/07/31	4,600,000.00	4,476,914.07	
US TREASURY N/B 2.88% 25/11/30	2,300,000.00	2,228,304.67	
US TREASURY N/B 2.88% 28/05/15	3,400,000.00	3,208,085.94	
US TREASURY N/B 2.88% 28/08/15	1,500,000.00	1,411,816.41	
US TREASURY N/B 2.88% 32/05/15	3,900,000.00	3,513,046.87	
US TREASURY N/B 2.88% 43/05/15	300,000.00	234,011.71	
US TREASURY N/B 2.88% 45/08/15	1,100,000.00	840,554.68	
US TREASURY N/B 2.88% 46/11/15	800,000.00	605,218.75	
US TREASURY N/B 2.88% 49/05/15	500,000.00	373,144.53	
US TREASURY N/B 2.88% 52/05/15	1,500,000.00	1,111,816.41	

US TREASURY N/B 3.0% 25/09/30	2,500,000.00	2,431,835.95	
US TREASURY N/B 3.0% 42/05/15	1,200,000.00	964,453.12	
US TREASURY N/B 3.0% 45/05/15	1,100,000.00	860,964.84	
US TREASURY N/B 3.0% 45/11/15	1,000,000.00	779,765.62	
US TREASURY N/B 3.0% 47/02/15	900,000.00	695,320.30	
US TREASURY N/B 3.0% 47/05/15	1,000,000.00	771,250.00	
US TREASURY N/B 3.0% 48/02/15	550,000.00	422,468.75	
US TREASURY N/B 3.0% 48/08/15	1,500,000.00	1,149,433.59	
US TREASURY N/B 3.0% 49/02/15	1,700,000.00	1,300,632.80	
US TREASURY N/B 3.0% 52/08/15	1,800,000.00	1,369,898.44	
US TREASURY N/B 3.13% 27/08/31	3,200,000.00	3,067,750.01	
US TREASURY N/B 3.13% 28/11/15	1,700,000.00	1,613,937.50	
US TREASURY N/B 3.13% 41/11/15	950,000.00	783,712.89	
US TREASURY N/B 3.13% 42/02/15	1,400,000.00	1,150,898.43	
US TREASURY N/B 3.13% 43/02/15	700,000.00	569,351.56	
US TREASURY N/B 3.13% 44/08/15	1,100,000.00	885,027.34	
US TREASURY N/B 3.13% 48/05/15	1,500,000.00	1,178,085.93	
US TREASURY N/B 3.25% 29/06/30	2,800,000.00	2,658,796.86	
US TREASURY N/B 3.38% 33/05/15	2,200,000.00	2,043,765.63	
US TREASURY N/B 3.38% 42/08/15	1,300,000.00	1,103,019.52	
US TREASURY N/B 3.38% 48/11/15	2,050,000.00	1,682,521.48	
US TREASURY N/B 3.5% 28/01/31	1,900,000.00	1,840,847.66	
US TREASURY N/B 3.5% 33/02/15	1,800,000.00	1,691,226.55	
US TREASURY N/B 3.5% 39/02/15	400,000.00	360,609.37	
US TREASURY N/B 3.63% 28/03/31	2,500,000.00	2,432,226.55	
US TREASURY N/B 3.63% 43/08/15	600,000.00	524,554.68	
US TREASURY N/B 3.63% 44/02/15	800,000.00	697,906.24	
US TREASURY N/B 3.63% 53/02/15	1,100,000.00	948,019.52	
US TREASURY N/B 3.75% 41/08/15	800,000.00	723,312.49	
US TREASURY N/B 3.75% 43/11/15	700,000.00	622,453.12	
US TREASURY N/B 3.88% 25/04/30	5,800,000.00	5,730,445.29	
US TREASURY N/B 3.88% 26/01/15	1,000,000.00	985,703.12	
US TREASURY N/B 3.88% 33/08/15	2,000,000.00	1,932,500.00	
US TREASURY N/B 3.88% 40/08/15	900,000.00	833,976.55	
US TREASURY N/B 3.88% 43/05/15	800,000.00	726,625.00	
US TREASURY N/B 4.0% 28/06/30	2,300,000.00	2,269,812.50	
US TREASURY N/B 4.0% 42/11/15	300,000.00	277,886.71	
US TREASURY N/B 4.0% 52/11/15	900,000.00	831,234.37	
US TREASURY N/B 4.13% 32/11/15	2,200,000.00	2,169,320.31	
US TREASURY N/B 4.13% 53/08/15	850,000.00	802,984.37	
US TREASURY N/B 4.25% 39/05/15	500,000.00	490,351.56	
US TREASURY N/B 4.25% 40/11/15	1,000,000.00	968,671.88	
US TREASURY N/B 4.38% 28/11/30	350,000.00	351,121.09	
US TREASURY N/B 4.38% 30/11/30	1,500,000.00	1,504,453.12	
US TREASURY N/B 4.38% 38/02/15	400,000.00	401,546.87	
US TREASURY N/B 4.38% 39/11/15	750,000.00	743,232.42	
US TREASURY N/B 4.38% 40/05/15	500,000.00	493,632.81	

US TREASURY N/B 4.38% 43/08/15	500,000.00	486,328.12	
US TREASURY N/B 4.5% 33/11/15	2,100,000.00	2,131,500.00	
US TREASURY N/B 4.5% 36/02/15	520,000.00	534,401.56	
US TREASURY N/B 4.5% 38/05/15	300,000.00	304,289.06	
US TREASURY N/B 4.63% 25/06/30	500,000.00	498,535.15	
US TREASURY N/B 4.63% 28/09/30	1,800,000.00	1,822,500.00	
US TREASURY N/B 4.75% 41/02/15	1,800,000.00	1,850,484.38	
US TREASURY N/B 4.75% 43/11/15	350,000.00	357,929.68	
US TREASURY N/B 4.75% 53/11/15	950,000.00	997,648.41	
US TREASURY N/B 5.0% 25/08/31	1,500,000.00	1,503,984.37	
US TREASURY N/B 5.0% 25/09/30	2,000,000.00	2,006,718.75	
US TREASURY N/B 5.0% 37/05/15	200,000.00	214,296.87	
US TREASURY N/B 5.38% 31/02/15	500,000.00	534,414.06	
US TREASURY N/B 6.0% 26/02/15	2,000,000.00	2,051,796.88	
US TREASURY N/B 6.13% 27/11/15	300,000.00	317,707.03	
US TREASURY N/B 6.25% 30/05/15	900,000.00	993,937.50	
アメリカ・ドル小計	330,570,000.00	290,711,635.50 (43,717,215,745)	

カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT BOND 0.5% 25/09/01	1,650,000.00	1,554,085.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.0% 27/06/01	1,200,000.00	1,097,196.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 30/06/01	1,090,000.00	946,425.20	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 26/06/01	1,100,000.00	1,037,674.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 31/06/01	1,720,000.00	1,488,642.80	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 53/12/01	820,000.00	564,324.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 28/06/01	550,000.00	513,496.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 32/06/01	1,710,000.00	1,514,136.60	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 51/12/01	850,000.00	630,334.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 25/06/01	3,350,000.00	3,252,247.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 33/06/01	300,000.00	280,254.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 48/12/01	430,000.00	379,384.70	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 55/12/01	150,000.00	130,573.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 64/12/01	360,000.00	311,400.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 34/06/01	300,000.00	285,081.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 45/12/01	450,000.00	450,238.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 37/06/01	450,000.00	516,573.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 29/06/01	750,000.00	825,892.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/06/01	700,000.00	817,551.00	
カナダ・ドル小計		17,930,000.00	16,595,510.30 (1,848,407,936)	

オーストラ リア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.0% 30/12/21	1,400,000.00	1,152,181.89	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.0% 31/11/21	910,000.00	725,752.68	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 32/05/21	2,250,000.00	1,803,709.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 51/06/21	500,000.00	282,505.63	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 28/05/21	700,000.00	658,269.03	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.5% 30/05/21	700,000.00	645,011.26	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 27/11/21	650,000.00	627,125.56	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 35/06/21	490,000.00	425,380.57	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 41/05/21	400,000.00	318,355.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 47/03/21	340,000.00	265,441.19	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 25/04/21	50,000.00	49,582.98	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 29/04/21	370,000.00	359,896.91	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 39/06/21	350,000.00	306,026.46	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 37/04/21	350,000.00	330,962.94	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 26/04/21	1,650,000.00	1,665,544.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 33/04/21	1,980,000.00	2,032,720.76	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 27/04/21	930,000.00	957,299.08	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 54/06/21	130,000.00	134,840.77	
オーストラリア・ドル小計		14,150,000.00	12,740,606.61 (1,251,254,974)	

イギリス・ bond	UK GILT BOND 0.25% 31/07/31	1,390,000.00	1,055,051.70	
	UK GILT BOND 0.38% 30/10/22	800,000.00	632,502.40	
	UK GILT BOND 0.88% 29/10/22	810,000.00	683,636.76	
	UK GILT BOND 1.13% 39/01/31	650,000.00	414,565.66	
	UK GILT BOND 1.25% 27/07/22	900,000.00	818,424.00	
	UK GILT BOND 1.5% 26/07/22	1,150,000.00	1,078,801.20	
	UK GILT BOND 1.63% 28/10/22	500,000.00	450,050.00	
	UK GILT BOND 1.63% 71/10/22	970,000.00	439,798.00	
	UK GILT BOND 1.75% 37/09/07	700,000.00	513,156.28	
	UK GILT BOND 1.75% 49/01/22	900,000.00	520,463.70	
	UK GILT BOND 1.75% 57/07/22	880,000.00	459,609.92	
	UK GILT BOND 2.0% 25/09/07	1,650,000.00	1,587,531.00	
	UK GILT BOND 2.5% 65/07/22	820,000.00	513,768.42	
	UK GILT BOND 3.25% 33/01/31	900,000.00	842,715.90	
	UK GILT BOND 3.25% 44/01/22	450,000.00	370,071.92	
	UK GILT BOND 3.5% 45/01/22	800,000.00	679,445.12	
	UK GILT BOND 3.5% 68/07/22	650,000.00	526,350.37	
	UK GILT BOND 3.75% 52/07/22	970,000.00	836,172.01	
	UK GILT BOND 4.0% 60/01/22	920,000.00	828,239.20	
	UK GILT BOND 4.25% 27/12/07	1,050,000.00	1,054,473.00	
	UK GILT BOND 4.25% 32/06/07	1,050,000.00	1,065,781.50	
	UK GILT BOND 4.25% 36/03/07	850,000.00	847,189.56	
	UK GILT BOND 4.25% 39/09/07	430,000.00	418,648.00	
	UK GILT BOND 4.25% 40/12/07	650,000.00	628,615.00	
	UK GILT BOND 4.25% 46/12/07	850,000.00	803,520.30	
	UK GILT BOND 4.25% 49/12/07	650,000.00	611,704.86	
	UK GILT BOND 4.25% 55/12/07	950,000.00	891,765.00	
	UK GILT BOND 4.5% 34/09/07	900,000.00	922,197.60	
	UK GILT BOND 4.5% 42/12/07	750,000.00	742,545.00	
	UK GILT BOND 4.75% 30/12/07	800,000.00	835,478.72	
	UK GILT BOND 4.75% 38/12/07	600,000.00	619,560.00	
	UK GILT BOND 4.75% 43/10/22	100,000.00	101,710.14	
	UK GILT BOND 5.0% 25/03/07	1,720,000.00	1,722,808.07	
	UK GILT BOND 6.0% 28/12/07	700,000.00	759,839.08	
イギリス・bond小計		28,860,000.00	25,276,189.39	(4,784,782,652)

シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 1.88% 50/03/01	160,000.00	127,875.38	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 1.88% 51/10/01	190,000.00	153,012.70	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.38% 25/06/01	455,000.00	448,947.59	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.38% 39/07/01	240,000.00	220,801.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 42/04/01	370,000.00	357,897.30	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 46/03/01	110,000.00	105,404.63	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.88% 30/09/01	650,000.00	642,813.54	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.0% 72/08/01	90,000.00	91,548.76	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.38% 33/09/01	350,000.00	359,049.25	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.5% 27/03/01	850,000.00	859,969.03	
シンガポール・ドル小計		3,465,000.00	3,367,319.38 (376,028,554)	
マレーシア・リングット	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 27/05/31	1,000,000.00	1,000,148.11	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.58% 32/07/15	300,000.00	294,092.91	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.76% 40/05/22	200,000.00	192,960.94	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.9% 26/11/30	2,500,000.00	2,528,620.15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.96% 25/09/15	1,550,000.00	1,562,282.29	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.07% 50/06/15	850,000.00	831,345.27	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 30/04/15	1,700,000.00	1,772,043.17	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.64% 33/11/07	3,100,000.00	3,298,505.02	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.74% 46/03/15	1,550,000.00	1,677,324.90	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.92% 48/07/06	450,000.00	497,899.93	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.94% 43/09/30	1,130,000.00	1,245,991.48	
マレーシア・リングット小計		14,330,000.00	14,901,214.17 (467,728,251)	

ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	540,000.00	524,074.06	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	800,000.00	664,833.32	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	30,000.00	27,700.59	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1,150,000.00	933,107.34	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	290,000.00	178,932.90	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	205,000.00	134,265.91	
ニュージーランド・ドル小計		3,015,000.00	2,462,914.12 (227,400,861)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/05/12	4,200,000.00	3,906,844.91	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 0.75% 29/11/12	1,400,000.00	1,277,300.08	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 1.0% 26/11/12	3,000,000.00	2,865,979.38	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 2.5% 25/05/12	2,100,000.00	2,081,016.33	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.5% 39/03/30	2,950,000.00	3,270,075.00	
スウェーデン・クローナ小計		13,650,000.00	13,401,215.70 (193,781,579)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.38% 30/08/19	2,200,000.00	1,896,113.12	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 26/02/19	2,700,000.00	2,569,185.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 27/02/17	3,000,000.00	2,819,685.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 29/09/06	1,700,000.00	1,528,198.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 2.13% 32/05/18	1,300,000.00	1,144,023.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 33/08/15	950,000.00	888,251.52	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 42/10/06	750,000.00	737,536.50	
ノルウェー・クローネ小計		12,600,000.00	11,582,992.54 (165,984,283)	
デンマーク・クローネ	DANISH GOVERNMENT BOND 0.25% 52/11/15	2,090,000.00	1,108,467.03	
	DANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 27/11/15	3,400,000.00	3,161,987.08	
	DANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/11/15	2,050,000.00	1,842,569.93	
	DANISH GOVERNMENT BOND 1.75% 25/11/15	1,600,000.00	1,571,223.04	
	DANISH GOVERNMENT BOND 4.5% 39/11/15	3,160,000.00	3,912,857.99	
デンマーク・クローネ小計		12,300,000.00	11,597,105.07 (251,889,122)	

メキシコ・ペソ	MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 36/11/20	7,200,000.00	7,626,384.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 5.75% 26/03/05	19,000,000.00	17,490,319.09	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.5% 27/06/03	19,500,000.00	18,423,970.89	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 31/05/29	11,500,000.00	10,603,000.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 34/11/23	5,500,000.00	4,952,035.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 42/11/13	4,300,000.00	3,685,487.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 47/11/07	9,100,000.00	7,908,537.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 53/07/31	4,000,000.00	3,442,640.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 29/05/31	10,500,000.00	10,192,455.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 38/11/18	7,000,000.00	6,548,290.00	
メキシコ・ペソ小計		97,600,000.00	90,873,117.98 (801,573,599)	
イスラエル・シェケル	ISRAEL FIXED BOND	2,000,000.00	1,957,900.00	
	ISRAEL FIXED BOND	1,300,000.00	1,255,735.00	
	ISRAEL FIXED BOND	1,400,000.00	1,316,210.00	
	ISRAEL FIXED BOND	880,000.00	746,548.00	
	ISRAEL FIXED BOND	950,000.00	1,052,932.50	
	ISRAEL FIXED BOND	1,240,000.00	1,110,978.00	
	ISRAEL FIXED BOND	150,000.00	121,927.50	
イスラエル・シェケル小計		7,920,000.00	7,562,231.00 (312,983,348)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 0.75% 25/04/25	620,000.00	590,624.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND 1.25% 30/10/25	2,500,000.00	1,944,972.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 1.75% 32/04/25	1,370,000.00	1,045,386.72	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5% 26/07/25	3,000,000.00	2,828,424.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25% 25/07/25	2,580,000.00	2,516,661.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 29/04/25	3,220,000.00	3,287,268.37	
	POLAND GOVERNMENT BOND 6.0% 33/10/25	640,000.00	663,252.48	
ポーランド・ズロチ小計		13,930,000.00	12,876,589.47 (481,802,061)	

中国・人民 元	CHINA GOVERNMENT BOND	23,500,000.00	23,582,119.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	21,200,000.00	21,237,299.28	
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	20,019,998.20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,017,221.19	
	CHINA GOVERNMENT BOND	39,100,000.00	39,599,202.21	
	CHINA GOVERNMENT BOND	21,000,000.00	21,117,590.97	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,123,254.55	
	CHINA GOVERNMENT BOND	19,500,000.00	19,770,473.77	
	CHINA GOVERNMENT BOND	42,000,000.00	43,163,664.18	
	CHINA GOVERNMENT BOND	17,900,000.00	18,099,937.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,034,905.42	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,100,000.00	5,200,036.95	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,079,885.54	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,007,913.87	
	CHINA GOVERNMENT BOND	18,300,000.00	19,021,192.75	
	CHINA GOVERNMENT BOND	25,800,000.00	26,607,507.49	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,519,942.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,133,980.57	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,500,000.00	8,538,457.99	
	CHINA GOVERNMENT BOND	13,200,000.00	15,996,600.97	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,500,000.00	12,202,169.59	
	CHINA GOVERNMENT BOND	14,100,000.00	15,856,573.62	
中国・人民元小計		362,700,000.00	373,929,929.31 (7,803,394,123)	

ユーロ	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.0% 30/02/20	820,000.00	697,692.90	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.0% 31/02/20	550,000.00	453,622.40	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.0% 40/10/20	250,000.00	150,289.75	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.5% 29/02/20	350,000.00	314,230.35	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 26/10/20	700,000.00	664,046.60	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 28/02/20	700,000.00	648,662.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 51/03/20	390,000.00	225,591.99	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.85% 20/06/30	150,000.00	67,062.60	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.2% 25/10/20	230,000.00	223,341.96	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.5% 47/02/20	335,000.00	246,922.80	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.5% 86/11/02	120,000.00	71,197.49	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.1% 17/09/20	190,000.00	142,432.17	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.4% 34/05/23	300,000.00	286,095.60	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.9% 33/02/20	550,000.00	550,995.50	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.15% 44/06/20	240,000.00	239,877.60	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.8% 62/01/26	195,000.00	222,996.73	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.15% 37/03/15	400,000.00	446,244.80	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.85% 26/03/15	350,000.00	363,303.85	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 6.25% 27/07/15	650,000.00	722,276.10	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.1% 30/06/22	400,000.00	340,191.60	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.35% 32/06/22	200,000.00	163,633.25	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.4% 40/06/22	280,000.00	179,870.64	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.65% 71/06/22	260,000.00	108,140.50	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 25/06/22	400,000.00	387,661.20	

BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 27/06/22	380,000.00	357,031.66	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 28/06/22	750,000.00	694,194.75	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.9% 29/06/22	580,000.00	529,855.40	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.0% 31/06/22	900,000.00	796,425.30	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.25% 33/04/22	450,000.00	393,453.90	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.45% 37/06/22	300,000.00	245,524.80	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.6% 47/06/22	350,000.00	251,333.25	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.7% 50/06/22	450,000.00	319,506.52	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.9% 38/06/22	300,000.00	256,215.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.15% 66/06/22	160,000.00	119,599.20	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.25% 57/06/22	580,000.00	449,535.96	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.0% 34/06/22	450,000.00	452,107.80	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.75% 45/06/22	340,000.00	361,442.78	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 32/03/28	950,000.00	1,032,041.21	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 41/03/28	370,000.00	417,431.41	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/28	480,000.00	495,481.92	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.0% 35/03/28	500,000.00	593,253.25	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.5% 28/03/28	800,000.00	887,027.20	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.0% 30/09/15	30,000.00	25,142.94	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.13% 31/09/15	230,000.00	188,877.03	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.13% 36/04/15	250,000.00	177,042.10	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.13% 52/04/15	180,000.00	83,277.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.25% 40/09/15	150,000.00	95,123.85	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 26/04/15	430,000.00	409,235.05	

FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 27/09/15	120,000.00	111,062.76	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 28/09/15	300,000.00	272,058.60	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/09/15	170,000.00	150,793.57	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.75% 31/04/15	280,000.00	244,020.95	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.13% 34/04/15	200,000.00	169,065.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.38% 47/04/15	170,000.00	123,015.96	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.63% 42/07/04	245,000.00	228,670.75	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.75% 28/07/04	200,000.00	200,541.60	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.95% 55/04/15	80,000.00	78,166.90	
FINNISH GOVERNMENT BOND 3.0% 33/09/15	50,000.00	50,511.73	
FINNISH GOVERNMENT BOND 4.0% 25/07/04	320,000.00	323,604.48	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 26/02/25	650,000.00	613,744.95	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 29/11/25	1,400,000.00	1,202,579.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 30/11/25	2,300,000.00	1,919,833.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 31/11/25	1,800,000.00	1,458,902.52	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 32/05/25	1,850,000.00	1,476,172.35	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.25% 26/11/25	2,280,000.00	2,128,544.16	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 25/05/25	900,000.00	870,277.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 26/05/25	2,800,000.00	2,658,124.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/05/25	1,600,000.00	1,431,046.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 40/05/25	900,000.00	595,773.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 72/05/25	190,000.00	72,895.02	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/05/25	2,230,000.00	2,058,758.30	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/11/25	1,250,000.00	1,143,549.88	

FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 53/05/25	530,000.00	278,417.74	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 25/11/25	1,950,000.00	1,884,492.51	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 27/05/25	1,250,000.00	1,183,256.25	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.25% 34/05/25	1,500,000.00	1,281,379.99	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.25% 36/05/25	1,100,000.00	901,037.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.5% 31/05/25	1,700,000.00	1,565,926.10	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.5% 50/05/25	1,100,000.00	754,448.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 39/06/25	1,200,000.00	1,001,934.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 66/05/25	850,000.00	570,101.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.0% 32/11/25	800,000.00	750,458.08	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.0% 48/05/25	1,200,000.00	941,580.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.5% 30/05/25	2,100,000.00	2,077,954.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.75% 27/10/25	2,600,000.00	2,602,361.37	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.0% 54/05/25	350,000.00	326,027.10	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.25% 45/05/25	1,190,000.00	1,184,948.11	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.5% 26/04/25	1,700,000.00	1,722,380.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 38/10/25	900,000.00	992,330.10	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 55/04/25	930,000.00	1,044,270.96	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 60/04/25	570,000.00	648,979.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.5% 41/04/25	950,000.00	1,112,246.70	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.75% 35/04/25	1,400,000.00	1,634,808.78	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.5% 29/04/25	1,480,000.00	1,676,992.44	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/10/25	1,300,000.00	1,588,312.70	
FRENCH GOVERNMENT BOND 6.0% 25/10/25	750,000.00	785,827.50	

GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 25/10/10	900,000.00	859,708.08	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 26/08/15	2,500,000.00	2,342,712.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 29/08/15	630,000.00	554,954.92	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 30/02/15	700,000.00	609,736.28	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 30/08/15	900,000.00	776,505.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 31/02/15	1,100,000.00	937,444.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 31/08/15	1,200,000.00	1,011,202.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 31/08/15	1,200,000.00	1,011,493.44	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 35/05/15	600,000.00	456,361.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 50/08/15	1,300,000.00	669,531.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 52/08/15	880,000.00	431,866.16	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 27/02/15	1,850,000.00	1,728,973.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 28/08/15	1,350,000.00	1,229,169.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 29/02/15	600,000.00	541,265.40	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 25/02/15	600,000.00	583,792.78	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 26/02/15	2,000,000.00	1,911,700.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 27/08/15	1,750,000.00	1,636,090.75	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.0% 25/08/15	1,950,000.00	1,893,052.68	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.25% 48/08/15	1,150,000.00	876,827.85	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.7% 32/08/15	2,330,000.00	2,215,713.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.8% 53/08/15	750,000.00	632,218.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.2% 34/02/15	300,000.00	294,558.91	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 44/07/04	950,000.00	931,946.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 46/08/15	1,050,000.00	1,032,932.25	

GERMAN GOVERNMENT BOND 2.6% 33/08/15	900,000.00	916,178.40	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 42/07/04	350,000.00	381,367.14	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/04	580,000.00	673,153.22	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.25% 39/07/04	600,000.00	724,168.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/07/04	800,000.00	875,917.45	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 34/07/04	1,050,000.00	1,271,283.30	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 40/07/04	680,000.00	872,250.96	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.5% 31/01/04	1,100,000.00	1,317,035.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.63% 28/01/04	1,300,000.00	1,449,813.30	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.25% 30/01/04	850,000.00	1,028,663.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.5% 27/07/04	1,200,000.00	1,351,123.20	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.0% 31/10/18	100,000.00	81,948.80	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.35% 32/10/18	100,000.00	82,265.50	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.4% 35/05/15	170,000.00	131,231.50	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.55% 41/04/22	70,000.00	47,204.08	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.9% 28/05/15	420,000.00	392,162.40	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.0% 26/05/15	650,000.00	625,751.10	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.1% 29/05/15	220,000.00	204,090.04	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.3% 33/05/15	190,000.00	168,482.12	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.35% 31/03/18	500,000.00	459,794.50	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.5% 50/05/15	405,000.00	291,934.12	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.7% 37/05/15	220,000.00	190,632.20	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.0% 45/02/18	250,000.00	209,660.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.4% 30/05/15	320,000.00	316,196.48	

IRISH GOVERNMENT BOND 5.4% 25/03/13	100,000.00	102,128.32	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.6% 31/08/01	1,230,000.00	993,020.82	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.9% 31/04/01	700,000.00	584,626.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 26/12/01	2,100,000.00	1,994,143.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.35% 30/04/01	1,000,000.00	885,400.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 25/06/01	850,000.00	830,049.12	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.6% 26/06/01	3,100,000.00	2,992,978.70	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.65% 30/12/01	1,000,000.00	887,595.92	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.65% 32/03/01	1,750,000.00	1,510,468.75	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.7% 51/09/01	420,000.00	252,309.12	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.8% 41/03/01	970,000.00	687,330.36	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 25/12/01	2,000,000.00	1,957,557.34	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 28/02/01	2,600,000.00	2,483,910.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.05% 27/08/01	1,000,000.00	963,197.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.2% 27/06/01	1,200,000.00	1,163,700.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 36/09/01	900,000.00	743,924.94	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.45% 33/09/01	1,230,000.00	1,101,782.34	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.45% 50/09/01	600,000.00	429,420.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.7% 47/03/01	550,000.00	426,416.65	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.8% 28/12/01	1,100,000.00	1,076,770.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.8% 67/03/01	550,000.00	395,098.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.95% 38/09/01	500,000.00	435,759.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 29/08/01	1,400,000.00	1,374,130.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 46/09/01	600,000.00	512,562.00	

ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.35% 35/03/01	700,000.00	662,893.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.45% 48/03/01	600,000.00	526,740.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 30/03/01	900,000.00	903,877.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.85% 49/09/01	600,000.00	558,072.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/02/01	1,150,000.00	1,148,677.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.2% 34/03/01	450,000.00	462,791.25	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.4% 33/05/01	900,000.00	945,016.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/01	1,500,000.00	1,536,684.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 53/10/01	100,000.00	101,537.62	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/09/01	1,270,000.00	1,347,188.91	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 44/09/01	500,000.00	529,135.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 25/03/01	780,000.00	791,655.54	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 34/08/01	850,000.00	930,318.73	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 39/08/01	800,000.00	870,539.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 40/09/01	850,000.00	924,702.25	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.25% 29/11/01	1,400,000.00	1,535,688.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/02/01	1,050,000.00	1,208,729.36	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 6.0% 31/05/01	800,000.00	925,629.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 7.25% 26/11/01	900,000.00	993,916.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 30/07/15	500,000.00	425,056.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 31/07/15	800,000.00	662,416.75	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 38/01/15	450,000.00	305,400.06	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 52/01/15	550,000.00	262,647.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.25% 25/07/15	520,000.00	499,980.43	

NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.25% 29/07/15	250,000.00	221,305.55	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.5% 26/07/15	950,000.00	901,004.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.5% 40/01/15	370,000.00	261,344.46	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.75% 27/07/15	700,000.00	658,037.91	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.75% 28/07/15	700,000.00	647,405.85	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.0% 54/01/15	180,000.00	152,583.37	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.5% 33/01/15	650,000.00	643,601.02	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.75% 47/01/15	540,000.00	536,786.46	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.25% 44/01/15	100,000.00	106,244.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.75% 42/01/15	500,000.00	563,852.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/15	500,000.00	564,025.15	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 5.5% 28/01/15	700,000.00	773,512.36	
SPANISH GOVERNMENT BOND 0.1% 31/04/30	1,550,000.00	1,257,904.05	
SPANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 30/04/30	850,000.00	731,675.07	
SPANISH GOVERNMENT BOND 0.6% 29/10/31	750,000.00	657,974.25	
SPANISH GOVERNMENT BOND 0.7% 32/04/30	2,200,000.00	1,818,559.60	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.0% 42/07/30	680,000.00	437,535.80	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.0% 50/10/31	550,000.00	293,843.55	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.3% 26/10/31	1,150,000.00	1,101,732.20	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.4% 28/04/30	1,100,000.00	1,034,936.76	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.4% 28/07/30	900,000.00	843,982.20	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 27/10/31	1,100,000.00	1,044,099.10	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 29/04/30	600,000.00	557,673.46	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 71/10/31	270,000.00	130,061.16	

	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.5% 27/04/30	1,600,000.00	1,531,291.20	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.6% 25/04/30	750,000.00	735,263.03	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.85% 35/07/30	870,000.00	745,492.84	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.9% 52/10/31	500,000.00	331,041.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.95% 30/07/30	750,000.00	704,073.17	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 2.15% 25/10/31	1,550,000.00	1,527,224.30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 2.35% 33/07/30	1,200,000.00	1,115,780.40	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 2.7% 48/10/31	520,000.00	428,449.12	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 2.9% 46/10/31	440,000.00	381,772.60	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 3.45% 66/07/30	350,000.00	314,493.90	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 3.9% 39/07/30	400,000.00	411,436.45	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.2% 37/01/31	950,000.00	1,022,134.45	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.65% 25/07/30	1,050,000.00	1,071,016.27	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.7% 41/07/30	800,000.00	905,336.88	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.9% 40/07/30	900,000.00	1,035,307.80	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15% 28/10/31	750,000.00	822,395.25	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15% 44/10/31	400,000.00	479,897.13	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/07/30	1,050,000.00	1,252,971.82	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.9% 26/07/30	1,800,000.00	1,920,814.20	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 6.0% 29/01/31	800,000.00	912,358.65	
	ユーロ小計	194,260,000.00	182,302,592.35 (29,522,081,804)	
	国債証券合計		92,206,308,892 (92,206,308,892)	
	合 計		92,206,308,892 (92,206,308,892)	

（注）１．通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

２．合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	有価証券の合計額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 157銘柄	100.0%	47.4%
カナダ・ドル	国債証券 19銘柄	100.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券 18銘柄	100.0%	1.4%
イギリス・ポンド	国債証券 34銘柄	100.0%	5.2%
シンガポール・ドル	国債証券 10銘柄	100.0%	0.4%
マレーシア・リンギット	国債証券 11銘柄	100.0%	0.5%
ニュージーランド・ドル	国債証券 6銘柄	100.0%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
メキシコ・ペソ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.9%
イスラエル・シェケル	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
中国・人民元	国債証券 22銘柄	100.0%	8.5%
ユーロ	国債証券 236銘柄	100.0%	32.0%

（注）組入債券時価比率は時価の合計額に対する通貨毎の比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

(2024年2月29日現在)

資産総額	5,151,634,998円
負債総額	17,471,452円
純資産総額（ - ）	5,134,163,546円
発行済口数	3,806,187,194口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3489円

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（日本株式インデックス・マザーファンド）

(2024年2月29日現在)

資産総額	59,274,383,476円
負債総額	281,093,224円
純資産総額（ - ）	58,993,290,252円
発行済口数	11,859,415,738口
1口当たり純資産額（ / ）	4.9744円

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（日本債券インデックス・マザーファンド）

(2024年2月29日現在)

資産総額	108,756,867,903円
負債総額	2,654,679,930円
純資産総額（ - ）	106,102,187,973円
発行済口数	86,860,880,298口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2215円

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

(2024年2月29日現在)

資産総額	273,846,271,228円
負債総額	189,041,731円
純資産総額（ - ）	273,657,229,497円
発行済口数	42,976,955,304口
1口当たり純資産額（ / ）	6.3675円

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

(2024年2月29日現在)

資産総額	93,663,875,680円
負債総額	26,843,218円
純資産総額（ - ）	93,637,032,462円
発行済口数	32,057,062,256口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9209円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

(1) 受益証券の名義書換等

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

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

(2) 受益者等名簿の閉鎖の時期

該当事項はありません。

(3) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(4) 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容

< 受益権の譲渡 >

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

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

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

< 受益権の譲渡の対抗要件 >

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

(5) その他内国投資信託受益証券事務に関し投資者に示すことが必要な事項

< 受益権の再分割 >

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

< 償還金 >

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された

受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。

< 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて >

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

第三部【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（本書提出日現在）

資本金の額

委託会社の資本金の額は金3億1千万円です。

発行する株式の総数

委託会社の発行する株式の総数は6,200株です。

発行済株式の総数

委託会社の発行済株式総数は6,200株です。

最近5年間ににおける主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

(2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

投資運用の意思決定機構

1) 運用基本方針の決定

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

2) 運用実施計画の作成

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

3) 運用の実行

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

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また金融商品取引法に定める投資助言業、第一種金融商品取引業及び第二種金融商品取引業を行っています。

2024年2月末現在、委託会社の運用する証券投資信託は、124本であり、その純資産総額は3,587,060百万円です（親投資信託を除く、公募投資信託および私募投資信託の合計値です。）。

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規制」（昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という）ならびに同規則第38条第1項及び第57条第1項の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期事業年度（2022年4月1日から2023年3月31日まで）の財務諸表ならびに第27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）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

１．財務諸表

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

期 別 科 目	前事業年度 (2022年3月31日現在)			当事業年度 (2023年3月31日現在)		
	金 額		構成比	金 額		構成比
(資産の部)			%			%
流動資産						
預金		4,391,110			4,944,755	
有価証券		23,294			24,319	
前払金		119,649			232,900	
前払費用		29,290			34,419	
未収入金		688,466			615,211	
未収委託者報酬		685,229			665,966	
未収収益		42,751			36,568	
流動資産計		5,979,793	75.8		6,554,141	80.5
固定資産						
有形固定資産		375			112	
建物附属設備	1	0			0	
器具備品	1	375			112	
無形固定資産		0			0	
ソフトウェア		0			0	
投資その他の資産		1,904,306			1,586,165	
長期差入保証金		71,694			42,548	
繰延税金資産		1,826,336			1,537,341	
その他投資		6,275			6,275	
固定資産計		1,904,682	24.2		1,586,278	19.5
資産合計		7,884,475	100.0		8,140,419	100.0

（単位：千円）

期 別 科 目	前事業年度 (2022年3月31日現在)			当事業年度 (2023年3月31日現在)		
	金 額		構成比	金 額		構成比
(負債の部)			%			%
流動負債						
預り金		172,682			211,213	
未払金		344,370			341,855	
未払手数料	177,539			180,016		
その他未払金	166,831			161,839		
未払費用		11,699			12,884	
未払法人税等		296,332			176,932	
未払消費税等		30,068			25,106	
賞与引当金		74,876			92,579	
流動負債計		930,030	11.8		860,572	10.6
固定負債						
退職給付引当金		84,840			76,260	
固定負債計		84,840	1.1		76,260	0.9
負債合計		1,014,871	12.9		936,833	11.5
(純資産の部)			%			%
株主資本		6,869,604	87.1		7,203,586	88.5

資本金	310,000			310,000		
利益剰余金						
利益準備金	77,500			77,500		
その他利益剰余金						
別途積立金	31,620			31,620		
繰越利益剰余金	6,450,484			6,784,466		
純資産合計		6,869,604	87.1		7,203,586	88.5
負債・純資産合計		7,884,475	100.0		8,140,419	100.0

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

科 目	期 別	前事業年度			当事業年度		
		自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	金 額	構成比	自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日	金 額	構成比
営業収益				%			%
委託者報酬			2,655,508			2,681,106	
投資顧問収入			3,030,659			2,805,885	
その他営業収益	1		85,660			12,640	
営業収益計			5,771,828	100.0		5,499,631	100.0
営業費用							
支払手数料			711,649			753,876	
広告宣伝費			53,735			51,264	
公告費			1,140			1,140	
調査費			712,486			654,933	
調査費		407,466			337,268		
委託調査費		304,641			317,181		
図書費		378			483		
委託計算費			485,872			387,357	
営業雑経費			29,696			44,076	
通信費		3,997			6,765		
印刷費		7,276			14,575		
協会費		12,853			17,758		
諸会費		55			7		
その他		5,512			4,968		
営業費用計			1,994,579	34.6		1,892,648	34.4
一般管理費							
給料			1,568,661			1,475,040	
役員報酬		425,268			251,291		
給料・手当		787,766			816,610		
賞与		285,950			330,579		
賞与引当金繰入額		69,676			76,559		
交際費			1,607			3,676	
旅費交通費			676			10,847	
租税公課			32,240			3,770	
不動産賃借料			60,478			64,855	
退職給付費用			74,675			61,481	
固定資産減価償却費			2,571			765	
福利厚生費			130,238			139,590	
諸経費			186,753			192,029	
一般管理費計			2,057,903	35.7		1,952,057	35.5
営業利益			1,719,345	29.8		1,654,925	30.1
営業外収益							
移転価格調整金	1、 2					131,841	
為替差益			18			1,707	
有価証券運用益			1,013			2,727	

雑収入		881		106	
営業外収益計		1,913	0.0	136,383	2.5
営業外費用					
移転価格調整金	1	363,220		-	
為替差損		214		1,046	
有価証券運用損		1		-	
雑損失		329		73	
営業外費用計		363,766	6.3	1,119	0.0
経常利益		1,357,491	23.5	1,790,188	32.6
特別利益					
事業再構築費用戻入		7,084		-	
特別利益計		7,084	0.1	-	0.0
特別損失					
事務処理損失		146		4,303	
固定資産除却損		2,326		-	
特別損失計		2,472	0.0	4,303	0.1
税引前当期純利益		1,362,102	23.6	1,785,884	32.5
法人税,住民税及び事業税		261,905	4.5	324,907	5.9
法人税等調整額		261,874	4.5	288,994	5.3
当期純利益		838,322	14.5	1,171,982	21.3

（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：千円）

	株 主 資 本						純資産合計
	資本金	利益剰余金				株主資本 合計	
		利益準備金	その他利益 剰余金		利益剰余金 合計		
			別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,091,161	6,200,281	6,510,281	6,510,281
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	(479,000)	(479,000)	(479,000)	(479,000)
当期純利益	-	-	-	838,322	838,322	838,322	838,322
当期変動額合計	-	-	-	359,322	359,322	359,322	359,322
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,450,484	6,559,604	6,869,604	6,869,604

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本						純資産合計
	資本金	利益剰余金				株主資本 合計	
		利益準備金	その他利益 剰余金		利益剰余金 合計		
			別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,450,484	6,559,604	6,869,604	6,869,604
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	(838,000)	(838,000)	(838,000)	(838,000)
当期純利益	-	-	-	1,171,982	1,171,982	1,171,982	1,171,982
当期変動額合計	-	-	-	333,982	333,982	333,982	333,982
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,784,466	6,893,586	7,203,586	7,203,586

〔重要な会計方針〕

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	有価証券 売買目的有価証券 決算期末日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定）を採用しております。
--------------------	---

2. 固定資産の減価償却方法	有形固定資産 リース資産以外の有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります 器具備品 3～7年
3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
4. 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当期に負担すべき金額を計上しております。 (2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、必要額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。 数理計算上の差異 発生の翌事業年度に一括損益処理しております。
5. 収益の計上方法	(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託約款に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資信託約款毎に、日々の純資産総額に信託報酬率を乗じた金額で収益を認識しております。 (2) 投資顧問収入 投資顧問収入は、投資顧問契約に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資顧問契約毎に計算基礎額に投資顧問料率を乗じた金額で収益を認識しております。
6. その他 財務諸表作成のための重要な事項	消費税等の処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

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27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準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。ただし、これによる具体的な会計方針の変更は無く、したがって、時価算定会計基準適用指針の適用にともなう当事業年度における貸借対照表、損益計算書および株主資本等変動計算書への影響は有りません。

会計上の見積りに関する注記

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

繰延税金資産 1,537,341千円

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

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

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 (2022年3月31日現在)	当事業年度 (2023年3月31日現在)
1. 有形固定資産の減価償却累計額 器 具 備 品 30,399千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 器 具 備 品 30,661千円
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左

（損益計算書関係）

前事業年度 自 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. 移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額85,395千円は、損益計算書のその他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額363,220千円は、損益計算書の営業外費用である移転価格調整金に含まれております。	1. 移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた事務手数料調整額12,389千円は、損益計算書のその他営業収益に、移転価格調整額131,841千円は、損益計算書の営業外収益に含まれております。
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	2. 関係会社に係る注記 関係会社との取引高 営業外収益 131,841千円

（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. 発行済株式の総数に関する事項

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

2. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

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

3. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が当事業年度の末日後となるもの

（決議）	株式の種類	配当金の総額	配当の原資	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2022年6月27日 定時株主総会	普通株式	838,000千円	利益剰余金	135,161.29円	2022年3月31日	2022年6月28日

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式の総数に関する事項

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

2. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

（決議）	株式の種類	配当金の総額	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2022年6月27日 定時株主総会	普通株式	838,000千円	135,161.29円	2022年3月31日	2022年6月28日

3. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が当事業年度の末日後となるもの

（決議）	株式の種類	配当金の総額	配当の原資	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2023年6月27日 定時株主総会	普通株式	1,171,000千円	利益剰余金	188,870.96円	2023年3月31日	2023年6月28日

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年3月31日現在

預金、未収入金、未収委託者報酬、未収収益、未払手数料及びその他未払金は、短期間で決済されるため、時価が帳簿価額に近似することから、注記を省略しております。

2023年3月31日現在

	貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
有価証券	24,319	24,319	-
資産計	24,319	24,319	-

預金、未収入金、未収委託者報酬、未収収益、未払手数料及びその他未払金は、短期間で決済されるため、時価が帳簿価額に近似することから、注記を省略しております。

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

2022年3月31日現在

前項にて注記を省略しているため、記載を省略しております。

2023年3月31日現在

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又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。

時価で貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券	-	24,319	-	24,319
資産計	-	24,319	-	24,319

（注）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

有価証券は投資信託であり基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル2に分類しております。

（有価証券関係）

前事業年度 （2022年3月31日現在）		当事業年度 （2023年3月31日現在）	
売買目的の有価証券		売買目的の有価証券	
貸借対照表計上額	23,294千円	貸借対照表計上額	24,319千円
当事業年度の損益		当事業年度の損益	
に含まれた評価差額	1,013千円	に含まれた評価差額	1,025千円

（デリバティブ取引関係）

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	
該当事項はありません。		同左	

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

	前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
退職給付債務の期首残高	450,505
勤務費用	58,354
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	10,018
退職給付の支払額	<u>18,668</u>
退職給付債務の期末残高	480,173

(単位：千円)

	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	480,173
勤務費用	53,150
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	12,549
退職給付の支払額	<u>37,376</u>
退職給付債務の期末残高	483,396

3．年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
年金資産の期首残高	368,935
期待運用収益	2,728
数理計算上の差異の発生額	2,919
事業主からの拠出額	52,354
退職給付の支払額	<u>18,668</u>
年金資産の期末残高	402,431

(単位：千円)

	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
年金資産の期首残高	402,431
期待運用収益	2,979
数理計算上の差異の発生額	3,493
事業主からの拠出額	51,651
退職給付の支払額	<u>37,376</u>
年金資産の期末残高	416,191

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

(単位：千円)

	前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
積立型制度の退職給付債務	480,173
年金資産	402,431
	<u>77,742</u>
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	77,742
未認識数理計算上の差異	<u>7,098</u>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	84,840

(単位：千円)

	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
積立型制度の退職給付債務	483,396
年金資産	416,191
	<u>67,205</u>
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	67,205
未認識数理計算上の差異	<u>9,055</u>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	76,260

５．退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	<u>55,694</u>
(1)勤務費用	58,354
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益	2,728
(4)過去勤務費用の費用処理額	0
(5)数理計算上の差異の費用処理額	69
(6)その他	-

(単位：千円)

	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	<u>43,071</u>
(1)勤務費用	53,150
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益	2,979
(4)過去勤務費用の費用処理額	0

(5)数理計算上の差異の費用処理額	7,098
(6)その他	-

6．年金資産に関する事項

前事業年度（2022年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定）	98.1%
その他	1.9%
合計	100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

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

当事業年度（2023年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定）	98.2%
その他	1.8%
合計	100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

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

7．退職給付債務等の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (2022年3月31日現在)
(1)割引率	0.0%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年

	当事業年度 (2023年3月31日現在)
(1)割引率	0.0%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年

8．確定拠出制度

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,980千円であります。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,410千円であります。

（税効果会計関係）

前事業年度	当事業年度
自 2021年4月 1日	自 2022年4月 1日
至 2022年3月31日	至 2023年3月31日

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円)	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金繰入超過額 19,674	賞与引当金繰入超過額 22,144
退職給付引当金 27,681	退職給付引当金 25,052
(注) 繰越欠損金 1,727,082	(注) 繰越欠損金 1,453,659
その他 51,898	その他 36,485
繰延税金資産 合計 1,826,336	繰延税金資産 合計 1,537,341
繰延税金負債との相殺 -	繰延税金負債との相殺 -
繰延税金資産の純額 1,826,336	繰延税金資産の純額 1,537,341

(注) 税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

前事業年度（2022年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超 2年以内 (千円)	2年超 3年以内 (千円)	3年超 4年以内 (千円)	4年超 5年以内 (千円)	5年超 (千円)	合計 (千円)
税務上の繰越欠損金(*1)	-	-	-	597,044	157,331	972,706	1,727,082
繰延税金資産	-	-	-	597,044	157,331	972,706	(*2)1,727,082

(*1) 税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額であります。

(*2) 税務上の繰越欠損金1,727,082千円（法定実効税率を乗じた金額）について、繰延税金資産1,727,082千円を計上しております。当該税務上の繰越欠損金に係る繰延税金資産については、将来の課税所得の見込等により回収可能と判断しております。

当事業年度（2023年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超 2年以内 (千円)	2年超 3年以内 (千円)	3年超 4年以内 (千円)	4年超 5年以内 (千円)	5年超 (千円)	合計 (千円)
税務上の繰越欠損金(*1)	-	-	319,359	158,439	-	975,860	1,453,659
繰延税金資産	-	-	319,359	158,439	-	975,860	(*2)1,453,659

(*1) 税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額であります。

(*2) 税務上の繰越欠損金1,453,659千円（法定実効税率を乗じた金額）について、繰延税金資産1,453,659千円を計上しております。当該税務上の繰越欠損金に係る繰延税金資産については、将来の課税所得の見込等により回収可能と判断しております。

前事業年度（2022年3月31日現在）	当事業年度（2023年3月31日現在）
---------------------	---------------------

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳 <table> <tr> <td>法定実効税率</td><td>30.6%</td></tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に 算入されない項目</td><td>8.0%</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>0.2%</td></tr> <tr> <td colspan="2"> </td></tr> <tr> <td>税効果会計適用後の 法人税等の負担率</td><td>38.4%</td></tr> <tr> <td colspan="2">=====</td></tr> </table>	法定実効税率	30.6%	交際費等永久に損金に 算入されない項目	8.0%	その他	0.2%			税効果会計適用後の 法人税等の負担率	38.4%	=====		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳 <table> <tr> <td>法定実効税率</td><td>30.6%</td></tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に 算入されない項目</td><td>3.1%</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>0.6%</td></tr> <tr> <td colspan="2"> </td></tr> <tr> <td>税効果会計適用後の 法人税等の負担率</td><td>34.3%</td></tr> <tr> <td colspan="2">=====</td></tr> </table>	法定実効税率	30.6%	交際費等永久に損金に 算入されない項目	3.1%	その他	0.6%			税効果会計適用後の 法人税等の負担率	34.3%	=====	
法定実効税率	30.6%																								
交際費等永久に損金に 算入されない項目	8.0%																								
その他	0.2%																								
税効果会計適用後の 法人税等の負担率	38.4%																								
=====																									
法定実効税率	30.6%																								
交際費等永久に損金に 算入されない項目	3.1%																								
その他	0.6%																								
税効果会計適用後の 法人税等の負担率	34.3%																								
=====																									

（資産除去債務関係）

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

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

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

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

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は14,661千円であります。当事業年度において、本社オフィスの一部解約等に伴う原状回復費用の精算が行われたことから、資産除去債務の総額は、20,679千円減少しました。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

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

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

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

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は15,059千円であります。当事業年度において、原状回復費用の見直しが行われたことから、資産除去債務の総額は、397千円増加千円減少しました。

（収益認識関係）

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

(1) 収益の分解情報

損益計算書に記載のとおりです。

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

重要な会計方針「5.収益の計上方法」に記載のとおりです。

(3) 当期及び翌期以降の収益の金額を理解するための情報

重要性が乏しいため、注記を省略しております。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

(1) 収益の分解情報

損益計算書に記載のとおりです。

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

重要な会計方針「5.収益の計上方法」に記載のとおりです。

(3) 当期及び翌期以降の収益の金額を理解するための情報

重要性が乏しいため、注記を省略しております。

（セグメント情報）

1. セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

2. セグメント関連情報

1. 商品及びサービスに関する情報

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

2. 地域に関する情報

営業収益

本邦に所在している顧客への収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

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

有形固定資産

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

3. 主要な顧客に関する情報

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

また、投資顧問収入については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

該当事項はありません。

(2) 同一の親会社を持つ会社

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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	所在地	資本金 又は 出資金	事業の内容 又は 職業	議決権の所 有(被所有) 割合	関連当事者との関係 役員の 兼任等	事業上の関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・オブ・ニューヨーク・トラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ	ソフトウェア使用料の支払	351,919	前払金	598
								投資顧問料の支払	221,949		
								ソフトウェアの使用契約	396,782	未払金	28,457
								人件費等及び事務手数料の支払	85,395		
	ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ	移転価格調整金の支払	363,220		
								投資信託計理業務委託	38,999	前払金	119,051
								兼職社員の人件費支払等	127,476		
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ユナイテッド・キングダム	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ	投資顧問料の支払	19,193	-	-
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ及びETF商品の紹介	紹介料の受取	264	-	-
								投資顧問料の支払	24,400		

(注) 上記の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には、消費税等が含まれております。

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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	所在地	資本金又は 出資金	事業の内容 又は 職業	議決権の所有 (被所有) 割合	関連当事者との関係 役員の 兼任等	事業上の関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ	ソフトウェア使用料の支払	295,434	前払金	3,388
								投資顧問料の支払	232,843		
								ソフトウェアの使用契約	175,762	未払金	24,509
								人件費等及び事務手数料の受取	12,389		
								移転価格調整金の受取	131,841		
	ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ	投資信託計理業務委託	39,303	前払金	229,512
								兼職社員の人件費支払等	127,670		
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・リミテッド・キングダム	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ	投資顧問料の支払	19,754	-	-
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ及びETF商品の紹介	紹介料の受取	250	-	-
								投資顧問料の支払	22,792		

(注) 上記の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には、消費税等が含まれております。

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

前事業年度 自 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 1,108,000円68銭	1株当たり純資産 1,161,868円75銭
1株当たり当期純利益 135,213円36銭	1株当たり当期純利益 189,029円36銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。	なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

(注) 1株当たり当期純利益の算定基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 自 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（千円）	838,322	1,171,982
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式にかかる当期純利益（千円）	838,322	1,171,982
期中平均株式数（株）	6,200	6,200

（重要な後発事象）

前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

期 別 科 目	第27期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)		
	金 額		構成比
(資産の部)			%
流動資産			
預金		5,594,690	
前払金		98,445	
前払費用		27,130	
未収入金		687,092	
未収委託者報酬		735,800	
未収収益		301,004	
流動資産計		7,444,163	83.4
固定資産			
有形固定資産		7	
器具備品	1	7	
投資その他の資産		1,478,931	
投資有価証券		26,352	
長期差入保証金		50,200	
繰延税金資産		1,396,103	
その他投資		6,275	
固定資産計		1,478,939	16.6
資 産 合 計		8,923,103	100.0
(負債の部)			%
流動負債			
預り金		43,582	
未払金		390,886	
未払手数料		206,128	
その他未払金		184,758	
未払費用		13,156	
未払法人税等		233,970	
未払消費税等	2	16,949	
賞与引当金		299,712	
流動負債計		998,258	11.2
固定負債			
退職給付引当金		69,904	
固定負債計		69,904	0.8
負 債 合 計		1,068,163	12.0
(純資産の部)			%
株主資本		7,850,518	88.0
資本金		310,000	
利益剰余金		7,540,518	
利益準備金		77,500	
その他利益剰余金			
別途積立金		31,620	
繰越利益剰余金		7,431,398	
評価・換算差額等		4,421	

その他有価証券評価差額金	4,421		
純 資 産 合 計		7,854,940	88.0
負 債 ・ 純 資 産 合 計		8,923,103	100.0

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

期 別 科 目	第27期中間会計期間 自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日		
	金 額		構成比
			%
営業収益			
委託者報酬		1,435,040	
投資顧問収入		1,434,219	
その他営業収益	1	63,660	
営業収益計		2,932,920	100.0
営業費用・一般管理費			
営業費用		1,028,805	
支払手数料	427,673		
その他営業費用	601,131		
一般管理費	2	967,219	
営業費用・一般管理費計		1,996,024	68.1
営業利益		936,895	31.9
営業外収益	1	69,185	2.4
営業外費用		4,146	0.1
経常利益		1,001,933	34.2
特別利益		0	0.0
特別損失		0	0.0
税引前中間純利益		1,001,933	34.2
法人税,住民税及び事業税		215,714	7.4
法人税等調整額		139,286	4.7
中間純利益		646,932	22.1

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

(単位：千円)

	株 主 資 本						評価・換算差額等		純資産 合計
	資本金	利益剰余金				株主資本 合計	その他有 価証券評 価差額金	評価・ 換算差額等 合計	
		その他利益 剰余金		利益剰余金 合計					
		利益 準備金	別途積立金		繰越利益 剰余金				
当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,784,466	6,893,586	7,203,586	-	-	7,203,586
当中間期変動額									
中間純利益				646,932	646,932	646,932			646,932
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	4,421	4,421	4,421
当中間期変動額合計	-	-	-	646,932	646,932	646,932	4,421	4,421	651,353
当中間期末残高	310,000	77,500	31,620	7,431,398	7,540,518	7,850,518	4,421	4,421	7,854,940

[重要な会計方針]

	第27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	有価証券 其他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法（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）を採用しております。 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法を採用しております。
2. 固定資産の減価償却方法	有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 器具備品 3～7年
3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
4. 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当中間会計期間に負担すべき金額を計上しております。 (2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当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、期間定額基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。 数理計算上の差異 発生の翌事業年度に一括費用処理しております。
5. 収益の計上方法	(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託約款に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資信託約款毎に、日々の純資産総額に信託報酬率を乗じた金額で収益を認識しております。 (2) 投資顧問収入 投資顧問収入は、投資顧問契約に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資顧問契約毎に、計算基礎額に投資顧問料率を乗じた金額で収益を認識しております。
6. その他	消費税等の処理方法

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。
------------------------	--------------------------------

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第27期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額 器具備品	30,766千円
2. 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。

（中間損益計算書関係）

第27期中間会計期間 自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日	
1. 移転価格調整金の取り扱いに係る注記	当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当中間会計期間にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた事務手数料調整額63,545千円は、中間損益計算書のその他営業収益に、移転価格調整額66,918千円は、中間損益計算書の営業外収益に含まれております。
2. 減価償却実施額 有形固定資産	320千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第27期中間会計期間 自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日				
1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項				
株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 株式数（株）
普通株式	6,200	—	—	6,200

（金融商品関係）

第27期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)

1. 金融商品の時価等に関する事項

	中間貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
投資有価証券	26,352	26,352	-
資産計	26,352	26,352	-

預金、未収入金、未収委託者報酬、未収収益、未払手数料及びその他未払金は、短期間で決済されるため、時価が帳簿価額に近似することから、注記を省略しております。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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又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。

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券	-	26,352	-	26,352
其他有価証券	-	26,352	-	26,352
資産計	-	26,352	-	26,352

（注）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

投資有価証券は投資信託であり基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル2に分類しております。

（有価証券関係）

第27期中間会計期間末
(2023年9月30日現在)

其他有価証券

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
投資信託	26,352千円	19,980千円	6,372千円
小計	26,352千円	19,980千円	6,372千円
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
合計	26,352千円	19,980千円	6,372千円

（資産除去債務関係）

第27期中間会計期間末
(2023年9月30日現在)

当社は建物所有者との間で建物賃貸借契約を締結しており、貸借期間終了時に原状回復する義務をゆうしているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

（デリバティブ取引関係）

第27期中間会計期間末
(2023年9月30日現在)

当社はデリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第27期中間会計期間末
(2023年9月30日現在)

（セグメント情報）

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

（セグメント関連情報）

1. 商品およびサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、記載を省略しております。
また、投資顧問収入については、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（収益認識関係）

第27期中間会計期間
自 2023年4月 1日
至 2023年9月30日

(1) 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次のとおりです。

委託者報酬	1,435,040千円
投資顧問収入	1,434,219千円
その他営業収益	63,660千円
合計	2,932,920千円

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

重要な会計方針「5. 収益の計上方法」に記載のとおりです。

(3) 当期及び翌期以降の収益の金額を理解するための情報

重要性が乏しいため、注記を省略しております。

(1 株当たり情報)

第27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 1,266,925円84銭

1株当たり中間純利益 104,343円97銭

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

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27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（千円）	646,932
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式にかかる中間純利益（千円）	646,932
期中平均株式数（株）	6,200

(重要な後発事象)

第27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。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称

三井住友信託銀行株式会社

資本金の額

342,037百万円（2023年3月末現在）

事業の内容

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

（参考）再信託受託会社

名 称：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2023年3月末現在）

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

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2023年3月末)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	11,758百万円 (2022年12月末現在)	
楽天証券株式会社	19,495百万円	

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

当ファンドの販売会社として受益権の募集の取扱い等を行います。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

- (1) 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
- (2) 目論見書の表紙および裏表紙に、委託会社の名称および本店の所在地、当ファンドの基本的形態等を記載すること、委託会社および当ファンドのロゴマークを表示し、図案を採用することがあります。
- (3) 目論見書の表紙等に、以下のような別称を使用することがあります。
交付目論見書 「投資信託説明書（交付目論見書）」
請求目論見書 「投資信託説明書（請求目論見書）」
- (4) 目論見書の表紙裏に、以下の事項を記載することがあります。
「当ファンドは、有価証券などの値動きのある証券に投資します（また、外国証券にはこの他に為替変動もあります。）ので、基準価額は変動します。従って、元本が保証されているものではありません。」
- (5) 請求目論見書に当ファンドの信託約款の全文を記載します。
- (6) 目論見書に当該委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額および目論見書の使用を開始する日を記載することがあります。
- (7) 目論見書に投資信託財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を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22日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

公認会計士

稲葉 宏 和

業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第26期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の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役の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2024年4月26日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太
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A M C /ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）の2023年2月21日から2024年2月20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、A M C /ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）の2024年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注） １．上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

２．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月22日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

稲葉 宏和

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第27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、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の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役の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的

な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

監査人は、監査役に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。