【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年10月25日提出
【計算期間】	第14期(自 2023年7月26日至 2024年7月25日)
【ファンド名】	インデックスコレクション（バランス株式３０） インデックスコレクション（バランス株式５０） インデックスコレクション（バランス株式７０）
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田　賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【事務連絡者氏名】	北添　道生
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

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

＜信託金限度額＞

各ファンドについて、1兆円を上限とします。

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。
なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でもご覧いただけます。

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

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

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

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

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

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

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

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］
(1)株式

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

◆ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

＜ファンドの特色＞

資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

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

国内外の株式・公社債へ分散投資します。

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

基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設けます。

<投資対象とするマザーファンド>

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

ポートフォリオ構築プロセス

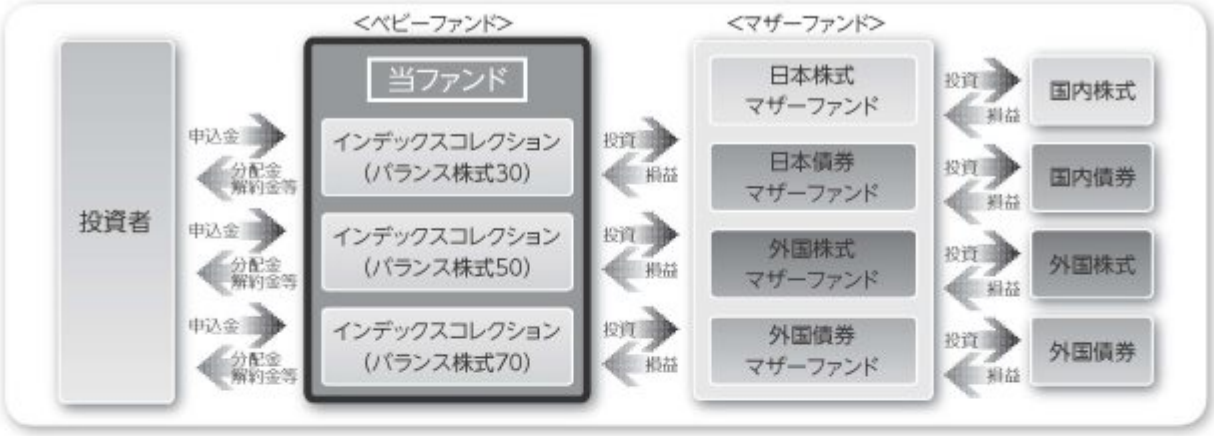
ファンドマネジャーは各ファンドの基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。

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

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

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



分配方針

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

主な投資制限

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

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

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

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

◆各マザーファンドが対象とする指数は次のとおりです。

日本株式マザーファンド「TOPIX（東証株価指数）（配当込み）」

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

日本債券マザーファンド「NOMURA-BPI総合」

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

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

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

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

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

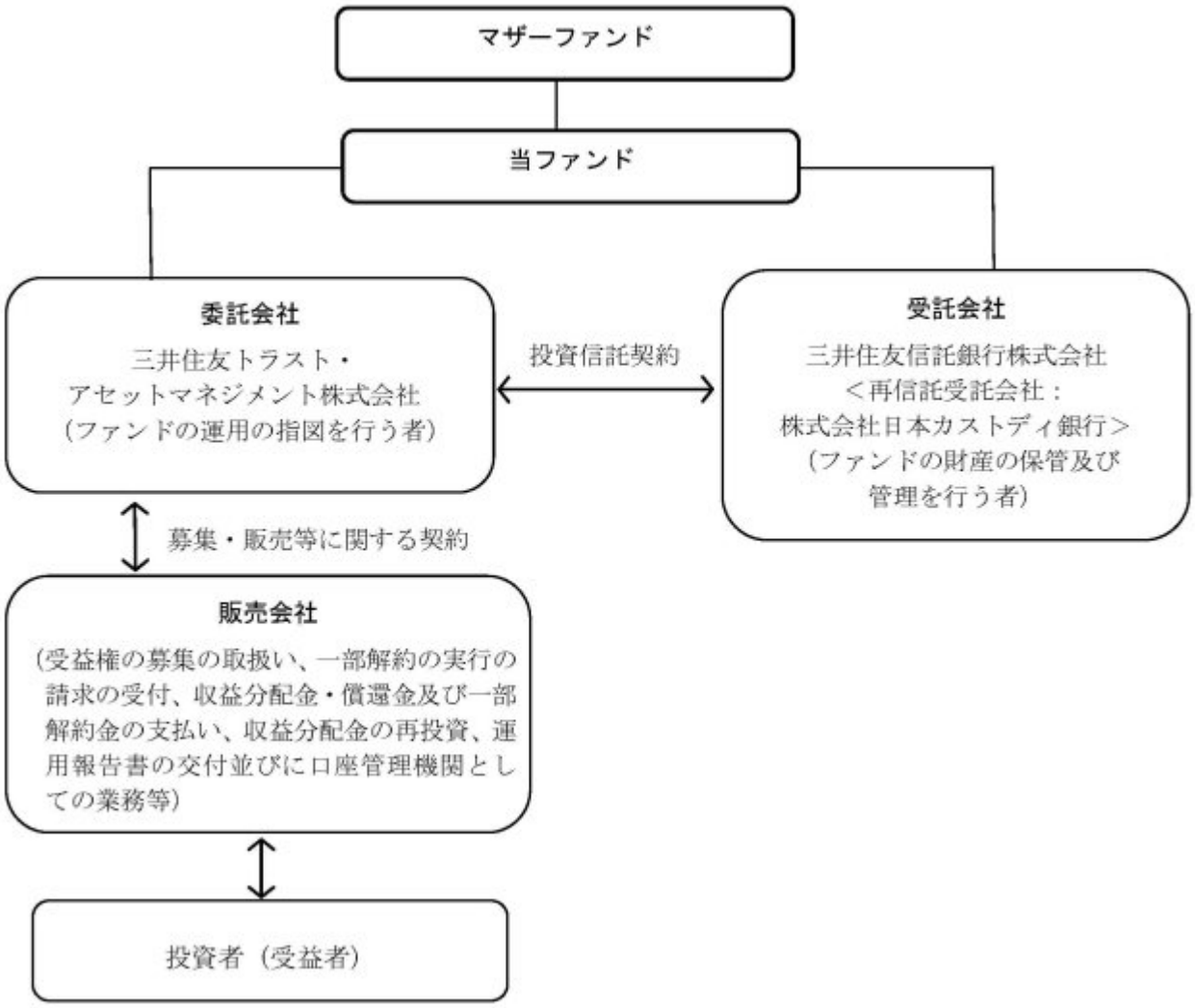
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（２）【ファンドの沿革】

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

（３）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2024年10月1日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

株　主　名	住　　所	持株数	持株比率
三井住友トラストグループ株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

①　運用方針

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

②　投資態度

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

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

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

C．上記B．の基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設けます。

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

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

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

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

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

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

（2）【投資対象】

①　投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

１．有価証券

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

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

４．約束手形（上記１．に掲げるものに該当するものを除きます。）

B．次に掲げる特定資産以外の資産

１．為替手形

② 運用指図できる投資対象である有価証券

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

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

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

③ 運用指図できる金融商品

A．委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用

することを指図することができます。

１．預金

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

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

６．外国の者に対する権利で上記５．の権利の性質を有するもの

Ｂ．金融商品による運用の特例

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

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

２．運用方法

（１）投資対象

わが国の金融商品取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

（２）投資態度

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

②　株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

③　信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

⑤　信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑥　信託財産に属する資産の価格変動リスク回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑦　信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引を行うことができます。

３．投資制限

①　株式への投資割合には制限を設けません。

②　外貨建資産への投資は、行いません。

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

④　同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
⑤　同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号及び第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑥　同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑦　投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑧　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
⑨　デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「日本債券マザーファンド」の概要

１．基本方針
この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

２．運用方法
（１）投資対象
わが国の公社債を主要投資対象とします。
（２）投資態度
①　わが国の公社債に投資を行い、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。
②　信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
③　ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
④　信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
⑤　信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
⑥　信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引を行うことができます。

３．投資制限
①　株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

② 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。
③ 外貨建資産への投資は、行いません。
④ 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。
⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
⑥ デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国株式マザーファンド」の概要

１．基本方針
この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

２．運用方法
（１）投資対象
わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。
（２）投資態度
① ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている国の株式に投資を行い、同指数と連動する投資成果を目標として運用を行います。
② 株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。
③ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
④ 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
⑤ ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
⑥ 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。
⑦ 信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
⑧ 信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

３．投資制限
① 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
② 株式への投資割合には制限を設けません。

③　新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
④　同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
⑤　同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑥　投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑦　同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑧　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
⑨　デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国債券マザーファンド」の概要

１．基本方針
この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

２．運用方法
（１）投資対象
日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
（２）投資態度
①　FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。
②　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
③　信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
④　ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
⑤　信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。
⑥　信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
⑦　信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

３．投資制限

①　株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

③　外貨建資産への投資には、制限を設けません。

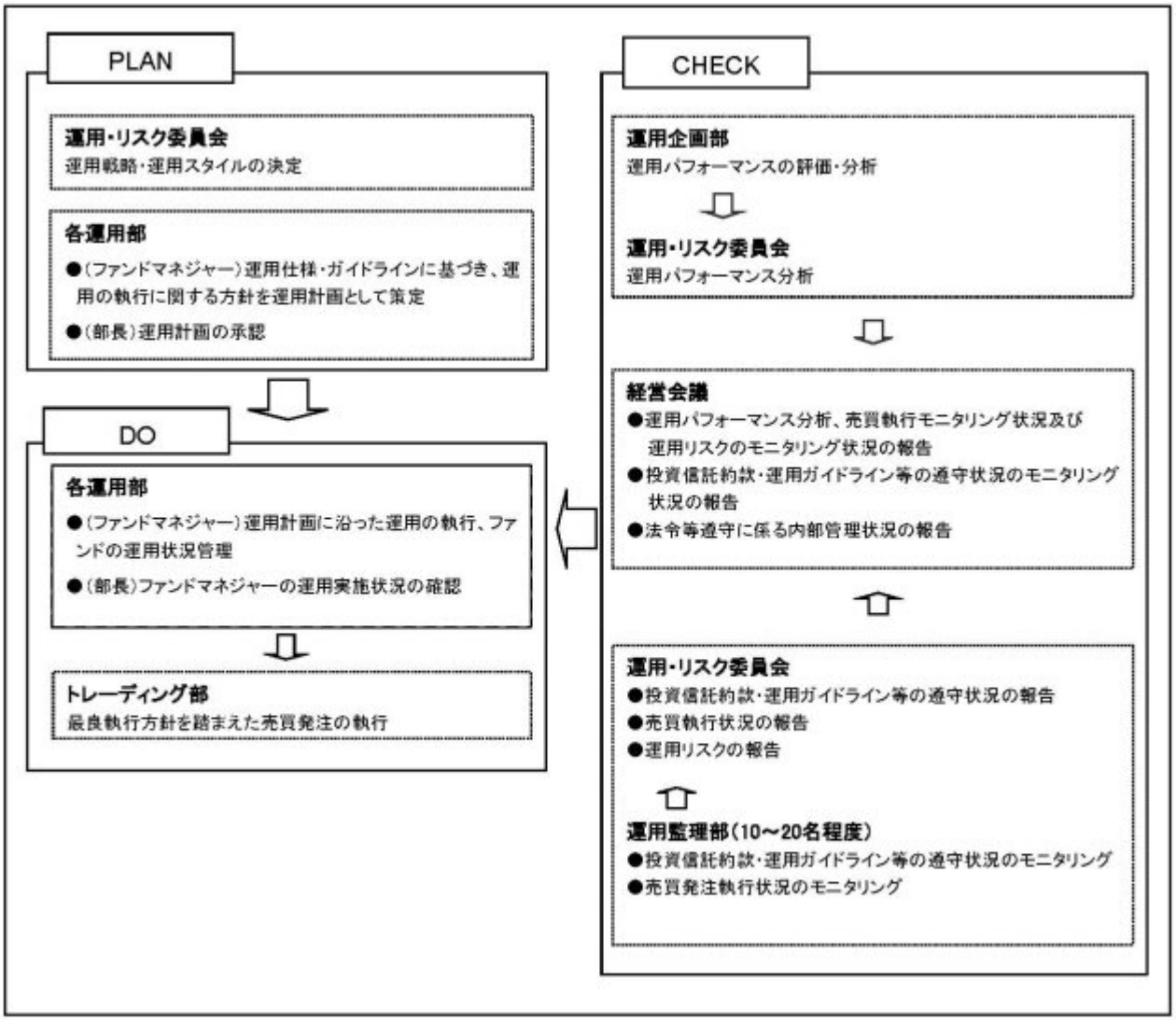
④　投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

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

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

（３）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

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

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

・収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

①　約款に定める投資制限

Ａ．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

○バランス株式３０……信託財産の純資産総額の40%以下

○バランス株式５０……信託財産の純資産総額の60%以下

○バランス株式７０……信託財産の純資産総額の80%以下

Ｂ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

○バランス株式３０……信託財産の純資産総額の30%以下

○バランス株式５０……信託財産の純資産総額の40%以下

○バランス株式７０……信託財産の純資産総額の45%以下

Ｃ．新株引受権証券等への投資割合

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

Ｄ．同一銘柄の株式への投資割合

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

Ｅ．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

Ｆ．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

Ｇ．投資信託証券への投資割合

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

Ｈ．投資する株式等の範囲

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

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

資することを指図することができるものとします。

Ⅰ．信用取引の指図範囲

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

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

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

Ｊ．先物取引等の運用指図

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

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

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

Ｋ．スワップ取引の運用指図

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

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

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

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

Ｌ．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

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

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

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

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

Ｍ．有価証券の貸付の指図及び範囲

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

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

合計額を超えないものとします。

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

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

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

N．公社債の空売りの指図及び範囲

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

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

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

O．公社債の借入れの指図及び範囲

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

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

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

ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

P．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

Q．外国為替予約取引の指図

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

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

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

R．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

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

S．再投資の指図

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

Ｔ．資金の借入れ

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

Ｕ．受託会社による資金の立替え

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

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

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

Ｖ．利害関係人等との取引等

イ．受託会社は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託会社が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）及び受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第２条第１項にて準用する信託業法第29条第２項第１号に規定する利害関係人をいいます。以下イ．及び下記ロ．において同じ。）、信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、前記（２）に掲げる資産への投資等並びに上記Ｉ．からＯ．まで及びＱ．からＴ．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

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

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

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

及び同法第32条第３項の通知は行いません。

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

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

＜関連法令に基づく投資制限＞

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（１）ファンドのリスク

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

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 株価変動リスク

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

② 為替変動リスク

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

③ 金利変動リスク

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

④ 信用リスク

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

⑤ 有価証券の貸付等に係るリスク

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

⑥ 流動性リスク

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

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

⑦　カントリーリスク

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

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

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

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

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

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

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

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

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

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

（２）リスクの管理体制

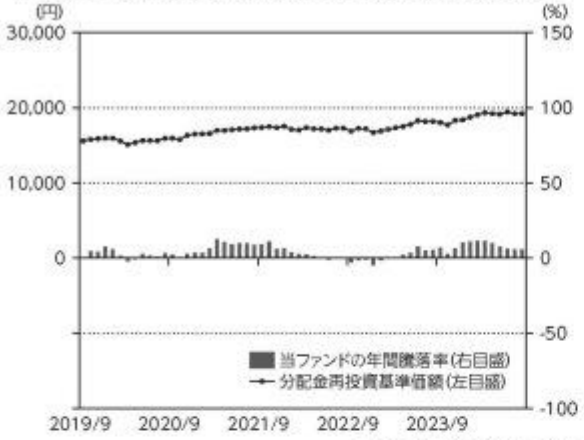
委託会社におけるリスク管理体制

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

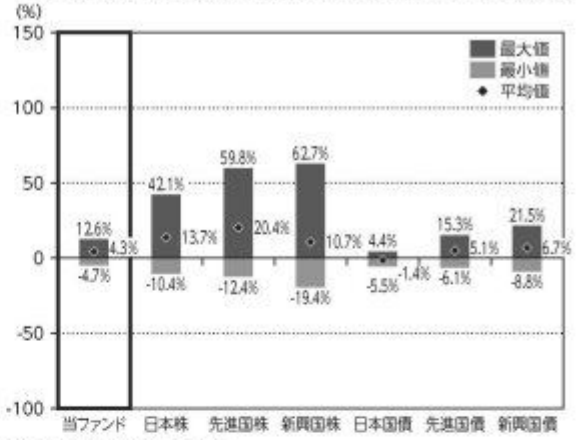
〔参考情報〕

インデックスコレクション(バランス株式30)

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

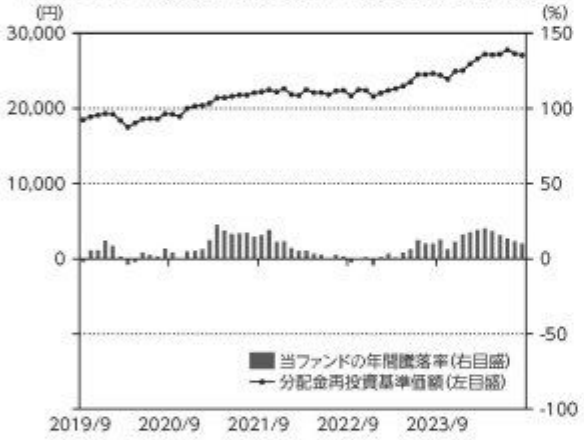


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

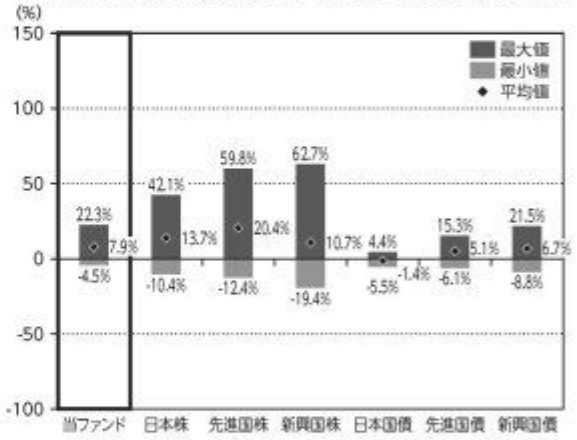


インデックスコレクション(バランス株式50)

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



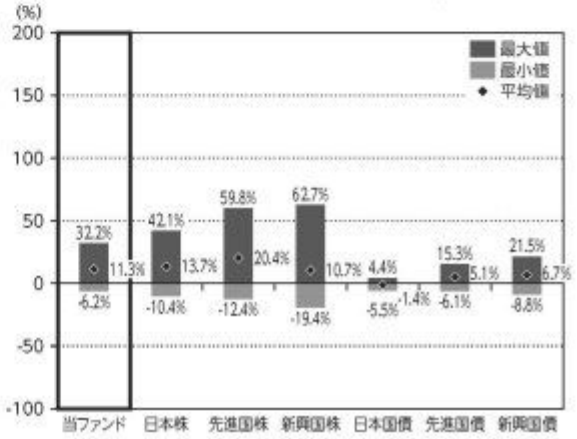
当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



インデックスコレクション(バランス株式70)

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



〔参考情報〕

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

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

＊2019年9月～2024年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

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

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

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

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

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

※2024年10月25日現在、合計で49.5%（税抜45%）以内とし、その配分は委託会社29.7%（税抜27%）、受託会社19.8%（税抜18%）です。（品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

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

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

（4）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

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

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

（5）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。
確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

※上記は、2024年 8月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

(参考情報)ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
インデックスコレクション(バランス株式30)	0.15%	0.15%	0.00%
インデックスコレクション(バランス株式50)	0.16%	0.15%	0.01%
インデックスコレクション(バランス株式70)	0.16%	0.15%	0.01%

※対象期間は2023年7月26日～2024年7月25日です。
※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。
※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。
※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

以下は、2024年8月30日現在の状況について記載してあります。

【インデックスコレクション（バランス株式３０）】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	166,194,559,758	99.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	810,286,480	0.49
合計(純資産総額)		167,004,846,238	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	76,370,320,087	1.2719	97,137,258,404	1.2860	98,212,231,631	58.81
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	10,639,031,511	3.2112	34,164,057,989	3.2720	34,810,911,103	20.84
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	2,450,779,476	7.0031	17,163,053,749	6.9047	16,921,897,047	10.13
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	5,336,810,292	3.1214	16,658,319,646	3.0448	16,249,519,977	9.73

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.51
合計	99.51

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第5期計算期間末 (2015年 7月27日)	7,218,074,538	7,218,074,538	14,344	14,344
第6期計算期間末 (2016年 7月25日)	26,094,390,333	26,094,390,333	14,066	14,066
第7期計算期間末 (2017年 7月25日)	36,940,752,492	36,940,752,492	14,836	14,836
第8期計算期間末 (2018年 7月25日)	47,046,612,483	47,046,612,483	15,400	15,400
第9期計算期間末 (2019年 7月25日)	58,853,542,284	58,853,542,284	15,526	15,526
第10期計算期間末 (2020年 7月27日)	112,284,528,451	112,284,528,451	15,765	15,765
第11期計算期間末 (2021年 7月26日)	129,179,991,406	129,179,991,406	17,227	17,227
第12期計算期間末 (2022年 7月25日)	137,409,329,672	137,409,329,672	17,240	17,240
第13期計算期間末 (2023年 7月25日)	154,275,276,866	154,275,276,866	18,231	18,231
第14期計算期間末 (2024年 7月25日)	165,327,931,440	165,327,931,440	19,105	19,105
2023年 8月末日	154,939,903,004	—	18,174	—
9月末日	154,158,457,612	—	18,041	—
10月末日	151,538,845,910	—	17,696	—
11月末日	157,099,092,186	—	18,310	—
12月末日	158,125,411,897	—	18,381	—
2024年 1月末日	161,386,315,759	—	18,732	—
2月末日	164,902,301,655	—	19,066	—
3月末日	167,497,036,392	—	19,328	—
4月末日	165,954,275,229	—	19,224	—
5月末日	165,595,271,180	—	19,143	—
6月末日	168,930,781,043	—	19,417	—
7月末日	166,907,862,994	—	19,212	—
8月末日	167,004,846,238	—	19,221	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	0

第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	0
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	0
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	0
第13期計算期間	2022年 7月26日～2023年 7月25日	0
第14期計算期間	2023年 7月26日～2024年 7月25日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	10.5
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	△1.9
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	5.5
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	3.8
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0.8
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	1.5
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	9.3
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	0.1
第13期計算期間	2022年 7月26日～2023年 7月25日	5.7
第14期計算期間	2023年 7月26日～2024年 7月25日	4.8

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	1,662,961,851	310,939,646	5,032,287,961
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	14,070,621,585	551,965,479	18,550,944,067
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	7,358,731,907	1,010,990,195	24,898,685,779
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	7,713,381,660	2,062,382,166	30,549,685,273
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	8,500,605,703	1,144,421,624	37,905,869,352
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	40,477,320,641	7,158,886,380	71,224,303,613
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	9,629,005,674	5,864,610,694	74,988,698,593
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	8,983,817,540	4,266,776,438	79,705,739,695
第13期計算期間	2022年 7月26日～2023年 7月25日	9,635,639,646	4,720,461,836	84,620,917,505
第14期計算期間	2023年 7月26日～2024年 7月25日	8,676,873,087	6,759,403,756	86,538,386,836

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

【インデックスコレクション（バランス株式５０）】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）

親投資信託受益証券	日本	38,231,675,564	99.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	179,187,621	0.47
合計(純資産総額)		38,410,863,185	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	11,504,129,442	1.2720	14,633,803,167	1.2860	14,794,310,462	38.52
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	3,665,602,662	3.2244	11,819,369,224	3.2720	11,993,851,910	31.23
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	1,127,476,520	7.0368	7,933,826,776	6.9047	7,784,887,127	20.27
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	1,201,598,156	3.1214	3,750,668,485	3.0448	3,658,626,065	9.52

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.53
合計	99.53

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第5期計算期間末 (2015年 7月27日)	5,112,201,159	5,112,201,159	16,776	16,776
第6期計算期間末 (2016年 7月25日)	5,810,707,419	5,810,707,419	15,725	15,725
第7期計算期間末 (2017年 7月25日)	6,724,648,904	6,724,648,904	17,405	17,405
第8期計算期間末 (2018年 7月25日)	8,658,183,416	8,658,183,416	18,451	18,451
第9期計算期間末 (2019年 7月25日)	11,669,771,032	11,669,771,032	18,409	18,409
第10期計算期間末 (2020年 7月27日)	13,923,564,557	13,923,564,557	18,866	18,866
第11期計算期間末 (2021年 7月26日)	18,266,192,032	18,266,192,032	21,871	21,871
第12期計算期間末 (2022年 7月25日)	22,060,577,957	22,060,577,957	22,268	22,268
第13期計算期間末 (2023年 7月25日)	31,075,058,212	31,075,058,212	24,503	24,503

第14期計算期間末	(2024年 7月25日)	38,033,335,014	38,033,335,014	27,054	27,054
	2023年 8月末日	31,635,848,412	—	24,616	—
	9月末日	31,608,351,695	—	24,423	—
	10月末日	31,073,649,382	—	23,879	—
	11月末日	32,593,070,165	—	24,923	—
	12月末日	32,986,763,805	—	25,039	—
	2024年 1月末日	34,312,363,690	—	25,897	—
	2月末日	37,100,403,351	—	26,594	—
	3月末日	38,292,197,153	—	27,192	—
	4月末日	38,212,419,869	—	27,119	—
	5月末日	38,013,880,863	—	27,182	—
	6月末日	39,054,741,606	—	27,762	—
	7月末日	38,563,312,991	—	27,279	—
	8月末日	38,410,863,185	—	27,068	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	0
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	0
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	0
第13期計算期間	2022年 7月26日～2023年 7月25日	0
第14期計算期間	2023年 7月26日～2024年 7月25日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	15.3
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	△6.3
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	10.7
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	6.0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	△0.2
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	2.5
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	15.9
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	1.8
第13期計算期間	2022年 7月26日～2023年 7月25日	10.0
第14期計算期間	2023年 7月26日～2024年 7月25日	10.4

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	449,877,581	339,477,441	3,047,289,027
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	961,565,392	313,575,798	3,695,278,621
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	603,139,592	434,776,876	3,863,641,337
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	1,120,338,164	291,368,383	4,692,611,118
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	2,005,968,696	359,477,733	6,339,102,081
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	1,649,045,263	607,727,034	7,380,420,310
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	1,599,018,504	627,657,001	8,351,781,813
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	2,149,578,883	594,320,528	9,907,040,168
第13期計算期間	2022年 7月26日～2023年 7月25日	3,440,793,433	665,483,939	12,682,349,662
第14期計算期間	2023年 7月26日～2024年 7月25日	2,671,427,595	1,295,472,751	14,058,304,506

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

【インデックスコレクション（バランス株式７０）】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	30,316,275,162	99.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	149,793,231	0.49
合計(純資産総額)		30,466,068,393	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	3,772,341,943	3.2355	12,205,538,476	3.2720	12,343,102,837	40.51
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	1,306,676,788	7.0286	9,184,224,756	6.9047	9,022,211,218	29.61
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	5,799,643,797	1.2725	7,380,119,501	1.2860	7,458,341,922	24.48
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	490,219,123	3.1116	1,525,383,306	3.0448	1,492,619,185	4.90

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.51
合計	99.51

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第5期計算期間末 (2015年 7月27日)	3,890,683,336	3,890,683,336	19,106	19,106
第6期計算期間末 (2016年 7月25日)	3,517,186,547	3,517,186,547	17,198	17,198
第7期計算期間末 (2017年 7月25日)	4,084,827,402	4,084,827,402	19,885	19,885
第8期計算期間末 (2018年 7月25日)	5,289,106,724	5,289,106,724	21,519	21,519
第9期計算期間末 (2019年 7月25日)	6,627,304,937	6,627,304,937	21,241	21,241
第10期計算期間末 (2020年 7月27日)	7,965,836,155	7,965,836,155	21,868	21,868
第11期計算期間末 (2021年 7月26日)	11,461,085,557	11,461,085,557	26,791	26,791
第12期計算期間末 (2022年 7月25日)	14,953,795,408	14,953,795,408	27,683	27,683
第13期計算期間末 (2023年 7月25日)	22,409,858,821	22,409,858,821	31,644	31,644
第14期計算期間末 (2024年 7月25日)	30,249,303,295	30,249,303,295	36,620	36,620
2023年 8月末日	23,070,904,634	—	31,976	—
9月末日	23,116,880,955	—	31,729	—
10月末日	22,673,351,703	—	30,892	—
11月末日	23,957,349,990	—	32,507	—
12月末日	24,430,142,391	—	32,685	—
2024年 1月末日	25,943,090,799	—	34,283	—
2月末日	28,412,426,752	—	35,516	—
3月末日	29,761,749,187	—	36,613	—
4月末日	29,843,081,648	—	36,553	—
5月末日	29,933,878,724	—	36,852	—
6月末日	31,129,274,086	—	37,835	—
7月末日	30,733,208,009	—	37,028	—
8月末日	30,466,068,393	—	36,532	—

②【分配の推移】

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

第13期計算期間	2022年 7月26日～2023年 7月25日	0
第14期計算期間	2023年 7月26日～2024年 7月25日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	19.7
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	△10.0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	15.6
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	8.2
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	△1.3
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	3.0
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	22.5
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	3.3
第13期計算期間	2022年 7月26日～2023年 7月25日	14.3
第14期計算期間	2023年 7月26日～2024年 7月25日	15.7

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	672,066,846	554,506,519	2,036,343,451
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	442,910,032	434,101,250	2,045,152,233
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	508,202,695	499,147,088	2,054,207,840
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	778,728,051	375,069,629	2,457,866,262
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	1,031,236,687	369,101,257	3,120,001,692
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	1,230,292,042	707,559,121	3,642,734,613
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	1,243,904,534	608,757,486	4,277,881,661
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	1,822,918,129	698,992,306	5,401,807,484
第13期計算期間	2022年 7月26日～2023年 7月25日	2,386,770,370	706,798,835	7,081,779,019
第14期計算期間	2023年 7月26日～2024年 7月25日	2,304,220,664	1,125,603,176	8,260,396,507

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

（参考）

日本株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	422,504,422,340	99.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	3,930,966,936	0.92
合計(純資産総額)		426,435,389,276	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	3,665,925,000	0.86

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	5,881,900	2,967.35	17,453,655,965	2,759.50	16,231,103,050	3.81
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	774,800	14,692.96	11,384,105,408	14,200.00	11,002,160,000	2.58
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	6,636,400	1,313.68	8,718,105,952	1,528.00	10,140,419,200	2.38
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,685,400	2,334.90	6,270,140,460	3,572.00	9,592,248,800	2.25
日本	株式	キーエンス	電気機器	110,700	66,596.38	7,372,219,266	69,610.00	7,705,827,000	1.81
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	819,200	6,233.45	5,106,442,240	9,047.00	7,411,302,400	1.74
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	763,100	7,432.52	5,671,756,012	9,550.00	7,287,605,000	1.71
日本	株式	三菱商事	卸売業	2,247,900	2,612.71	5,873,110,809	3,013.00	6,772,922,700	1.59
日本	株式	信越化学工業	化学	993,900	5,880.04	5,844,171,756	6,422.00	6,382,825,800	1.50
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	786,900	6,651.62	5,234,159,778	7,706.00	6,063,851,400	1.42
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	234,200	28,647.23	6,709,181,266	25,805.00	6,043,531,000	1.42
日本	株式	第一三共	医薬品	966,700	4,447.03	4,298,943,901	6,108.00	5,904,603,600	1.38
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,064,000	3,892.18	4,141,279,520	5,506.00	5,858,384,000	1.37
日本	株式	任天堂	その他製品	698,600	8,087.50	5,649,927,500	7,902.00	5,520,337,200	1.29
日本	株式	三井物産	卸売業	1,753,700	2,985.21	5,235,162,777	3,123.00	5,476,805,100	1.28
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	33,008,900	189.02	6,239,342,278	155.70	5,139,485,730	1.21
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	547,400	6,780.95	3,711,892,030	8,405.00	4,600,897,000	1.08
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	217,800	18,605.47	4,052,271,366	20,595.00	4,485,591,000	1.05
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,470,900	2,597.13	3,820,118,517	3,009.00	4,425,938,100	1.04
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	982,100	4,360.78	4,282,722,038	4,333.00	4,255,439,300	1.00
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,621,600	1,604.36	4,205,990,176	1,588.00	4,163,100,800	0.98
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	816,200	5,034.07	4,108,807,934	4,911.00	4,008,358,200	0.94
日本	株式	三菱重工業	機械	1,954,300	983.64	1,922,327,652	1,942.50	3,796,227,750	0.89
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,772,900	1,982.56	3,514,880,624	2,038.00	3,613,170,200	0.85
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	65,800	39,954.66	2,629,016,628	46,650.00	3,069,570,000	0.72
日本	株式	村田製作所	電気機器	988,400	3,043.78	3,008,472,152	3,033.00	2,997,817,200	0.70
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,224,100	2,208.73	2,703,706,393	2,441.00	2,988,028,100	0.70

日本	株式	日本たばこ産業	食料品	662,000	3,806.51	2,519,909,620	4,203.00	2,782,386,000	0.65
日本	株式	キヤノン	電気機器	551,900	3,787.04	2,090,067,376	5,017.00	2,768,882,300	0.65
日本	株式	富士通	電気機器	1,028,300	2,072.29	2,130,935,807	2,677.50	2,753,273,250	0.65

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.29
		建設業	2.13
		食料品	3.13
		繊維製品	0.37
		パルプ・紙	0.15
		化学	5.64
		医薬品	5.05
		石油・石炭製品	0.55
		ゴム製品	0.59
		ガラス・土石製品	0.66
		鉄鋼	0.85
		非鉄金属	0.76
		金属製品	0.49
		機械	5.30
		電気機器	17.39
		輸送用機器	7.45
		精密機器	2.39
		その他製品	2.44
		電気・ガス業	1.42
		陸運業	2.30
		海運業	0.81
		空運業	0.36
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	7.39
		卸売業	7.24
		小売業	4.27
		銀行業	7.50
		証券、商品先物取引業	0.86
		保険業	3.10
		その他金融業	1.20
		不動産業	2.03
		サービス業	4.73
		小計	99.08
合計			99.08

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	135	円	3,576,714,250	3,665,925,000	0.86

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

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

日本債券マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	345,888,280,980	84.49
地方債証券	日本	21,012,166,080	5.13
特殊債券	日本	21,847,706,730	5.34
	国際機関	199,112,000	0.05
	小計	22,046,818,730	5.39
社債券	日本	18,167,073,000	4.44
	フランス	898,429,000	0.22
	韓国	99,502,000	0.02
	小計	19,165,004,000	4.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,276,631,685	0.31
合計(純資産総額)		409,388,901,475	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率（%）	償還期限	投資比率（%）
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	3,975,000,000	98.13	3,900,809,500	97.45	3,873,677,250	0.100	2030/9/20	0.95
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	3,890,000,000	99.76	3,880,664,000	98.95	3,849,193,900	0.100	2028/3/20	0.94
日本	国債証券	第３６８回利付国債（１０年）	3,925,000,000	96.37	3,782,654,000	96.08	3,771,140,000	0.200	2032/9/20	0.92
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	3,720,000,000	100.07	3,722,871,600	99.47	3,700,321,200	0.100	2026/9/20	0.90
日本	国債証券	第３６５回利付国債（１０年）	3,700,000,000	97.15	3,594,550,000	96.20	3,559,437,000	0.100	2031/12/20	0.87
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	3,435,000,000	100.20	3,441,870,000	99.31	3,411,607,650	0.100	2027/3/20	0.83

日本	国債証券	第３７４回利付国債（１０年）	3,315,000,000	98.02	3,249,427,700	99.42	3,295,971,900	0.800	2034/3/20	0.81
日本	国債証券	第３６３回利付国債（１０年）	3,395,000,000	97.61	3,313,984,300	96.76	3,285,205,700	0.100	2031/6/20	0.80
日本	国債証券	第１４９回利付国債（５年）	3,285,000,000	99.94	3,283,251,800	99.27	3,261,249,450	0.005	2026/9/20	0.80
日本	国債証券	第３７１回利付国債（１０年）	3,320,000,000	98.16	3,258,912,000	96.83	3,214,789,200	0.400	2033/6/20	0.79
日本	国債証券	第３７３回利付国債（１０年）	3,200,000,000	98.42	3,149,440,000	97.93	3,133,760,000	0.600	2033/12/20	0.77
日本	国債証券	第３５９回利付国債（１０年）	3,180,000,000	98.73	3,139,614,000	97.63	3,104,824,800	0.100	2030/6/20	0.76
日本	国債証券	第３４３回利付国債（１０年）	3,070,000,000	100.18	3,075,774,250	99.56	3,056,553,400	0.100	2026/6/20	0.75
日本	国債証券	第３４１回利付国債（１０年）	3,050,000,000	100.53	3,066,244,500	100.01	3,050,366,000	0.300	2025/12/20	0.75
日本	国債証券	第３６４回利付国債（１０年）	3,145,000,000	97.27	3,059,217,600	96.48	3,034,516,150	0.100	2031/9/20	0.74
日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	3,040,000,000	100.20	3,046,188,400	99.66	3,029,694,400	0.100	2026/3/20	0.74
日本	国債証券	第３６９回利付国債（１０年）	3,060,000,000	99.51	3,045,056,500	98.20	3,004,920,000	0.500	2032/12/20	0.73
日本	国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	3,060,000,000	99.22	3,036,315,600	98.17	3,004,063,200	0.100	2029/6/20	0.73
日本	国債証券	第３６２回利付国債（１０年）	3,070,000,000	97.89	3,005,311,500	97.03	2,978,943,800	0.100	2031/3/20	0.73
日本	国債証券	第３６１回利付国債（１０年）	3,050,000,000	98.13	2,993,222,400	97.26	2,966,430,000	0.100	2030/12/20	0.72
日本	国債証券	第３５８回利付国債（１０年）	3,000,000,000	98.75	2,962,652,600	97.78	2,933,640,000	0.100	2030/3/20	0.72
日本	国債証券	第３４７回利付国債（１０年）	2,925,000,000	100.06	2,926,826,300	99.23	2,902,711,500	0.100	2027/6/20	0.71
日本	国債証券	第３７２回利付国債（１０年）	2,900,000,000	101.59	2,946,358,800	100.00	2,900,000,000	0.800	2033/9/20	0.71
日本	国債証券	第３６６回利付国債（１０年）	2,988,000,000	97.61	2,916,586,800	96.69	2,889,186,840	0.200	2032/3/20	0.71
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	2,920,000,000	99.41	2,902,895,500	98.66	2,881,047,200	0.100	2028/9/20	0.70
日本	国債証券	第１４７回利付国債（５年）	2,890,000,000	99.98	2,889,529,500	99.51	2,875,983,500	0.005	2026/3/20	0.70
日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	2,850,000,000	100.14	2,854,018,000	99.39	2,832,757,500	0.100	2026/12/20	0.69
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	2,860,000,000	99.36	2,841,953,400	98.52	2,817,786,400	0.100	2028/12/20	0.69
日本	国債証券	第１５３回利付国債（５年）	2,845,000,000	99.83	2,840,163,500	98.97	2,815,838,750	0.005	2027/6/20	0.69
日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	2,770,000,000	99.96	2,768,892,000	99.05	2,743,823,500	0.100	2027/12/20	0.67

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.49
地方債証券	5.13
特殊債券	5.39
社債券	4.68
合計	99.69

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	377,896,402,935	68.85
	イギリス	20,640,793,031	3.76
	カナダ	17,463,734,828	3.18
	スイス	16,377,804,676	2.98
	フランス	14,854,982,115	2.71
	ドイツ	12,419,776,723	2.26
	オランダ	9,740,474,805	1.77
	オーストラリア	9,683,839,477	1.76
	アイルランド	9,677,258,313	1.76
	デンマーク	5,350,113,166	0.97
	スウェーデン	4,602,271,227	0.84
	スペイン	3,775,296,915	0.69
	イタリア	3,091,743,812	0.56
	香港	1,948,186,605	0.35
	シンガポール	1,485,545,470	0.27
	フィンランド	1,451,526,028	0.26
	ベルギー	1,113,180,131	0.20
	イスラエル	1,092,019,181	0.20
	ジャージー	829,802,014	0.15
	ノルウェー	829,076,790	0.15
	バミューダ	682,443,288	0.12
	ケイマン	615,772,186	0.11
	キュラソー	501,091,292	0.09
	ニュージーランド	353,158,695	0.06
	リベリア	350,176,472	0.06
	オーストリア	258,239,655	0.05
	ルクセンブルク	257,085,847	0.05
	ポルトガル	240,614,856	0.04
	パナマ	137,805,445	0.03
	マン島	40,512,400	0.01
	小計	517,760,728,378	94.33
新株予約権証券	カナダ	—	—
投資信託受益証券	オーストラリア	71,840,119	0.01

	香港	34,560,627	0.01
	小計	106,400,746	0.02
投資証券	アメリカ	8,934,331,984	1.63
	オーストラリア	703,298,705	0.13
	フランス	188,098,602	0.03
	イギリス	141,493,612	0.03
	シンガポール	131,172,843	0.02
	香港	101,002,972	0.02
	カナダ	46,233,091	0.01
	ベルギー	27,696,292	0.01
	小計	10,273,328,101	1.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	20,714,790,589	3.77
合計(純資産総額)		548,855,247,814	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	15,556,081,200	2.83
	買建	カナダ	538,752,340	0.10
	買建	ドイツ	2,653,219,660	0.48
	買建	イギリス	1,121,516,235	0.20
	買建	オーストラリア	630,724,768	0.11

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	―	1,244,413,691	0.23
	売建	―	151,487,200	△0.03

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	830,085	27,413.01	22,755,135,759	33,273.59	27,619,909,615	5.03

アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,414,780	9,990.95	14,135,007,532	17,027.03	24,089,504,333	4.39
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	399,405	58,730.14	23,457,112,234	59,819.77	23,892,317,633	4.35
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	529,993	24,512.77	12,991,598,322	24,922.97	13,209,002,819	2.41
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	123,975	65,866.62	8,165,814,711	75,038.25	9,302,867,788	1.69
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	333,825	20,890.99	6,973,935,911	23,425.74	7,820,098,991	1.42
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	289,456	21,055.36	6,094,602,600	23,660.32	6,848,621,586	1.25
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	45,828	102,262.45	4,686,483,727	136,140.96	6,239,067,915	1.14
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	249,250	17,717.43	4,416,071,521	22,723.46	5,663,823,402	1.03
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	162,226	25,354.48	4,113,155,873	32,176.00	5,219,785,074	0.95
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	74,385	57,058.04	4,244,262,693	67,819.97	5,044,788,915	0.92
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	162,662	26,814.67	4,361,728,396	29,869.34	4,858,607,234	0.89
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	52,063	73,945.01	3,849,799,368	85,659.33	4,459,682,010	0.81
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	253,667	14,735.29	3,737,857,259	17,105.22	4,339,030,856	0.79
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	185,314	17,532.10	3,248,945,334	19,836.52	3,675,985,238	0.67
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	88,763	40,074.84	3,557,163,733	39,721.53	3,525,802,700	0.64
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	47,345	66,680.40	3,156,983,538	69,619.84	3,296,151,325	0.60
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	133,078	23,017.41	3,063,111,345	24,620.34	3,276,426,139	0.60
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	25,209	103,138.96	2,600,030,142	128,384.02	3,236,432,861	0.59
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	135,984	22,891.85	3,112,925,690	23,780.50	3,233,768,056	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	56,243	51,585.00	2,901,295,155	53,150.28	2,989,331,648	0.54
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	22,598	133,774.87	3,023,044,558	132,042.12	2,983,887,828	0.54
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	100,779	25,059.70	2,525,491,562	28,262.06	2,848,222,548	0.52
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	252,213	8,212.61	2,071,327,956	11,065.61	2,790,892,208	0.51
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	24,501	80,491.42	1,972,120,379	100,271.10	2,456,742,319	0.45

アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	144,010	18,369.89	2,645,448,047	17,008.20	2,449,352,034	0.45
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	230,231	8,679.31	1,998,246,681	10,432.83	2,401,963,186	0.44
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	152,013	16,968.34	2,579,408,616	15,563.52	2,365,857,974	0.43
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	401,937	4,784.19	1,922,943,780	5,816.61	2,337,913,185	0.43
イギリス	株式	ASTRAZENECA	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	87,036	20,088.33	1,748,408,587	25,313.51	2,203,187,353	0.40

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	エネルギー	4.19
		素材	3.51
		資本財	6.77
		商業・専門サービス	1.55
		運輸	1.55
		自動車・自動車部品	1.50
		耐久消費財・アパレル	1.28
		消費者サービス	1.79
		メディア・娯楽	6.02
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.46
		生活必需品流通・小売り	1.74
		食品・飲料・タバコ	3.10
		家庭用品・パーソナル用品	1.54
		ヘルスケア機器・サービス	4.09
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.96
		銀行	5.47
		金融サービス	6.54
		保険	3.01
		エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.03
		ソフトウェア・サービス	9.26
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.46
		電気通信サービス	1.08
		公益事業	2.59
		半導体・半導体製造装置	8.58
		不動産管理・開発	0.27
		小計	94.33
新株予約権証券	—	—	—
投資信託受益証券	—	—	0.02
投資証券	—	—	1.87

合計	96.23

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	383	アメリカドル	105,935,316.8	15,339,433,873	107,431,500	15,556,081,200	2.83
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	18	カナダドル	4,785,473	513,672,671	5,019,120	538,752,340	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	37	スイスフラン	4,483,439	765,950,718	4,597,620	785,457,400	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	234	ユーロ	11,476,168.8	1,841,236,522	11,641,500	1,867,762,260	0.34
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	32	オーストラリアドル	6,236,199	613,891,430	6,407,200	630,724,768	0.11
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	70	イギリスポンド	5,772,092.5	1,100,738,040	5,881,050	1,121,516,235	0.20

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	6,540,600.00	956,214,806	945,536,681	0.17
	ユーロ	買建	1,300,000.00	208,730,680	208,308,740	0.04
	イギリスポンド	買建	300,000.00	56,194,050	57,106,830	0.01
	ノルウェークローネ	買建	1,000,000.00	13,757,000	13,783,500	0.00
	オーストラリアドル	買建	200,000.00	19,626,800	19,677,940	0.00
	アメリカドル	売建	800,000.00	115,768,000	115,771,840	△0.02
	ユーロ	売建	100,000.00	16,036,700	16,037,420	△0.00
	オーストラリアドル	売建	200,000.00	19,674,800	19,677,940	△0.00

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

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

外国債券マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	83,607,819,954	46.01
	中国	18,563,205,200	10.22

	フランス	13,519,005,119	7.44
	イタリア	12,364,425,640	6.80
	ドイツ	10,850,668,146	5.97
	イギリス	9,515,072,172	5.24
	スペイン	8,030,710,812	4.42
	カナダ	3,582,593,120	1.97
	ベルギー	2,870,482,970	1.58
	オランダ	2,419,926,763	1.33
	オーストラリア	2,359,948,327	1.30
	オーストリア	2,048,784,925	1.13
	メキシコ	1,256,233,560	0.69
	マレーシア	926,025,767	0.51
	ポーランド	918,990,714	0.51
	フィンランド	896,563,406	0.49
	アイルランド	867,361,945	0.48
	シンガポール	727,585,488	0.40
	イスラエル	561,688,026	0.31
	デンマーク	472,284,467	0.26
	ニュージーランド	461,918,333	0.25
	スウェーデン	287,142,067	0.16
	ノルウェー	283,516,948	0.16
	小計	177,391,953,869	97.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	4,317,324,376	2.38
合計(純資産総額)		181,709,278,245	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
債券先物取引	買建	アメリカ	883,259,629	0.49
	買建	ドイツ	792,624,940	0.44

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	2,047,272,453	1.13

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,110,000	11,893.39	1,440,290,366	12,294.42	1,488,854,867	1.375	2031/11/15	0.82
アメリカ	国債証券	T 0.375% 01/31/26	10,690,000	13,425.99	1,435,238,650	13,737.33	1,468,521,047	0.375	2026/1/31	0.81
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	10,200,000	13,769.85	1,404,525,494	14,023.82	1,430,429,984	2.875	2028/8/15	0.79
アメリカ	国債証券	T 4.125% 03/31/29	9,000,000	14,596.51	1,313,686,688	14,734.24	1,326,082,354	4.125	2029/3/31	0.73
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	9,130,000	11,643.39	1,063,041,560	12,088.82	1,103,709,292	0.625	2030/8/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	7,460,000	13,899.95	1,036,936,389	14,139.21	1,054,785,131	3.125	2028/11/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/33	6,900,000	14,109.41	973,549,962	14,501.49	1,000,603,073	3.875	2033/8/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	6,900,000	13,545.02	934,606,512	13,832.64	954,452,312	2.625	2029/2/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 4.5% 11/15/33	6,250,000	14,842.99	927,686,876	15,193.53	949,595,992	4.500	2033/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.125% 10/31/26	6,850,000	13,337.72	913,633,839	13,658.14	935,583,063	1.125	2026/10/31	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	6,750,000	13,251.46	894,473,718	13,591.12	917,400,620	2.875	2032/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	7,400,000	11,737.85	868,600,900	12,182.99	901,541,771	0.625	2030/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/29	6,390,000	13,253.16	846,877,052	13,651.07	872,303,795	2.375	2029/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 4.625% 10/15/26	5,800,000	14,431.35	837,018,663	14,697.20	852,437,600	4.625	2026/10/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	6,000,000	13,833.49	830,009,436	14,134.12	848,047,218	3.500	2033/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	5,690,000	14,512.80	825,778,670	14,798.44	842,031,629	4.125	2032/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 3.75% 04/15/26	5,800,000	14,305.50	829,719,272	14,414.38	836,034,475	3.750	2026/4/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/29	6,000,000	13,578.11	814,686,653	13,875.34	832,520,815	2.750	2029/5/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	6,550,000	11,859.74	776,813,114	12,258.50	802,932,260	1.250	2031/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.25% 05/31/28	6,000,000	12,875.03	772,502,347	13,230.81	793,849,032	1.250	2028/5/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	6,200,000	12,306.30	762,990,791	12,687.25	786,609,600	1.875	2032/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	5,500,000	13,937.00	766,535,000	14,141.19	777,765,482	2.250	2025/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.75% 04/30/27	5,500,000	13,638.94	750,142,141	14,099.90	775,494,500	2.750	2027/4/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	6,160,000	11,789.03	726,204,808	12,202.79	751,692,099	0.875	2030/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	5,400,000	13,646.26	736,898,517	13,914.65	751,391,521	1.625	2026/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.25% 12/31/26	5,500,000	13,335.74	733,465,733	13,655.88	751,073,643	1.250	2026/12/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.375% 03/31/29	5,400,000	13,298.01	718,093,054	13,664.65	737,891,187	2.375	2029/3/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/28	5,550,000	12,872.21	714,407,704	13,224.87	733,980,734	1.500	2028/11/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	5,300,000	13,532.57	717,226,639	13,823.59	732,650,387	1.500	2026/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	5,260,000	13,548.69	712,661,535	13,827.26	727,314,339	2.250	2027/11/15	0.40

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	97.62
合計	97.62

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	22	アメリカドル	2,414,639.67	349,639,824	2,411,234.32	349,146,729	0.19
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	15	アメリカドル	1,711,518.55	247,827,886	1,708,125	247,336,500	0.14
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	16	アメリカドル	1,989,732.3	288,113,237	1,980,500	286,776,400	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	8	ユーロ	850,821.8	136,505,850	850,200	136,406,088	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	12	ユーロ	1,417,725.2	227,459,830	1,412,520	226,624,708	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	20	ユーロ	2,695,122	432,405,374	2,677,600	429,594,144	0.24

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	6,850,000.00	999,926,264	989,838,015	0.54
	カナダドル	買建	720,000.00	76,975,236	77,161,248	0.04
	ユーロ	買建	4,000,000.00	643,244,120	640,838,800	0.35
	イギリスポンド	買建	600,000.00	113,087,208	114,197,820	0.06
	オフショア人民元	買建	11,050,000.00	225,901,937	225,236,570	0.12

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

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

≪参考情報≫

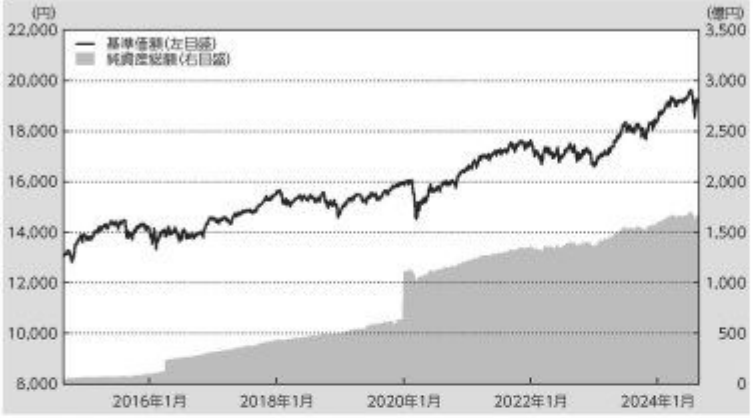
交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2010年10月20日
作成基準日：2024年 8 月30日

インデックスコレクション(バランス株式30)

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	19,221円
純資産総額	1,670.05億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年 7 月	0円
2021年 7 月	0円
2022年 7 月	0円
2023年 7 月	0円
2024年 7 月	0円
設定来分配金合計額	0円

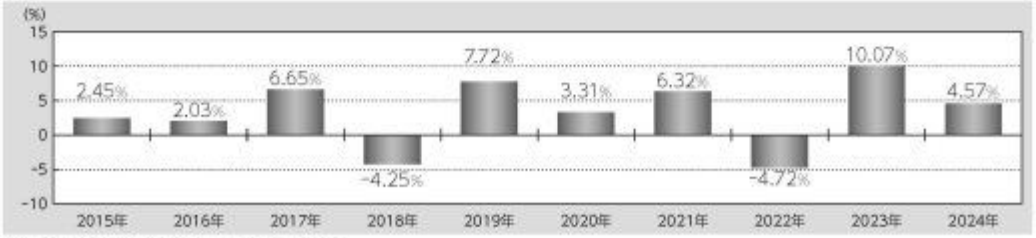
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券マザーファンド	58.8%	第360回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2030/09/20	0.6%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.6%
		第368回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.200%	2032/09/20	0.5%
日本株式マザーファンド	20.8%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.8%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.5%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.5%
外国株式マザーファンド	10.1%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	0.5%
		NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.4%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.4%
外国債券マザーファンド	9.7%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.1%
		T 0.375% 01/31/26	アメリカ	国債	-	0.375%	2026/01/31	0.1%
		T 2.875% 08/15/28	アメリカ	国債	-	2.875%	2028/08/15	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2024年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

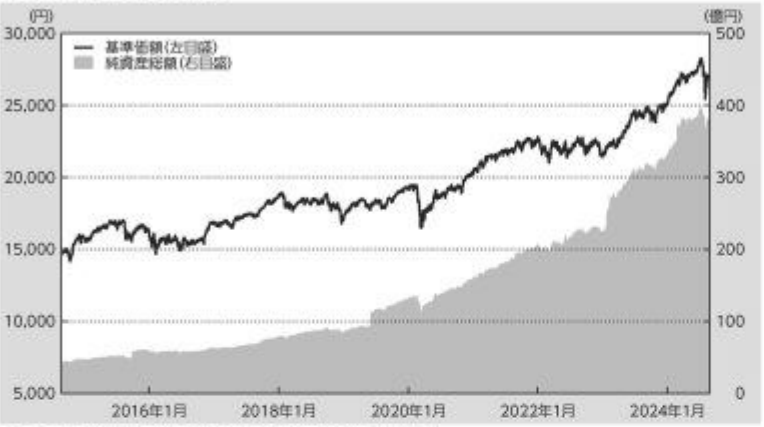
記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

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

当初設定日：2010年10月20日
作成基準日：2024年 8 月30日

インデックスコレクション(バランス株式50)

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	27,068円
純資産総額	384.11億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年 7 月	0円
2021年 7 月	0円
2022年 7 月	0円
2023年 7 月	0円
2024年 7 月	0円
設定来分配金合計額	0円

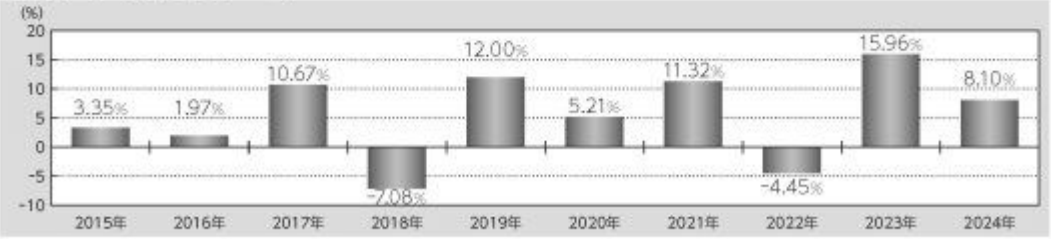
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券マザーファンド	38.5%	第360回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2030/09/20	0.4%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.4%
		第368回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.200%	2032/09/20	0.4%
日本株式マザーファンド	31.2%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.2%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.8%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.7%
外国株式マザーファンド	20.3%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	1.0%
		NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.9%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.9%
外国債券マザーファンド	9.5%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.1%
		T 0.375% 01/31/26	アメリカ	国債	-	0.375%	2026/01/31	0.1%
		T 2.875% 08/15/28	アメリカ	国債	-	2.875%	2028/08/15	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2024年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

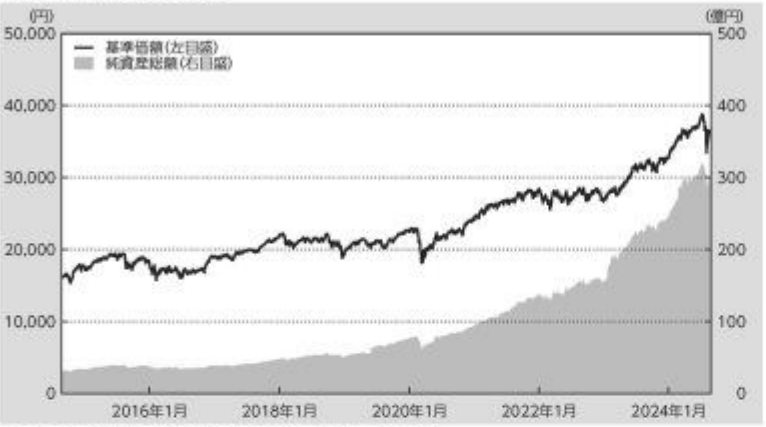
運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページ等でご確認いただけます。

運用実績

当初設定日：2010年10月20日
作成基準日：2024年 8 月30日

インデックスコレクション(バランス株式70)

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	36,532円
純資産総額	304.66億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年 7 月	0円
2021年 7 月	0円
2022年 7 月	0円
2023年 7 月	0円
2024年 7 月	0円
設定来分配金合計額	0円

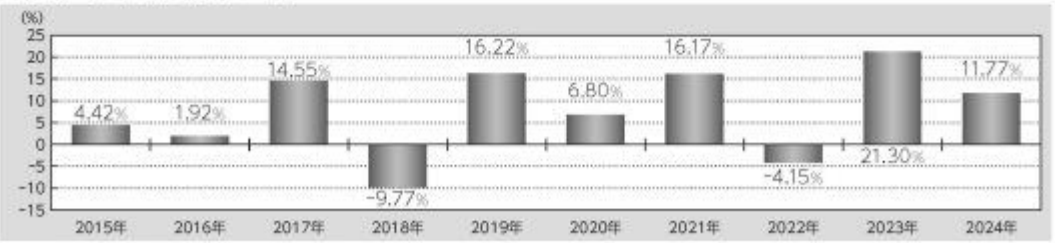
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本株式マザーファンド	40.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.5%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	1.0%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	-	-	1.0%
外国株式マザーファンド	29.6%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	1.5%
		NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	1.3%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.3%
日本債券マザーファンド	24.5%	第360回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2030/09/20	0.2%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.2%
		第368回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.200%	2032/09/20	0.2%
外国債券マザーファンド	4.9%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.0%
		T 0.375% 01/31/26	アメリカ	国債	-	0.375%	2026/01/31	0.0%
		T 2.875% 08/15/28	アメリカ	国債	-	2.875%	2028/08/15	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2024年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作

成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。
受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

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

＜申込みの受付＞
お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。
※2024年11月5日受付分からは、お申込みの受付は、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜申込単位＞
1円以上1円単位とします。

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

＜申込手数料＞
ありません。

＜申込代金の支払い＞
販売会社が定める期日までにお支払いください。

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

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

＜その他＞
取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファン

ドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

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

＜一部解約の受付＞

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

※2024年11月5日受付分からは、一部解約の実行の請求の受付は、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜一部解約単位＞

1口以上1口単位とします。

＜解約価額＞

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

＜一部解約代金の支払い＞

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

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

＜受付不可日＞
一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

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

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

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

計算日の基準価額で評価します。

B．国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

D．公社債等

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

イ．日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

ロ．金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

ハ．価格情報会社の提供する価額

※　外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

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

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2010年10月20日設定）

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

（４）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年７月26日から翌年７月25日までとすることを原則とします。ただし、第１計算期間は2010年10月20日から2011年７月25日までとします。
なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。
・受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合
・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
・やむを得ない事情が発生した場合
②委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。
③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。
④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

委託会社は上記（1）①によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行います。
①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
④上記①から③までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

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

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

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

て取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

１【財務諸表】

【インデックスコレクション（バランス株式３０）】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間(2023年7月26日から2024年7月25日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第13期 （2023年 7月25日現在）	第14期 （2024年 7月25日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	865,235,237	988,320,111
親投資信託受益証券	153,538,872,748	164,499,129,487
未収入金	69,853,061	54,011,257
未収利息	-	1,776
流動資産合計	154,473,961,046	165,541,462,631
資産合計	154,473,961,046	165,541,462,631
負債の部		
流動負債		
未払解約金	85,181,805	85,607,323
未払受託者報酬	16,051,824	18,104,713
未払委託者報酬	96,310,878	108,628,193
未払利息	2,106	-
その他未払費用	1,137,567	1,190,962
流動負債合計	198,684,180	213,531,191
負債合計	198,684,180	213,531,191
純資産の部		
元本等		
元本	84,620,917,505	86,538,386,836
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	69,654,359,361	78,789,544,604
（分配準備積立金）	21,218,598,564	26,756,499,162
元本等合計	154,275,276,866	165,327,931,440
純資産合計	154,275,276,866	165,327,931,440
負債純資産合計	154,473,961,046	165,541,462,631

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期 自　2022年 7月26日 至　2023年 7月25日	第14期 自　2023年 7月26日 至　2024年 7月25日
営業収益		
受取利息	1,489	177,430
有価証券売買等損益	8,685,381,971	7,751,556,070
営業収益合計	8,685,383,460	7,751,733,500
営業費用		
支払利息	319,408	180,394
受託者報酬	31,375,720	35,267,948
委託者報酬	188,254,210	211,607,547
その他費用	2,269,134	2,366,535
営業費用合計	222,218,472	249,422,424
営業利益又は営業損失（△）	8,463,164,988	7,502,311,076
経常利益又は経常損失（△）	8,463,164,988	7,502,311,076
当期純利益又は当期純損失（△）	8,463,164,988	7,502,311,076
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（△）	62,094,473	359,472,393
期首剰余金又は期首欠損金（△）	57,703,589,977	69,654,359,361
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,963,414,472	7,564,416,844
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,963,414,472	7,564,416,844
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,413,715,603	5,572,070,284
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,413,715,603	5,572,070,284
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	69,654,359,361	78,789,544,604

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第13期 (2023年 7月25日現在)	第14期 (2024年 7月25日現在)
１．計算期間の末日における受益権の総数	84,620,917,505口	86,538,386,836口
２．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.8231円 (1万口当たり純資産額) (18,231円)	1口当たり純資産額 1.9105円 (1万口当たり純資産額) (19,105円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第13期
自 2022年 7月26日
至 2023年 7月25日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,945,785,996円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	5,126,635,271円
収益調整金額	C	48,435,760,797円
分配準備積立金額	D	14,146,177,297円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	69,654,359,361円
当ファンドの期末残存口数	F	84,620,917,505口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,231円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

第14期
自 2023年 7月26日
至 2024年 7月25日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,122,289,856円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	5,020,548,827円
収益調整金額	C	52,033,045,442円
分配準備積立金額	D	19,613,660,479円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	78,789,544,604円
当ファンドの期末残存口数	F	86,538,386,836口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,104円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第14期 自 2023年 7月26日 至 2024年 7月25日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
３.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第14期 (2024年 7月25日現在)
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第13期 自 2022年 7月26日 至 2023年 7月25日	第14期 自 2023年 7月26日 至 2024年 7月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	79,705,739,695円	84,620,917,505円
期中追加設定元本額	9,635,639,646円	8,676,873,087円
期中一部解約元本額	4,720,461,836円	6,759,403,756円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第13期 (2023年 7月25日現在)	第14期 (2024年 7月25日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	8,131,132,423	5,978,019,545
合計	8,131,132,423	5,978,019,545

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	9,739,008,341	31,825,131,456	
	日本債券マザーファンド	79,102,620,417	100,555,251,074	
	外国株式マザーファンド	2,249,771,400	15,873,937,044	
	外国債券マザーファンド	5,201,668,240	16,244,809,913	
合計		96,293,068,398	164,499,129,487	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【インデックスコレクション（バランス株式５０）】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間(2023年7月26日から2024年7月25日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第13期 （2023年 7月25日現在）	第14期 （2024年 7月25日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	181,536,166	212,086,771
親投資信託受益証券	30,927,294,568	37,865,042,693
未収入金	2,579,132	15,357,210
未収利息	-	381
流動資産合計	31,111,409,866	38,092,487,055
資産合計	31,111,409,866	38,092,487,055
負債の部		
流動負債		
未払解約金	13,790,438	29,627,679
未払受託者報酬	3,112,472	4,097,661
未払委託者報酬	18,674,753	24,585,917
未払利息	442	-
その他未払費用	773,549	840,784
流動負債合計	36,351,654	59,152,041
負債合計	36,351,654	59,152,041
純資産の部		
元本等		
元本	12,682,349,662	14,058,304,506
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	18,392,708,550	23,975,030,508
（分配準備積立金）	6,715,813,286	9,288,064,544
元本等合計	31,075,058,212	38,033,335,014
純資産合計	31,075,058,212	38,033,335,014
負債純資産合計	31,111,409,866	38,092,487,055

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期 自　2022年 7月26日 至　2023年 7月25日	第14期 自　2023年 7月26日 至　2024年 7月25日
営業収益		
受取利息	274	51,194
有価証券売買等損益	2,868,121,929	3,443,882,296
営業収益合計	2,868,122,203	3,443,933,490
営業費用		
支払利息	58,879	37,997
受託者報酬	5,621,166	7,633,310
委託者報酬	33,726,838	45,799,704
その他費用	1,400,663	1,675,645
営業費用合計	40,807,546	55,146,656
営業利益又は営業損失（△）	2,827,314,657	3,388,786,834
経常利益又は経常損失（△）	2,827,314,657	3,388,786,834
当期純利益又は当期純損失（△）	2,827,314,657	3,388,786,834
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（△）	35,058,619	204,430,652
期首剰余金又は期首欠損金（△）	12,153,537,789	18,392,708,550
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,262,800,754	4,292,069,639
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,262,800,754	4,292,069,639
剰余金減少額又は欠損金増加額	815,886,031	1,894,103,863
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	815,886,031	1,894,103,863
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	18,392,708,550	23,975,030,508

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第13期 (2023年 7月25日現在)	第14期 (2024年 7月25日現在)
１．計算期間の末日における受益権の総数	12,682,349,662口	14,058,304,506口
２．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.4503円 (1万口当たり純資産額) (24,503円)	1口当たり純資産額 2.7054円 (1万口当たり純資産額) (27,054円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第13期
自 2022年 7月26日
至 2023年 7月25日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	432,274,935円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	2,359,981,103円
収益調整金額	C	11,676,895,264円
分配準備積立金額	D	3,923,557,248円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	18,392,708,550円
当ファンドの期末残存口数	F	12,682,349,662口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	14,502円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

第14期
自 2023年 7月26日
至 2024年 7月25日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	551,767,068円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	2,632,589,114円
収益調整金額	C	14,686,965,964円
分配準備積立金額	D	6,103,708,362円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	23,975,030,508円
当ファンドの期末残存口数	F	14,058,304,506口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	17,053円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第14期 自 2023年 7月26日 至 2024年 7月25日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
３.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第14期 (2024年 7月25日現在)
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第13期 自 2022年 7月26日 至 2023年 7月25日	第14期 自 2023年 7月26日 至 2024年 7月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	9,907,040,168円	12,682,349,662円
期中追加設定元本額	3,440,793,433円	2,671,427,595円
期中一部解約元本額	665,483,939円	1,295,472,751円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第13期 (2023年 7月25日現在)	第14期 (2024年 7月25日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	2,740,222,261	3,140,338,664
合計	2,740,222,261	3,140,338,664

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	3,376,296,514	11,033,061,748	
	日本債券マザーファンド	11,972,724,754	15,219,727,707	
	外国株式マザーファンド	1,100,113,723	7,762,182,406	
	外国債券マザーファンド	1,232,811,666	3,850,070,832	
合計		17,681,946,657	37,865,042,693	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【インデックスコレクション（バランス株式７０）】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間(2023年7月26日から2024年7月25日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第13期 （2023年 7月25日現在）	第14期 （2024年 7月25日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	111,434,467	135,477,063
親投資信託受益証券	22,302,636,133	30,117,161,602
未収入金	26,538,372	61,309,721
未収利息	-	243
流動資産合計	22,440,608,972	30,313,948,629
資産合計	22,440,608,972	30,313,948,629
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,908,657	41,474,275
未払受託者報酬	2,185,014	3,196,951
未払委託者報酬	13,110,017	19,181,654
未払利息	271	-
その他未払費用	546,192	792,454
流動負債合計	30,750,151	64,645,334
負債合計	30,750,151	64,645,334
純資産の部		
元本等		
元本	7,081,779,019	8,260,396,507
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	15,328,079,802	21,988,906,788
（分配準備積立金）	4,996,878,537	7,772,692,047
元本等合計	22,409,858,821	30,249,303,295
純資産合計	22,409,858,821	30,249,303,295
負債純資産合計	22,440,608,972	30,313,948,629

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期 自　2022年 7月26日 至　2023年 7月25日	第14期 自　2023年 7月26日 至　2024年 7月25日
営業収益		
受取利息	198	31,936
有価証券売買等損益	2,757,566,826	3,814,871,837
営業収益合計	2,757,567,024	3,814,903,773
営業費用		
支払利息	42,884	29,535
受託者報酬	3,905,145	5,789,424
委託者報酬	23,430,743	34,736,466
その他費用	976,163	1,440,514
営業費用合計	28,354,935	41,995,939
営業利益又は営業損失（△）	2,729,212,089	3,772,907,834
経常利益又は経常損失（△）	2,729,212,089	3,772,907,834
当期純利益又は当期純損失（△）	2,729,212,089	3,772,907,834
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（△）	76,470,049	321,313,184
期首剰余金又は期首欠損金（△）	9,551,987,924	15,328,079,802
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,376,414,164	5,678,743,154
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,376,414,164	5,678,743,154
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,253,064,326	2,469,510,818
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,253,064,326	2,469,510,818
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	15,328,079,802	21,988,906,788

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第13期 (2023年 7月25日現在)	第14期 (2024年 7月25日現在)
１．計算期間の末日における受益権の総数	7,081,779,019口	8,260,396,507口
２．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.1644円 (1万口当たり純資産額) (31,644円)	1口当たり純資産額 3.6620円 (1万口当たり純資産額) (36,620円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第13期
自 2022年 7月26日
至 2023年 7月25日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	342,473,398円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	2,310,268,642円
収益調整金額	C	10,331,201,265円
分配準備積立金額	D	2,344,136,497円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	15,328,079,802円
当ファンドの期末残存口数	F	7,081,779,019口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	21,644円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

第14期
自 2023年 7月26日
至 2024年 7月25日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	465,050,681円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	2,986,543,969円
収益調整金額	C	14,216,214,741円
分配準備積立金額	D	4,321,097,397円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	21,988,906,788円
当ファンドの期末残存口数	F	8,260,396,507口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	26,619円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第14期 自 2023年 7月26日 至 2024年 7月25日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
３.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第14期 (2024年 7月25日現在)
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第13期 自 2022年 7月26日 至 2023年 7月25日	第14期 自 2023年 7月26日 至 2024年 7月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	5,401,807,484円	7,081,779,019円
期中追加設定元本額	2,386,770,370円	2,304,220,664円
期中一部解約元本額	706,798,835円	1,125,603,176円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第13期 (2023年 7月25日現在)	第14期 (2024年 7月25日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	2,748,231,987	3,678,542,394
合計	2,748,231,987	3,678,542,394

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	3,680,076,685	12,025,754,591	
	日本債券マザーファンド	5,971,834,307	7,591,395,771	
	外国株式マザーファンド	1,308,735,111	9,234,173,196	
	外国債券マザーファンド	405,327,584	1,265,838,044	
合計		11,365,973,687	30,117,161,602	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2024年 7月25日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,274,529,268
株式	416,131,698,170
未収配当金	500,524,200
未収利息	2,290
前払金	48,590,000
差入委託証拠金	28,873,691
流動資産合計	417,984,217,619
資産合計	417,984,217,619
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	48,616,400
未払金	6,017,700
未払解約金	188,776,601
流動負債合計	243,410,701
負債合計	243,410,701
純資産の部	
元本等	
元本	127,835,821,556
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	289,904,985,362
元本等合計	417,740,806,918
純資産合計	417,740,806,918
負債純資産合計	417,984,217,619

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月25日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 7月25日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	127,835,821,556口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.2678円 (1万口当たり純資産額) (32,678円)

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	2024年 7月25日現在
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
３.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2024年 7月25日現在
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 7月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月26日
期首元本額	132,331,482,461円
期中追加設定元本額	8,232,315,617円
期中一部解約元本額	12,727,976,522円
期末元本額	127,835,821,556円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	568,417,428円
ＤＣ日本株式インデックスファンド	273,018,898円
ＤＣ日本株式インデックスファンドＬ	53,431,673,976円
ＤＣ日本株式インデックスファンドＡ	629,358,580円
ＤＣバランスファンド３０	1,827,999,059円

区分	2024年 7月25日現在
ＤＣバランスファンド５０	3,217,010,096円
ＤＣバランスファンド７０	2,260,729,204円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	480,520,118円
日本株式インデックスｅ	1,313,898,502円
インデックスコレクション（国内株式）	24,070,818,165円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	9,739,008,341円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	3,376,296,514円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	3,680,076,685円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	8,253,171,076円
日本株式パッシブファンド私募Ａ（適格機関投資家専用）	2,614,038,533円
日本株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	558,997,517円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	18,857,141円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	273,587,300円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	38,609,167円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	99,027,042円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	24,933,982円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	321,654,738円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	265,333,284円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	4,790,440,023円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	523,699,149円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	31,343,651円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	745,333,255円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	12,313,413円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	90,801,114円
バランスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	1,233,231,327円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	29,593,880円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	32,988,442円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	9,647,456円
バランスファンドＶＡ２（適格機関投資家専用）	316,585,697円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	155,248,267円
バランスファンドＶＡ３（適格機関投資家専用）	2,392,560,743円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	48,793,065円
国内バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	14,767,549円
国内バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	5,349,436円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	63,021,878円
私募日本株式インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	3,067,865円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 7月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	24,751,836,472
合計	24,751,836,472

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 7月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,345,790,000	－	1,297,200,000	△48,590,000
合計		1,345,790,000	－	1,297,200,000	△48,590,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	6,300	3,965.00	24,979,500	
ニッスイ	153,200	887.30	135,934,360	
マルハニチロ	22,700	3,335.00	75,704,500	
雪国まいたけ	13,100	999.00	13,086,900	
カネコ種苗	4,300	1,394.00	5,994,200	
サカタのタネ	17,400	3,430.00	59,682,000	
ホクト	12,300	1,877.00	23,087,100	
ホクリヨウ	800	995.00	796,000	
住石ホールディングス	19,500	1,110.00	21,645,000	
日鉄鉱業	6,100	4,580.00	27,938,000	
三井松島ホールディングス	9,100	5,210.00	47,411,000	
ＩＮＰＥＸ	514,700	2,252.00	1,159,104,400	
石油資源開発	17,800	6,000.00	106,800,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	6,900	3,300.00	22,770,000	
ショーボンドホールディングス	20,900	5,771.00	120,613,900	
ミライト・ワン	46,300	2,056.00	95,192,800	
タマホーム	9,600	4,495.00	43,152,000	
サンヨーホームズ	600	734.00	440,400	
日本アクア	2,100	862.00	1,810,200	
ファーストコーポレーション	1,500	781.00	1,171,500	
ベステラ	1,200	967.00	1,160,400	
キャンディル	900	636.00	572,400	
ダイセキ環境ソリューション	1,000	1,023.00	1,023,000	
第一カッター興業	4,400	1,530.00	6,732,000	
安藤・間	88,800	1,177.00	104,517,600	
東急建設	48,000	773.00	37,104,000	
コムシスホールディングス	48,900	3,200.00	156,480,000	
ビーアールホールディングス	22,500	365.00	8,212,500	
高松コンストラクショングループ	11,400	3,050.00	34,770,000	
東建コーポレーション	3,900	11,510.00	44,889,000	
ソネック	500	946.00	473,000	
ヤマウラ	7,800	1,288.00	10,046,400	
オリエンタル白石	56,700	339.00	19,221,300	

大成建設	98,200	6,241.00	612,866,200	
大林組	383,400	1,948.50	747,054,900	
清水建設	304,000	886.60	269,526,400	
飛島建設	11,100	1,501.00	16,661,100	
長谷工コーポレーション	98,400	1,830.00	180,072,000	
松井建設	10,000	825.00	8,250,000	
錢高組	500	4,010.00	2,005,000	
鹿島建設	237,700	2,810.50	668,055,850	
不動テトラ	7,400	2,373.00	17,560,200	
大末建設	1,400	1,693.00	2,370,200	
鉄建建設	7,700	2,469.00	19,011,300	
西松建設	20,500	4,776.00	97,908,000	
三井住友建設	79,800	394.00	31,441,200	
大豊建設	3,700	3,475.00	12,857,500	
佐田建設	2,300	846.00	1,945,800	
ナカノフドー建設	2,500	501.00	1,252,500	
奥村組	17,400	5,040.00	87,696,000	
東鉄工業	13,300	3,235.00	43,025,500	
イチケン	900	2,569.00	2,312,100	
富士ピー・エス	1,600	446.00	713,600	
淺沼組	7,900	3,800.00	30,020,000	
戸田建設	145,100	1,043.50	151,411,850	
熊谷組	17,700	3,555.00	62,923,500	
北野建設	700	3,605.00	2,523,500	
植木組	1,000	1,653.00	1,653,000	
矢作建設工業	14,600	1,622.00	23,681,200	
ピーエス・コンストラクション	13,600	991.00	13,477,600	
日本ハウスホールディングス	22,900	354.00	8,106,600	
新日本建設	15,000	1,605.00	24,075,000	
東亜道路工業	21,000	1,256.00	26,376,000	
日本道路	12,600	1,774.00	22,352,400	
東亜建設工業	32,400	975.00	31,590,000	
日本国土開発	30,500	473.00	14,426,500	
若築建設	3,700	3,135.00	11,599,500	
東洋建設	27,000	1,508.00	40,716,000	
五洋建設	152,000	653.50	99,332,000	
世紀東急工業	13,800	1,693.00	23,363,400	
福田組	4,000	6,000.00	24,000,000	
住友林業	92,600	6,088.00	563,748,800	
日本基礎技術	2,100	585.00	1,228,500	
巴コーポレーション	4,500	822.00	3,699,000	
大和ハウス工業	296,500	4,181.00	1,239,666,500	

ライト工業	19,800	2,117.00	41,916,600	
積水ハウス	325,100	3,765.00	1,224,001,500	
日特建設	10,200	1,113.00	11,352,600	
北陸電気工事	7,300	1,105.00	8,066,500	
ユアテック	23,600	1,407.00	33,205,200	
日本リーテック	8,400	1,219.00	10,239,600	
四電工	4,500	3,555.00	15,997,500	
中電工	16,600	3,245.00	53,867,000	
関電工	67,100	1,731.00	116,150,100	
きんでん	74,500	3,088.00	230,056,000	
東京エネシス	10,000	1,240.00	12,400,000	
トーエネック	3,600	4,670.00	16,812,000	
住友電設	10,200	4,055.00	41,361,000	
日本電設工業	20,100	1,981.00	39,818,100	
エクシオグループ	104,800	1,612.50	168,990,000	
新日本空調	6,900	4,115.00	28,393,500	
九電工	23,200	5,609.00	130,128,800	
三機工業	23,200	2,279.00	52,872,800	
日揮ホールディングス	106,100	1,240.50	131,617,050	
中外炉工業	3,500	3,010.00	10,535,000	
ヤマト	3,000	987.00	2,961,000	
太平電業	6,800	5,040.00	34,272,000	
高砂熱学工業	28,700	5,220.00	149,814,000	
三晃金属工業	500	4,395.00	2,197,500	
朝日工業社	10,000	1,291.00	12,910,000	
明星工業	20,700	1,335.00	27,634,500	
大氣社	12,400	4,935.00	61,194,000	
ダイダン	14,100	2,817.00	39,719,700	
日比谷総合設備	7,800	3,105.00	24,219,000	
フィル・カンパニー	1,700	601.00	1,021,700	
テスホールディングス	23,100	397.00	9,170,700	
インフロニア・ホールディングス	123,600	1,266.00	156,477,600	
東洋エンジニアリング	15,800	784.00	12,387,200	
レイズネクスト	15,500	1,783.00	27,636,500	
ニップン	32,200	2,300.00	74,060,000	
日清製粉グループ本社	99,500	1,823.50	181,438,250	
日東富士製粉	1,900	7,070.00	13,433,000	
昭和産業	10,100	3,210.00	32,421,000	
鳥越製粉	3,200	695.00	2,224,000	
中部飼料	14,900	1,506.00	22,439,400	
フィード・ワン	15,700	943.00	14,805,100	
東洋精糖	700	1,576.00	1,103,200	

日本甜菜製糖	6,300	2,814.00	17,728,200	
DM三井製糖ホールディングス	10,700	3,210.00	34,347,000	
塩水港精糖	4,700	281.00	1,320,700	
ウェルネオシュガー	5,400	2,245.00	12,123,000	
森永製菓	45,500	2,813.50	128,014,250	
中村屋	2,700	3,350.00	9,045,000	
江崎グリコ	30,800	4,573.00	140,848,400	
名糖産業	4,200	2,006.00	8,425,200	
井村屋グループ	6,200	2,566.00	15,909,200	
不二家	7,400	2,687.00	19,883,800	
山崎製パン	72,000	3,653.00	263,016,000	
第一屋製パン	700	638.00	446,600	
モロゾフ	3,500	4,655.00	16,292,500	
亀田製菓	6,200	4,320.00	26,784,000	
寿スピリッツ	50,900	1,930.50	98,262,450	
カルビー	49,300	3,294.00	162,394,200	
森永乳業	37,600	3,478.00	130,772,800	
六甲バター	7,900	1,455.00	11,494,500	
ヤクルト本社	153,800	2,860.00	439,868,000	
明治ホールディングス	131,900	3,752.00	494,888,800	
雪印メグミルク	26,000	2,799.00	72,774,000	
プリマハム	14,500	2,450.00	35,525,000	
日本ハム	46,300	4,933.00	228,397,900	
林兼産業	1,200	515.00	618,000	
丸大食品	10,800	1,702.00	18,381,600	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	11,900	3,000.00	35,700,000	
柿安本店	4,200	2,628.00	11,037,600	
伊藤ハム米久ホールディングス	16,400	4,325.00	70,930,000	
サッポロホールディングス	35,400	6,256.00	221,462,400	
アサヒグループホールディングス	248,700	5,629.00	1,399,932,300	
キリンホールディングス	448,300	2,106.00	944,119,800	
宝ホールディングス	72,600	1,122.50	81,493,500	
オエノンホールディングス	32,200	413.00	13,298,600	
養命酒製造	3,500	2,383.00	8,340,500	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	84,300	2,175.00	183,352,500	
ライフドリンク　カンパニー	2,100	6,950.00	14,595,000	
サントリー食品インターナショナル	75,800	5,498.00	416,748,400	
ダイドーグループホールディングス	12,200	2,662.00	32,476,400	
伊藤園	36,500	3,536.00	129,064,000	
キーコーヒー	12,100	2,072.00	25,071,200	
ユニカフェ	1,200	923.00	1,107,600	
日清オイリオグループ	15,200	5,080.00	77,216,000	

不二製油グループ本社	25,100	3,106.00	77,960,600	
かどや製油	400	3,610.00	1,444,000	
Ｊ－オイルミルズ	12,300	2,004.00	24,649,200	
キッコーマン	356,600	1,933.50	689,486,100	
味の素	253,000	6,195.00	1,567,335,000	
ブルドックソース	5,700	2,025.00	11,542,500	
キユーピー	57,800	3,833.00	221,547,400	
ハウス食品グループ本社	37,100	2,880.00	106,848,000	
カゴメ	46,300	3,364.00	155,753,200	
アリアケジャパン	10,700	5,280.00	56,496,000	
ピエトロ	500	1,798.00	899,000	
エバラ食品工業	2,500	2,900.00	7,250,000	
やまみ	500	3,370.00	1,685,000	
ニチレイ	49,300	3,851.00	189,854,300	
東洋水産	54,400	9,449.00	514,025,600	
イートアンドホールディングス	5,100	2,089.00	10,653,900	
大冷	500	1,945.00	972,500	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,900	1,497.00	7,335,300	
日清食品ホールディングス	113,500	4,326.00	491,001,000	
一正蒲鉾	1,500	761.00	1,141,500	
フジッコ	11,100	1,842.00	20,446,200	
ロック・フィールド	13,100	1,493.00	19,558,300	
日本たばこ産業	654,000	4,360.00	2,851,440,000	
ケンコーマヨネーズ	7,400	2,091.00	15,473,400	
わらべや日洋ホールディングス	7,200	2,546.00	18,331,200	
なとり	6,800	2,162.00	14,701,600	
イフジ産業	700	1,414.00	989,800	
ファーマフーズ	14,300	1,081.00	15,458,300	
ユーグレナ	67,000	519.00	34,773,000	
紀文食品	9,300	1,233.00	11,466,900	
ピックルスホールディングス	6,300	1,117.00	7,037,100	
ミヨシ油脂	1,400	1,515.00	2,121,000	
理研ビタミン	9,300	2,794.00	25,984,200	
片倉工業	10,200	2,027.00	20,675,400	
グンゼ	7,800	5,490.00	42,822,000	
東洋紡	47,600	1,013.00	48,218,800	
ユニチカ	36,600	290.00	10,614,000	
富士紡ホールディングス	4,900	4,330.00	21,217,000	
倉敷紡績	7,800	4,485.00	34,983,000	
シキボウ	5,100	1,116.00	5,691,600	
日本毛織	28,300	1,305.00	36,931,500	
トーア紡コーポレーション	1,400	428.00	599,200	

帝国繊維	12,500	2,417.00	30,212,500	
帝人	105,400	1,392.00	146,716,800	
東レ	734,000	763.70	560,555,800	
住江織物	800	2,295.00	1,836,000	
日本フエルト	2,600	495.00	1,287,000	
イチカワ	600	1,784.00	1,070,400	
日東製網	400	1,473.00	589,200	
アツギ	2,600	654.00	1,700,400	
ダイニック	1,100	795.00	874,500	
セーレン	21,300	2,294.00	48,862,200	
ソトー	1,200	713.00	855,600	
東海染工	400	831.00	332,400	
小松マテーレ	15,900	729.00	11,591,100	
ワコールホールディングス	20,400	4,273.00	87,169,200	
ホギメディカル	14,500	4,110.00	59,595,000	
ＴＳＩホールディングス	32,900	860.00	28,294,000	
マツオカコーポレーション	1,100	1,618.00	1,779,800	
ワールド	15,500	2,213.00	34,301,500	
三陽商会	4,600	2,450.00	11,270,000	
ナイガイ	1,400	261.00	365,400	
オンワードホールディングス	64,600	546.00	35,271,600	
ルックホールディングス	3,100	2,715.00	8,416,500	
ゴールドウイン	19,400	9,236.00	179,178,400	
デサント	18,900	3,915.00	73,993,500	
キング	1,400	749.00	1,048,600	
ヤマトインターナショナル	3,000	378.00	1,134,000	
特種東海製紙	5,800	3,765.00	21,837,000	
王子ホールディングス	456,100	626.90	285,929,090	
日本製紙	61,800	945.00	58,401,000	
三菱製紙	4,900	692.00	3,390,800	
北越コーポレーション	53,800	1,070.00	57,566,000	
中越パルプ工業	1,500	1,494.00	2,241,000	
大王製紙	48,400	868.50	42,035,400	
阿波製紙	1,000	532.00	532,000	
レンゴー	99,700	1,029.00	102,591,300	
トーモク	6,300	2,666.00	16,795,800	
ザ・パック	8,100	3,855.00	31,225,500	
北の達人コーポレーション	46,100	175.00	8,067,500	
クラレ	159,600	1,829.00	291,908,400	
旭化成	740,700	1,038.50	769,216,950	
共和レザー	2,100	765.00	1,606,500	
巴川コーポレーション	1,000	947.00	947,000	

レゾナック・ホールディングス	105,800	3,517.00	372,098,600	
住友化学	812,500	369.30	300,056,250	
住友精化	5,100	5,110.00	26,061,000	
日産化学	51,100	4,715.00	240,936,500	
ラサ工業	4,200	2,770.00	11,634,000	
クレハ	23,900	2,867.00	68,521,300	
多木化学	4,300	4,170.00	17,931,000	
テイカ	8,800	1,565.00	13,772,000	
石原産業	18,200	1,526.00	27,773,200	
片倉コープアグリ	900	1,139.00	1,025,100	
日本曹達	12,800	5,280.00	67,584,000	
東ソー	146,200	2,001.00	292,546,200	
トクヤマ	35,400	2,743.00	97,102,200	
セントラル硝子	11,700	3,730.00	43,641,000	
東亞合成	52,600	1,480.00	77,848,000	
大阪ソーダ	7,600	10,020.00	76,152,000	
関東電化工業	21,200	898.00	19,037,600	
デンカ	39,800	2,142.00	85,251,600	
信越化学工業	981,800	6,230.00	6,116,614,000	
日本カーバイド工業	4,100	1,822.00	7,470,200	
堺化学工業	8,300	2,720.00	22,576,000	
第一稀元素化学工業	11,600	843.00	9,778,800	
エア・ウォーター	103,300	2,086.50	215,535,450	
日本酸素ホールディングス	106,200	4,378.00	464,943,600	
日本化学工業	4,000	2,443.00	9,772,000	
東邦アセチレン	3,800	375.00	1,425,000	
日本パーカライジング	48,800	1,229.00	59,975,200	
高圧ガス工業	15,900	914.00	14,532,600	
チタン工業	500	1,007.00	503,500	
四国化成ホールディングス	12,400	2,055.00	25,482,000	
戸田工業	2,500	1,928.00	4,820,000	
ステラ　ケミファ	5,900	4,060.00	23,954,000	
保土谷化学工業	3,400	4,760.00	16,184,000	
日本触媒	63,800	1,594.50	101,729,100	
大日精化工業	7,600	3,075.00	23,370,000	
カネカ	27,000	4,162.00	112,374,000	
三菱瓦斯化学	79,900	2,784.00	222,441,600	
三井化学	90,300	4,242.00	383,052,600	
東京応化工業	52,200	3,809.00	198,829,800	
大阪有機化学工業	9,200	3,375.00	31,050,000	
三菱ケミカルグループ	800,400	857.00	685,942,800	
ＫＨネオケム	16,700	2,170.00	36,239,000	

ダイセル	135,800	1,395.50	189,508,900	
住友ベークライト	30,700	4,122.00	126,545,400	
積水化学工業	218,000	2,215.50	482,979,000	
日本ゼオン	75,000	1,321.50	99,112,500	
アイカ工業	27,600	3,388.00	93,508,800	
ＵＢＥ	52,100	2,646.50	137,882,650	
積水樹脂	16,300	2,521.00	41,092,300	
タキロンシーアイ	27,900	850.00	23,715,000	
旭有機材	7,300	4,695.00	34,273,500	
ニチバン	5,900	1,885.00	11,121,500	
リケンテクノス	20,500	968.00	19,844,000	
大倉工業	5,100	2,817.00	14,366,700	
積水化成品工業	15,400	439.00	6,760,600	
群栄化学工業	2,600	3,005.00	7,813,000	
タイガースポリマー	1,700	829.00	1,409,300	
ミライアル	1,200	1,412.00	1,694,400	
ダイキアクシス	1,500	730.00	1,095,000	
ダイキョーニシカワ	24,200	686.00	16,601,200	
竹本容器	1,400	846.00	1,184,400	
森六ホールディングス	5,700	2,635.00	15,019,500	
恵和	7,900	1,523.00	12,031,700	
日本化薬	83,600	1,239.50	103,622,200	
カーリット	11,800	1,395.00	16,461,000	
日本精化	6,800	2,660.00	18,088,000	
扶桑化学工業	11,600	3,645.00	42,282,000	
トリケミカル研究所	13,300	3,555.00	47,281,500	
ＡＤＥＫＡ	38,200	3,061.00	116,930,200	
日油	99,100	2,153.50	213,411,850	
新日本理化	5,000	212.00	1,060,000	
ハリマ化成グループ	6,400	930.00	5,952,000	
花王	247,600	6,731.00	1,666,595,600	
第一工業製薬	4,400	3,435.00	15,114,000	
石原ケミカル	4,900	2,413.00	11,823,700	
日華化学	1,500	1,008.00	1,512,000	
ニイタカ	700	1,905.00	1,333,500	
三洋化成工業	6,700	4,010.00	26,867,000	
有機合成薬品工業	2,900	301.00	872,900	
大日本塗料	12,100	1,200.00	14,520,000	
日本ペイントホールディングス	581,400	920.00	534,888,000	
関西ペイント	94,600	2,378.00	224,958,800	
神東塗料	3,000	139.00	417,000	
中国塗料	22,500	1,988.00	44,730,000	

日本特殊塗料	2,600	1,210.00	3,146,000	
藤倉化成	12,600	529.00	6,665,400	
太陽ホールディングス	19,100	3,330.00	63,603,000	
ＤＩＣ	42,800	2,926.00	125,232,800	
サカタインクス	24,400	1,715.00	41,846,000	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	21,800	3,080.00	67,144,000	
富士フイルムホールディングス	610,100	3,488.00	2,128,028,800	
資生堂	228,900	4,532.00	1,037,374,800	
ライオン	139,500	1,285.00	179,257,500	
高砂香料工業	8,100	3,675.00	29,767,500	
マンダム	23,700	1,243.00	29,459,100	
ミルボン	14,900	3,257.00	48,529,300	
ファンケル	47,600	2,775.00	132,090,000	
コーセー	22,300	9,916.00	221,126,800	
コタ	11,100	1,614.00	17,915,400	
シーボン	500	1,393.00	696,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	56,200	1,381.00	77,612,200	
ノエビアホールディングス	9,800	5,800.00	56,840,000	
アジュバンホールディングス	900	869.00	782,100	
新日本製薬	6,300	1,744.00	10,987,200	
Ｉ－ｎｅ	2,900	1,630.00	4,727,000	
アクシージア	6,900	964.00	6,651,600	
エステー	8,500	1,548.00	13,158,000	
アグロ　カネショウ	4,400	1,170.00	5,148,000	
コニシ	31,700	1,176.00	37,279,200	
長谷川香料	20,900	3,185.00	66,566,500	
小林製薬	31,900	5,908.00	188,465,200	
荒川化学工業	9,300	1,146.00	10,657,800	
メック	9,000	3,785.00	34,065,000	
日本高純度化学	2,500	3,300.00	8,250,000	
タカラバイオ	29,500	1,139.00	33,600,500	
ＪＣＵ	12,100	3,615.00	43,741,500	
新田ゼラチン	2,500	736.00	1,840,000	
ＯＡＴアグリオ	3,800	1,757.00	6,676,600	
デクセリアルズ	27,100	6,907.00	187,179,700	
アース製薬	10,000	4,945.00	49,450,000	
北興化学工業	11,000	1,553.00	17,083,000	
大成ラミック	3,200	2,787.00	8,918,400	
クミアイ化学工業	43,600	783.00	34,138,800	
日本農薬	20,100	700.00	14,070,000	
アキレス	6,900	1,508.00	10,405,200	
有沢製作所	19,200	1,559.00	29,932,800	

日東電工	70,400	12,725.00	895,840,000	
レック	14,000	1,066.00	14,924,000	
三光合成	13,800	674.00	9,301,200	
きもと	6,000	211.00	1,266,000	
藤森工業	8,700	4,370.00	38,019,000	
前澤化成工業	7,100	1,835.00	13,028,500	
未来工業	3,900	3,695.00	14,410,500	
ウェーブロックホールディングス	1,400	637.00	891,800	
ＪＳＰ	7,700	2,237.00	17,224,900	
エフピコ	20,700	2,432.50	50,352,750	
天馬	7,300	2,700.00	19,710,000	
信越ポリマー	23,600	1,447.00	34,149,200	
東リ	8,100	416.00	3,369,600	
ニフコ	32,800	3,718.00	121,950,400	
バルカー	9,200	3,535.00	32,522,000	
ユニ・チャーム	228,400	5,018.00	1,146,111,200	
ショーエイコーポレーション	1,100	590.00	649,000	
協和キリン	132,400	3,116.00	412,558,400	
武田薬品工業	970,200	4,239.00	4,112,677,800	
アステラス製薬	961,600	1,664.00	1,600,102,400	
住友ファーマ	81,300	410.00	33,333,000	
塩野義製薬	133,300	6,705.00	893,776,500	
わかもと製薬	3,800	248.00	942,400	
日本新薬	28,700	3,415.00	98,010,500	
中外製薬	343,100	6,026.00	2,067,520,600	
科研製薬	18,800	4,051.00	76,158,800	
エーザイ	133,300	6,599.00	879,646,700	
ロート製薬	106,200	3,472.00	368,726,400	
小野薬品工業	224,200	2,243.50	502,992,700	
久光製薬	24,400	4,154.00	101,357,600	
持田製薬	12,300	3,460.00	42,558,000	
参天製薬	193,400	1,779.00	344,058,600	
扶桑薬品工業	3,900	2,250.00	8,775,000	
日本ケミファ	400	1,577.00	630,800	
ツムラ	34,500	3,914.00	135,033,000	
キッセイ薬品工業	18,100	3,255.00	58,915,500	
生化学工業	18,600	866.00	16,107,600	
栄研化学	18,900	2,412.00	45,586,800	
鳥居薬品	5,900	3,675.00	21,682,500	
ＪＣＲファーマ	37,100	612.00	22,705,200	
東和薬品	16,800	3,030.00	50,904,000	
富士製薬工業	8,100	1,382.00	11,194,200	

ゼリア新薬工業	15,200	2,150.00	32,680,000	
ネクセラファーマ	48,000	1,687.00	80,976,000	
第一三共	955,000	5,796.00	5,535,180,000	
杏林製薬	23,800	1,707.00	40,626,600	
大幸薬品	22,800	439.00	10,009,200	
ダイト	8,300	2,298.00	19,073,400	
大塚ホールディングス	228,000	7,407.00	1,688,796,000	
ペプチドリーム	53,100	2,638.00	140,077,800	
セルソース	4,000	1,477.00	5,908,000	
あすか製薬ホールディングス	11,200	2,335.00	26,152,000	
サワイグループホールディングス	25,100	6,683.00	167,743,300	
日本コークス工業	111,200	109.00	12,120,800	
ニチレキ	14,200	2,369.00	33,639,800	
ユシロ化学工業	5,700	1,749.00	9,969,300	
ビーピー・カストロール	1,400	940.00	1,316,000	
富士石油	32,000	444.00	14,208,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	1,300	1,307.00	1,699,100	
出光興産	569,200	955.00	543,586,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,735,500	760.30	1,319,500,650	
コスモエネルギーホールディングス	32,500	7,502.00	243,815,000	
横浜ゴム	55,400	3,331.00	184,537,400	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	63,000	2,396.00	150,948,000	
ブリヂストン	320,900	6,034.00	1,936,310,600	
住友ゴム工業	107,500	1,517.00	163,077,500	
藤倉コンポジット	9,100	1,290.00	11,739,000	
オカモト	5,100	4,925.00	25,117,500	
フコク	5,800	2,020.00	11,716,000	
ニッタ	11,100	3,905.00	43,345,500	
住友理工	17,000	1,406.00	23,902,000	
三ツ星ベルト	12,700	4,345.00	55,181,500	
バンドー化学	16,300	1,895.00	30,888,500	
日東紡績	13,900	5,150.00	71,585,000	
ＡＧＣ	97,800	5,166.00	505,234,800	
日本板硝子	52,300	404.00	21,129,200	
石塚硝子	600	2,773.00	1,663,800	
日本山村硝子	1,400	1,454.00	2,035,600	
日本電気硝子	44,800	3,537.00	158,457,600	
オハラ	5,200	1,347.00	7,004,400	
住友大阪セメント	18,300	4,107.00	75,158,100	
太平洋セメント	62,800	3,984.00	250,195,200	
日本ヒューム	9,600	1,192.00	11,443,200	
日本コンクリート工業	21,400	367.00	7,853,800	

三谷セキサン	4,600	5,300.00	24,380,000	
アジアパイルホールディングス	15,600	943.00	14,710,800	
東海カーボン	101,200	937.70	94,895,240	
日本カーボン	5,800	4,890.00	28,362,000	
東洋炭素	7,700	5,910.00	45,507,000	
ノリタケ	12,100	3,935.00	47,613,500	
ＴＯＴＯ	72,400	4,050.00	293,220,000	
日本碍子	127,500	2,000.00	255,000,000	
日本特殊陶業	91,800	4,358.00	400,064,400	
ＭＡＲＵＷＡ	4,000	35,350.00	141,400,000	
品川リフラクトリーズ	13,500	1,805.00	24,367,500	
黒崎播磨	9,000	2,501.00	22,509,000	
ヨータイ	6,400	1,767.00	11,308,800	
東京窯業	4,000	423.00	1,692,000	
ニッカトー	1,700	583.00	991,100	
フジミインコーポレーテッド	29,500	2,910.00	85,845,000	
クニミネ工業	1,100	1,100.00	1,210,000	
エーアンドエーマテリアル	800	1,359.00	1,087,200	
ニチアス	27,700	4,580.00	126,866,000	
ニチハ	13,700	3,575.00	48,977,500	
日本製鉄	511,200	3,232.00	1,652,198,400	
神戸製鋼所	226,800	1,832.00	415,497,600	
中山製鋼所	25,800	910.00	23,478,000	
合同製鐵	6,300	4,745.00	29,893,500	
ＪＦＥホールディングス	313,600	2,150.00	674,240,000	
東京製鐵	31,700	1,457.00	46,186,900	
共英製鋼	12,900	1,988.00	25,645,200	
大和工業	21,300	7,751.00	165,096,300	
東京鐵鋼	5,000	4,600.00	23,000,000	
大阪製鐵	5,200	2,360.00	12,272,000	
淀川製鋼所	11,700	5,500.00	64,350,000	
中部鋼鈑	7,400	2,443.00	18,078,200	
丸一鋼管	34,300	3,569.00	122,416,700	
モリ工業	1,800	5,340.00	9,612,000	
大同特殊鋼	71,100	1,370.50	97,442,550	
日本高周波鋼業	1,500	443.00	664,500	
日本冶金工業	8,200	4,785.00	39,237,000	
山陽特殊製鋼	11,100	1,941.00	21,545,100	
愛知製鋼	6,500	3,220.00	20,930,000	
日本金属	1,000	778.00	778,000	
大平洋金属	9,600	1,229.00	11,798,400	
新日本電工	56,200	280.00	15,736,000	

栗本鐵工所	5,200	4,745.00	24,674,000	
虹技	500	1,132.00	566,000	
三菱製鋼	8,400	1,400.00	11,760,000	
日亜鋼業	3,800	320.00	1,216,000	
日本精線	8,800	1,180.00	10,384,000	
エンビプロ・ホールディングス	9,500	448.00	4,256,000	
シンニッタン	4,800	231.00	1,108,800	
新家工業	800	5,300.00	4,240,000	
大紀アルミニウム工業所	14,500	1,188.00	17,226,000	
日本軽金属ホールディングス	33,100	1,707.00	56,501,700	
三井金属鉱業	32,900	4,884.00	160,683,600	
三菱マテリアル	80,700	2,687.00	216,840,900	
住友金属鉱山	130,800	4,505.00	589,254,000	
ＤＯＷＡホールディングス	27,900	5,332.00	148,762,800	
古河機械金属	15,000	1,774.00	26,610,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,700	2,418.00	47,634,600	
東邦チタニウム	23,500	1,339.00	31,466,500	
ＵＡＣＪ	15,900	4,025.00	63,997,500	
ＣＫサンエツ	2,800	3,555.00	9,954,000	
古河電気工業	37,600	3,702.00	139,195,200	
住友電気工業	422,000	2,252.50	950,555,000	
フジクラ	133,100	2,859.50	380,599,450	
ＳＷＣＣ	12,700	4,300.00	54,610,000	
タツタ電線	20,100	737.00	14,813,700	
カナレ電気	700	1,598.00	1,118,600	
平河ヒューテック	7,100	1,394.00	9,897,400	
リョービ	12,100	2,044.00	24,732,400	
アーレスティ	4,100	715.00	2,931,500	
ＡＲＥホールディングス	42,500	2,038.00	86,615,000	
稲葉製作所	6,300	1,757.00	11,069,100	
宮地エンジニアリンググループ	5,700	4,825.00	27,502,500	
トーカロ	32,500	1,888.00	61,360,000	
アルファＣｏ	1,400	1,347.00	1,885,800	
ＳＵＭＣＯ	200,400	2,281.00	457,112,400	
川田テクノロジーズ	8,000	2,662.00	21,296,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	7,500	3,140.00	23,550,000	
ジェイテックコーポレーション	600	1,562.00	937,200	
信和	2,400	753.00	1,807,200	
東洋製罐グループホールディングス	64,700	2,450.00	158,515,000	
ホッカンホールディングス	5,500	1,668.00	9,174,000	
コロナ	6,300	945.00	5,953,500	
横河ブリッジホールディングス	17,600	2,716.00	47,801,600	

駒井ハルテック	700	1,760.00	1,232,000	
高田機工	300	3,580.00	1,074,000	
三和ホールディングス	112,300	3,009.00	337,910,700	
文化シヤッター	29,500	1,622.00	47,849,000	
三協立山	13,900	741.00	10,299,900	
アルインコ	8,600	1,040.00	8,944,000	
東洋シヤッター	900	918.00	826,200	
ＬＩＸＩＬ	176,100	1,746.50	307,558,650	
日本フイルコン	2,400	525.00	1,260,000	
ノーリツ	17,900	1,813.00	32,452,700	
長府製作所	11,200	2,116.00	23,699,200	
リンナイ	54,000	3,615.00	195,210,000	
ダイニチ工業	1,900	671.00	1,274,900	
日東精工	16,300	605.00	9,861,500	
三洋工業	400	3,215.00	1,286,000	
岡部	20,100	773.00	15,537,300	
ジーテクト	14,300	1,796.00	25,682,800	
東プレ	19,900	2,025.00	40,297,500	
高周波熱錬	16,700	1,066.00	17,802,200	
東京製綱	7,300	1,234.00	9,008,200	
サンコール	8,600	474.00	4,076,400	
モリテック　スチール	3,300	222.00	732,600	
パイオラックス	14,000	2,401.00	33,614,000	
エイチワン	11,600	956.00	11,089,600	
日本発條	99,800	1,607.00	160,378,600	
中央発條	8,400	1,178.00	9,895,200	
アドバネクス	500	1,029.00	514,500	
立川ブラインド工業	5,100	1,361.00	6,941,100	
三益半導体工業	8,700	3,695.00	32,146,500	
日本ドライケミカル	900	2,688.00	2,419,200	
日本製鋼所	30,400	4,156.00	126,342,400	
三浦工業	46,100	3,443.00	158,722,300	
タクマ	37,300	1,701.00	63,447,300	
ツガミ	23,600	1,442.00	34,031,200	
オークマ	9,700	7,153.00	69,384,100	
芝浦機械	10,400	3,605.00	37,492,000	
アマダ	167,300	1,706.00	285,413,800	
アイダエンジニアリング	25,600	854.00	21,862,400	
ＦＵＪＩ	52,000	2,462.50	128,050,000	
牧野フライス製作所	12,200	6,390.00	77,958,000	
オーエスジー	48,700	1,945.00	94,721,500	
ダイジェット工業	400	850.00	340,000	

旭ダイヤモンド工業	25,500	915.00	23,332,500	
DMG森精機	75,400	3,697.00	278,753,800	
ソディック	26,900	708.00	19,045,200	
ディスコ	53,200	46,850.00	2,492,420,000	
日東工器	5,100	2,245.00	11,449,500	
日進工具	10,100	924.00	9,332,400	
パンチ工業	3,600	450.00	1,620,000	
冨士ダイス	5,700	825.00	4,702,500	
豊和工業	2,000	858.00	1,716,000	
リケンＮＰＲ	12,000	2,739.00	32,868,000	
東洋機械金属	3,100	700.00	2,170,000	
エンシュウ	900	691.00	621,900	
島精機製作所	17,600	1,586.00	27,913,600	
オプトラン	18,100	1,893.00	34,263,300	
イワキポンプ	7,400	2,885.00	21,349,000	
フリュー	10,400	1,033.00	10,743,200	
ヤマシンフィルタ	26,300	417.00	10,967,100	
日阪製作所	12,000	1,033.00	12,396,000	
やまびこ	18,000	2,108.00	37,944,000	
野村マイクロ・サイエンス	14,900	3,460.00	51,554,000	
平田機工	5,300	6,070.00	32,171,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	12,200	563.00	6,868,600	
マルマエ	4,800	1,695.00	8,136,000	
タツモ	6,700	3,060.00	20,502,000	
ナブテスコ	69,300	2,704.50	187,421,850	
三井海洋開発	14,000	2,744.00	38,416,000	
レオン自動機	12,800	1,558.00	19,942,400	
ＳＭＣ	33,000	70,010.00	2,310,330,000	
ホソカワミクロン	7,400	4,000.00	29,600,000	
ユニオンツール	4,900	5,420.00	26,558,000	
瑞光	8,000	1,028.00	8,224,000	
オイレス工業	15,000	2,277.00	34,155,000	
日精エー・エス・ビー機械	3,800	5,100.00	19,380,000	
サトーホールディングス	15,700	2,092.00	32,844,400	
技研製作所	10,400	1,780.00	18,512,000	
日本エアーテック	5,200	1,202.00	6,250,400	
カワタ	1,200	865.00	1,038,000	
日精樹脂工業	8,200	1,019.00	8,355,800	
オカダアイヨン	1,200	2,302.00	2,762,400	
ワイエイシイホールディングス	4,700	2,206.00	10,368,200	
小松製作所	517,500	4,500.00	2,328,750,000	
住友重機械工業	65,300	3,944.00	257,543,200	

日立建機	44,000	4,136.00	181,984,000	
日工	16,400	764.00	12,529,600	
巴工業	4,300	4,350.00	18,705,000	
井関農機	10,400	1,010.00	10,504,000	
ＴＯＷＡ	12,300	8,610.00	105,903,000	
丸山製作所	600	2,405.00	1,443,000	
北川鉄工所	4,400	1,510.00	6,644,000	
ローツェ	5,800	23,110.00	134,038,000	
タカキタ	1,200	478.00	573,600	
クボタ	577,200	2,160.00	1,246,752,000	
荏原実業	5,800	3,960.00	22,968,000	
三菱化工機	3,900	3,810.00	14,859,000	
月島ホールディングス	15,000	1,418.00	21,270,000	
帝国電機製作所	7,600	2,596.00	19,729,600	
新東工業	22,400	1,090.00	24,416,000	
澁谷工業	10,400	3,570.00	37,128,000	
アイチ　コーポレーション	15,300	1,178.00	18,023,400	
小森コーポレーション	27,200	1,252.00	34,054,400	
鶴見製作所	8,400	3,850.00	32,340,000	
日本ギア工業	1,400	510.00	714,000	
酒井重工業	1,500	5,640.00	8,460,000	
荏原製作所	226,500	2,053.50	465,117,750	
石井鐵工所	400	3,125.00	1,250,000	
酉島製作所	9,500	2,966.00	28,177,000	
北越工業	11,100	2,091.00	23,210,100	
ダイキン工業	131,800	21,685.00	2,858,083,000	
オルガノ	13,300	6,680.00	88,844,000	
トーヨーカネツ	3,800	3,650.00	13,870,000	
栗田工業	61,800	6,155.00	380,379,000	
椿本チエイン	15,200	6,190.00	94,088,000	
大同工業	1,600	912.00	1,459,200	
木村化工機	8,500	693.00	5,890,500	
アネスト岩田	17,100	1,483.00	25,359,300	
ダイフク	186,300	2,628.50	489,689,550	
サムコ	2,600	4,180.00	10,868,000	
加藤製作所	1,900	1,200.00	2,280,000	
油研工業	600	2,441.00	1,464,600	
タダノ	63,600	1,135.00	72,186,000	
フジテック	25,800	4,277.00	110,346,600	
ＣＫＤ	30,500	2,722.00	83,021,000	
平和	32,600	2,114.00	68,916,400	
理想科学工業	8,800	2,956.00	26,012,800	

ＳＡＮＫＹＯ	106,300	1,680.00	178,584,000	
日本金銭機械	13,400	983.00	13,172,200	
マースグループホールディングス	5,600	3,560.00	19,936,000	
フクシマガリレイ	7,200	6,560.00	47,232,000	
オーイズミ	1,400	344.00	481,600	
ダイコク電機	5,400	3,630.00	19,602,000	
竹内製作所	20,000	4,770.00	95,400,000	
アマノ	31,300	4,091.00	128,048,300	
ＪＵＫＩ	17,100	493.00	8,430,300	
ジャノメ	11,200	684.00	7,660,800	
マックス	15,600	3,545.00	55,302,000	
グローリー	26,500	2,616.00	69,324,000	
新晃工業	11,100	3,840.00	42,624,000	
大和冷機工業	16,900	1,522.00	25,721,800	
セガサミーホールディングス	98,600	2,448.00	241,372,800	
ＴＰＲ	14,000	2,416.00	33,824,000	
ツバキ・ナカシマ	22,100	763.00	16,862,300	
ホシザキ	65,100	4,683.00	304,863,300	
大豊工業	9,600	746.00	7,161,600	
日本精工	204,400	774.50	158,307,800	
ＮＴＮ	239,500	297.40	71,227,300	
ジェイテクト	98,200	1,041.50	102,275,300	
不二越	8,200	3,250.00	26,650,000	
日本トムソン	30,100	585.00	17,608,500	
ＴＨＫ	63,700	2,703.50	172,212,950	
ユーシン精機	8,800	691.00	6,080,800	
前澤給装工業	7,900	1,394.00	11,012,600	
イーグル工業	12,200	2,031.00	24,778,200	
前澤工業	2,300	1,433.00	3,295,900	
ＰＩＬＬＡＲ	10,200	4,935.00	50,337,000	
キッツ	37,000	1,086.00	40,182,000	
マキタ	125,900	4,434.00	558,240,600	
三井Ｅ＆Ｓ	54,800	1,313.00	71,952,400	
日立造船	97,400	1,051.00	102,367,400	
三菱重工業	1,930,500	1,735.50	3,350,382,750	
ＩＨＩ	82,200	5,046.00	414,781,200	
スター精密	20,300	2,057.00	41,757,100	
日清紡ホールディングス	83,000	1,074.00	89,142,000	
イビデン	57,600	5,974.00	344,102,400	
コニカミノルタ	246,800	440.50	108,715,400	
ブラザー工業	147,500	3,028.00	446,630,000	
ミネベアミツミ	192,100	3,516.00	675,423,600	

日立製作所	2,652,800	3,078.00	8,165,318,400	
三菱電機	1,209,200	2,514.00	3,039,928,800	
富士電機	67,100	7,873.00	528,278,300	
東洋電機製造	1,300	1,205.00	1,566,500	
安川電機	119,900	5,013.00	601,058,700	
シンフォニアテクノロジー	12,200	3,045.00	37,149,000	
明電舎	20,500	3,170.00	64,985,000	
オリジン	800	1,290.00	1,032,000	
山洋電気	4,800	7,250.00	34,800,000	
デンヨー	8,400	2,675.00	22,470,000	
ＰＨＣホールディングス	20,800	1,122.00	23,337,600	
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	57,600	4,095.00	235,872,000	
ソシオネクスト	80,500	3,072.00	247,296,000	
東芝テック	14,100	3,420.00	48,222,000	
芝浦メカトロニクス	6,300	8,100.00	51,030,000	
マブチモーター	54,300	2,248.00	122,066,400	
ニデック	243,700	6,943.00	1,692,009,100	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,300	396.00	2,890,800	
トレックス・セミコンダクター	5,700	1,836.00	10,465,200	
東光高岳	6,700	1,894.00	12,689,800	
ダブル・スコープ	31,600	469.00	14,820,400	
ダイヘン	10,500	7,150.00	75,075,000	
ヤーマン	21,600	823.00	17,776,800	
ＪＶＣケンウッド	87,300	889.00	77,609,700	
ミマキエンジニアリング	10,500	1,640.00	17,220,000	
Ｉ－ＰＥＸ	7,700	1,996.00	15,369,200	
大崎電気工業	23,700	650.00	15,405,000	
オムロン	84,300	5,283.00	445,356,900	
日東工業	14,900	3,350.00	49,915,000	
ＩＤＥＣ	16,300	2,896.00	47,204,800	
正興電機製作所	1,300	1,245.00	1,618,500	
不二電機工業	800	1,157.00	925,600	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	43,100	2,626.50	113,202,150	
サクサ	800	2,556.00	2,044,800	
メルコホールディングス	3,200	3,225.00	10,320,000	
テクノメディカ	2,800	1,740.00	4,872,000	
日本電気	145,000	12,420.00	1,800,900,000	
富士通	1,015,900	2,435.50	2,474,224,450	
沖電気工業	49,900	1,004.00	50,099,600	
岩崎通信機	1,700	1,447.00	2,459,900	
電気興業	4,500	2,043.00	9,193,500	
サンケン電気	10,300	7,367.00	75,880,100	

ナカヨ	600	1,224.00	734,400	
アイホン	6,000	3,020.00	18,120,000	
ルネサスエレクトロニクス	688,200	2,583.50	1,777,964,700	
セイコーエプソン	141,600	2,541.50	359,876,400	
ワコム	77,700	723.00	56,177,100	
アルバック	24,200	8,786.00	212,621,200	
アクセル	4,300	1,416.00	6,088,800	
ＥＩＺＯ	8,100	4,855.00	39,325,500	
日本信号	25,100	1,020.00	25,602,000	
京三製作所	23,100	633.00	14,622,300	
能美防災	15,000	2,432.00	36,480,000	
ホーチキ	8,300	2,206.00	18,309,800	
星和電機	1,800	559.00	1,006,200	
エレコム	26,500	1,640.00	43,460,000	
パナソニック　ホールディングス	1,304,100	1,210.50	1,578,613,050	
シャープ	186,100	873.90	162,632,790	
アンリツ	77,700	1,246.00	96,814,200	
富士通ゼネラル	31,300	2,040.00	63,852,000	
ソニーグループ	765,400	13,415.00	10,267,841,000	
ＴＤＫ	174,800	9,541.00	1,667,766,800	
帝国通信工業	4,900	2,119.00	10,383,100	
タムラ製作所	44,000	676.00	29,744,000	
アルプスアルパイン	98,700	1,520.50	150,073,350	
池上通信機	1,200	769.00	922,800	
日本電波工業	13,300	1,403.00	18,659,900	
鈴木	6,000	1,407.00	8,442,000	
メイコー	11,000	5,950.00	65,450,000	
日本トリム	2,500	3,330.00	8,325,000	
ローランド　ディー．ジー．	2,500	5,340.00	13,350,000	
フォスター電機	8,200	1,594.00	13,070,800	
ＳＭＫ	2,800	2,437.00	6,823,600	
ヨコオ	9,800	1,875.00	18,375,000	
ホシデン	25,200	2,052.00	51,710,400	
ヒロセ電機	16,300	18,220.00	296,986,000	
日本航空電子工業	26,400	2,471.00	65,234,400	
ＴＯＡ	12,600	1,033.00	13,015,800	
マクセル	24,400	1,706.00	41,626,400	
古野電気	14,400	1,881.00	27,086,400	
スミダコーポレーション	15,000	1,040.00	15,600,000	
アイコム	4,200	3,085.00	12,957,000	
リオン	4,600	2,615.00	12,029,000	
横河電機	120,800	3,770.00	455,416,000	

新電元工業	4,200	2,824.00	11,860,800	
アズビル	75,200	4,286.00	322,307,200	
東亜ディーケーケー	1,800	845.00	1,521,000	
日本光電工業	93,800	2,290.50	214,848,900	
チノー	4,500	2,401.00	10,804,500	
共和電業	3,400	436.00	1,482,400	
日本電子材料	6,700	3,065.00	20,535,500	
堀場製作所	20,900	11,395.00	238,155,500	
アドバンテスト	313,200	5,708.00	1,787,745,600	
小野測器	1,700	599.00	1,018,300	
エスペック	8,800	2,822.00	24,833,600	
キーエンス	109,300	65,440.00	7,152,592,000	
日置電機	5,200	7,940.00	41,288,000	
シスメックス	283,000	2,412.50	682,737,500	
日本マイクロニクス	19,700	5,680.00	111,896,000	
メガチップス	8,700	4,160.00	36,192,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	6,400	3,995.00	25,568,000	
澤藤電機	500	1,246.00	623,000	
原田工業	1,800	581.00	1,045,800	
コーセル	11,800	1,204.00	14,207,200	
イリソ電子工業	10,100	2,885.00	29,138,500	
オプテックスグループ	20,100	1,688.00	33,928,800	
千代田インテグレ	4,300	3,150.00	13,545,000	
レーザーテック	50,100	26,740.00	1,339,674,000	
スタンレー電気	70,000	2,769.00	193,830,000	
ウシオ電機	48,400	2,098.50	101,567,400	
岡谷電機産業	3,300	250.00	825,000	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	3,900	899.00	3,506,100	
エノモト	1,100	1,493.00	1,642,300	
日本セラミック	9,000	2,449.00	22,041,000	
遠藤照明	1,700	1,495.00	2,541,500	
古河電池	8,100	1,384.00	11,210,400	
山一電機	9,900	3,055.00	30,244,500	
図研	9,100	3,740.00	34,034,000	
日本電子	27,400	5,885.00	161,249,000	
カシオ計算機	79,000	1,210.00	95,590,000	
ファナック	528,900	4,030.00	2,131,467,000	
日本シイエムケイ	25,800	534.00	13,777,200	
エンプラス	3,200	6,880.00	22,016,000	
大真空	16,500	710.00	11,715,000	
ローム	202,100	1,981.00	400,360,100	
浜松ホトニクス	87,700	4,039.00	354,220,300	

三井ハイテック	9,700	5,562.00	53,951,400	
新光電気工業	38,700	5,676.00	219,661,200	
京セラ	679,200	1,855.00	1,259,916,000	
太陽誘電	53,300	4,352.00	231,961,600	
村田製作所	976,400	3,420.00	3,339,288,000	
双葉電子工業	21,000	581.00	12,201,000	
北陸電気工業	1,400	1,355.00	1,897,000	
ニチコン	28,800	1,110.00	31,968,000	
日本ケミコン	11,700	1,403.00	16,415,100	
ＫＯＡ	16,600	1,285.00	21,331,000	
市光工業	19,900	490.00	9,751,000	
小糸製作所	113,300	2,143.00	242,801,900	
ミツバ	20,500	1,004.00	20,582,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	37,400	13,000.00	486,200,000	
キヤノン電子	12,100	2,200.00	26,620,000	
キヤノン	545,200	4,333.00	2,362,351,600	
リコー	274,000	1,380.00	378,120,000	
象印マホービン	29,800	1,488.00	44,342,400	
ＭＵＴＯＨホールディングス	500	2,509.00	1,254,500	
東京エレクトロン	231,300	29,010.00	6,710,013,000	
イノテック	7,400	1,608.00	11,899,200	
トヨタ紡織	46,000	2,016.00	92,736,000	
芦森工業	800	2,221.00	1,776,800	
ユニプレス	19,600	1,243.00	24,362,800	
豊田自動織機	93,200	12,390.00	1,154,748,000	
モリタホールディングス	19,200	1,722.00	33,062,400	
三櫻工業	16,700	967.00	16,148,900	
デンソー	901,800	2,391.00	2,156,203,800	
東海理化電機製作所	30,800	2,015.00	62,062,000	
川崎重工業	89,200	5,358.00	477,933,600	
名村造船所	30,600	1,914.00	58,568,400	
日本車輌製造	3,600	2,401.00	8,643,600	
三菱ロジスネクスト	17,500	1,299.00	22,732,500	
近畿車輛	500	1,722.00	861,000	
日産自動車	1,438,200	485.00	697,527,000	
いすゞ自動車	306,900	2,065.50	633,901,950	
トヨタ自動車	5,810,400	3,020.00	17,547,408,000	
日野自動車	164,400	402.10	66,105,240	
三菱自動車工業	426,400	425.30	181,347,920	
エフテック	2,600	630.00	1,638,000	
レシップホールディングス	1,600	616.00	985,600	
ＧＭＢ	700	1,393.00	975,100	

ファルテック	700	546.00	382,200	
武蔵精密工業	26,700	2,014.00	53,773,800	
日産車体	11,100	933.00	10,356,300	
新明和工業	31,500	1,428.00	44,982,000	
極東開発工業	18,100	2,474.00	44,779,400	
トピー工業	8,900	2,260.00	20,114,000	
ティラド	2,400	3,640.00	8,736,000	
曙ブレーキ工業	66,700	154.00	10,271,800	
タチエス	20,200	1,991.00	40,218,200	
ＮＯＫ	42,500	2,131.00	90,567,500	
フタバ産業	29,300	795.00	23,293,500	
カヤバ	10,300	5,080.00	52,324,000	
大同メタル工業	21,400	579.00	12,390,600	
プレス工業	43,700	610.00	26,657,000	
ミクニ	4,600	384.00	1,766,400	
太平洋工業	25,100	1,429.00	35,867,900	
アイシン	84,300	5,015.00	422,764,500	
マツダ	361,500	1,320.00	477,180,000	
今仙電機製作所	2,300	604.00	1,389,200	
本田技研工業	2,589,800	1,585.00	4,104,833,000	
スズキ	803,000	1,701.00	1,365,903,000	
ＳＵＢＡＲＵ	339,000	2,903.50	984,286,500	
安永	1,600	573.00	916,800	
ヤマハ発動機	472,400	1,380.00	651,912,000	
ＴＢＫ	4,000	304.00	1,216,000	
エクセディ	17,900	3,075.00	55,042,500	
豊田合成	31,300	2,591.00	81,098,300	
愛三工業	18,100	1,297.00	23,475,700	
盟和産業	500	1,040.00	520,000	
日本プラスト	3,100	411.00	1,274,100	
ヨロズ	10,300	1,105.00	11,381,500	
エフ・シー・シー	19,400	2,263.00	43,902,200	
シマノ	44,100	25,585.00	1,128,298,500	
テイ・エス　テック	38,900	1,937.00	75,349,300	
ジャムコ	6,000	1,512.00	9,072,000	
テルモ	609,300	2,699.00	1,644,500,700	
クリエートメディック	1,200	944.00	1,132,800	
日機装	25,500	1,171.00	29,860,500	
日本エム・ディ・エム	8,700	663.00	5,768,100	
島津製作所	145,200	4,195.00	609,114,000	
ＪＭＳ	10,100	512.00	5,171,200	
長野計器	7,900	2,782.00	21,977,800	

ブイ・テクノロジー	5,800	2,860.00	16,588,000	
東京計器	8,400	3,330.00	27,972,000	
愛知時計電機	4,700	2,150.00	10,105,000	
インターアクション	6,600	1,301.00	8,586,600	
オーバル	3,200	437.00	1,398,400	
東京精密	22,400	10,345.00	231,728,000	
マニー	43,700	2,131.50	93,146,550	
ニコン	158,000	1,654.50	261,411,000	
トプコン	53,100	1,727.50	91,730,250	
オリンパス	625,800	2,582.00	1,615,815,600	
理研計器	15,500	3,895.00	60,372,500	
タムロン	13,200	4,375.00	57,750,000	
ＨＯＹＡ	215,200	18,345.00	3,947,844,000	
シード	2,200	561.00	1,234,200	
ノーリツ鋼機	10,400	3,950.00	41,080,000	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	15,900	2,709.00	43,073,100	
朝日インテック	133,200	2,353.00	313,419,600	
シチズン時計	100,600	1,002.00	100,801,200	
リズム	800	3,680.00	2,944,000	
大研医器	3,100	541.00	1,677,100	
メニコン	37,600	1,377.50	51,794,000	
シンシア	400	445.00	178,000	
松風	4,900	4,840.00	23,716,000	
セイコーグループ	15,200	4,415.00	67,108,000	
ニプロ	91,100	1,298.50	118,293,350	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	5,400	174.00	939,600	
中本パックス	1,200	1,642.00	1,970,400	
パラマウントベッドホールディングス	22,700	2,643.00	59,996,100	
トランザクション	7,200	1,743.00	12,549,600	
粧美堂	1,000	553.00	553,000	
ニホンフラッシュ	10,200	910.00	9,282,000	
前田工繊	19,500	1,605.00	31,297,500	
永大産業	4,300	240.00	1,032,000	
アートネイチャー	9,800	801.00	7,849,800	
フルヤ金属	10,400	4,285.00	44,564,000	
バンダイナムコホールディングス	296,700	3,164.00	938,758,800	
アイフィスジャパン	1,000	613.00	613,000	
ＳＨＯＥＩ	30,700	1,969.00	60,448,300	
フランスベッドホールディングス	14,100	1,178.00	16,609,800	
パイロットコーポレーション	15,400	4,568.00	70,347,200	
萩原工業	7,300	1,531.00	11,176,300	
フジシールインターナショナル	22,100	2,310.00	51,051,000	

タカラトミー	49,700	3,136.00	155,859,200	
広済堂ホールディングス	31,800	544.00	17,299,200	
エステールホールディングス	800	654.00	523,200	
タカノ	1,300	925.00	1,202,500	
プロネクサス	10,100	1,256.00	12,685,600	
ホクシン	2,800	117.00	327,600	
ウッドワン	1,300	910.00	1,183,000	
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	130,300	4,166.00	542,829,800	
大日本印刷	113,300	4,935.00	559,135,500	
共同印刷	3,100	3,730.00	11,563,000	
ＮＩＳＳＨＡ	18,700	1,895.00	35,436,500	
光村印刷	300	1,597.00	479,100	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	6,500	2,960.00	19,240,000	
アシックス	372,500	2,442.50	909,831,250	
ツツミ	2,000	2,136.00	4,272,000	
ローランド	8,100	3,820.00	30,942,000	
小松ウオール工業	4,400	3,290.00	14,476,000	
ヤマハ	68,900	3,470.00	239,083,000	
河合楽器製作所	3,300	2,892.00	9,543,600	
クリナップ	10,700	709.00	7,586,300	
ピジョン	69,600	1,490.00	103,704,000	
キングジム	9,600	871.00	8,361,600	
リンテック	21,900	3,295.00	72,160,500	
イトーキ	20,800	1,476.00	30,700,800	
任天堂	690,100	8,280.00	5,714,028,000	
三菱鉛筆	15,100	2,532.00	38,233,200	
タカラスタンダード	22,300	1,719.00	38,333,700	
コクヨ	44,700	2,580.50	115,348,350	
ナカバヤシ	11,800	541.00	6,383,800	
グローブライド	9,800	2,051.00	20,099,800	
オカムラ	32,900	2,163.00	71,162,700	
美津濃	10,900	7,550.00	82,295,000	
東京電力ホールディングス	985,300	741.00	730,107,300	
中部電力	402,800	1,840.50	741,353,400	
関西電力	422,100	2,560.50	1,080,787,050	
中国電力	189,900	1,025.50	194,742,450	
北陸電力	111,800	911.20	101,872,160	
東北電力	287,800	1,233.00	354,857,400	
四国電力	101,800	1,248.00	127,046,400	
九州電力	252,000	1,512.50	381,150,000	
北海道電力	105,600	992.30	104,786,880	
沖縄電力	27,900	1,077.00	30,048,300	

電源開発	89,800	2,426.50	217,899,700	
エフオン	8,000	392.00	3,136,000	
イーレックス	19,500	686.00	13,377,000	
レノバ	29,200	933.00	27,243,600	
東京瓦斯	212,800	3,309.00	704,155,200	
大阪瓦斯	217,800	3,347.00	728,976,600	
東邦瓦斯	47,300	3,965.00	187,544,500	
北海道瓦斯	6,500	3,235.00	21,027,500	
広島ガス	23,100	396.00	9,147,600	
西部ガスホールディングス	11,400	1,887.00	21,511,800	
静岡ガス	21,800	935.00	20,383,000	
メタウォーター	13,100	1,776.00	23,265,600	
ＳＢＳホールディングス	9,700	2,711.00	26,296,700	
東武鉄道	120,100	2,565.50	308,116,550	
相鉄ホールディングス	39,100	2,405.00	94,035,500	
東急	306,500	1,783.50	546,642,750	
京浜急行電鉄	135,300	1,161.00	157,083,300	
小田急電鉄	180,700	1,493.00	269,785,100	
京王電鉄	52,500	3,732.00	195,930,000	
京成電鉄	70,500	4,521.00	318,730,500	
富士急行	13,500	3,185.00	42,997,500	
東日本旅客鉄道	602,400	2,738.50	1,649,672,400	
西日本旅客鉄道	259,300	2,861.50	741,986,950	
東海旅客鉄道	421,000	3,440.00	1,448,240,000	
西武ホールディングス	132,200	2,630.00	347,686,000	
鴻池運輸	18,600	2,338.00	43,486,800	
西日本鉄道	29,200	2,461.50	71,875,800	
ハマキョウレックス	9,300	4,660.00	43,338,000	
サカイ引越センター	12,100	2,604.00	31,508,400	
近鉄グループホールディングス	109,100	3,381.00	368,867,100	
阪急阪神ホールディングス	145,500	4,158.00	604,989,000	
南海電気鉄道	48,700	2,622.00	127,691,400	
京阪ホールディングス	60,100	2,981.00	179,158,100	
神戸電鉄	3,000	2,769.00	8,307,000	
名古屋鉄道	112,600	1,779.00	200,315,400	
山陽電気鉄道	8,200	2,000.00	16,400,000	
アルプス物流	8,700	5,720.00	49,764,000	
ヤマトホールディングス	132,600	1,796.50	238,215,900	
山九	26,300	5,327.00	140,100,100	
丸運	2,100	492.00	1,033,200	
丸全昭和運輸	6,700	5,190.00	34,773,000	
センコーグループホールディングス	57,800	1,100.00	63,580,000	

トナミホールディングス	2,400	5,820.00	13,968,000	
ニッコンホールディングス	33,600	3,679.00	123,614,400	
日本石油輸送	400	3,015.00	1,206,000	
福山通運	10,000	4,010.00	40,100,000	
セイノーホールディングス	61,400	2,259.50	138,733,300	
神奈川中央交通	3,100	3,225.00	9,997,500	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	27,900	1,260.00	35,154,000	
九州旅客鉄道	77,200	3,853.00	297,451,600	
ＳＧホールディングス	183,200	1,484.00	271,868,800	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	37,000	7,193.00	266,141,000	
日本郵船	282,700	4,620.00	1,306,074,000	
商船三井	237,100	4,578.00	1,085,443,800	
川崎汽船	263,100	2,248.50	591,580,350	
ＮＳユナイテッド海運	6,000	4,760.00	28,560,000	
飯野海運	40,400	1,222.00	49,368,800	
共栄タンカー	1,000	1,233.00	1,233,000	
乾汽船	13,100	1,110.00	14,541,000	
日本航空	268,000	2,465.50	660,754,000	
ＡＮＡホールディングス	296,900	2,922.00	867,541,800	
パスコ	700	1,850.00	1,295,000	
トランコム	3,200	6,230.00	19,936,000	
日新	8,300	4,365.00	36,229,500	
三菱倉庫	26,000	5,176.00	134,576,000	
三井倉庫ホールディングス	10,200	4,675.00	47,685,000	
住友倉庫	29,200	2,761.00	80,621,200	
澁澤倉庫	5,000	2,975.00	14,875,000	
東陽倉庫	1,000	1,464.00	1,464,000	
日本トランスシティ	22,000	936.00	20,592,000	
ケイヒン	600	2,078.00	1,246,800	
中央倉庫	5,800	1,273.00	7,383,400	
川西倉庫	700	1,196.00	837,200	
安田倉庫	7,400	1,550.00	11,470,000	
ファイズホールディングス	500	1,028.00	514,000	
東洋埠頭	1,000	1,345.00	1,345,000	
上組	50,400	3,371.00	169,898,400	
サンリツ	900	844.00	759,600	
キムラユニティー	1,700	1,580.00	2,686,000	
キユーソー流通システム	5,400	1,849.00	9,984,600	
東海運	2,100	292.00	613,200	
エーアイテイー	6,800	1,897.00	12,899,600	
内外トランスライン	4,400	2,656.00	11,686,400	
日本コンセプト	4,000	1,723.00	6,892,000	

ＮＥＣネッツエスアイ	42,700	2,499.00	106,707,300	
クロスキャット	7,000	1,313.00	9,191,000	
システナ	165,900	339.00	56,240,100	
デジタルアーツ	6,900	4,690.00	32,361,000	
日鉄ソリューションズ	37,400	3,000.00	112,200,000	
キューブシステム	5,800	1,149.00	6,664,200	
コア	4,900	2,092.00	10,250,800	
手間いらず	1,900	3,525.00	6,697,500	
ラクーンホールディングス	8,200	583.00	4,780,600	
ソリトンシステムズ	5,700	1,208.00	6,885,600	
ソフトクリエイトホールディングス	9,000	1,811.00	16,299,000	
ＴＩＳ	115,900	3,166.00	366,939,400	
テクミラホールディングス	1,700	377.00	640,900	
グリー	36,700	534.00	19,597,800	
GMOペパボ	1,300	1,501.00	1,951,300	
コーエーテクモホールディングス	68,700	1,448.00	99,477,600	
三菱総合研究所	5,400	5,030.00	27,162,000	
電算	400	1,495.00	598,000	
ＡＧＳ	1,500	1,001.00	1,501,500	
ファインデックス	8,700	1,031.00	8,969,700	
ブレインパッド	9,100	993.00	9,036,300	
ＫＬａｂ	21,400	228.00	4,879,200	
ポールトゥウィンホールディングス	18,700	449.00	8,396,300	
ネクソン	240,700	3,155.00	759,408,500	
アイスタイル	36,700	433.00	15,891,100	
エムアップホールディングス	13,400	1,353.00	18,130,200	
エイチーム	7,300	687.00	5,015,100	
エニグモ	14,000	345.00	4,830,000	
テクノスジャパン	3,200	840.00	2,688,000	
コロプラ	37,300	617.00	23,014,100	
ブロードリーフ	52,000	604.00	31,408,000	
クロス・マーケティンググループ	1,700	602.00	1,023,400	
デジタルハーツホールディングス	6,800	1,000.00	6,800,000	
メディアドゥ	5,000	1,400.00	7,000,000	
じげん	32,000	586.00	18,752,000	
ブイキューブ	13,200	255.00	3,366,000	
エンカレッジ・テクノロジ	900	639.00	575,100	
サイバーリンクス	1,400	783.00	1,096,200	
フィックスターズ	11,000	1,741.00	19,151,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5,200	1,488.00	7,737,600	
オプティム	11,300	650.00	7,345,000	
セレス	4,400	1,585.00	6,974,000	

ＳＨＩＦＴ	7,300	11,000.00	80,300,000	
ティーガイア	11,500	3,670.00	42,205,000	
セック	1,400	4,185.00	5,859,000	
テクマトリックス	20,000	2,096.00	41,920,000	
プロシップ	5,300	1,489.00	7,891,700	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	28,500	2,876.50	81,980,250	
GMOペイメントゲートウェイ	25,000	8,398.00	209,950,000	
ザッパラス	900	426.00	383,400	
システムリサーチ	7,500	1,592.00	11,940,000	
インターネットイニシアティブ	52,400	2,520.50	132,074,200	
さくらインターネット	13,700	3,345.00	45,826,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,300	2,899.00	9,566,700	
ＳＲＡホールディングス	5,600	4,245.00	23,772,000	
システムインテグレータ	1,100	371.00	408,100	
朝日ネット	11,800	657.00	7,752,600	
ｅＢＡＳＥ	15,400	660.00	10,164,000	
アバントグループ	13,900	1,382.00	19,209,800	
アドソル日進	4,600	1,877.00	8,634,200	
ＯＤＫソリューションズ	700	612.00	428,400	
フリービット	4,800	1,325.00	6,360,000	
コムチュア	15,800	1,850.00	29,230,000	
アステリア	8,600	556.00	4,781,600	
アイル	6,100	2,596.00	15,835,600	
マークラインズ	5,900	2,980.00	17,582,000	
メディカル・データ・ビジョン	13,100	536.00	7,021,600	
ｇｕｍｉ	17,800	318.00	5,660,400	
ショーケース	900	294.00	264,600	
モバイルファクトリー	800	669.00	535,200	
テラスカイ	4,800	2,112.00	10,137,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,700	1,864.00	10,624,800	
ＰＣＩホールディングス	1,500	961.00	1,441,500	
アイビーシー	600	567.00	340,200	
ネオジャパン	3,700	1,761.00	6,515,700	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	2,200	1,810.00	3,982,000	
ラクス	51,900	2,060.50	106,939,950	
ランドコンピュータ	1,800	806.00	1,450,800	
ダブルスタンダード	3,300	1,753.00	5,784,900	
オープンドア	6,400	770.00	4,928,000	
アカツキ	5,300	2,350.00	12,455,000	
ベネフィットジャパン	300	1,188.00	356,400	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	3,500	1,318.00	4,613,000	
カナミックネットワーク	13,800	555.00	7,659,000	

ノムラシステムコーポレーション	4,000	135.00	540,000	
チェンジホールディングス	23,900	1,135.00	27,126,500	
シンクロ・フード	2,300	490.00	1,127,000	
オークネット	4,100	2,332.00	9,561,200	
キャピタル・アセット・プランニング	700	846.00	592,200	
セグエグループ	3,300	620.00	2,046,000	
エイトレッド	600	1,606.00	963,600	
マクロミル	21,500	859.00	18,468,500	
ビーグリー	800	1,260.00	1,008,000	
オロ	4,000	2,543.00	10,172,000	
ユーザーローカル	4,600	1,996.00	9,181,600	
テモナ	900	208.00	187,200	
ニーズウェル	4,000	370.00	1,480,000	
マネーフォワード	24,500	4,712.00	115,444,000	
サインポスト	1,400	605.00	847,000	
Ｓｕｎ　Ａｓｔｅｒｉｓｋ	7,800	907.00	7,074,600	
プラスアルファ・コンサルティング	13,800	1,857.00	25,626,600	
電算システムホールディングス	4,900	2,847.00	13,950,300	
Ａｐｐｉｅｒ　Ｇｒｏｕｐ	37,600	1,244.00	46,774,400	
ビジョナル	13,000	7,510.00	97,630,000	
ソルクシーズ	3,000	318.00	954,000	
フェイス	1,000	438.00	438,000	
プロトコーポレーション	12,000	1,409.00	16,908,000	
ハイマックス	3,400	1,375.00	4,675,000	
野村総合研究所	237,400	4,263.00	1,012,036,200	
ＣＥホールディングス	1,700	543.00	923,100	
日本システム技術	7,500	1,708.00	12,810,000	
インテージホールディングス	12,400	1,490.00	18,476,000	
東邦システムサイエンス	3,600	1,638.00	5,896,800	
ソースネクスト	50,200	223.00	11,194,600	
インフォコム	14,000	6,050.00	84,700,000	
シンプレクス・ホールディングス	16,700	2,605.00	43,503,500	
ＨＥＲＯＺ	4,300	1,169.00	5,026,700	
ラクスル	26,500	1,072.00	28,408,000	
メルカリ	53,500	2,190.50	117,191,750	
ＩＰＳ	3,200	2,201.00	7,043,200	
ＦＩＧ	4,200	309.00	1,297,800	
システムサポート	4,200	1,940.00	8,148,000	
イーソル	7,900	880.00	6,952,000	
東海ソフト	600	1,307.00	784,200	
ウイングアーク１ｓｔ	11,400	2,664.00	30,369,600	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,700	950.00	3,515,000	

サーバーワークス	2,200	2,879.00	6,333,800	
東名	400	2,735.00	1,094,000	
ヴィッツ	400	828.00	331,200	
トビラシステムズ	1,000	803.00	803,000	
Ｓａｎｓａｎ	36,000	2,247.00	80,892,000	
Ｌｉｎｋ－Ｕグループ	700	570.00	399,000	
ギフティ	9,600	1,115.00	10,704,000	
メドレー	14,700	4,105.00	60,343,500	
ベース	3,800	2,765.00	10,507,000	
ＪＭＤＣ	18,700	3,272.00	61,186,400	
フォーカスシステムズ	7,300	1,218.00	8,891,400	
クレスコ	18,000	1,326.00	23,868,000	
フジ・メディア・ホールディングス	105,300	1,807.50	190,329,750	
オービック	36,600	22,240.00	813,984,000	
ジャストシステム	15,800	3,130.00	49,454,000	
ＴＤＣソフト	20,500	1,251.00	25,645,500	
ＬＩＮＥヤフー	1,560,900	368.10	574,567,290	
トレンドマイクロ	51,800	7,178.00	371,820,400	
ＩＤホールディングス	7,400	1,451.00	10,737,400	
日本オラクル	21,000	11,915.00	250,215,000	
アルファシステムズ	2,900	2,958.00	8,578,200	
フューチャー	23,400	1,658.00	38,797,200	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	5,900	1,818.00	10,726,200	
トーセ	1,100	682.00	750,200	
オービックビジネスコンサルタント	15,400	6,316.00	97,266,400	
アイティフォー	14,000	1,483.00	20,762,000	
東計電算	3,100	4,350.00	13,485,000	
エックスネット	500	1,501.00	750,500	
大塚商会	108,700	3,254.00	353,709,800	
サイボウズ	15,100	1,764.00	26,636,400	
電通総研	13,300	5,380.00	71,554,000	
ＡＣＣＥＳＳ	11,400	1,341.00	15,287,400	
デジタルガレージ	17,500	2,627.00	45,972,500	
ＥＭシステムズ	18,300	626.00	11,455,800	
ウェザーニューズ	3,400	5,650.00	19,210,000	
ＣＩＪ	27,300	457.00	12,476,100	
ビジネスエンジニアリング	2,300	3,990.00	9,177,000	
日本エンタープライズ	3,800	131.00	497,800	
ＷＯＷＯＷ	8,300	1,080.00	8,964,000	
スカラ	10,200	619.00	6,313,800	
インテリジェント　ウェイブ	1,900	1,073.00	2,038,700	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	15,500	2,507.00	38,858,500	

ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	11,000	526.00	5,786,000	
ネットワンシステムズ	42,700	2,972.00	126,904,400	
システムソフト	38,300	68.00	2,604,400	
アルゴグラフィックス	10,100	4,855.00	49,035,500	
マーベラス	17,800	652.00	11,605,600	
エイベックス	18,700	1,504.00	28,124,800	
ＢＩＰＲＯＧＹ	35,900	4,477.00	160,724,300	
都築電気	5,800	2,371.00	13,751,800	
ＴＢＳホールディングス	55,100	4,060.00	223,706,000	
日本テレビホールディングス	97,100	2,312.50	224,543,750	
朝日放送グループホールディングス	10,300	671.00	6,911,300	
テレビ朝日ホールディングス	26,600	2,054.00	54,636,400	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	85,200	843.00	71,823,600	
テレビ東京ホールディングス	7,900	3,645.00	28,795,500	
日本ＢＳ放送	1,300	917.00	1,192,100	
ビジョン	16,400	1,358.00	22,271,200	
スマートバリュー	1,100	371.00	408,100	
Ｕ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	12,300	4,740.00	58,302,000	
ワイヤレスゲート	1,600	251.00	401,600	
日本通信	108,000	187.00	20,196,000	
クロップス	500	1,061.00	530,500	
日本電信電話	32,608,000	158.10	5,155,324,800	
ＫＤＤＩ	806,300	4,554.00	3,671,890,200	
ソフトバンク	1,750,900	1,946.00	3,407,251,400	
光通信	10,900	27,455.00	299,259,500	
エムティーアイ	7,500	821.00	6,157,500	
GMOインターネットグループ	40,200	2,388.50	96,017,700	
ファイバーゲート	5,900	1,209.00	7,133,100	
アイドママーケティングコミュニケーション	1,000	235.00	235,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	58,000	2,765.00	160,370,000	
学研ホールディングス	20,100	1,050.00	21,105,000	
ゼンリン	18,800	902.00	16,957,600	
昭文社ホールディングス	1,600	371.00	593,600	
インプレスホールディングス	3,700	161.00	595,700	
アイネット	6,600	1,862.00	12,289,200	
松竹	5,700	9,246.00	52,702,200	
東宝	61,000	5,244.00	319,884,000	
東映	18,100	3,780.00	68,418,000	
ＮＴＴデータグループ	286,600	2,299.50	659,036,700	
ピー・シー・エー	6,300	2,170.00	13,671,000	
ビジネスブレイン太田昭和	4,300	2,143.00	9,214,900	
ＤＴＳ	21,700	4,210.00	91,357,000	

スクウェア・エニックス・ホールディングス	50,100	4,961.00	248,546,100	
シーイーシー	13,800	1,972.00	27,213,600	
カプコン	196,100	2,990.00	586,339,000	
アイ・エス・ビー	5,600	1,468.00	8,220,800	
ＳＣＳＫ	76,700	3,037.00	232,937,900	
ＮＳＷ	4,700	3,100.00	14,570,000	
アイネス	8,500	1,773.00	15,070,500	
ＴＫＣ	18,700	3,450.00	64,515,000	
富士ソフト	22,000	7,040.00	154,880,000	
ＮＳＤ	38,700	3,050.00	118,035,000	
コナミグループ	41,100	11,465.00	471,211,500	
福井コンピュータホールディングス	6,800	2,555.00	17,374,000	
ＪＢＣＣホールディングス	7,300	3,600.00	26,280,000	
ミロク情報サービス	10,000	1,868.00	18,680,000	
ソフトバンクグループ	540,800	9,365.00	5,064,592,000	
リョーサン菱洋ホールディングス	21,800	2,837.00	61,846,600	
高千穂交易	3,300	3,855.00	12,721,500	
オルバヘルスケアホールディングス	600	2,023.00	1,213,800	
伊藤忠食品	2,600	6,570.00	17,082,000	
エレマテック	10,400	1,948.00	20,259,200	
あらた	17,700	3,475.00	61,507,500	
トーメンデバイス	1,700	6,970.00	11,849,000	
東京エレクトロン　デバイス	11,500	3,810.00	43,815,000	
円谷フィールズホールディングス	18,700	1,557.00	29,115,900	
双日	128,800	3,669.00	472,567,200	
アルフレッサ　ホールディングス	116,100	2,340.00	271,674,000	
横浜冷凍	29,100	1,046.00	30,438,600	
ラサ商事	4,300	1,691.00	7,271,300	
アルコニックス	15,200	1,439.00	21,872,800	
神戸物産	89,500	3,936.00	352,272,000	
ハイパー	900	322.00	289,800	
あい　ホールディングス	18,500	2,438.00	45,103,000	
ディーブイエックス	1,100	996.00	1,095,600	
ダイワボウホールディングス	51,200	2,770.00	141,824,000	
マクニカホールディングス	27,400	5,762.00	157,878,800	
ラクト・ジャパン	4,500	3,020.00	13,590,000	
グリムス	4,900	2,356.00	11,544,400	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	17,200	1,319.00	22,686,800	
八洲電機	9,400	1,745.00	16,403,000	
メディアスホールディングス	6,700	873.00	5,849,100	
レスター	9,800	2,905.00	28,469,000	
ジオリーブグループ	900	1,223.00	1,100,700	

大光	2,000	611.00	1,222,000	
ＯＣＨＩホールディングス	900	1,462.00	1,315,800	
ＴＯＫＡＩホールディングス	62,800	988.00	62,046,400	
黒谷	1,100	751.00	826,100	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	800	902.00	721,600	
三洋貿易	11,900	1,478.00	17,588,200	
ビューティガレージ	3,700	1,488.00	5,505,600	
ウイン・パートナーズ	7,500	1,190.00	8,925,000	
ミタチ産業	1,100	1,185.00	1,303,500	
シップヘルスケアホールディングス	41,600	2,272.00	94,515,200	
明治電機工業	4,300	1,774.00	7,628,200	
デリカフーズホールディングス	1,700	574.00	975,800	
スターティアホールディングス	1,000	2,118.00	2,118,000	
コメダホールディングス	28,400	2,652.00	75,316,800	
ピーバンドットコム	500	393.00	196,500	
アセンテック	4,400	590.00	2,596,000	
富士興産	1,100	1,668.00	1,834,800	
協栄産業	400	2,673.00	1,069,200	
フルサト・マルカホールディングス	10,300	2,225.00	22,917,500	
ヤマエグループホールディングス	8,100	2,225.00	18,022,500	
小野建	11,600	1,570.00	18,212,000	
南陽	1,600	1,072.00	1,715,200	
佐鳥電機	6,700	2,018.00	13,520,600	
エコートレーディング	700	1,005.00	703,500	
伯東	6,600	4,930.00	32,538,000	
コンドーテック	8,900	1,336.00	11,890,400	
中山福	2,100	374.00	785,400	
ナガイレーベン	14,600	2,658.00	38,806,800	
三菱食品	10,700	5,200.00	55,640,000	
松田産業	8,800	2,893.00	25,458,400	
第一興商	44,800	1,763.00	78,982,400	
メディパルホールディングス	117,600	2,690.50	316,402,800	
ＳＰＫ	5,100	2,252.00	11,485,200	
萩原電気ホールディングス	5,000	3,715.00	18,575,000	
アズワン	35,900	3,107.00	111,541,300	
スズデン	4,000	1,861.00	7,444,000	
尾家産業	900	1,995.00	1,795,500	
シモジマ	7,700	1,288.00	9,917,600	
ドウシシャ	10,700	2,230.00	23,861,000	
小津産業	900	1,610.00	1,449,000	
高速	6,400	2,360.00	15,104,000	
たけびし	4,400	2,398.00	10,551,200	

リックス	1,800	2,934.00	5,281,200	
丸文	10,300	1,137.00	11,711,100	
ハピネット	9,800	3,150.00	30,870,000	
橋本総業ホールディングス	4,600	1,282.00	5,897,200	
日本ライフライン	31,000	1,140.00	35,340,000	
タカショー	10,100	515.00	5,201,500	
ＩＤＯＭ	30,600	1,103.00	33,751,800	
進和	7,100	2,580.00	18,318,000	
エスケイジャパン	900	774.00	696,600	
ダイトロン	4,600	2,722.00	12,521,200	
シークス	16,500	1,236.00	20,394,000	
田中商事	1,100	776.00	853,600	
オーハシテクニカ	6,100	1,890.00	11,529,000	
白銅	3,300	2,521.00	8,319,300	
ダイコー通産	400	1,207.00	482,800	
伊藤忠商事	777,400	7,536.00	5,858,486,400	
丸紅	959,200	2,800.00	2,685,760,000	
高島	2,600	966.00	2,511,600	
長瀬産業	51,700	3,188.00	164,819,600	
蝶理	7,100	3,635.00	25,808,500	
豊田通商	303,900	2,881.50	875,687,850	
三共生興	16,000	666.00	10,656,000	
兼松	48,400	2,489.00	120,467,600	
ツカモトコーポレーション	500	1,256.00	628,000	
三井物産	1,732,400	3,452.00	5,980,244,800	
日本紙パルプ商事	5,500	6,170.00	33,935,000	
カメイ	12,300	2,124.00	26,125,200	
東都水産	300	6,970.00	2,091,000	
ＯＵＧホールディングス	600	2,669.00	1,601,400	
スターゼン	8,000	3,035.00	24,280,000	
山善	35,100	1,521.00	53,387,100	
椿本興業	6,000	1,997.00	11,982,000	
住友商事	699,900	3,784.00	2,648,421,600	
内田洋行	4,700	7,930.00	37,271,000	
三菱商事	2,220,600	3,097.00	6,877,198,200	
第一実業	10,900	2,313.00	25,211,700	
キヤノンマーケティングジャパン	26,800	4,389.00	117,625,200	
西華産業	4,500	4,035.00	18,157,500	
佐藤商事	8,000	1,645.00	13,160,000	
東京産業	10,600	721.00	7,642,600	
ユアサ商事	9,000	5,440.00	48,960,000	
神鋼商事	2,900	8,320.00	24,128,000	

トルク	2,800	228.00	638,400	
阪和興業	20,800	5,560.00	115,648,000	
正栄食品工業	7,700	4,970.00	38,269,000	
カナデン	8,400	1,583.00	13,297,200	
ＲＹＯＤＥＮ	9,300	2,736.00	25,444,800	
岩谷産業	26,300	9,336.00	245,536,800	
ナイス	1,200	1,988.00	2,385,600	
ニチモウ	1,200	2,126.00	2,551,200	
極東貿易	6,900	1,677.00	11,571,300	
アステナホールディングス	21,700	545.00	11,826,500	
三愛オブリ	27,000	2,077.00	56,079,000	
稲畑産業	22,900	3,330.00	76,257,000	
ＧＳＩクレオス	6,200	2,150.00	13,330,000	
明和産業	13,700	704.00	9,644,800	
クワザワホールディングス	1,400	856.00	1,198,400	
ワキタ	19,100	1,624.00	31,018,400	
東邦ホールディングス	31,200	4,437.00	138,434,400	
サンゲツ	26,600	2,955.00	78,603,000	
ミツウロコグループホールディングス	14,800	1,659.00	24,553,200	
シナネンホールディングス	3,200	4,890.00	15,648,000	
伊藤忠エネクス	28,700	1,690.00	48,503,000	
サンリオ	93,900	3,052.00	286,582,800	
サンワテクノス	5,900	2,126.00	12,543,400	
新光商事	15,600	866.00	13,509,600	
トーホー	4,500	3,170.00	14,265,000	
三信電気	4,700	2,071.00	9,733,700	
東陽テクニカ	10,700	1,554.00	16,627,800	
モスフードサービス	17,000	3,495.00	59,415,000	
加賀電子	10,600	5,320.00	56,392,000	
ソーダニッカ	6,700	1,144.00	7,664,800	
立花エレテック	7,700	3,075.00	23,677,500	
フォーバル	4,500	1,449.00	6,520,500	
ＰＡＬＴＡＣ	15,600	4,226.00	65,925,600	
三谷産業	20,200	354.00	7,150,800	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	8,800	1,387.00	12,205,600	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	300	2,611.00	783,300	
コーア商事ホールディングス	8,600	724.00	6,226,400	
ＫＰＰグループホールディングス	30,000	721.00	21,630,000	
ヤマタネ	5,100	3,095.00	15,784,500	
丸紅建材リース	300	3,055.00	916,500	
泉州電業	7,200	4,985.00	35,892,000	
トラスコ中山	24,300	2,343.00	56,934,900	

オートバックスセブン	40,300	1,602.50	64,580,750	
モリト	8,300	1,465.00	12,159,500	
加藤産業	14,300	4,155.00	59,416,500	
北恵	1,000	894.00	894,000	
イエローハット	18,400	2,361.00	43,442,400	
ＪＫホールディングス	8,900	1,068.00	9,505,200	
日伝	7,600	3,425.00	26,030,000	
北沢産業	2,400	334.00	801,600	
杉本商事	5,400	2,677.00	14,455,800	
因幡電機産業	30,000	3,875.00	116,250,000	
東テク	11,600	2,420.00	28,072,000	
ミスミグループ本社	174,700	2,547.50	445,048,250	
アルテック	2,100	263.00	552,300	
タキヒヨー	900	1,296.00	1,166,400	
蔵王産業	700	2,502.00	1,751,400	
スズケン	41,300	5,417.00	223,722,100	
ジェコス	6,900	973.00	6,713,700	
サンエー	8,900	5,220.00	46,458,000	
カワチ薬品	9,100	2,842.00	25,862,200	
エービーシー・マート	50,700	2,910.00	147,537,000	
ハードオフコーポレーション	4,700	2,068.00	9,719,600	
アスクル	28,000	2,221.00	62,188,000	
ゲオホールディングス	13,100	1,640.00	21,484,000	
アダストリア	14,000	3,210.00	44,940,000	
くら寿司	13,600	3,810.00	51,816,000	
キャンドゥ	4,200	4,210.00	17,682,000	
ＩＫホールディングス	1,800	397.00	714,600	
パルグループホールディングス	22,800	1,740.00	39,672,000	
エディオン	45,900	1,741.00	79,911,900	
サーラコーポレーション	24,600	797.00	19,606,200	
ワッツ	2,000	762.00	1,524,000	
ハローズ	5,300	4,425.00	23,452,500	
あみやき亭	2,800	5,450.00	15,260,000	
大黒天物産	3,600	9,650.00	34,740,000	
ハニーズホールディングス	10,400	1,593.00	16,567,200	
ファーマライズホールディングス	1,200	632.00	758,400	
アルペン	9,700	2,173.00	21,078,100	
ハブ	1,500	870.00	1,305,000	
クオールホールディングス	16,100	1,500.00	24,150,000	
ジンズホールディングス	8,900	4,365.00	38,848,500	
ビックカメラ	69,400	1,702.00	118,118,800	
ＤＣＭホールディングス	60,100	1,419.00	85,281,900	

ＭｏｎｏｔａＲＯ	164,100	2,057.50	337,635,750	
東京一番フーズ	1,600	516.00	825,600	
きちりホールディングス	1,100	878.00	965,800	
Ｊ．フロント　リテイリング	132,800	1,799.00	238,907,200	
ドトール・日レスホールディングス	20,600	2,310.00	47,586,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	210,500	2,373.00	499,516,500	
ブロンコビリー	6,800	3,430.00	23,324,000	
ＺＯＺＯ	73,700	4,285.00	315,804,500	
トレジャー・ファクトリー	7,300	1,925.00	14,052,500	
物語コーポレーション	19,400	3,415.00	66,251,000	
三越伊勢丹ホールディングス	191,500	2,934.50	561,956,750	
Ｈａｍｅｅ	4,900	1,111.00	5,443,900	
マーケットエンタープライズ	600	930.00	558,000	
ウエルシアホールディングス	60,100	1,946.00	116,954,600	
クリエイトＳＤホールディングス	16,500	3,260.00	53,790,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	5,200	340.00	1,768,000	
ミサワ	1,200	610.00	732,000	
ティーライフ	700	1,390.00	973,000	
チムニー	1,200	1,338.00	1,605,600	
シュッピン	10,600	1,442.00	15,285,200	
オイシックス・ラ・大地	15,700	1,327.00	20,833,900	
ネクステージ	26,500	1,932.00	51,198,000	
ジョイフル本田	32,200	2,180.00	70,196,000	
エターナルホスピタリティグループ	4,300	3,600.00	15,480,000	
ホットランド	8,900	2,350.00	20,915,000	
すかいらーくホールディングス	158,200	2,029.00	320,987,800	
ＳＦＰホールディングス	5,600	2,061.00	11,541,600	
綿半ホールディングス	9,100	1,791.00	16,298,100	
ヨシックスホールディングス	2,300	3,000.00	6,900,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	32,600	885.00	28,851,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,700	510.00	2,907,000	
ＢＥＥＮＯＳ	6,200	2,251.00	13,956,200	
あさひ	10,900	1,497.00	16,317,300	
日本調剤	7,800	1,497.00	11,676,600	
コスモス薬品	9,800	12,860.00	126,028,000	
トーエル	2,000	819.00	1,638,000	
セブン＆アイ・ホールディングス	1,184,000	1,756.00	2,079,104,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	78,300	1,037.00	81,197,100	
ツルハホールディングス	24,300	9,004.00	218,797,200	
サンマルクホールディングス	9,400	2,115.00	19,881,000	
フェリシモ	1,100	934.00	1,027,400	

トリドールホールディングス	32,500	3,758.00	122,135,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	13,100	273.00	3,576,300	
ウイルプラスホールディングス	1,000	1,171.00	1,171,000	
ＪＭホールディングス	8,800	2,737.00	24,085,600	
サツドラホールディングス	1,800	823.00	1,481,400	
アレンザホールディングス	8,800	1,088.00	9,574,400	
串カツ田中ホールディングス	3,200	1,647.00	5,270,400	
バロックジャパンリミテッド	9,300	778.00	7,235,400	
クスリのアオキホールディングス	34,900	3,020.00	105,398,000	
力の源ホールディングス	6,700	1,393.00	9,333,100	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	61,800	2,523.00	155,921,400	
メディカルシステムネットワーク	12,900	543.00	7,004,700	
はるやまホールディングス	2,200	604.00	1,328,800	
ノジマ	33,700	1,638.00	55,200,600	
カッパ・クリエイト	18,200	1,844.00	33,560,800	
ライトオン	2,900	386.00	1,119,400	
良品計画	137,800	2,808.00	386,942,400	
パリミキホールディングス	5,400	395.00	2,133,000	
アドヴァングループ	10,100	905.00	9,140,500	
アルビス	3,900	2,741.00	10,689,900	
コナカ	4,600	278.00	1,278,800	
ハウス　オブ　ローゼ	600	1,577.00	946,200	
Ｇ－７ホールディングス	12,800	1,639.00	20,979,200	
イオン北海道	34,300	903.00	30,972,900	
コジマ	22,500	1,077.00	24,232,500	
ヒマラヤ	1,600	915.00	1,464,000	
コーナン商事	14,200	3,980.00	56,516,000	
エコス	4,400	2,270.00	9,988,000	
ワタミ	12,200	923.00	11,260,600	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	233,600	3,872.00	904,499,200	
西松屋チェーン	22,900	2,171.00	49,715,900	
ゼンショーホールディングス	58,900	5,960.00	351,044,000	
幸楽苑ホールディングス	8,600	1,339.00	11,515,400	
ハークスレイ	1,400	768.00	1,075,200	
サイゼリヤ	17,100	6,100.00	104,310,000	
ＶＴホールディングス	45,600	500.00	22,800,000	
魚力	3,900	2,511.00	9,792,900	
フジ・コーポレーション	5,600	2,082.00	11,659,200	
ユナイテッドアローズ	13,700	2,098.00	28,742,600	
ハイデイ日高	17,200	2,711.00	46,629,200	

YU−WA Creation Holdings	3,700	127.00	469,900	
コロワイド	49,700	2,013.00	100,046,100	
壱番屋	45,900	1,045.00	47,965,500	
ＰＬＡＮＴ	1,000	1,467.00	1,467,000	
スギホールディングス	70,000	2,414.50	169,015,000	
薬王堂ホールディングス	5,700	2,783.00	15,863,100	
スクロール	17,400	1,001.00	17,417,400	
ヨンドシーホールディングス	11,100	1,952.00	21,667,200	
木曽路	17,600	2,607.00	45,883,200	
ＳＲＳホールディングス	19,200	1,281.00	24,595,200	
千趣会	21,300	299.00	6,368,700	
リテールパートナーズ	17,300	1,619.00	28,008,700	
上新電機	11,500	2,750.00	31,625,000	
日本瓦斯	61,400	2,412.50	148,127,500	
ロイヤルホールディングス	20,400	2,450.00	49,980,000	
いなげや	11,300	1,245.00	14,068,500	
チヨダ	11,300	933.00	10,542,900	
ライフコーポレーション	12,100	3,565.00	43,136,500	
リンガーハット	14,900	2,198.00	32,750,200	
ＭｒＭａｘＨＤ	14,900	699.00	10,415,100	
ＡＯＫＩホールディングス	25,000	1,326.00	33,150,000	
オークワ	16,700	876.00	14,629,200	
コメリ	17,900	3,605.00	64,529,500	
青山商事	24,900	1,458.00	36,304,200	
しまむら	27,200	7,087.00	192,766,400	
はせがわ	2,500	345.00	862,500	
高島屋	73,700	2,725.50	200,869,350	
松屋	19,700	1,116.00	21,985,200	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	51,200	2,579.00	132,044,800	
近鉄百貨店	5,100	2,312.00	11,791,200	
丸井グループ	76,800	2,377.00	182,553,600	
アクシアル　リテイリング	31,800	1,003.00	31,895,400	
イオン	392,000	3,327.00	1,304,184,000	
イズミ	20,500	3,491.00	71,565,500	
平和堂	19,400	2,406.00	46,676,400	
フジ	17,800	1,984.00	35,315,200	
ヤオコー	13,700	9,122.00	124,971,400	
ゼビオホールディングス	15,900	1,183.00	18,809,700	
ケーズホールディングス	77,800	1,637.50	127,397,500	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	2,100	529.00	1,110,900	
日産東京販売ホールディングス	6,100	498.00	3,037,800	
シルバーライフ	3,000	923.00	2,769,000	

Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	10,200	2,975.00	30,345,000	
ナルミヤ・インターナショナル	800	1,321.00	1,056,800	
ブックオフグループホールディングス	7,700	1,370.00	10,549,000	
ギフトホールディングス	5,000	2,404.00	12,020,000	
アインホールディングス	16,000	5,761.00	92,176,000	
元気寿司	6,600	3,290.00	21,714,000	
ヤマダホールディングス	356,200	452.60	161,216,120	
アークランズ	34,500	1,793.00	61,858,500	
ニトリホールディングス	42,100	17,810.00	749,801,000	
グルメ杵屋	9,600	1,100.00	10,560,000	
愛眼	2,800	177.00	495,600	
ケーユーホールディングス	5,600	1,158.00	6,484,800	
吉野家ホールディングス	42,700	2,761.50	117,916,050	
松屋フーズホールディングス	5,500	5,730.00	31,515,000	
サガミホールディングス	17,500	1,660.00	29,050,000	
関西フードマーケット	7,900	2,662.00	21,029,800	
王将フードサービス	8,600	8,810.00	75,766,000	
ミニストップ	8,400	1,648.00	13,843,200	
アークス	21,300	2,708.00	57,680,400	
バローホールディングス	22,200	2,495.00	55,389,000	
ベルク	5,800	6,200.00	35,960,000	
大庄	5,200	1,210.00	6,292,000	
ファーストリテイリング	65,000	40,130.00	2,608,450,000	
サンドラッグ	39,100	4,025.00	157,377,500	
サックスバー　ホールディングス	10,000	800.00	8,000,000	
ヤマザワ	1,000	1,267.00	1,267,000	
やまや	900	3,100.00	2,790,000	
ベルーナ	28,100	762.00	21,412,200	
いよぎんホールディングス	128,100	1,446.50	185,296,650	
しずおかフィナンシャルグループ	237,100	1,474.50	349,603,950	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	90,600	1,616.00	146,409,600	
楽天銀行	49,900	3,165.00	157,933,500	
京都フィナンシャルグループ	135,500	2,705.00	366,527,500	
島根銀行	1,000	538.00	538,000	
じもとホールディングス	3,100	321.00	995,100	
めぶきフィナンシャルグループ	498,900	597.60	298,142,640	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,800	4,315.00	59,547,000	
九州フィナンシャルグループ	208,300	864.00	179,971,200	
ゆうちょ銀行	1,182,900	1,485.00	1,756,606,500	
富山第一銀行	34,200	1,269.00	43,399,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	572,700	905.00	518,293,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	60,200	1,932.00	116,306,400	

三十三フィナンシャルグループ	9,600	2,015.00	19,344,000	
第四北越フィナンシャルグループ	16,900	5,050.00	85,345,000	
ひろぎんホールディングス	153,200	1,168.50	179,014,200	
おきなわフィナンシャルグループ	9,200	2,686.00	24,711,200	
十六フィナンシャルグループ	14,000	4,600.00	64,400,000	
北國フィナンシャルホールディングス	10,500	5,210.00	54,705,000	
プロクレアホールディングス	12,300	1,830.00	22,509,000	
あいちフィナンシャルグループ	22,100	2,593.00	57,305,300	
あおぞら銀行	77,400	2,441.50	188,972,100	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	6,555,800	1,675.00	10,980,965,000	
りそなホールディングス	1,245,000	1,008.50	1,255,582,500	
三井住友トラスト・ホールディングス	383,100	3,686.00	1,412,106,600	
三井住友フィナンシャルグループ	753,900	10,440.00	7,870,716,000	
千葉銀行	300,000	1,368.50	410,550,000	
群馬銀行	208,900	964.00	201,379,600	
武蔵野銀行	15,000	3,085.00	46,275,000	
千葉興業銀行	21,700	995.00	21,591,500	
筑波銀行	47,200	301.00	14,207,200	
七十七銀行	31,300	4,280.00	133,964,000	
秋田銀行	7,200	2,404.00	17,308,800	
山形銀行	12,000	1,113.00	13,356,000	
岩手銀行	6,800	2,639.00	17,945,200	
東邦銀行	85,100	303.00	25,785,300	
東北銀行	1,700	1,205.00	2,048,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	93,800	4,141.00	388,425,800	
スルガ銀行	80,600	1,136.00	91,561,600	
八十二銀行	231,000	1,001.00	231,231,000	
山梨中央銀行	12,100	1,918.00	23,207,800	
大垣共立銀行	20,500	2,195.00	44,997,500	
福井銀行	9,600	2,033.00	19,516,800	
清水銀行	4,300	1,570.00	6,751,000	
富山銀行	600	1,740.00	1,044,000	
滋賀銀行	17,900	4,085.00	73,121,500	
南都銀行	16,200	3,365.00	54,513,000	
百五銀行	101,300	639.00	64,730,700	
紀陽銀行	38,500	1,881.00	72,418,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	66,600	1,924.50	128,171,700	
山陰合同銀行	67,400	1,375.00	92,675,000	
鳥取銀行	1,200	1,345.00	1,614,000	
百十四銀行	10,600	3,170.00	33,602,000	
四国銀行	15,800	1,127.00	17,806,600	
阿波銀行	15,100	2,707.00	40,875,700	

大分銀行	6,500	3,220.00	20,930,000	
宮崎銀行	6,500	3,205.00	20,832,500	
佐賀銀行	6,300	2,542.00	16,014,600	
琉球銀行	22,900	1,186.00	27,159,400	
セブン銀行	337,400	273.80	92,380,120	
みずほフィナンシャルグループ	1,453,000	3,249.00	4,720,797,000	
高知銀行	1,200	864.00	1,036,800	
山口フィナンシャルグループ	105,600	1,757.50	185,592,000	
名古屋銀行	6,800	7,500.00	51,000,000	
北洋銀行	163,100	477.00	77,798,700	
大光銀行	1,100	1,505.00	1,655,500	
愛媛銀行	14,500	1,205.00	17,472,500	
トマト銀行	1,300	1,259.00	1,636,700	
京葉銀行	44,300	806.00	35,705,800	
栃木銀行	53,800	338.00	18,184,400	
北日本銀行	3,500	2,679.00	9,376,500	
東和銀行	19,800	672.00	13,305,600	
福島銀行	3,700	269.00	995,300	
大東銀行	1,500	743.00	1,114,500	
トモニホールディングス	101,900	409.00	41,677,100	
フィデアホールディングス	11,100	1,559.00	17,304,900	
池田泉州ホールディングス	149,300	369.00	55,091,700	
ＦＰＧ	38,400	2,333.00	89,587,200	
ジャパンインベストメントアドバイザー	17,500	1,455.00	25,462,500	
マーキュリアホールディングス	1,900	890.00	1,691,000	
ＳＢＩホールディングス	172,900	3,786.00	654,599,400	
ジャフコ　グループ	32,100	1,858.50	59,657,850	
大和証券グループ本社	833,900	1,206.50	1,006,100,350	
野村ホールディングス	1,810,400	886.90	1,605,643,760	
岡三証券グループ	94,600	720.00	68,112,000	
丸三証券	35,900	1,030.00	36,977,000	
東洋証券	28,700	365.00	10,475,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	127,900	560.00	71,624,000	
光世証券	900	519.00	467,100	
水戸証券	29,600	512.00	15,155,200	
いちよし証券	20,200	797.00	16,099,400	
松井証券	53,000	820.00	43,460,000	
マネックスグループ	105,500	656.00	69,208,000	
極東証券	14,800	1,498.00	22,170,400	
岩井コスモホールディングス	12,300	2,177.00	26,777,100	
アイザワ証券グループ	15,600	2,321.00	36,207,600	
マネーパートナーズグループ	3,900	244.00	951,600	

スパークス・グループ	12,000	1,620.00	19,440,000	
かんぽ生命保険	109,600	3,015.00	330,444,000	
ＦＰパートナー	2,900	2,823.00	8,186,700	
ＳＯＭＰＯホールディングス	485,800	3,202.00	1,555,531,600	
アニコム　ホールディングス	36,600	637.00	23,314,200	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	723,100	3,425.00	2,476,617,500	
第一生命ホールディングス	506,100	4,410.00	2,231,901,000	
東京海上ホールディングス	1,051,000	5,696.00	5,986,496,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	289,100	2,745.50	793,724,050	
アドバンスクリエイト	6,800	1,096.00	7,452,800	
ＮＥＸＹＺ．Ｇｒｏｕｐ	1,700	699.00	1,188,300	
全国保証	28,200	5,975.00	168,495,000	
あんしん保証	3,000	221.00	663,000	
イントラスト	1,700	807.00	1,371,900	
日本モーゲージサービス	2,600	429.00	1,115,400	
Ｃａｓａ	1,800	930.00	1,674,000	
ＳＢＩアルヒ	10,700	878.00	9,394,600	
プレミアグループ	18,400	2,047.00	37,664,800	
ネットプロテクションズホールディングス	37,700	207.00	7,803,900	
クレディセゾン	68,300	3,322.00	226,892,600	
芙蓉総合リース	9,900	11,740.00	116,226,000	
みずほリース	90,500	1,080.00	97,740,000	
東京センチュリー	80,700	1,523.50	122,946,450	
日本証券金融	39,800	1,610.00	64,078,000	
アイフル	159,400	372.00	59,296,800	
リコーリース	10,300	5,310.00	54,693,000	
イオンフィナンシャルサービス	62,100	1,298.50	80,636,850	
アコム	193,000	420.60	81,175,800	
ジャックス	11,500	4,685.00	53,877,500	
オリエントコーポレーション	35,500	1,019.00	36,174,500	
オリックス	645,700	3,528.00	2,278,029,600	
三菱ＨＣキャピタル	480,000	1,036.00	497,280,000	
九州リースサービス	1,700	1,013.00	1,722,100	
日本取引所グループ	277,600	3,683.00	1,022,400,800	
イー・ギャランティ	17,800	1,415.00	25,187,000	
アサックス	2,000	780.00	1,560,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	5,400	4,135.00	22,329,000	
ｒｏｂｏｔ　ｈｏｍｅ	32,300	178.00	5,749,400	
大東建託	39,500	16,930.00	668,735,000	
サムティホールディングス	17,300	2,637.00	45,620,100	
いちご	114,500	409.00	46,830,500	
日本駐車場開発	130,300	207.00	26,972,100	

スター・マイカ・ホールディングス	13,200	655.00	8,646,000	
ＳＲＥホールディングス	4,700	4,860.00	22,842,000	
ＡＤワークスグループ	9,000	224.00	2,016,000	
ヒューリック	251,400	1,456.50	366,164,100	
野村不動産ホールディングス	60,100	4,022.00	241,722,200	
三重交通グループホールディングス	23,800	539.00	12,828,200	
ディア・ライフ	18,800	976.00	18,348,800	
地主	8,400	2,168.00	18,211,200	
プレサンスコーポレーション	14,500	1,925.00	27,912,500	
ハウスコム	900	1,042.00	937,800	
ＪＰＭＣ	6,600	1,216.00	8,025,600	
サンセイランディック	1,400	984.00	1,377,600	
フージャースホールディングス	16,600	1,118.00	18,558,800	
オープンハウスグループ	39,500	5,235.00	206,782,500	
東急不動産ホールディングス	324,100	1,044.00	338,360,400	
飯田グループホールディングス	103,400	2,208.00	228,307,200	
イーグランド	800	1,542.00	1,233,600	
ムゲンエステート	2,600	1,282.00	3,333,200	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	6,500	1,037.00	6,740,500	
シーアールイー	5,100	1,579.00	8,052,900	
ケイアイスター不動産	5,300	3,490.00	18,497,000	
グッドコムアセット	10,500	835.00	8,767,500	
ジェイ・エス・ビー	5,500	2,862.00	15,741,000	
ロードスターキャピタル	7,200	2,689.00	19,360,800	
テンポイノベーション	1,500	928.00	1,392,000	
フェイスネットワーク	1,200	1,772.00	2,126,400	
霞ヶ関キャピタル	4,400	11,520.00	50,688,000	
パーク２４	70,200	1,542.50	108,283,500	
パラカ	3,600	2,020.00	7,272,000	
三井不動産	1,493,800	1,483.00	2,215,305,400	
三菱地所	675,700	2,487.50	1,680,803,750	
平和不動産	17,600	3,955.00	69,608,000	
東京建物	94,200	2,540.00	239,268,000	
京阪神ビルディング	20,200	1,741.00	35,168,200	
住友不動産	155,800	4,787.00	745,814,600	
テーオーシー	19,800	690.00	13,662,000	
レオパレス２１	107,700	506.00	54,496,200	
スターツコーポレーション	15,600	3,285.00	51,246,000	
フジ住宅	14,100	791.00	11,153,100	
空港施設	15,400	598.00	9,209,200	
明和地所	6,100	940.00	5,734,000	
ゴールドクレスト	8,900	2,814.00	25,044,600	

エスリード	5,200	4,440.00	23,088,000	
日神グループホールディングス	18,100	546.00	9,882,600	
日本エスコン	20,100	1,014.00	20,381,400	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	56,000	517.00	28,952,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	2,400	862.00	2,068,800	
イオンモール	56,000	1,979.00	110,824,000	
毎日コムネット	1,800	754.00	1,357,200	
ファースト住建	1,800	1,080.00	1,944,000	
カチタス	29,200	1,856.00	54,195,200	
トーセイ	18,100	2,452.00	44,381,200	
穴吹興産	1,000	2,113.00	2,113,000	
サンフロンティア不動産	16,200	1,954.00	31,654,800	
ＦＪネクストホールディングス	11,700	1,268.00	14,835,600	
インテリックス	900	693.00	623,700	
ランドビジネス	1,300	239.00	310,700	
サンネクスタグループ	1,500	1,023.00	1,534,500	
グランディハウス	8,400	607.00	5,098,800	
日本空港ビルデング	38,200	5,460.00	208,572,000	
明豊ファシリティワークス	2,000	848.00	1,696,000	
ＬＩＦＵＬＬ	28,300	158.00	4,471,400	
ＭＩＸＩ	24,200	2,936.00	71,051,200	
ジェイエイシーリクルートメント	40,800	682.00	27,825,600	
日本M&Aセンターホールディングス	179,200	821.10	147,141,120	
メンバーズ	4,000	890.00	3,560,000	
中広	900	568.00	511,200	
ＵＴグループ	14,700	3,110.00	45,717,000	
アイティメディア	4,400	1,888.00	8,307,200	
ケアネット	20,000	543.00	10,860,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	6,600	1,767.00	11,662,200	
オープンアップグループ	33,800	2,117.00	71,554,600	
コシダカホールディングス	33,800	941.00	31,805,800	
アルトナー	1,600	1,937.00	3,099,200	
パソナグループ	13,700	2,027.00	27,769,900	
ＣＤＳ	1,000	1,818.00	1,818,000	
リンクアンドモチベーション	32,400	481.00	15,584,400	
エス・エム・エス	39,400	2,009.00	79,154,600	
サニーサイドアップグループ	1,500	642.00	963,000	
パーソルホールディングス	1,144,400	250.60	286,786,640	
リニカル	2,700	424.00	1,144,800	
クックパッド	31,500	198.00	6,237,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	2,000	795.00	1,590,000	
学情	5,800	1,854.00	10,753,200	

スタジオアリス	5,700	2,107.00	12,009,900	
エプコ	1,200	800.00	960,000	
ＮＪＳ	2,500	3,795.00	9,487,500	
綜合警備保障	187,800	936.60	175,893,480	
カカクコム	73,000	2,101.00	153,373,000	
アイロムグループ	4,600	2,767.00	12,728,200	
セントケア・ホールディング	8,200	890.00	7,298,000	
サイネックス	800	804.00	643,200	
ルネサンス	8,900	1,030.00	9,167,000	
ディップ	17,300	2,941.00	50,879,300	
デジタルホールディングス	6,000	1,050.00	6,300,000	
新日本科学	10,300	1,224.00	12,607,200	
キャリアデザインセンター	800	1,880.00	1,504,000	
エムスリー	222,100	1,496.50	332,372,650	
ツカダ・グローバルホールディング	2,400	493.00	1,183,200	
ウェルネット	3,500	744.00	2,604,000	
ワールドホールディングス	5,100	2,150.00	10,965,000	
ディー・エヌ・エー	40,000	1,532.00	61,280,000	
博報堂ＤＹホールディングス	143,400	1,198.50	171,864,900	
ぐるなび	21,400	311.00	6,655,400	
タカミヤ	15,500	460.00	7,130,000	
ファンコミュニケーションズ	16,100	404.00	6,504,400	
ライク	4,300	1,441.00	6,196,300	
Ａｏｂａ－ＢＢＴ	1,800	363.00	653,400	
エスプール	32,700	323.00	10,562,100	
ＷＤＢホールディングス	5,800	1,815.00	10,527,000	
ティア	2,800	461.00	1,290,800	
ＣＤＧ	500	1,284.00	642,000	
アドウェイズ	15,800	409.00	6,462,200	
バリューコマース	10,000	1,178.00	11,780,000	
インフォマート	117,100	295.00	34,544,500	
ＪＰホールディングス	29,000	581.00	16,849,000	
エコナックホールディングス	4,300	129.00	554,700	
ＣＬホールディングス	2,800	1,414.00	3,959,200	
プレステージ・インターナショナル	52,800	716.00	37,804,800	
アミューズ	6,900	1,601.00	11,046,900	
ドリームインキュベータ	3,600	2,286.00	8,229,600	
クイック	7,900	2,142.00	16,921,800	
ＴＡＣ	2,600	182.00	473,200	
電通グループ	110,500	3,927.00	433,933,500	
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,000	969.00	4,845,000	
イオンファンタジー	4,100	2,474.00	10,143,400	

シーティーエス	14,000	805.00	11,270,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	32,900	2,578.00	84,816,200	
アルプス技研	10,700	2,628.00	28,119,600	
日本空調サービス	12,200	990.00	12,078,000	
オリエンタルランド	594,600	4,372.00	2,599,591,200	
ダスキン	24,600	3,903.00	96,013,800	
明光ネットワークジャパン	13,800	725.00	10,005,000	
ファルコホールディングス	5,000	2,345.00	11,725,000	
ラウンドワン	106,100	861.00	91,352,100	
リゾートトラスト	48,900	2,493.50	121,932,150	
ビー・エム・エル	13,900	2,976.00	41,366,400	
リソー教育	58,000	240.00	13,920,000	
早稲田アカデミー	6,300	1,611.00	10,149,300	
ユー・エス・エス	252,200	1,368.00	345,009,600	
東京個別指導学院	13,600	403.00	5,480,800	
サイバーエージェント	248,500	950.80	236,273,800	
楽天グループ	966,100	841.70	813,166,370	
クリーク・アンド・リバー社	5,700	1,406.00	8,014,200	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	22,200	643.00	14,274,600	
テー・オー・ダブリュー	22,400	353.00	7,907,200	
山田コンサルティンググループ	4,900	2,134.00	10,456,600	
セントラルスポーツ	4,300	2,441.00	10,496,300	
フルキャストホールディングス	10,800	1,463.00	15,800,400	
エン・ジャパン	18,300	2,782.00	50,910,600	
リソルホールディングス	400	4,690.00	1,876,000	
テクノプロ・ホールディングス	65,800	2,717.50	178,811,500	
アトラグループ	1,100	163.00	179,300	
アイ・アールジャパンホールディングス	5,900	1,058.00	6,242,200	
ＫｅｅＰｅｒ技研	7,000	3,570.00	24,990,000	
ファーストロジック	1,400	616.00	862,400	
三機サービス	800	1,132.00	905,600	
Ｇｕｎｏｓｙ	9,100	784.00	7,134,400	
デザインワン・ジャパン	2,000	138.00	276,000	
イー・ガーディアン	5,300	1,954.00	10,356,200	
リブセンス	2,400	221.00	530,400	
ジャパンマテリアル	34,400	1,969.00	67,733,600	
ベクトル	13,500	1,000.00	13,500,000	
ウチヤマホールディングス	2,000	343.00	686,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	9,400	1,524.00	14,325,600	
キャリアリンク	4,200	2,407.00	10,109,400	
ＩＢＪ	8,800	609.00	5,359,200	
アサンテ	5,600	1,747.00	9,783,200	

バリューＨＲ	9,900	1,438.00	14,236,200	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	9,100	2,293.00	20,866,300	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,600	1,033.00	4,751,800	
ＥＲＩホールディングス	1,100	1,922.00	2,114,200	
アビスト	600	3,305.00	1,983,000	
シグマクシス・ホールディングス	14,800	1,480.00	21,904,000	
ウィルグループ	9,500	1,019.00	9,680,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	5,500	146.00	803,000	
メドピア	9,200	622.00	5,722,400	
レアジョブ	1,000	414.00	414,000	
リクルートホールディングス	809,200	8,275.00	6,696,130,000	
エラン	15,000	903.00	13,545,000	
土木管理総合試験所	2,200	320.00	704,000	
日本郵政	1,174,600	1,529.00	1,795,963,400	
ベルシステム２４ホールディングス	12,100	1,470.00	17,787,000	
鎌倉新書	9,900	430.00	4,257,000	
ＳＭＮ	1,100	310.00	341,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	900	693.00	623,700	
エアトリ	8,300	1,374.00	11,404,200	
アトラエ	8,400	847.00	7,114,800	
ストライク	5,600	4,205.00	23,548,000	
ソラスト	31,300	483.00	15,117,900	
セラク	3,500	1,356.00	4,746,000	
インソース	24,600	847.00	20,836,200	
ベイカレント・コンサルティング	82,600	4,544.00	375,334,400	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,600	1,205.00	3,133,000	
アイモバイル	14,500	481.00	6,974,500	
キャリアインデックス	2,000	192.00	384,000	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,700	1,052.00	4,944,400	
船場	900	1,272.00	1,144,800	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	36,500	2,733.00	99,754,500	
フルテック	700	1,130.00	791,000	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	2,100	250.00	525,000	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	800	594.00	475,200	
エル・ティー・エス	1,400	1,996.00	2,794,400	
ミダックホールディングス	6,900	1,556.00	10,736,400	
キュービーネットホールディングス	6,600	1,411.00	9,312,600	
オープングループ	15,700	252.00	3,956,400	
スプリックス	1,300	806.00	1,047,800	
マネジメントソリューションズ	4,900	1,311.00	6,423,900	
プロレド・パートナーズ	3,000	519.00	1,557,000	
テノ．ホールディングス	800	415.00	332,000	

フロンティア・マネジメント	2,900	1,171.00	3,395,900	
コプロ・ホールディングス	1,300	1,638.00	2,129,400	
ギークス	800	457.00	365,600	
アンビスホールディングス	24,100	2,505.00	60,370,500	
カーブスホールディングス	30,900	803.00	24,812,700	
フォーラムエンジニアリング	15,400	982.00	15,122,800	
Ｆａｓｔ　Ｆｉｔｎｅｓｓ　Ｊａｐａｎ	3,900	1,252.00	4,882,800	
ダイレクトマーケティングミックス	12,100	235.00	2,843,500	
ポピンズ	1,800	1,222.00	2,199,600	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	8,800	1,606.00	14,132,800	
コンフィデンス・インターワークス	400	1,790.00	716,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	2,200	551.00	1,212,200	
リログループ	56,400	1,747.00	98,530,800	
東祥	8,000	710.00	5,680,000	
ＩＤ＆Ｅホールディングス	6,800	4,000.00	27,200,000	
ビーウィズ	2,400	1,900.00	4,560,000	
ＴＲＥホールディングス	21,600	1,279.00	27,626,400	
人・夢・技術グループ	4,600	1,824.00	8,390,400	
ＮＩＳＳＯホールディングス	9,900	806.00	7,979,400	
大栄環境	20,500	2,747.00	56,313,500	
日本管財ホールディングス	11,800	2,724.00	32,143,200	
M&A総研ホールディングス	12,000	3,260.00	39,120,000	
エイチ・アイ・エス	32,700	1,683.00	55,034,100	
ラックランド	5,100	2,095.00	10,684,500	
共立メンテナンス	35,300	2,824.00	99,687,200	
イチネンホールディングス	12,000	1,682.00	20,184,000	
建設技術研究所	5,800	4,745.00	27,521,000	
スペース	7,500	1,111.00	8,332,500	
燦ホールディングス	10,500	1,262.00	13,251,000	
スバル興業	3,500	2,894.00	10,129,000	
東京テアトル	1,400	1,125.00	1,575,000	
タナベコンサルティンググループ	3,400	1,309.00	4,450,600	
ナガワ	3,400	7,700.00	26,180,000	
東京都競馬	9,400	4,165.00	39,151,000	
カナモト	17,500	2,710.00	47,425,000	
ニシオホールディングス	9,300	3,855.00	35,851,500	
トランス・コスモス	12,600	3,365.00	42,399,000	
乃村工藝社	49,200	845.00	41,574,000	
藤田観光	4,500	8,320.00	37,440,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	6,700	1,429.00	9,574,300	
トーカイ	10,000	2,196.00	21,960,000	
セコム	114,400	9,324.00	1,066,665,600	

セントラル警備保障	6,100	2,645.00	16,134,500	
丹青社	21,900	948.00	20,761,200	
メイテックグループホールディングス	38,300	3,310.00	126,773,000	
応用地質	10,500	2,480.00	26,040,000	
船井総研ホールディングス	22,500	2,162.00	48,645,000	
進学会ホールディングス	1,500	239.00	358,500	
オオバ	2,600	1,077.00	2,800,200	
いであ	1,100	2,248.00	2,472,800	
学究社	4,500	2,077.00	9,346,500	
イオンディライト	12,100	3,890.00	47,069,000	
ナック	9,800	572.00	5,605,600	
ダイセキ	23,000	3,550.00	81,650,000	
ステップ	4,200	1,912.00	8,030,400	
合　計	178,517,500		416,131,698,170	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2024年 7月25日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	490,011,482
国債証券	348,116,158,550
地方債証券	21,150,307,994
特殊債券	22,520,529,833
社債券	19,631,609,000
未収入金	196,027,000
未収利息	794,113,396
前払費用	30,360,496
流動資産合計	412,929,117,751
資産合計	412,929,117,751
負債の部	
流動負債	
未払金	200,000,000
未払解約金	279,841,858
流動負債合計	479,841,858
負債合計	479,841,858
純資産の部	
元本等	
元本	324,452,894,072
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	87,996,381,821

	2024年 7月25日現在
項目	金額（円）
元本等合計	412,449,275,893
純資産合計	412,449,275,893
負債純資産合計	412,929,117,751

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月25日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 7月25日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	324,452,894,072口
2.	担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。
		有価証券 98,566,000円
3.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.2712円 (1万口当たり純資産額) (12,712円)

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

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2024年 7月25日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2024年 7月25日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

	2024年 7月25日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 7月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月26日
期首元本額	301,735,610,363円
期中追加設定元本額	39,663,616,426円
期中一部解約元本額	16,946,332,717円
期末元本額	324,452,894,072円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	764,998,550円
ＤＣ日本債券インデックスファンド	1,691,938,068円
ＤＣ日本債券インデックスファンドＬ	43,175,891,598円
ＤＣバランスファンド３０	14,224,802,802円
ＤＣバランスファンド５０	11,187,133,822円
ＤＣバランスファンド７０	3,719,236,934円
日本債券インデックスｅ	879,791,774円
インデックスコレクション（国内債券）	37,799,956,624円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	79,102,620,417円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	11,972,724,754円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	5,971,834,307円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	56,123,184,658円
日本債券パッシブファンド私募Ａ（適格機関投資家専用）	6,774,492,335円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	120,850,273円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	701,553,355円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	118,736,764円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	99,729,392円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	99,106,183円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	2,186,587,890円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	1,038,556,777円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	12,458,356,399円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	172,834,655円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	207,966,626円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	2,963,362,348円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	130,519,927円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	361,706,677円
バランスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	3,153,242,489円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	313,719,208円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	786,909,700円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	51,088,260円
バランスファンドＶＡ２（適格機関投資家専用）	2,790,985,224円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	1,359,852,210円
バランスファンドＶＡ３（適格機関投資家専用）	20,866,139,561円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	439,756,805円
国内バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	94,291,971円
国内バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	41,026,485円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	500,993,806円
私募日本債券インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	6,414,444円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 7月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△12,137,363,910
地方債証券	△475,163,030
特殊債券	△544,214,918
社債券	△338,210,000
合計	△13,494,951,858

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第４５２回利付国債（２年）	3,250,000,000	3,243,012,500	
	第４５３回利付国債（２年）	630,000,000	628,437,600	
	第４５４回利付国債（２年）	1,020,000,000	1,018,255,800	
	第４５５回利付国債（２年）	670,000,000	667,742,100	
	第４５６回利付国債（２年）	2,060,000,000	2,054,685,200	
	第４５７回利付国債（２年）	1,600,000,000	1,595,024,000	
	第４５８回利付国債（２年）	560,000,000	558,885,600	
	第４５９回利付国債（２年）	70,000,000	69,835,500	
	第４６０回利付国債（２年）	1,270,000,000	1,268,653,800	
	第４６１回利付国債（２年）	1,640,000,000	1,640,738,000	
	第４６２回利付国債（２年）	790,000,000	790,150,100	
	第１４５回利付国債（５年）	2,605,000,000	2,601,535,350	
	第１４６回利付国債（５年）	2,230,000,000	2,225,317,000	
	第１４７回利付国債（５年）	2,810,000,000	2,795,697,100	
	第１４８回利付国債（５年）	2,750,000,000	2,730,530,000	
	第１４９回利付国債（５年）	3,285,000,000	3,257,964,450	
	第１５０回利付国債（５年）	2,760,000,000	2,733,724,800	
	第１５１回利付国債（５年）	2,110,000,000	2,087,043,200	
	第１５２回利付国債（５年）	1,535,000,000	1,522,121,350	
	第１５３回利付国債（５年）	2,845,000,000	2,809,921,150	
	第１５４回利付国債（５年）	2,680,000,000	2,650,412,800	
	第１５５回利付国債（５年）	1,460,000,000	1,451,429,800	
	第１５６回利付国債（５年）	2,060,000,000	2,041,027,400	

第１５７回利付国債（５年）	1,010,000,000	999,132,400	
第１５８回利付国債（５年）	2,120,000,000	2,089,599,200	
第１５９回利付国債（５年）	390,000,000	383,662,500	
第１６０回利付国債（５年）	1,320,000,000	1,303,592,400	
第１６１回利付国債（５年）	1,810,000,000	1,794,415,900	
第１６２回利付国債（５年）	800,000,000	791,872,000	
第１６３回利付国債（５年）	2,490,000,000	2,474,811,000	
第１６４回利付国債（５年）	1,040,000,000	1,023,245,600	
第１６５回利付国債（５年）	1,580,000,000	1,561,340,200	
第１６６回利付国債（５年）	1,010,000,000	1,002,404,800	
第１６７回利付国債（５年）	840,000,000	832,582,800	
第１６８回利付国債（５年）	1,020,000,000	1,020,224,400	
第１６９回利付国債（５年）	1,400,000,000	1,393,658,000	
第１回利付国債（４０年）	270,000,000	290,133,900	
第２回利付国債（４０年）	560,000,000	577,533,600	
第３回利付国債（４０年）	585,000,000	599,747,850	
第４回利付国債（４０年）	915,000,000	932,220,300	
第５回利付国債（４０年）	495,000,000	481,288,500	
第６回利付国債（４０年）	830,000,000	784,856,300	
第７回利付国債（４０年）	990,000,000	889,990,200	
第８回利付国債（４０年）	910,000,000	753,288,900	
第９回利付国債（４０年）	1,540,000,000	912,172,800	
第１０回利付国債（４０年）	1,270,000,000	884,059,700	
第１１回利付国債（４０年）	1,080,000,000	715,683,600	
第１２回利付国債（４０年）	970,000,000	563,269,300	
第１３回利付国債（４０年）	1,590,000,000	904,471,500	
第１４回利付国債（４０年）	1,545,000,000	936,115,500	
第１５回利付国債（４０年）	1,861,000,000	1,244,748,460	
第１６回利付国債（４０年）	1,550,000,000	1,137,436,500	
第１７回利付国債（４０年）	380,000,000	363,082,400	
第３４０回利付国債（１０年）	2,930,000,000	2,936,211,600	
第３４１回利付国債（１０年）	3,050,000,000	3,052,104,500	
第３４２回利付国債（１０年）	3,040,000,000	3,029,268,800	
第３４３回利付国債（１０年）	2,955,000,000	2,939,368,050	
第３４４回利付国債（１０年）	4,220,000,000	4,193,836,000	
第３４５回利付国債（１０年）	3,490,000,000	3,464,662,600	
第３４６回利付国債（１０年）	3,435,000,000	3,406,180,350	
第３４７回利付国債（１０年）	2,885,000,000	2,857,304,000	
第３４８回利付国債（１０年）	2,710,000,000	2,680,081,600	
第３４９回利付国債（１０年）	2,770,000,000	2,735,208,800	
第３５０回利付国債（１０年）	3,890,000,000	3,834,217,400	代用有価証券 100,000,000円
第３５１回利付国債（１０年）	1,840,000,000	1,810,100,000	

第３５２回利付国債（１０年）	2,920,000,000	2,867,790,400	
第３５３回利付国債（１０年）	2,860,000,000	2,802,256,600	
第３５４回利付国債（１０年）	2,475,000,000	2,419,015,500	
第３５５回利付国債（１０年）	3,060,000,000	2,982,888,000	
第３５６回利付国債（１０年）	2,750,000,000	2,675,915,000	
第３５７回利付国債（１０年）	2,740,000,000	2,661,334,600	
第３５８回利付国債（１０年）	3,000,000,000	2,907,690,000	
第３５９回利付国債（１０年）	3,260,000,000	3,152,713,400	
第３６０回利付国債（１０年）	3,675,000,000	3,543,839,250	
第３６１回利付国債（１０年）	3,080,000,000	2,961,296,800	
第３６２回利付国債（１０年）	3,070,000,000	2,942,656,400	
第３６３回利付国債（１０年）	3,215,000,000	3,071,803,900	
第３６４回利付国債（１０年）	3,765,000,000	3,584,242,350	
第３６５回利付国債（１０年）	3,755,000,000	3,561,317,100	
第３６６回利付国債（１０年）	3,568,000,000	3,400,196,960	
第３６７回利付国債（１０年）	3,015,000,000	2,862,471,150	
第３６８回利付国債（１０年）	4,145,000,000	3,921,584,500	
第３６９回利付国債（１０年）	3,060,000,000	2,958,591,600	
第３７０回利付国債（１０年）	3,216,000,000	3,100,320,480	
第３７１回利付国債（１０年）	3,370,000,000	3,209,958,700	
第３７２回利付国債（１０年）	2,900,000,000	2,853,745,000	
第３７３回利付国債（１０年）	4,020,000,000	3,871,782,600	
第３７４回利付国債（１０年）	2,860,000,000	2,797,337,400	
第１回利付国債（３０年）	50,000,000	55,484,500	
第２回利付国債（３０年）	100,000,000	109,558,000	
第３回利付国債（３０年）	140,000,000	153,031,200	
第４回利付国債（３０年）	190,000,000	215,691,800	
第５回利付国債（３０年）	180,000,000	197,244,000	
第６回利付国債（３０年）	205,000,000	228,154,750	
第７回利付国債（３０年）	130,000,000	144,185,600	
第９回利付国債（３０年）	180,000,000	187,102,800	
第１０回利付国債（３０年）	170,000,000	172,312,000	
第１１回利付国債（３０年）	375,000,000	398,737,500	
第１２回利付国債（３０年）	430,000,000	472,036,800	
第１３回利付国債（３０年）	130,000,000	141,476,400	
第１４回利付国債（３０年）	350,000,000	393,638,000	
第１５回利付国債（３０年）	370,000,000	419,809,400	
第１６回利付国債（３０年）	335,000,000	380,091,000	
第１７回利付国債（３０年）	405,000,000	455,633,100	
第１８回利付国債（３０年）	420,000,000	468,266,400	
第１９回利付国債（３０年）	345,000,000	384,737,100	
第２０回利付国債（３０年）	250,000,000	283,922,500	

第２１回利付国債（３０年）	585,000,000	651,830,400	
第２２回利付国債（３０年）	475,000,000	539,486,000	
第２３回利付国債（３０年）	180,000,000	204,368,400	
第２４回利付国債（３０年）	150,000,000	170,230,500	
第２５回利付国債（３０年）	185,000,000	205,636,750	
第２６回利付国債（３０年）	1,210,000,000	1,359,011,500	
第２７回利付国債（３０年）	890,000,000	1,008,823,900	
第２８回利付国債（３０年）	905,000,000	1,024,948,700	
第２９回利付国債（３０年）	1,050,000,000	1,174,719,000	
第３０回利付国債（３０年）	890,000,000	981,403,000	
第３１回利付国債（３０年）	970,000,000	1,054,477,300	
第３２回利付国債（３０年）	1,275,000,000	1,399,835,250	
第３３回利付国債（３０年）	1,540,000,000	1,621,142,600	
第３４回利付国債（３０年）	1,350,000,000	1,454,571,000	
第３５回利付国債（３０年）	1,370,000,000	1,432,184,300	
第３６回利付国債（３０年）	1,365,000,000	1,421,551,950	
第３７回利付国債（３０年）	1,560,000,000	1,596,628,800	
第３８回利付国債（３０年）	935,000,000	937,618,000	
第３９回利付国債（３０年）	825,000,000	838,406,250	
第４０回利付国債（３０年）	705,000,000	703,991,850	
第４１回利付国債（３０年）	655,000,000	641,886,900	
第４２回利付国債（３０年）	838,000,000	819,287,460	
第４３回利付国債（３０年）	865,000,000	844,283,250	
第４４回利付国債（３０年）	920,000,000	895,794,800	
第４５回利付国債（３０年）	932,000,000	873,973,680	
第４６回利付国債（３０年）	1,145,000,000	1,070,712,400	
第４７回利付国債（３０年）	1,145,000,000	1,087,910,300	
第４８回利付国債（３０年）	1,040,000,000	949,353,600	
第４９回利付国債（３０年）	1,190,000,000	1,082,983,300	
第５０回利付国債（３０年）	1,220,000,000	977,403,000	
第５１回利付国債（３０年）	1,169,000,000	828,470,300	
第５２回利付国債（３０年）	1,160,000,000	859,235,200	
第５３回利付国債（３０年）	1,075,000,000	811,399,250	
第５４回利付国債（３０年）	925,000,000	728,678,000	
第５５回利付国債（３０年）	1,165,000,000	913,826,000	
第５６回利付国債（３０年）	760,000,000	593,598,000	
第５７回利付国債（３０年）	1,050,000,000	816,585,000	
第５８回利付国債（３０年）	1,500,000,000	1,161,570,000	
第５９回利付国債（３０年）	990,000,000	744,549,300	
第６０回利付国債（３０年）	940,000,000	739,676,600	
第６１回利付国債（３０年）	885,000,000	659,546,250	
第６２回利付国債（３０年）	900,000,000	632,709,000	
第６３回利付国債（３０年）	1,050,000,000	713,779,500	

第６４回利付国債（３０年）	960,000,000	648,672,000	
第６５回利付国債（３０年）	560,000,000	376,415,200	
第６６回利付国債（３０年）	860,000,000	574,609,000	
第６７回利付国債（３０年）	1,060,000,000	746,303,600	
第６８回利付国債（３０年）	970,000,000	679,087,300	
第６９回利付国債（３０年）	1,185,000,000	849,799,050	
第７０回利付国債（３０年）	1,120,000,000	799,478,400	
第７１回利付国債（３０年）	930,000,000	660,746,400	
第７２回利付国債（３０年）	1,020,000,000	721,874,400	
第７３回利付国債（３０年）	1,135,000,000	800,152,300	
第７４回利付国債（３０年）	1,465,000,000	1,119,465,100	
第７５回利付国債（３０年）	1,253,000,000	1,033,023,320	
第７６回利付国債（３０年）	1,126,000,000	949,578,320	
第７７回利付国債（３０年）	1,022,000,000	902,967,660	
第７８回利付国債（３０年）	1,169,000,000	981,363,810	
第７９回利付国債（３０年）	930,000,000	739,554,600	
第８０回利付国債（３０年）	1,140,000,000	1,051,536,000	
第８１回利付国債（３０年）	1,250,000,000	1,097,475,000	
第８２回利付国債（３０年）	810,000,000	745,831,800	
第８１回利付国債（２０年）	180,000,000	183,695,400	
第８２回利付国債（２０年）	485,000,000	495,514,800	
第８３回利付国債（２０年）	470,000,000	482,149,500	
第８４回利付国債（２０年）	190,000,000	194,647,400	
第８５回利付国債（２０年）	360,000,000	370,573,200	
第８６回利付国債（２０年）	240,000,000	247,836,000	
第８７回利付国債（２０年）	170,000,000	175,271,700	
第８８回利付国債（２０年）	290,000,000	300,538,600	
第８９回利付国債（２０年）	320,000,000	331,024,000	
第９０回利付国債（２０年）	610,000,000	633,643,600	
第９１回利付国債（２０年）	310,000,000	322,675,900	
第９２回利付国債（２０年）	1,190,000,000	1,238,135,500	
第９３回利付国債（２０年）	300,000,000	312,501,000	
第９４回利付国債（２０年）	255,000,000	266,293,950	
第９５回利付国債（２０年）	950,000,000	1,001,043,500	
第９６回利付国債（２０年）	470,000,000	492,560,000	
第９７回利付国債（２０年）	570,000,000	601,104,900	
第９８回利付国債（２０年）	370,000,000	389,040,200	
第９９回利付国債（２０年）	1,290,000,000	1,360,640,400	
第１００回利付国債（２０年）	660,000,000	700,583,400	
第１０１回利付国債（２０年）	360,000,000	384,717,600	
第１０２回利付国債（２０年）	1,070,000,000	1,147,350,300	
第１０３回利付国債（２０年）	920,000,000	982,992,400	

第１０４回利付国債（２０年）	260,000,000	275,813,200	
第１０５回利付国債（２０年）	730,000,000	776,413,400	
第１０６回利付国債（２０年）	400,000,000	427,060,000	
第１０７回利付国債（２０年）	500,000,000	533,085,000	
第１０８回利付国債（２０年）	925,000,000	978,252,250	
第１０９回利付国債（２０年）	642,000,000	680,359,500	
第１１０回利付国債（２０年）	515,000,000	550,437,150	
第１１１回利付国債（２０年）	450,000,000	484,047,000	
第１１２回利付国債（２０年）	880,000,000	942,400,800	
第１１３回利付国債（２０年）	1,525,000,000	1,638,109,250	
第１１４回利付国債（２０年）	920,000,000	991,171,200	
第１１５回利付国債（２０年）	370,000,000	400,558,300	
第１１６回利付国債（２０年）	330,000,000	358,165,500	
第１１７回利付国債（２０年）	935,000,000	1,009,697,150	
第１１８回利付国債（２０年）	450,000,000	484,524,000	
第１１９回利付国債（２０年）	320,000,000	340,912,000	
第１２０回利付国債（２０年）	895,000,000	943,052,550	
第１２１回利付国債（２０年）	970,000,000	1,040,198,900	
第１２２回利付国債（２０年）	700,000,000	746,522,000	
第１２３回利付国債（２０年）	1,180,000,000	1,282,011,000	
第１２４回利付国債（２０年）	650,000,000	702,208,000	
第１２５回利付国債（２０年）	670,000,000	733,382,000	
第１２６回利付国債（２０年）	590,000,000	638,120,400	
第１２７回利付国債（２０年）	670,000,000	720,390,700	
第１２８回利付国債（２０年）	960,000,000	1,033,113,600	
第１２９回利付国債（２０年）	560,000,000	598,976,000	
第１３０回利付国債（２０年）	1,040,000,000	1,112,623,200	
第１３１回利付国債（２０年）	725,000,000	770,711,250	
第１３２回利付国債（２０年）	750,000,000	797,452,500	
第１３３回利付国債（２０年）	940,000,000	1,006,044,400	
第１３４回利付国債（２０年）	725,000,000	776,692,500	
第１３５回利付国債（２０年）	580,000,000	617,178,000	
第１３６回利付国債（２０年）	530,000,000	559,955,600	
第１３７回利付国債（２０年）	780,000,000	829,701,600	
第１３８回利付国債（２０年）	460,000,000	482,314,600	
第１３９回利付国債（２０年）	645,000,000	681,068,400	
第１４０回利付国債（２０年）	945,000,000	1,005,092,550	
第１４１回利付国債（２０年）	660,000,000	702,068,400	
第１４２回利付国債（２０年）	780,000,000	835,816,800	
第１４３回利付国債（２０年）	1,320,000,000	1,393,022,400	
第１４４回利付国債（２０年）	550,000,000	575,784,000	
第１４５回利付国債（２０年）	1,550,000,000	1,648,115,000	
第１４６回利付国債（２０年）	1,520,000,000	1,615,319,200	

	第１４７回利付国債（２０年）	1,605,000,000	1,689,214,350	
	第１４８回利付国債（２０年）	1,935,000,000	2,016,579,600	
	第１４９回利付国債（２０年）	1,900,000,000	1,977,558,000	
	第１５０回利付国債（２０年）	2,080,000,000	2,140,902,400	
	第１５１回利付国債（２０年）	1,995,000,000	2,009,862,750	
	第１５２回利付国債（２０年）	1,845,000,000	1,854,630,900	
	第１５３回利付国債（２０年）	1,685,000,000	1,706,989,250	
	第１５４回利付国債（２０年）	1,795,000,000	1,795,879,550	
	第１５５回利付国債（２０年）	1,585,000,000	1,547,768,350	
	第１５６回利付国債（２０年）	1,395,000,000	1,267,329,600	
	第１５７回利付国債（２０年）	2,250,000,000	1,984,680,000	
	第１５８回利付国債（２０年）	2,205,000,000	2,008,269,900	
	第１５９回利付国債（２０年）	1,980,000,000	1,817,402,400	
	第１６０回利付国債（２０年）	870,000,000	805,419,900	
	第１６１回利付国債（２０年）	1,630,000,000	1,483,446,700	
	第１６２回利付国債（２０年）	1,270,000,000	1,150,747,000	
	第１６３回利付国債（２０年）	1,665,000,000	1,501,114,050	
	第１６４回利付国債（２０年）	1,895,000,000	1,677,435,050	
	第１６５回利付国債（２０年）	1,665,000,000	1,466,715,150	
	第１６６回利付国債（２０年）	1,040,000,000	937,934,400	
	第１６７回利付国債（２０年）	1,390,000,000	1,211,732,500	
	第１６８回利付国債（２０年）	1,630,000,000	1,392,085,200	
	第１６９回利付国債（２０年）	1,305,000,000	1,091,019,150	
	第１７０回利付国債（２０年）	1,320,000,000	1,097,316,000	
	第１７１回利付国債（２０年）	1,130,000,000	934,035,400	
	第１７２回利付国債（２０年）	810,000,000	676,908,900	
	第１７３回利付国債（２０年）	1,680,000,000	1,396,130,400	
	第１７４回利付国債（２０年）	1,525,000,000	1,260,168,500	
	第１７５回利付国債（２０年）	1,530,000,000	1,278,927,000	
	第１７６回利付国債（２０年）	1,310,000,000	1,089,042,300	
	第１７７回利付国債（２０年）	1,455,000,000	1,181,823,750	
	第１７８回利付国債（２０年）	1,900,000,000	1,562,940,000	
	第１７９回利付国債（２０年）	1,650,000,000	1,350,525,000	
	第１８０回利付国債（２０年）	1,660,000,000	1,427,135,200	
	第１８１回利付国債（２０年）	1,605,000,000	1,398,998,250	
	第１８２回利付国債（２０年）	1,565,000,000	1,407,404,500	
	第１８３回利付国債（２０年）	1,513,000,000	1,426,380,750	
	第１８４回利付国債（２０年）	1,650,000,000	1,472,278,500	
	第１８５回利付国債（２０年）	1,710,000,000	1,519,745,400	
	第１８６回利付国債（２０年）	1,630,000,000	1,548,222,900	
	第１８７回利付国債（２０年）	1,300,000,000	1,189,422,000	
	第１８８回利付国債（２０年）	970,000,000	932,364,000	

国債証券合計		365,564,000,000	348,116,158,550	
地方債証券	第１回東京都公募公債（東京グリーンボンド（３０年））	100,000,000	79,774,000	
	第７回東京都公募公債（３０年）	200,000,000	223,664,000	
	第１１回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	209,084,000	
	第１６回東京都公募公債（２０年）	150,000,000	158,916,000	
	第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	106,287,000	
	第１８回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	214,230,000	
	第２０回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	106,998,000	
	第２１回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	107,790,000	
	第７６０回東京都公募公債	140,000,000	138,747,000	
	第７８６回東京都公募公債	200,000,000	196,316,000	
	第８００回東京都公募公債	300,000,000	289,926,000	
	第８３０回東京都公募公債	100,000,000	94,973,000	
	平成２７年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	99,739,000	
	平成３０年度第３回北海道公募公債	100,000,000	98,444,000	
	令和４年度第１回北海道公募公債	100,000,000	95,228,000	
	第３回神奈川県公募公債（３０年）	100,000,000	113,710,000	
	第１１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	106,782,000	
	第１５回神奈川県公募公債（２０年）	300,000,000	321,300,000	
	第１６回神奈川県公募公債（２０年）	600,000,000	648,864,000	
	第２０回神奈川県公募公債（２０年）	300,000,000	317,502,000	
	第２１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	106,073,000	
	第２４３回神奈川県公募公債	100,000,000	96,616,000	
	第２回大阪府公募公債（２０年）	300,000,000	323,511,000	
	第１８３回大阪府公募公債（５年）	240,000,000	238,053,600	
	第４０３回大阪府公募公債（１０年）	300,000,000	300,537,000	
	第４１７回大阪府公募公債（１０年）	108,000,000	107,305,560	
	第４２３回大阪府公募公債（１０年）	300,000,000	296,802,000	
	第４８６回大阪府公募公債（１０年）	172,000,000	166,318,840	
	第４９０回大阪府公募公債（１０年）	121,000,000	117,313,130	
	平成１９年度第３回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	105,636,000	
	平成２５年度第２回京都府公募公債（１５年）	100,000,000	101,747,000	
	平成２７年度第１３回京都府公募公債	105,860,000	105,385,747	
	令和２年度第１回京都府公募公債（１０年）	100,000,000	96,632,000	
	令和５年度第６回京都府公募公債	100,000,000	97,473,000	
	第３回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	105,534,000	
	第４回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	102,548,000	
	第８回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	101,911,000	
	第１１回兵庫県公募公債（１５年）	200,000,000	199,652,000	
	平成２８年度第３０回兵庫県公募公債	100,000,000	99,243,000	

令和３年度第５回兵庫県公募公債	100,000,000	94,838,000	
令和３年度第９回兵庫県公募公債（５年）	100,000,000	98,883,000	
令和５年度第２回兵庫県公募公債	100,000,000	97,174,000	
令和５年度第４回兵庫県公募公債（グリーンボンド・１０年）	100,000,000	96,792,000	
令和５年度第５回兵庫県公募公債	100,000,000	97,790,000	
第４回静岡県公募公債（１５年）	100,000,000	102,860,000	
第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	76,193,000	
第１５回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	105,820,000	
平成２９年度第１１回静岡県公募公債	100,000,000	99,026,000	
令和４年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	95,084,000	
平成２２年度第１４回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	108,056,000	
平成２５年度第８回愛知県公募公債（３０年）	110,000,000	112,194,500	
平成２５年度第１７回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	104,642,000	
平成２７年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	200,364,000	
平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	200,090,000	
平成２９年度第５回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	198,208,000	
平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	99,126,000	
平成２９年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	98,934,000	
平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	197,056,000	
令和元年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	96,528,000	
令和２年度第７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	96,433,000	
令和３年度第６回愛知県公募公債（３０年）	200,000,000	139,530,000	
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	107,088,000	
平成２９年度第７回広島県公募公債	131,440,000	129,670,817	
令和２年度第７回広島県公募公債	100,000,000	96,114,000	
第２回埼玉県公募公債（１０年）	100,000,000	97,341,000	
第５回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	106,412,000	
第７回埼玉県公募公債（１５年）	400,000,000	361,808,000	
第８回埼玉県公募公債（１５年）	100,000,000	89,502,000	
第９回埼玉県公募公債（３０年）	100,000,000	76,596,000	
第１８回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	177,708,000	
平成２９年度第５回埼玉県公募公債	100,000,000	99,128,000	
令和４年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	96,579,000	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	113,601,000	
	100,000,000	106,635,000	

平成２０年度第１回福岡県公募公債（２０年）			
平成２０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	200,000,000	217,790,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	102,355,000	
平成２９年度第８回福岡県公募公債	200,000,000	197,640,000	
令和３年度第２回福岡県公募公債	100,000,000	95,497,000	
令和３年度第５回福岡県公募公債	100,000,000	98,905,000	
令和３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	200,000,000	176,614,000	
令和６年度第３回福岡県公募公債	100,000,000	99,565,000	
第６回千葉県公募公債（２０年）	200,000,000	214,776,000	
第８回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	108,107,000	
第９回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	106,473,000	
平成２８年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	99,363,000	
平成２９年度第５回千葉県公募公債	120,000,000	118,650,000	
令和元年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	96,458,000	
令和４年度第８回千葉県公募公債	100,000,000	97,850,000	
平成２７年度第３回新潟県公募公債	200,000,000	199,074,000	
平成２８年度第１回新潟県公募公債	120,000,000	118,870,800	
令和３年度第１回長野県公募公債（１０年）	200,000,000	191,736,000	
令和５年度第３回長野県公募公債（グリーンボンド（１０年））	100,000,000	98,316,000	
令和６年度第１回茨城県公募公債	100,000,000	99,181,000	
第２回群馬県公募公債（２０年）	100,000,000	107,924,000	
第１３回群馬県公募公債（１０年）	100,000,000	100,227,000	
第２８回群馬県公募公債（１０年）	100,000,000	96,831,000	
第３０回群馬県公募公債（１０年）	100,000,000	99,565,000	
第１５３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,196,000	
第１６１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	297,519,000	
第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,375,000	
第１７１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,064,000	
第１７５回共同発行市場公募地方債	150,000,000	148,467,000	
第１７８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,864,000	
第１８１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,512,000	
第１９４回共同発行市場公募地方債	160,000,000	155,652,800	
第２０９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,224,000	
第２２８回共同発行市場公募地方債	200,000,000	189,476,000	
第２３１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	190,428,000	
第２３３回共同発行市場公募地方債	200,000,000	190,156,000	
第２４３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,031,000	
平成２７年度第１回熊本市公募公債	100,000,000	100,215,000	
令和３年度第４回奈良県公募公債（５年）	100,000,000	98,899,000	
第７回大阪市公募公債（３０年）	100,000,000	79,639,000	

第１０回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	108,059,000	
第２２回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	89,075,000	
令和３年度第２回大阪市公募公債	100,000,000	95,572,000	
第３回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	112,206,000	
第１３回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	79,699,000	
第４９５回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	99,542,000	
第５２２回名古屋市公募公債（１０年）	200,000,000	193,158,000	
第５２５回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	97,792,000	
第６回京都市公募公債（２０年）	100,000,000	105,765,000	
平成２７年度第５回京都市公募公債	200,000,000	199,480,000	
令和４年度第３回京都市公募公債	200,000,000	193,158,000	
令和４年度第４回京都市公募公債	100,000,000	98,471,000	
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	106,775,000	
平成２４年度第１２回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	105,875,000	
平成２６年度第３回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	103,155,000	
令和２年度第９回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	70,239,000	
第５回横浜市公募公債（３０年）	100,000,000	113,926,000	
第７回横浜市公募公債（３０年）	100,000,000	112,409,000	
第２５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	105,960,000	
第２６回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	106,379,000	
平成２８年度第５回横浜市公募公債	100,000,000	99,341,000	
平成２９年度第５回横浜市公募公債	100,000,000	98,931,000	
第５５回横浜市公募公債（５年）	100,000,000	99,223,000	
令和３年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	95,569,000	
平成２５年度第５回札幌市公募公債（１５年）	200,000,000	205,682,000	
第８回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	107,546,000	
第１１回川崎市公募公債（２０年）	150,000,000	159,691,500	
第１３回川崎市公募公債（３０年）	200,000,000	176,198,000	
第６６回川崎市公募公債（５年）	200,000,000	197,588,000	
第８８回川崎市公募公債	100,000,000	100,194,000	
第９６回川崎市公募公債	100,000,000	98,131,000	
平成２５年度第６回福岡市公募公債（２０年）	400,000,000	414,864,000	
平成２９年度第１２回福岡市公募公債	130,000,000	128,243,700	
平成３０年度第９回福岡市公募公債（１０年）	100,000,000	98,606,000	
平成２７年度第２回広島市公募公債	100,000,000	100,196,000	
令和３年度第３回仙台市公募公債（５年）	135,000,000	133,380,000	
令和３年度第１回千葉市公募公債	100,000,000	95,950,000	
平成２７年度第１回三重県公募公債	100,000,000	100,196,000	
令和３年度第２回三重県公募公債	100,000,000	95,339,000	

	令和５年度第２回鹿児島県公募公債（５年）	100,000,000	99,177,000	
	令和５年度第５回福井県公募公債	100,000,000	97,466,000	
	平成２７年度第１回山梨県公募公債（１０年）	100,000,000	100,245,000	
地方債証券合計		21,243,300,000	21,150,307,994	
特殊債券	第１２９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	52,045,000	
	第１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,430,000	
	第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	154,914,000	
	第２１回道路債券	100,000,000	113,704,000	
	第２２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	218,716,000	
	第２７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,564,000	
	第２８回道路債券	300,000,000	343,212,000	
	第３３回道路債券	100,000,000	115,187,000	
	第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,761,000	
	第３９回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,923,000	
	第４３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,765,000	
	第４９回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,742,000	
	第８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,458,000	
	第９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,130,000	
	第９９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,034,000	
	第１０１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,842,000	
	第１０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,285,000	
	第１１１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,312,000	
	第１２３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,563,000	
	第１５５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,805,000	
	第１７６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,463,000	
	第１７８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,720,000	
	第１８３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,075,000	
	第２３５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,368,000	
	第２４６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,500,000	

第２５８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,254,000	
第２６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,977,000	
第２７３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,343,000	
第２８８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,058,000	
第３００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	297,393,000	
第３０１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	197,904,000	
第３０２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	91,559,000	
第３０７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	90,517,000	
第３１２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	185,984,000	
第３１６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	189,092,000	
第３２７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,877,000	
第３３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	243,000,000	239,952,780	
第３６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,396,000	
第４００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	333,955,000	
第４６７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	294,819,000	
第２回地方公営企業等金融機構債券（２０年）	100,000,000	107,285,000	
第４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	107,146,000	
第５回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	215,512,000	
第７回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	107,926,000	
第１２回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	107,770,000	
第１５回地方公共団体金融機構債券（２０年）	300,000,000	322,851,000	
第１７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	103,212,000	
第１７回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	106,470,000	
第１９回公営企業債券（２０年）	100,000,000	104,376,000	
第２２回公営企業債券（２０年）	200,000,000	210,100,000	
第２３回地方公共団体金融機構債券（２０年）	400,000,000	420,400,000	
第２４回公営企業債券（２０年）	100,000,000	106,122,000	
第３０回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	105,965,000	
第３４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	400,000,000	416,492,000	

第７５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,215,000	
Ｆ７６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,365,000	
第７７回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,270,000	
第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	421,000,000	421,454,680	
第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,882,000	
第８３回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,658,000	
第８８回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	161,922,000	
第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,115,000	
第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券	400,000,000	396,360,000	
第９６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,003,000	
第１０３回政府保証地方公共団体金融機構債券	133,000,000	131,333,510	
第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	111,615,750	
第１０７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,394,000	
第１１０回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	147,343,500	
第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,431,000	
第１１６回政府保証地方公共団体金融機構債券	120,000,000	117,178,800	
Ｆ２０２回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,592,000	
第２９回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	98,948,000	
第３３回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,034,000	
第２７回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,180,000	
第２８回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,557,000	
第１５９回都市再生債券	100,000,000	54,039,000	
第１６１回都市再生債券	100,000,000	60,094,000	
第１６９回都市再生債券	100,000,000	63,046,000	
第１９１回都市再生債券	100,000,000	85,729,000	
第５回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	114,222,000	112,226,541	
第６回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,405,000	
第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	40,536,000	39,820,539	
第９回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	49,304,000	48,329,259	
第１２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	10,040,000	10,071,726	
第２３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,854,000	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,421,000	12,759,348	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,071,000	14,550,539	
第２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,810,000	26,430,472	
第２９回政府保証住宅金融支援機構債券	200,000,000	195,546,000	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,277,000	18,873,195	

第３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,341,000	17,922,790	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,454,000	16,950,088	
第３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,060,000	36,893,346	
第４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,591,000	22,047,217	
第４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,415,000	21,997,059	
第４３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,123,000	
第４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,038,000	63,033,942	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,604,000	69,589,529	
第４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,013,000	16,455,599	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,579,000	17,007,732	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,545,000	17,999,590	
第５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,870,000	20,311,908	
第５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,860,000	21,323,717	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,439,000	23,910,358	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,407,000	22,884,493	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,268,000	31,259,870	
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,752,000	33,021,548	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,350,000	28,640,871	
第７１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,704,000	26,776,100	
第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,206,000	27,281,904	
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,187,000	32,500,179	
第８５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,212,000	
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,358,000	
第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,668,000	51,969,407	
第１０９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	123,276,000	115,503,448	
第１１１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,577,000	58,855,136	
第１１２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,542,000	61,172,970	
第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,323,000	61,144,940	
第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,558,000	60,206,145	
第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,196,000	60,993,465	
第１１５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,062,000	
第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,597,000	61,693,978	
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,993,000	61,883,615	
第１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,428,000	61,460,446	
第１２１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,815,000	62,384,497	
	68,464,000	63,730,399	

第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,886,000	64,841,628	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,422,000	63,648,197	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,475,000	65,351,467	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,280,000	65,834,208	
第１３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,055,000	66,780,574	
第１３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,917,000	66,710,928	
第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,844,000	66,167,605	
第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,820,000	67,579,257	
第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,473,000	68,891,754	
第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,483,000	69,220,939	
第１５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	240,255,000	217,764,729	
第１５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	238,461,000	217,485,970	
第１５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,813,000	72,763,117	
第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,174,000	146,433,025	
第１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,327,000	75,078,930	
第１６１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,452,000	75,074,195	
第１６２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,795,000	
第１６３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,162,000	76,536,081	
第１６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,201,000	77,280,715	
第１６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,977,000	77,651,982	
第１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,587,000	77,142,498	
第１６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	172,252,000	156,816,498	
第１７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,341,000	79,033,124	
第１７５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,937,000	80,721,889	
第１７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,166,000	162,464,765	
第１８１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,996,000	82,581,229	

第１８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,798,000	84,052,084	
第１８４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,617,000	
第１８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,426,000	169,120,606	
第１８８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,571,000	88,891,302	
第１９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,061,000	89,881,105	
第１９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,207,000	90,463,213	
第１９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,866,000	90,925,266	
第１９５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,309,000	92,146,525	
第１９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,414,000	93,067,470	
第１９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,909,000	94,247,878	
第２０５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,816,000	99,189,155	
第３４４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	89,211,000	
第３５４回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	183,054,000	
第３５６回一般担保住宅金融支援機構債券	500,000,000	469,895,000	
い第８４５号商工債	200,000,000	199,298,000	
い第８５３号商工債	100,000,000	98,993,000	
い第８７６号商工債	400,000,000	393,976,000	
い第８７８号商工債	100,000,000	98,315,000	
第３７６回信金中金債（５年）	200,000,000	198,560,000	
第３７９回信金中金債（５年）	100,000,000	99,049,000	
第３８６回信金中金債（５年）	100,000,000	98,654,000	
第３９４回信金中金債（５年）	100,000,000	98,476,000	
第２０回アンデス開発公社円貨債券（２０２３）	200,000,000	198,804,000	
第３４回国際協力機構債券	100,000,000	99,707,000	
第６７回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	193,508,000	
第７４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,504,000	
第８７回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	97,250,000	
第１０３回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,078,000	
第１１４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,799,000	
第８８回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,186,000	
第１００回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,865,000	
第１０１回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,950,000	
第１０３回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,407,000	
第１０７回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,512,000	
第２７回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,240,000	
第２９回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,554,000	

	第５６回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,638,000	
	第７７回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	296,634,000	
	第８０回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,100,000	
	第８７回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,079,000	
	第９０回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,000,000	
	第６６回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,568,000	
特殊債券合計		23,004,934,000	22,520,529,833	
社債券	第４１回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	100,153,000	
	第３２回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	300,000,000	298,743,000	
	第１９回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,276,000	
	第２５回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,946,000	
	第３回韓国輸出入銀行保証株式會社大韓航空円貨社債（２０２３）	100,000,000	99,398,000	
	第８回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債（２０２３）	200,000,000	199,318,000	
	第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,532,000	
	第１７回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	100,000,000	99,510,000	
	第１２回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	97,742,000	
	第５回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,620,000	
	第２４回大和ハウス工業株式会社無担保社債	200,000,000	198,024,000	
	第３回高砂熱学工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,906,000	
	第２回ＤＭ三井製糖ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,678,000	
	第１９回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,103,000	
	第２２回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,182,000	
	第１２回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	95,717,000	
	第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,779,000	
	第１１回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,384,000	
	第１０回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,284,000	
	第２５回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,006,000	
	第１４回株式会社セブン＆アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	99,578,000	
	第１６回株式会社セブン＆アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	99,446,000	
	第３０回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	98,980,000	
	第１９回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,674,000	
	第３１回レンゴー株式会社無担保社債	100,000,000	98,953,000	
	第１３回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,777,000	

第２２回三菱瓦斯化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,627,000	
第５６回三井化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,200,000	
第３２回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	98,649,000	
第４２回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	77,211,000	
第１４回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	98,076,000	
第６回株式会社電通無担保社債	100,000,000	96,836,000	
第１６回武田薬品工業株式会社無担保社債	200,000,000	187,514,000	
第１回アステラス製薬株式会社無担保社債	200,000,000	199,410,000	
第３回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	99,362,000	
第３回株式会社ツムラ無担保社債	100,000,000	98,333,000	
第１３回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	94,794,000	
第２０回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,606,000	
第４回ＥＮＥＯＳホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	95,638,000	
第１４回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	97,414,000	
第９回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	98,814,000	
第９回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	97,933,000	
第１５回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	98,683,000	
第３４回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	98,429,000	
第１４回株式会社ＬＩＸＩＬ無担保社債	100,000,000	98,735,000	
第１７回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,833,000	
第１７回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	96,552,000	
第５３回日本精工株式会社無担保社債	100,000,000	98,846,000	
第２０回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	96,063,000	
第２３回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	95,131,000	
第２６回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,035,000	
第３７回ソニーグループ株式会社無担保社債	300,000,000	299,139,000	
第８回ＴＤＫ株式会社無担保社債	100,000,000	98,686,000	
第１５回株式会社デンソー無担保社債	200,000,000	197,524,000	
第１回株式会社東海理化電機製作所無担保社債	100,000,000	98,514,000	
第２５回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,279,000	
第３０回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,829,000	
第３０回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,305,000	
第３２回マツダ株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第８回株式会社ＳＵＢＡＲＵ無担保社債	100,000,000	98,773,000	
第１回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,174,000	
第６回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	81,211,000	
第１１９回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,523,000	
第６９回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	106,787,000	
第６０回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	95,449,000	

第４４回株式会社丸井グループ無担保社債	200,000,000	196,794,000	
第８７回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	97,789,000	
第９９回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	98,496,000	
第２２回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	95,839,000	
第２４回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	98,711,000	
第９回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,336,000	
第２５回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,093,000	
第２３回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	98,954,000	
第４１回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,276,000	
第１６回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,495,000	
第１８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	96,271,000	
第２５回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	300,000,000	294,276,000	
第２８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,082,000	
第３４回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,382,000	
第３４回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,350,000	
第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,140,000	
第６５回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,630,000	
第７６回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,466,000	
第９４回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,592,000	
第９８回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,666,000	
第３６回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	96,483,000	
第１７回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	98,875,000	
第２０回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,643,000	
第３５回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,701,000	
第２１７回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	98,779,000	
第3回三菱ＨＣキャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	93,301,000	
第7回三菱ＨＣキャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,164,000	
第８２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,323,000	
第３８回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,721,000	
	100,000,000	98,586,000	

第３回野村ホールディングス株式会社無担保社債			
第４回野村ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,409,000	
第７回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,414,000	
第７回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	100,000,000	98,726,000	
第１回損害保険ジャパン株式会社無担保社債	100,000,000	98,620,000	
第４７回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	105,249,000	
第７８回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	82,958,000	
第８３回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	105,077,000	
第１１８回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,039,000	
第１３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	81,534,000	
第１４３回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	96,377,000	
第１１１回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	98,856,000	
第３回東急株式会社無担保社債	100,000,000	96,389,000	
第４５回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	82,168,000	
第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	82,682,000	
第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	69,400,000	
第４２回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	82,737,000	
第４９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,263,000	
第６７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,182,000	
第１２９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	70,623,000	
第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	68,786,000	
第１６５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	80,689,000	
第１６６回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	68,994,000	
第１７６回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	59,599,000	
第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	65,519,000	
第５１回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	77,121,000	
第５１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,056,000	
第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	95,966,000	
第８回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	105,391,000	
第１０回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	107,070,000	
第１３回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	104,122,000	
第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	68,513,000	
第５６回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	72,117,000	
第４５回西日本鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	194,902,000	
	100,000,000	99,301,000	

第５８回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債			
第１３回日本航空株式会社無担保社債	100,000,000	98,897,000	
第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	200,000,000	195,408,000	
第１７回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	96,650,000	
第３１回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	83,314,000	
第３７回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	81,059,000	
第５３５回中部電力株式会社社債	200,000,000	192,408,000	
第５０９回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,150,000	
第５１０回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,107,000	
第５３６回関西電力株式会社社債	200,000,000	190,790,000	
第５４１回関西電力株式会社社債	100,000,000	93,761,000	
第５５４回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,850,000	
第４２５回中国電力株式会社社債	100,000,000	95,812,000	
第４２６回中国電力株式会社社債	100,000,000	95,423,000	
第４４３回中国電力株式会社社債	200,000,000	197,948,000	
第４４８回中国電力株式会社社債	100,000,000	95,662,000	
第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,747,000	
第３２１回北陸電力株式会社社債	100,000,000	98,956,000	
第３６４回北陸電力株式会社社債	100,000,000	95,506,000	
第５０８回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,695,000	
第５２１回東北電力株式会社社債	100,000,000	96,334,000	
第５３５回東北電力株式会社社債	200,000,000	194,666,000	
第５３６回東北電力株式会社社債	100,000,000	93,193,000	
第２９６回四国電力株式会社社債	100,000,000	98,698,000	
第４６８回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,168,000	
第５０７回九州電力株式会社社債	200,000,000	189,530,000	
第５１６回九州電力株式会社社債	300,000,000	286,986,000	
第３２３回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,321,000	
第３２６回北海道電力株式会社社債	200,000,000	200,658,000	
第３５７回北海道電力株式会社社債	100,000,000	97,553,000	
第３８５回北海道電力株式会社社債	100,000,000	96,484,000	
第５６回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	92,541,000	
第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	97,965,000	
第８４回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,756,000	
第８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,449,000	
第３１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,639,000	
第３９回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,454,000	
第４２回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,110,000	
第４８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	260,451,000	
	100,000,000	95,958,000	

	第６６回東京電力パワーグリッド株式会社社債			
	第２２回株式会社ＪＥＲＡ無担保社債	100,000,000	99,323,000	
	第４回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	100,000,000	98,990,000	
	第３８回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	98,397,000	
	第４１回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	94,504,000	
	第４２回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	80,181,000	
	第７回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	98,468,000	
社債券合計		20,400,000,000	19,631,609,000	
合計			411,418,605,377	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2024年 7月25日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	11,145,975,111
コール・ローン	1,443,823,471
株式	530,220,263,004
投資信託受益証券	109,365,305
投資証券	10,211,397,866
派生商品評価勘定	37,598,169
未収入金	1
未収配当金	354,346,401
未収利息	2,594
前払金	99,198,865
差入委託証拠金	4,022,247,966
流動資産合計	557,644,218,753
資産合計	557,644,218,753
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	188,259,866
未払解約金	212,139,535
流動負債合計	400,399,401
負債合計	400,399,401
純資産の部	
元本等	
元本	78,976,212,309
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	478,267,607,043
元本等合計	557,243,819,352
純資産合計	557,243,819,352
負債純資産合計	557,644,218,753

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月25日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (4)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 7月25日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	78,976,212,309口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 7.0558円 (1万口当たり純資産額) (70,558円)

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	2024年 7月25日現在
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
３.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2024年 7月25日現在
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 7月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月26日
期首元本額	77,486,252,195円
期中追加設定元本額	8,346,956,355円
期中一部解約元本額	6,856,996,241円
期末元本額	78,976,212,309円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,383,145,798円
ＤＣ外国株式インデックスファンド	5,208,662,274円
ＤＣ外国株式インデックスファンドＬ	30,633,857,783円
ＤＣバランスファンド３０	443,712,560円

区分	2024年 7月25日現在
ＤＣバランスファンド５０	1,006,774,124円
ＤＣバランスファンド７０	811,451,354円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	233,273,030円
外国株式インデックスｅ	4,153,968,547円
インデックスコレクション（外国株式）	19,887,911,445円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	2,249,771,400円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	1,100,113,723円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	1,308,735,111円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,071,725,700円
外国株式パッシブファンド私募Ａ（適格機関投資家専用）	1,577,072,179円
外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	263,532,667円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	8,682,098円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	128,287,597円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	17,664,897円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	45,305,143円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	57,028,579円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	101,978,807円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	105,357,747円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	2,173,795,681円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	267,259,276円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	43,018,361円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	340,937,889円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	5,632,608円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	43,358,171円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	40,613,792円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	135,808,414円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	4,411,830円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	30,684,186円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	86,465,208円
私募外国株式インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	6,214,330円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 7月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	41,285,971,198
投資信託受益証券	△3,249,891
投資証券	565,574,220
合計	41,848,295,527

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 7月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	16,782,128,088	－	16,682,929,223	△99,198,865
合計		16,782,128,088	－	16,682,929,223	△99,198,865

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2024年 7月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,233,806,602	－	1,182,343,770	△51,462,832
	アメリカドル	963,314,062	－	924,146,850	△39,167,212
	ユーロ	208,838,520	－	199,039,080	△9,799,440
	イギリスポンド	61,654,020	－	59,157,840	△2,496,180
合計		1,233,806,602	－	1,182,343,770	△51,462,832

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	17,739	30.28	537,136.92	
	BAKER HUGHES CO	56,594	34.90	1,975,130.60	
	CHENIERE ENERGY INC	13,711	174.91	2,398,191.01	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	5,333	77.66	414,160.78	
	CHEVRON CORP	99,356	155.07	15,407,134.92	
	CHORD ENERGY CORP	3,500	170.78	597,730.00	
	CONOCOPHILLIPS	66,583	111.10	7,397,371.30	
	COTERRA ENERGY INC	41,058	25.79	1,058,885.82	
	DEVON ENERGY CORPORATION	36,666	45.58	1,671,236.28	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	9,733	198.83	1,935,212.39	
	EOG RESOURCES INC	33,038	125.10	4,133,053.80	
	EQT CORPORATION	31,839	35.10	1,117,548.90	
	EXXON MOBIL	253,667	115.01	29,174,241.67	
	HALLIBURTON CO	51,295	32.99	1,692,222.05	
	HESS CORP	15,786	147.01	2,320,699.86	
	HF SINCLAIR CORP	8,443	48.53	409,738.79	
	KINDER MORGAN INC	105,760	21.05	2,226,248.00	
	MARATHON OIL CORP	36,460	27.86	1,015,775.60	
	MARATHON PETROLEUM CORP	21,104	167.55	3,535,975.20	

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	38,623	60.07	2,320,083.61	
ONEOK INC	31,717	82.16	2,605,868.72	
OVINTIV INC	13,202	45.64	602,539.28	
PHILLIPS 66	24,974	138.17	3,450,657.58	
SCHLUMBERGER	78,329	48.03	3,762,141.87	
TARGA RESOURCES CORP	11,099	131.62	1,460,850.38	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,050	793.47	833,143.50	
VALERO ENERGY CORP	18,652	148.82	2,775,790.64	
WILLIAMS COS	67,360	42.49	2,862,126.40	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	12,269	260.20	3,192,393.80	
ALBEMARLE CORP	6,375	90.88	579,360.00	
AMCOR PLC	82,838	10.08	835,007.04	
AVERY DENNISON CORP	4,953	214.79	1,063,854.87	
BALL CORP	17,147	62.06	1,064,142.82	
CELANESE CORP-SERIES A	6,990	136.13	951,548.70	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	71.48	741,890.92	
CLEVELAND-CLIFFS INC	27,048	14.94	404,097.12	
CORTEVA INC	40,775	53.82	2,194,510.50	
CRH PLC	38,902	79.67	3,099,322.34	
CROWN HOLDINGS INC	6,218	85.03	528,716.54	
DOW INC	38,891	53.32	2,073,668.12	
DUPONT DE NEMOURS INC	23,669	79.59	1,883,815.71	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,266	96.38	603,917.08	
ECOLAB INC	14,774	245.43	3,625,982.82	
FREEPORT-MCMORAN INC	81,305	44.18	3,592,054.90	
INT'L PAPER CO	17,345	46.28	802,726.60	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,928	98.08	1,366,058.24	
LINDE PLC	27,416	443.76	12,166,124.16	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,698	95.28	1,400,425.44	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,496	537.83	1,880,253.68	
MOSAIC CO/THE	18,682	28.56	533,557.92	
NEWMONT CORPORATION	65,758	47.70	3,136,656.60	
NUCOR CORP	14,369	154.79	2,224,177.51	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,174	193.28	1,000,030.72	
PPG INDUSTRIES INC	12,407	125.24	1,553,852.68	
RELIANCE INC	3,200	293.82	940,224.00	
RPM INTERNATIONAL INC	6,687	110.88	741,454.56	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	13,583	332.02	4,509,827.66	
STEEL DYNAMICS INC	9,667	123.29	1,191,844.43	
VULCAN MATERIALS CO	7,535	250.51	1,887,592.85	
WESTLAKE CORP	2,096	141.26	296,080.96	
3 M COMPANY	32,049	103.25	3,309,059.25	

AECOM	7,200	87.36	628,992.00	
AERCAP HOLDINGS NV	10,161	93.21	947,106.81	
ALLEGION PLC	4,638	127.86	593,014.68	
AMETEK INC	12,923	166.95	2,157,494.85	
AXON ENTERPRISE INC	4,329	313.11	1,355,453.19	
BOEING CO	32,250	180.07	5,807,257.50	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	6,900	154.12	1,063,428.00	
CARLISLE COS INC	2,870	412.27	1,183,214.90	
CARRIER GLOBAL CORP	47,961	65.99	3,164,946.39	
CATERPILLAR	28,272	336.04	9,500,522.88	
CNH INDUSTRIAL NV	57,411	9.88	567,220.68	
CUMMINS INC	7,929	281.57	2,232,568.53	
DEERE&CO	15,208	369.39	5,617,683.12	
DOVER CORP	7,491	176.33	1,320,888.03	
EATON CORP	22,922	299.60	6,867,431.20	
EMCOR GROUP INC	2,930	356.73	1,045,218.90	
EMERSON ELECTRIC CO	32,395	114.08	3,695,621.60	
FASTENAL CO	31,790	67.31	2,139,784.90	
FERGUSON PLC	11,566	208.36	2,409,891.76	
FORTIVE CORP	20,480	70.40	1,441,792.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,412	69.04	442,684.48	
GE VERNOVA INC	15,289	162.90	2,490,578.10	
GENERAL DYNAMICS CORP	12,920	284.67	3,677,936.40	
GENERAL ELECTRIC CO	61,157	162.30	9,925,781.10	
GRACO INC	8,952	81.08	725,828.16	
GRAINGER (WW) INC	2,535	932.63	2,364,217.05	
HEICO CORP	2,252	227.10	511,429.20	
HEICO CORP-CLASS A	4,228	180.41	762,773.48	
HONEYWELL INTL INC	37,375	213.65	7,985,168.75	
HOWMET AEROSPACE INC	22,727	79.59	1,808,841.93	
HUBBELL INC	2,787	356.98	994,903.26	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	265.30	528,742.90	
IDEX CORP	3,918	198.71	778,545.78	
ILLINOIS TOOL WORKS	17,252	239.30	4,128,403.60	
INGERSOLL-RAND INC	22,994	95.75	2,201,675.50	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,600	35.83	343,968.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	39,654	67.54	2,678,231.16	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	10,469	237.15	2,482,723.35	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,584	541.15	857,181.60	
LOCKHEED MARTIN CORP	12,498	515.20	6,438,969.60	
MASCO CORP	12,110	70.58	854,723.80	
NORDSON CORP	3,191	235.99	753,044.09	

NORTHROP GRUMMAN CORP	7,890	442.12	3,488,326.80	
OTIS WORLDWIDE CORP	23,094	91.43	2,111,484.42	
OWENS CORNING	4,965	174.65	867,137.25	
PACCAR INC	29,938	98.90	2,960,868.20	
PARKER HANNIFIN CORP	7,433	529.26	3,933,989.58	
PENTAIR PLC	9,772	83.80	818,893.60	
QUANTA SERVICES INC	8,208	251.92	2,067,759.36	
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,432	263.07	1,692,066.24	
RTX CORP	75,277	104.83	7,891,287.91	
SMITH (A.O.) CORP	6,846	80.76	552,882.96	
SNAP-ON INC	2,772	270.07	748,634.04	
STANLEY BLACK&DECKER	8,223	86.39	710,384.97	
TEXTRON	10,911	90.12	983,299.32	
TORO CO	5,600	95.47	534,632.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	13,119	332.84	4,366,527.96	
TRANSDIGM GROUP INC	3,041	1,245.48	3,787,504.68	
UNITED RENTALS INC	3,678	715.82	2,632,785.96	
VERTIV HOLDINGS CO-A	21,018	78.59	1,651,804.62	
WABTEC CORP	10,381	157.28	1,632,723.68	
WATSCO INC	2,000	480.44	960,880.00	
XYLEM INC	12,709	136.71	1,737,447.39	
AUTOMATIC DATA PROCESS	23,247	247.10	5,744,333.70	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,038	154.09	1,084,485.42	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	6,756	203.15	1,372,481.40	
CINTAS CORP	5,087	754.05	3,835,852.35	
COPART INC	46,764	51.16	2,392,446.24	
DAYFORCE INC	9,041	51.29	463,712.89	
EQUIFAX INC	6,976	260.89	1,819,968.64	
JACOBS SOLUTIONS INC	6,625	142.93	946,911.25	
LEIDOS HOLDINGS	6,940	150.10	1,041,694.00	
PAYCHEX INC	17,989	123.24	2,216,964.36	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,625	158.58	416,272.50	
PAYLOCITY HOLDING CORP	2,200	142.31	313,082.00	
REPUBLIC SERVICES INC	12,099	199.67	2,415,807.33	
ROLLINS INC	15,210	49.95	759,739.50	
SMURFIT WESTROCK PLC	28,341	48.86	1,384,741.26	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	12,962	67.33	872,731.46	
TRANSUNION	10,758	77.63	835,143.54	
VERALTO CORP	12,852	99.30	1,276,203.60	
VERISK ANALYTICS INC	8,140	276.55	2,251,117.00	
WASTE CONNECTIONS INC	13,987	179.71	2,513,603.77	
WASTE MANAGEMENT INC	22,353	217.38	4,859,095.14	

C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,274	90.21	565,977.54	
CSX CORP	112,980	33.20	3,750,936.00	
DELTA AIR LINES INC	7,841	42.94	336,692.54	
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,512	124.03	1,055,743.36	
FEDEX CORP	13,559	298.28	4,044,378.52	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	134,628	3.36	452,350.08	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,321	163.80	707,779.80	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,000	48.98	489,800.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,643	221.34	2,798,401.62	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	11,264	194.62	2,192,199.68	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,754	26.61	179,723.94	
U-HAUL HOLDING CO	5,076	61.70	313,189.20	
UBER TECHNOLOGIES INC	107,529	66.14	7,111,968.06	
UNION PACIFIC CORP	34,272	237.38	8,135,487.36	
UNITED PARCEL SERVICE B	40,861	128.53	5,251,864.33	
APTIV PLC	16,326	67.08	1,095,148.08	
FORD MOTOR COMPANY	217,837	13.67	2,977,831.79	
GENERAL MOTORS CO	65,358	46.49	3,038,493.42	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	40,190	16.27	653,891.30	
TESLA INC	162,662	215.99	35,133,365.38	
DECKERS OUTDOOR CORP	1,400	846.04	1,184,456.00	
DR HORTON INC	17,138	171.07	2,931,797.66	
GARMIN LTD	9,152	172.84	1,581,831.68	
LENNAR CORP-CL A	14,595	168.79	2,463,490.05	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,410	272.06	1,743,904.60	
NIKE B	69,265	71.09	4,924,048.85	
NVR INC	188	8,404.49	1,580,044.12	
PULTE GROUP INC	12,386	122.56	1,518,028.16	
AIRBNB INC-CLASS A	25,073	144.23	3,616,278.79	
BOOKING HOLDINGS INC	1,935	3,805.78	7,364,184.30	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	12,243	34.21	418,833.03	
CARNIVAL CORPORATION	57,539	18.19	1,046,634.41	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	75,900	51.78	3,930,102.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	6,950	139.43	969,038.50	
DOMINO'S PIZZA INC	1,797	424.73	763,239.81	
DOORDASH INC - A	14,879	102.46	1,524,502.34	
DRAFTKINGS INC	24,000	35.86	860,640.00	
EXPEDIA GROUP INC	8,454	128.49	1,086,254.46	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	14,280	214.60	3,064,488.00	
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,200	150.31	480,992.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	19,449	40.32	784,183.68	
MARRIOTT INTL A	14,322	235.04	3,366,242.88	

MCDONALD'S CORP	40,896	253.37	10,361,819.52	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,799	42.44	670,509.56	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,495	164.51	2,384,572.45	
STARBUCKS CORP	64,570	74.68	4,822,087.60	
WYNN RESORTS LTD	5,210	80.97	421,853.70	
YUM BRANDS INC	14,772	125.95	1,860,533.40	
ALPHABET INC-CL A	333,825	172.63	57,628,209.75	
ALPHABET INC-CL C	289,456	174.37	50,472,442.72	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	5,239	312.66	1,638,025.74	
COMCAST CORP-CL A	224,579	38.09	8,554,214.11	
ELECTRONIC ARTS INC	14,435	141.18	2,037,933.30	
FOX CORP - CLASS A	15,560	37.09	577,120.40	
FOX CORP- CLASS B	6,975	34.47	240,428.25	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	22,646	29.57	669,642.22	
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	12,328	79.32	977,856.96	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	8,618	92.67	798,630.06	
MATCH GROUP INC	14,456	32.99	476,903.44	
META PLATFORMS INC-CLASS A	123,975	461.27	57,185,948.25	
NETFLIX INC	24,501	635.99	15,582,390.99	
NEWS CORP-CLASS A	22,307	27.31	609,204.17	
OMNICOM GROUP	10,921	90.75	991,080.75	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	30,808	11.65	358,913.20	
PINTEREST INC- CLASS A	35,629	38.81	1,382,761.49	
ROBLOX CORP -CLASS A	24,726	39.96	988,050.96	
ROKU INC	6,927	55.59	385,071.93	
SEA LTD-ADR	19,867	65.21	1,295,527.07	
SNAP INC - A	62,654	13.58	850,841.32	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	8,959	152.89	1,369,741.51	
THE WALT DISNEY CO	102,577	89.80	9,211,414.60	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	26,248	89.32	2,344,471.36	
WARNER BROS DISCOVERY INC	122,994	8.47	1,041,759.18	
AMAZON.COM	529,993	180.83	95,838,634.19	
AUTOZONE INC	975	2,941.73	2,868,186.75	
BATH & BODY WORKS INC	13,789	34.35	473,652.15	
BEST BUY COMPANY INC	10,832	87.73	950,291.36	
BURLINGTON STORES INC	3,549	246.39	874,438.11	
CARMAX INC	9,366	79.90	748,343.40	
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,000	201.40	805,600.00	
EBAY	29,667	53.66	1,591,931.22	
ETSY INC	6,573	60.26	396,088.98	
GENUINE PARTS CO	7,768	135.74	1,054,428.32	
GLOBAL-E ONLINE LTD	6,000	34.07	204,420.00	

HOME DEPOT	56,243	350.31	19,702,485.33	
LKQ CORP	13,325	44.48	592,696.00	
LOWES COMPANIES	31,948	231.67	7,401,393.16	
MERCADOLIBRE INC	2,509	1,642.55	4,121,157.95	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,383	1,050.71	3,554,551.93	
POOL CORP	2,087	327.19	682,845.53	
ROSS STORES INC	18,500	142.09	2,628,665.00	
TJX COMPANIES INC	64,603	111.25	7,187,083.75	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,763	262.52	1,512,902.76	
ULTA BEAUTY INC	2,749	369.61	1,016,057.89	
WILLIAMS-SONOMA INC	7,000	151.15	1,058,050.00	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	19,000	20.19	383,610.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	25,209	830.82	20,944,141.38	
DOLLAR GENERAL CORP	12,157	117.05	1,422,976.85	
DOLLAR TREE INC	11,506	103.69	1,193,057.14	
KROGER CO	38,327	54.18	2,076,556.86	
SYSCO CORP	28,275	71.20	2,013,180.00	
TARGET (DAYTON HUDSON)	26,160	146.45	3,831,132.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	40,229	11.16	448,955.64	
WALMART INC	252,213	70.60	17,806,237.80	
ALTRIA GROUP INC	100,574	49.42	4,970,367.08	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	30,271	62.65	1,896,478.15	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	10,307	43.72	450,622.04	
BUNGE GLOBAL SA	8,498	112.09	952,540.82	
CAMPBELL SOUP CO (US)	10,059	46.47	467,441.73	
CELSIUS HOLDINGS INC	9,664	45.64	441,064.96	
COCA-COLA CO	230,231	65.81	15,151,502.11	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	12,052	73.00	879,796.00	
CONAGRA BRANDS INC	26,163	29.86	781,227.18	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	9,454	246.88	2,334,003.52	
GENERAL MILLS INC	31,192	65.51	2,043,387.92	
HERSHEY FOODS CORPORATION	7,990	192.10	1,534,879.00	
HORMEL FOODS CORP	15,714	31.51	495,148.14	
JM SMUCKER CO	5,275	116.78	616,014.50	
KELLANOVA	16,208	57.23	927,583.84	
KEURIG DR PEPPER INC	60,387	32.77	1,978,881.99	
KRAFT HEINZ CO/THE	49,492	33.05	1,635,710.60	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	8,000	56.42	451,360.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,652	74.23	1,013,387.96	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	10,122	53.37	540,211.14	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	76,844	66.40	5,102,441.60	
MONSTER BEVERAGE CORP	43,508	49.59	2,157,561.72	

PEPSICO INC	77,137	168.17	12,972,129.29	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	87,258	111.44	9,724,031.52	
TYSON FOODS INC	14,778	59.38	877,517.64	
CHURCH & DWIGHT CO INC	14,150	100.35	1,419,952.50	
CLOROX COMPANY	6,394	132.80	849,123.20	
COLGATE-PALMOLIVE CO	43,378	96.60	4,190,314.80	
ESTEE LAUDER CO-CL A	13,683	99.80	1,365,563.40	
KENVUE INC	99,317	18.17	1,804,589.89	
KIMBERLY-CLARK CORP	18,647	140.51	2,620,089.97	
PROCTER & GAMBLE CO	133,078	168.00	22,357,104.00	
ABBOTT LABORATORIES	97,490	107.26	10,456,777.40	
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,193	244.80	1,026,446.40	
BAXTER INTERNATIONAL	26,594	35.49	943,821.06	
BECTON DICKINSON & CO	16,036	237.34	3,805,984.24	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	81,576	77.76	6,343,349.76	
CARDINAL HEALTH	14,569	96.71	1,408,967.99	
CENCORA INC	9,745	225.98	2,202,175.10	
CENTENE CORP	29,946	66.12	1,980,029.52	
COOPER COS INC/THE	10,244	91.99	942,345.56	
CVS HEALTH CORP	73,487	58.54	4,301,928.98	
DAVITA INC	3,582	143.81	515,127.42	
DEXCOM INC	22,165	111.94	2,481,150.10	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	34,369	86.95	2,988,384.55	
ELEVANCE HEALTH INC	13,315	512.12	6,818,877.80	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	25,756	79.69	2,052,495.64	
HCA HEALTHCARE INC	11,263	343.94	3,873,796.22	
HENRY SCHEIN INC	7,493	70.29	526,682.97	
HOLOGIC INC	12,961	78.34	1,015,364.74	
HUMANA INC	6,841	386.30	2,642,678.30	
IDEXX LABORATORIES INC	4,914	471.34	2,316,164.76	
INSULET CORP	3,546	194.38	689,271.48	
INTUITIVE SURGICAL INC	20,303	454.02	9,217,968.06	
LABCORP HOLDINGS INC	5,238	209.49	1,097,308.62	
MCKESSON CORP	7,488	589.99	4,417,845.12	
MEDTRONIC PLC	76,021	79.97	6,079,399.37	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,516	288.72	1,015,139.52	
QUEST DIAGNOSTICS	6,246	143.91	898,861.86	
RESMED INC	8,586	206.20	1,770,433.20	
SOLVENTUM CORP	8,012	58.09	465,417.08	
STERIS PLC	5,851	231.72	1,355,793.72	
STRYKER CORP	19,207	340.42	6,538,446.94	
TELEFLEX INC	2,672	224.57	600,051.04	

THE CIGNA GROUP	15,977	342.21	5,467,489.17	
UNITEDHEALTH GROUP INC	52,063	559.75	29,142,264.25	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	185.97	724,911.06	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	8,403	184.25	1,548,252.75	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,864	110.55	1,311,565.20	
ABBVIE INC	100,779	176.21	17,758,267.59	
AGILENT TECHNOLOGIES	15,996	134.16	2,146,023.36	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,056	236.48	1,668,602.88	
AMGEN	29,982	335.61	10,062,259.02	
AVANTOR INC	34,993	22.37	782,793.41	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,302	309.91	403,502.82	
BIO-TECHNE CORP	8,884	77.61	689,487.24	
BIOGEN INC	8,034	226.03	1,815,925.02	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	10,231	84.63	865,849.53	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	114,226	44.66	5,101,333.16	
CATALENT INC	11,603	58.40	677,615.20	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,641	222.41	587,384.81	
DANAHER CORP	40,172	265.76	10,676,110.72	
ELI LILLY & CO	45,828	859.88	39,406,580.64	
EXACT SCIENCES CORP	9,063	47.85	433,664.55	
GILEAD SCIENCES INC	70,144	73.50	5,155,584.00	
ILLUMINA INC	8,558	116.29	995,209.82	
INCYTE CORP	10,628	66.91	711,119.48	
IQVIA HOLDINGS INC	10,091	238.75	2,409,226.25	
JOHNSON & JOHNSON	135,984	156.28	21,251,579.52	
MERCK & CO	144,010	125.92	18,133,739.20	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,168	1,384.56	1,617,166.08	
MODERNA INC	17,875	118.19	2,112,646.25	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,281	145.88	916,272.28	
PFIZER	316,987	29.98	9,503,270.26	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,128	1,060.86	6,500,950.08	
REPLIGEN CORP	2,737	131.39	359,614.43	
REVVITY INC	6,426	111.61	717,205.86	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	23,158	28.67	663,939.86	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56,857	16.50	938,140.50	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	21,601	574.73	12,414,742.73	
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,421	331.59	802,779.39	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,517	490.80	7,124,943.60	
VIATRIS INC	63,857	11.70	747,126.90	
WATERS CORP	3,306	305.31	1,009,354.86	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,264	323.77	1,380,555.28	
ZOETIS INC	26,169	179.66	4,701,522.54	

BANK OF AMERICA CORP	401,937	42.19	16,957,722.03	
CITIGROUP	107,016	63.66	6,812,638.56	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	25,193	42.22	1,063,648.46	
FIFTH THIRD BANCORP	37,082	40.98	1,519,620.36	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	573	1,862.27	1,067,080.71	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	78,770	14.92	1,175,248.40	
JPMORGAN CHASE & CO	162,226	208.59	33,838,721.34	
KEY CORP	48,984	15.79	773,457.36	
M & T BANK CORP	9,606	171.68	1,649,158.08	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	23,164	177.40	4,109,293.60	
REGIONS FINL CORP	49,382	22.11	1,091,836.02	
TRUIST FINANCIAL CORP	76,097	43.61	3,318,590.17	
US BANCORP	85,114	44.77	3,810,553.78	
WELLS FARGO & CO	200,438	59.44	11,914,034.72	
ALLY FINANCIAL INC	18,129	42.24	765,768.96	
AMERICAN EXPRESS	32,633	240.99	7,864,226.67	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,866	424.25	2,488,650.50	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	22,034	121.72	2,681,978.48	
ARES MANAGEMENT CORP - A	9,376	144.51	1,354,925.76	
BANK NEW YORK CO	45,067	63.90	2,879,781.30	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	74,385	432.80	32,193,828.00	
BLACKROCK INC	8,457	827.65	6,999,436.05	
BLACKSTONE INC	39,953	137.63	5,498,731.39	
BLOCK INC	30,502	61.71	1,882,278.42	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,406	146.41	2,987,642.46	
CARLYLE GROUP INC/THE	10,351	44.74	463,103.74	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,992	185.17	1,109,538.64	
CME GROUP INC	19,867	197.25	3,918,765.75	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	10,291	245.06	2,521,912.46	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,500	29.00	565,500.00	
CORPAY INC	3,879	285.98	1,109,316.42	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,285	140.26	2,003,614.10	
EQUITABLE HOLDINGS INC	18,461	41.68	769,454.48	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,972	403.21	795,130.12	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	31,029	75.33	2,337,414.57	
FISERV INC	34,179	161.16	5,508,287.64	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	22.88	337,434.24	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,286	60.90	139,217.40	
GLOBAL PAYMENTS INC	15,111	98.38	1,486,620.18	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	18,693	486.70	9,097,883.10	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	32,467	147.51	4,789,207.17	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,514	167.93	590,106.02	

KKR & CO INC	36,018	115.73	4,168,363.14	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,096	227.00	929,792.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,112	218.04	460,500.48	
MASTERCARD INC-CLASS A	47,345	432.45	20,474,345.25	
MOODY'S CORP	9,174	433.81	3,979,772.94	
MORGAN STANLEY	70,454	101.97	7,184,194.38	
MSCI INC	4,355	534.20	2,326,441.00	
NASDAQ INC	24,462	62.73	1,534,501.26	
NORTHERN TRUST CORP	11,862	86.45	1,025,469.90	
PAYPAL HOLDINGS INC	57,102	58.07	3,315,913.14	
PRICE T ROWE GROUP INC	11,505	114.38	1,315,941.90	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,494	112.22	1,289,856.68	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	24,000	21.41	513,840.00	
S&P GLOBAL INC	18,434	481.66	8,878,920.44	
SCHWAB (CHARLES) CORP	86,629	64.08	5,551,186.32	
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	66.25	416,646.25	
STATE STREET CORP	17,821	82.96	1,478,430.16	
SYNCHRONY FINANCIAL	23,931	49.88	1,193,678.28	
TOAST INC-CLASS A	20,887	24.80	517,997.60	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	6,542	108.10	707,190.20	
VISA INC-CLASS A SHARES	88,763	254.17	22,560,891.71	
AFLAC	31,141	94.14	2,931,613.74	
ALLSTATE CORP	14,193	172.34	2,446,021.62	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,803	124.56	473,701.68	
AMERICAN INT'L GROUP	40,246	75.26	3,028,913.96	
AON PLC	11,563	298.20	3,448,086.60	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	20,703	96.40	1,995,769.20	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	11,870	274.32	3,256,178.40	
ASSURANT INC	2,684	169.88	455,957.92	
BROWN & BROWN INC	13,365	97.56	1,303,889.40	
CHUBB LTD	23,361	260.04	6,074,794.44	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,751	120.03	930,352.53	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,444	383.53	553,817.32	
EVEREST GROUP LTD	2,474	381.54	943,929.96	
FNF GROUP	12,836	53.15	682,233.40	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	16,673	101.94	1,699,645.62	
LOEWS CORP	10,482	77.92	816,757.44	
MARKEL GROUP INC	702	1,565.20	1,098,770.40	
MARSH & MCLENNAN COS	27,850	217.48	6,056,818.00	
METLIFE INC	35,762	74.52	2,664,984.24	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,725	83.73	1,065,464.25	
PROGRESSIVE CORP	32,935	215.44	7,095,516.40	

PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,869	123.38	2,574,817.22	
TRAVELERS COS INC/THE	12,320	207.73	2,559,233.60	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,009	267.00	1,604,403.00	
WR BERKLEY CORP	17,878	52.29	934,840.62	
WEYERHAEUSER CO	40,664	29.87	1,214,633.68	
ACCENTURE PLC-CL A	35,320	328.68	11,608,977.60	
ADOBE INC	25,550	531.04	13,568,072.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	8,949	95.22	852,123.78	
ANSYS INC	4,871	310.55	1,512,689.05	
APPLOVIN CORP-CLASS A	12,000	78.68	944,160.00	
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,805	187.45	338,347.25	
ATLASSIAN CORP-CL A	9,024	167.60	1,512,422.40	
AUTODESK INC	12,108	239.45	2,899,260.60	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	11,819	48.51	573,339.69	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	15,429	266.34	4,109,359.86	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,676	180.07	1,022,077.32	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	16,221	76.00	1,232,796.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	28,407	72.69	2,064,904.83	
CONFLUENT INC-CLASS A	9,000	24.37	219,330.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	13,273	258.14	3,426,292.22	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,100	258.13	542,073.00	
DATADOG INC - CLASS A	14,659	117.32	1,719,793.88	
DOCUSIGN INC	14,042	53.80	755,459.60	
DYNATRACE INC	14,980	42.86	642,042.80	
EPAM SYSTEMS INC	3,061	205.04	627,627.44	
FAIR ISAAC CORP	1,345	1,559.24	2,097,177.80	
FORTINET INC	36,982	56.64	2,094,660.48	
GARTNER INC	4,549	457.42	2,080,803.58	
GEN DIGITAL INC	29,838	25.20	751,917.60	
GODADDY INC - CLASS A	8,747	143.21	1,252,657.87	
HUBSPOT INC	2,683	473.33	1,269,944.39	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	51,075	184.02	9,398,821.50	
INTUIT INC	15,703	620.24	9,739,628.72	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	3,500	249.83	874,405.00	
MICROSOFT CORP	399,405	428.90	171,304,804.50	
MICROSTRATEGY INC-CL A	954	1,672.69	1,595,746.26	
MONDAY.COM LTD	2,400	229.84	551,616.00	
MONGODB INC	4,115	244.54	1,006,282.10	
OKTA INC	9,345	92.69	866,188.05	
ORACLE CORP	93,656	138.77	12,996,643.12	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	103,887	26.60	2,763,394.20	
PALO ALTO NETWORKS INC	18,608	324.24	6,033,457.92	

PTC INC	7,030	172.32	1,211,409.60	
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,903	531.97	3,140,218.91	
SALESFORCE INC	54,562	249.78	13,628,496.36	
SAMSARA INC-CL A	13,000	35.41	460,330.00	
SERVICENOW INC	11,509	730.87	8,411,582.83	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	17,647	125.62	2,216,816.14	
SYNOPSYS INC	8,405	553.33	4,650,738.65	
TWILIO INC - A	10,378	56.40	585,319.20	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,478	515.80	1,278,152.40	
UIPATH INC - CLASS A	24,000	11.93	286,320.00	
UNITY SOFTWARE INC	13,116	15.60	204,609.60	
VERISIGN INC	5,329	174.97	932,415.13	
WIX.COM LTD	3,273	161.47	528,491.31	
WORKDAY INC-CLASS A	12,333	220.52	2,719,673.16	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	12,443	58.16	723,684.88	
ZSCALER INC	5,230	181.82	950,918.60	
AMPHENOL CORPORATION	66,108	61.99	4,098,034.92	
APPLE INC	830,085	218.54	181,406,775.90	
ARISTA NETWORKS INC	14,708	325.87	4,792,895.96	
CDW CORP/DE	7,411	229.21	1,698,675.31	
CISCO SYSTEMS	228,543	46.85	10,707,239.55	
CORNING	43,885	43.95	1,928,745.75	
DELL TECHNOLOGIES -C	14,009	116.12	1,626,725.08	
F5 INC	4,047	170.44	689,770.68	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	75,299	20.05	1,509,744.95	
HP INC	58,493	37.82	2,212,205.26	
JABIL INC	7,400	111.05	821,770.00	
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	36.77	599,645.16	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	10,642	135.99	1,447,205.58	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,289	390.60	3,628,283.40	
NETAPP INC	10,843	125.70	1,362,965.10	
PURE STORAGE INC - CLASS A	19,185	58.32	1,118,869.20	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	12,680	109.53	1,388,840.40	
SUPER MICRO COMPUTER INC	3,099	711.56	2,205,124.44	
TE CONNECTIVITY LTD	17,335	156.85	2,718,994.75	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,404	417.00	1,002,468.00	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	13,869	55.70	772,503.30	
WESTERN DIGITAL CORP	17,228	72.01	1,240,588.28	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,892	322.09	931,484.28	
AT&T INC	395,564	19.16	7,579,006.24	
T-MOBILE US INC	29,432	176.89	5,206,226.48	
VERIZON COMMUNICATIONS	235,548	39.67	9,344,189.16	

AES CORP	45,182	17.31	782,100.42	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	16,537	55.66	920,449.42	
AMEREN CORPORATION	14,991	77.04	1,154,906.64	
AMERICAN ELECTRIC POWER	30,895	95.02	2,935,642.90	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,087	142.40	1,578,788.80	
ATMOS ENERGY CORP	9,420	125.90	1,185,978.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	36,651	29.02	1,063,612.02	
CMS ENERGY CORP	17,231	62.47	1,076,420.57	
CONSOLIDATED EDISON INC	18,713	95.88	1,794,202.44	
CONSTELLATION ENERGY	18,305	175.08	3,204,839.40	
DOMINION ENERGY INC	48,379	52.13	2,521,997.27	
DTE ENERGY COMPANY	10,982	117.91	1,294,887.62	
DUKE ENERGY CORP	43,568	108.60	4,731,484.80	
EDISON INTL	21,304	76.04	1,619,956.16	
ENTERGY CORP	12,274	111.86	1,372,969.64	
ESSENTIAL UTILITIES INC	12,969	41.07	532,636.83	
EVERGY INC	11,724	56.22	659,123.28	
EVERSOURCE ENERGY	18,286	63.03	1,152,566.58	
EXELON CORP	54,634	36.47	1,992,501.98	
FIRSTENERGY CORP	30,792	40.42	1,244,612.64	
NEXTERA ENERGY INC	117,427	75.41	8,855,170.07	
NISOURCE INC	25,553	31.01	792,398.53	
NRG ENERGY INC	12,298	74.19	912,388.62	
PG&E CORP	115,431	18.25	2,106,615.75	
PPL CORPORATION	45,254	29.17	1,320,059.18	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	28,637	75.95	2,174,980.15	
SEMPRA	35,873	79.12	2,838,271.76	
SOUTHERN CO	61,651	82.67	5,096,688.17	
VISTRA CORP	19,603	72.58	1,422,785.74	
WEC ENERGY GROUP INC	18,373	83.56	1,535,247.88	
XCEL ENERGY INC	31,146	56.36	1,755,388.56	
ADVANCED MICRO DEVICES	92,019	144.63	13,308,707.97	
ANALOG DEVICES	27,639	224.62	6,208,272.18	
APPLIED MATERIALS	47,292	206.53	9,767,216.76	
BROADCOM INC	249,250	151.34	37,721,495.00	
ENPHASE ENERGY INC	7,104	116.91	830,528.64	
ENTEGRIS INC	8,008	124.72	998,757.76	
FIRST SOLAR INC	5,850	221.33	1,294,780.50	
INTEL CORP	239,854	31.70	7,603,371.80	
KLA CORP	7,545	755.77	5,702,284.65	
LAM RESEARCH CORP	7,358	909.87	6,694,823.46	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	8,500	54.87	466,395.00	

	MARVELL TECHNOLOGY INC	50,387	64.35	3,242,403.45	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	29,374	86.57	2,542,907.18	
	MICRON TECHNOLOGY	63,416	110.28	6,993,516.48	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,625	787.88	2,068,185.00	
	NVIDIA CORP	1,414,780	114.25	161,638,615.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,362	254.40	3,653,692.80	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	24,703	70.11	1,731,927.33	
	QORVO INC	5,297	120.04	635,851.88	
	QUALCOMM	62,632	181.07	11,340,776.24	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,922	113.65	1,013,985.30	
	TERADYNE INC	9,235	143.54	1,325,591.90	
	TEXAS INSTRUMENTS	50,935	198.28	10,099,391.80	
	CBRE GROUP INC-A	16,391	98.30	1,611,235.30	
	COSTAR GROUP INC	22,748	76.35	1,736,809.80	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	64,300	3.36	216,048.00	
	ZILLOW GROUP INC-C	7,537	47.50	358,007.50	
アメリカドル 小計		20,829,190		2,633,007,029.01 (403,797,957,968)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	36,244	23.18	840,135.92	
	CAMECO CORP	22,453	64.19	1,441,258.07	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	122,354	47.59	5,822,826.86	
	CENOVUS ENERGY INC	83,349	26.83	2,236,253.67	
	ENBRIDGE	120,448	50.50	6,082,624.00	
	IMPERIAL OIL	11,645	96.58	1,124,674.10	
	KEYERA CORP	10,963	38.74	424,706.62	
	MEG ENERGY CORP	18,392	27.33	502,653.36	
	PARKLAND CORP	8,544	38.01	324,757.44	
	PEMBINA PIPELINE CORP	32,665	52.86	1,726,671.90	
	SUNCOR ENERGY	73,948	52.54	3,885,227.92	
	TC ENERGY CORP	57,598	57.18	3,293,453.64	
	TOURMALINE OIL CORP	16,980	59.74	1,014,385.20	
	AGNICO EAGLE MINES	27,843	103.07	2,869,778.01	
	BARRICK GOLD CORP	101,706	25.50	2,593,503.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	74.49	543,925.98	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	30,312	16.76	508,029.12	
	FRANCO-NEVADA CORP	11,522	173.60	2,000,219.20	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	35,897	17.67	634,299.99	
	KINROSS GOLD CORP	74,937	12.22	915,730.14	
	LUNDIN MINING CORP	30,173	13.86	418,197.78	
	NUTRIEN LTD	27,026	68.31	1,846,146.06	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	24,343	31.35	763,153.05	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	24,191	62.36	1,508,550.76	

WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,575	109.50	391,462.50	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	26,120	82.79	2,162,474.80	
CAE INC	16,864	24.58	414,517.12	
STANTEC INC	6,135	120.08	736,690.80	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,269	127.56	544,553.64	
WSP GLOBAL INC	7,506	225.74	1,694,404.44	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	20,483	26.33	539,317.39	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	10,920	54.54	595,576.80	
RB GLOBAL INC	9,865	109.79	1,083,078.35	
THOMSON REUTERS CORP	8,466	225.75	1,911,199.50	
AIR CANADA	6,737	16.03	107,994.11	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	31,884	159.98	5,100,802.32	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	52,627	111.99	5,893,697.73	
TFI INTERNATIONAL INC	4,630	211.37	978,643.10	
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,682	58.95	865,503.90	
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,366	91.66	125,207.56	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	53.75	537,500.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	17,311	96.62	1,672,588.82	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,586	141.96	367,108.56	
DOLLARAMA INC	16,822	130.76	2,199,644.72	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	45,716	82.85	3,787,570.60	
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	36.74	269,304.20	
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	168.99	1,532,401.32	
METRO INC	13,489	82.09	1,107,312.01	
WESTON (GEORGE) LTD	3,705	214.05	793,055.25	
SAPUTO INC	17,963	31.60	567,630.80	
BANK MONTREAL	42,340	119.15	5,044,811.00	
BANK NOVA SCOTIA	67,781	63.19	4,283,081.39	
CANADIAN IMPERIAL BANK	50,581	69.26	3,503,240.06	
NATIONAL BANK OF CANADA	19,372	113.13	2,191,554.36	
ROYAL BANK OF CANADA	80,323	152.21	12,225,963.83	
TORONTO-DOMINION BANK	99,612	79.36	7,905,208.32	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	18,244	56.81	1,036,441.64	
BROOKFIELD CORP	80,503	63.34	5,099,060.02	
IGM FINANCIAL INC	3,890	38.45	149,570.50	
ONEX CORP	3,361	93.57	314,488.77	
TMX GROUP LTD	16,225	41.68	676,258.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,198	1,592.14	1,907,383.72	
GREAT-WEST LIFECO INC	15,674	41.25	646,552.50	
IA FINANCIAL CORP INC	5,415	89.94	487,025.10	
INTACT FINANCIAL CORP	9,967	243.47	2,426,665.49	
MANULIFE FINANCIAL CORP	100,823	35.46	3,575,183.58	

	POWER CORP OF CANADA	29,992	39.03	1,170,587.76	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	32,024	68.24	2,185,317.76	
	CGI INC - CL A	11,043	147.97	1,634,032.71	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,145	4,304.21	4,928,320.45	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	4,402	136.42	600,520.84	
	OPEN TEXT CORP	15,045	42.44	638,509.80	
	SHOPIFY INC - CLASS A	69,109	81.87	5,657,953.83	
	BCE INC	3,102	45.78	142,009.56	
	QUEBECOR INC -CL B	9,679	29.01	280,787.79	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	18,199	51.16	931,060.84	
	TELUS CORP	23,120	21.78	503,553.60	
	ALTAGAS INCOME LTD	14,516	32.57	472,786.12	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,264	39.39	246,738.96	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	31.40	187,709.20	
	EMERA INC	19,067	48.40	922,842.80	
	FORTIS INC	29,864	56.46	1,686,121.44	
	HYDRO ONE LTD	20,457	41.63	851,624.91	
	NORTHLAND POWER INC	13,044	23.03	300,403.32	
	FIRSTSERVICE CORP	2,028	225.88	458,084.64	
カナダドル 小計		2,324,341		154,571,856.74 (17,160,567,535)	
ユーロ	ENI	123,037	14.05	1,729,654.14	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	30,121	19.24	579,528.04	
	NESTE OIL OYJ	21,882	17.30	378,558.60	
	OMV AG	7,462	38.84	289,824.08	
	REPSOL SA	71,632	13.24	948,407.68	
	TENARIS SA	27,420	14.41	395,122.20	
	TOTALENERGIES SE	121,586	62.46	7,594,261.56	
	AIR LIQUIDE	32,422	165.60	5,369,083.20	
	AKZO NOBEL	9,224	55.74	514,145.76	
	ARCELORMITTAL	29,386	20.83	612,110.38	
	ARKEMA	4,377	83.65	366,136.05	
	BASF SE	48,561	44.80	2,175,532.80	
	COVESTRO AG	10,438	54.92	573,254.96	
	DSM-FIRMENICH AG	10,830	111.75	1,210,252.50	
	EVONIK INDUSTRIES AG	19,273	18.95	365,223.35	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	8,131	99.88	812,124.28	
	OCI NV	5,799	22.40	129,897.60	
	STORA ENSO OYJ R	26,361	11.86	312,773.26	
	SYENSQO SA	3,676	81.79	300,660.04	
	SYMRISE AG	7,051	114.60	808,044.60	
	UMICORE	12,057	14.09	169,883.13	

UPM KYMMENE OYJ	32,788	30.16	988,886.08	
VOESTALPINE AG	5,948	23.86	141,919.28	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	13,098	38.92	509,774.16	
AIRBUS SE	33,517	130.60	4,377,320.20	
ALSTOM	16,908	17.97	303,921.30	
BOUYGUES ORD	11,344	32.10	364,142.40	
BRENNTAG SE	8,989	65.30	586,981.70	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	29,498	35.28	1,040,689.44	
DASSAULT AVIATION SA	1,210	174.70	211,387.00	
EIFFAGE	4,432	91.36	404,907.52	
FERROVIAL SE	29,779	38.46	1,145,300.34	
GEA GROUP AG	7,649	39.98	305,807.02	
IMCD NV	3,050	132.50	404,125.00	
KINGSPAN GROUP PLC	9,798	82.30	806,375.40	
KNORR-BREMSE AG	5,221	70.00	365,470.00	
KONE OYJ-B	19,254	45.57	877,404.78	
LEGRAND SA	15,620	94.92	1,482,650.40	
LEONARDO SPA	26,079	22.15	577,649.85	
METSO CORPORATION	35,225	9.14	322,026.95	
MTU AERO ENGINES AG	3,474	253.10	879,269.40	
PRYSMIAN SPA	15,275	63.46	969,351.50	
RATIONAL AG	268	780.50	209,174.00	
REXEL SA	15,000	25.15	377,250.00	
RHEINMETALL AG	2,442	496.00	1,211,232.00	
SAFRAN SA	18,948	200.50	3,799,074.00	
SAINT-GOBAIN	25,279	77.04	1,947,494.16	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	31,187	226.05	7,049,821.35	
SIEMENS	42,875	171.44	7,350,490.00	
SIEMENS ENERGY AG	37,924	25.72	975,405.28	
THALES SA	5,540	145.20	804,408.00	
VINCI S.A.	28,324	105.50	2,988,182.00	
WARTSILA OYJ	30,397	18.86	573,287.42	
BUREAU VERITAS SA	15,662	26.42	413,790.04	
RANDSTAD NV	5,866	44.65	261,916.90	
TELEPERFORMANCE	3,110	103.55	322,040.50	
WOLTERS KLUWER	14,750	153.75	2,267,812.50	
ADP	1,532	118.20	181,082.40	
AENA SME SA	4,116	184.80	760,636.80	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	38,499	5.69	219,367.30	
DHL GROUP	56,431	39.91	2,252,161.21	
GETLINK	18,582	16.17	300,563.85	
INPOST SA	16,994	15.73	267,315.62	

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,499	89.10	1,559,160.90	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,480	82.70	287,796.00	
CONTINENTAL AG	6,262	57.16	357,935.92	
DR ING HC F PORSCHE AG	5,800	68.80	399,040.00	
FERRARI NV	6,834	382.30	2,612,638.20	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	43,736	63.46	2,775,486.56	
MICHELIN	41,067	34.45	1,414,758.15	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	8,889	41.21	366,315.69	
RENAULT SA	11,301	47.55	537,362.55	
STELLANTIS NV	121,390	18.26	2,216,581.40	
VOLKSWAGEN AG-PFD	11,635	105.35	1,225,747.25	
VOLKSWAGEN STAMM	1,657	110.20	182,601.40	
ADIDAS AG	9,192	232.60	2,138,059.20	
HERMES INTERNATIONAL	1,765	2,039.00	3,598,835.00	
KERING	4,318	300.60	1,297,990.80	
LVMH	15,508	659.40	10,225,975.20	
MONCLER SPA	12,416	54.42	675,678.72	
PUMA SE	6,274	44.44	278,816.56	
SEB SA	1,310	102.30	134,013.00	
ACCOR	12,281	37.24	457,344.44	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	25,319	60.40	1,529,267.60	
DELIVERY HERO SE	8,935	18.31	163,599.85	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,332	33.00	175,956.00	
SODEXO	4,698	84.05	394,866.90	
BOLLORE SE	51,405	5.95	305,859.75	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	4,722	79.95	377,523.90	
PUBLICIS GROUPE	13,443	98.10	1,318,758.30	
SCOUT24 SE	4,128	72.10	297,628.80	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	47,953	28.38	1,360,906.14	
VIVENDI SE	41,539	10.75	446,544.25	
D'IETEREN GROUP	1,617	208.80	337,629.60	
INDITEX	58,730	45.07	2,646,961.10	
PROSUS	83,321	32.17	2,680,436.57	
ZALANDO SE	11,285	23.47	264,858.95	
CARREFOUR	30,831	14.51	447,511.96	
JERONIMO MARTINS	13,062	19.54	255,231.48	
KESKO OYJ-B SHS	14,326	16.37	234,588.25	
KONINKLIJKE AHOLD NV	52,445	29.84	1,564,958.80	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	50,369	55.68	2,804,545.92	
DANONE (GROUPE)	35,678	58.20	2,076,459.60	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	26,648	8.49	226,348.11	
HEINEKEN HOLDING NV	7,127	72.65	517,776.55	

HEINEKEN NV	16,000	89.08	1,425,280.00	
JDE PEET'S BV	9,274	18.17	168,508.58	
KERRY GROUP PLC-A	8,173	79.25	647,710.25	
LOTUS BAKERIES	24	9,880.00	237,120.00	
PERNOD-RICARD	11,584	125.00	1,448,000.00	
REMY COINTREAU	1,020	69.45	70,839.00	
BEIERSDORF AG	5,845	135.30	790,828.50	
HENKEL AG & CO KGAA	6,247	73.60	459,779.20	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	10,083	81.76	824,386.08	
LOREAL	13,589	398.25	5,411,819.25	
AMPLIFON SPA	6,606	29.94	197,783.64	
BIOMERIEUX	2,374	95.45	226,598.30	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,091	61.20	127,969.20	
DIASORIN ITALIA SPA	1,418	103.35	146,550.30	
ESSILORLUXOTTICA	16,595	195.60	3,245,982.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	9,705	37.34	362,384.70	
FRESENIUS SE&CO KGAA	23,936	31.46	753,026.56	
KONINKLIJKE PHILIPS	44,833	24.04	1,077,785.32	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,577	53.00	772,581.00	
ARGENX SE	3,157	429.00	1,354,353.00	
BAYER	54,521	26.97	1,470,703.97	
EUROFINS SCIENTIFIC	6,490	49.92	323,980.80	
GRIFOLS SA	14,240	9.17	130,666.24	
IPSEN	1,866	111.00	207,126.00	
MERCK KGAA	8,023	155.00	1,243,565.00	
ORION OYJ-CLASS B	5,393	40.31	217,391.83	
QIAGEN N.V.	12,712	38.68	491,700.16	
RECORDATI SPA	5,195	51.85	269,360.75	
SANOFI	63,904	93.57	5,979,497.28	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,716	227.60	390,561.60	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,435	161.65	231,967.75	
UCB (GROUPE)	6,718	146.55	984,522.90	
ABN AMRO BANK NV-CVA	19,718	16.52	325,839.95	
AIB GROUP PLC	86,175	5.39	464,483.25	
BANCO BILBAO VIZCAYA	328,517	10.10	3,318,021.70	
BANCO BPM SPA	78,110	6.55	511,620.50	
BANCO DE SABADELL SA	357,639	2.02	723,146.05	
BANCO SANTANDER SA	904,812	4.70	4,257,140.46	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	52,138	10.55	550,055.90	
BNP PARIBAS	59,550	64.08	3,815,964.00	
CAIXABANK	240,435	5.53	1,330,567.29	
COMMERZBANK AG	56,376	15.34	864,807.84	

CREDIT AGRICOLE SA	64,475	13.98	901,682.87	
ERSTE GROUP BANK AG	18,119	47.00	851,593.00	
FINECOBANK SPA	42,306	16.07	680,068.95	
ING GROEP NV-CVA	187,019	17.03	3,184,933.57	
INTESA SANPAOLO	853,697	3.72	3,180,021.32	
KBC GROEP NV	12,855	70.90	911,419.50	
MEDIOBANCA	29,447	14.78	435,226.66	
NORDEA BANK ABP	180,364	10.61	1,913,662.04	
SOCIETE GENERALE	41,916	24.02	1,006,822.32	
UNICREDIT SPA	89,900	39.10	3,515,090.00	
ADYEN NV	1,178	1,082.80	1,275,538.40	
AMUNDI SA	2,812	66.30	186,435.60	
DEUTSCHE BANK NAMEN	111,998	14.37	1,610,307.24	
DEUTSCHE BOERSE	10,526	188.10	1,979,940.60	
EDENRED	15,236	37.62	573,178.32	
EURAZEO SA	2,340	76.45	178,893.00	
EURONEXT NV	4,500	91.95	413,775.00	
EXOR NV	6,325	95.15	601,823.75	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,582	68.55	382,646.10	
NEXI SPA	36,598	5.70	208,608.60	
SOFINA	752	219.00	164,688.00	
AEGON LTD	95,201	5.85	556,925.85	
AGEAS	8,621	43.42	374,323.82	
ALLIANZ SE-REG	21,940	259.70	5,697,818.00	
ASR NEDERLAND NV	9,000	46.04	414,360.00	
AXA SA	100,654	32.11	3,231,999.94	
GENERALI	58,531	23.49	1,374,893.19	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,976	229.50	682,992.00	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	7,773	450.50	3,501,736.50	
NN GROUP NV	13,557	45.67	619,148.19	
POSTE ITALIANE SPA	25,777	12.21	314,737.17	
SAMPO OYJ-A SHS	25,899	39.54	1,024,046.46	
TALANX AG	5,000	70.70	353,500.00	
BECHTLE AG	4,296	39.46	169,520.16	
CAPGEMINI SA	9,097	196.45	1,787,105.65	
DASSAULT SYSTEMES SA	38,993	33.96	1,324,202.28	
NEMETSCHEK SE	3,320	87.05	289,006.00	
SAP SE	58,571	193.82	11,352,231.22	
NOKIA OYJ	300,315	3.40	1,022,422.41	
CELLNEX TELECOM SA	30,696	31.81	976,439.76	
DEUTSCHE TELEKOM	183,125	24.02	4,398,662.50	
ELISA A	7,825	42.00	328,650.00	

	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,877	10.26	152,638.02	
	KPN (KON.)	173,861	3.63	632,506.31	
	ORANGE	104,881	10.20	1,070,310.60	
	TELECOM ITALIA ORD	489,749	0.22	110,389.42	
	TELEFONICA	280,413	4.12	1,155,301.56	
	ACCIONA SA	1,278	113.30	144,797.40	
	E.ON SE	123,229	12.68	1,562,543.72	
	EDP RENOVAVEIS SA	15,623	14.21	222,002.83	
	ELIA GROUP SA/NV	1,604	94.05	150,856.20	
	ENDESA	17,138	17.99	308,312.62	
	ENEL	451,639	6.63	2,994,818.20	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	189,324	3.73	706,367.84	
	ENGIE	100,082	14.26	1,427,169.32	
	FORTUM OYJ	26,655	13.90	370,504.50	
	IBERDROLA SA	327,283	11.97	3,917,577.51	
	IBERDROLA SA-RTS	327,283	0.38	125,316.66	
	REDEIA CORP SA	23,296	16.33	380,423.68	
	RWE STAMM	33,396	33.25	1,110,417.00	
	SNAM SPA	115,930	4.37	507,541.54	
	TERNA SPA	80,424	7.57	609,131.37	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,814	28.56	1,051,407.84	
	VERBUND AG	3,916	76.45	299,378.20	
	ASM INTERNATIONAL NV	2,534	627.80	1,590,845.20	
	ASML HOLDING NV	22,598	831.60	18,792,496.80	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	4,300	140.65	604,795.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES	72,297	32.59	2,356,159.23	
	STMICROELECTRONICS NV	37,319	37.03	1,382,109.16	
	LEG IMMOBILIEN SE	3,774	80.54	303,957.96	
	VONOVIA SE	43,373	28.16	1,221,383.68	
ユーロ 小計		10,734,951		287,467,209.99 (47,788,548,988)	
イギリスポンド	BP PLC	965,605	4.53	4,374,673.45	
	SHELL PLC-NEW	362,521	27.64	10,020,080.44	
	ANGLO AMERICAN PLC	74,016	22.22	1,644,635.52	
	ANTOFAGASTA PLC	22,358	19.46	435,086.68	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,013	40.59	325,247.67	
	ENDEAVOUR MINING PLC	13,000	18.06	234,780.00	
	GLENCORE PLC	587,098	4.33	2,544,189.18	
	MONDI PLC	23,525	15.54	365,578.50	
	RIO TINTO PLC REG	61,891	49.37	3,055,868.12	
	ASHTEAD GROUP PLC	25,115	52.42	1,316,528.30	
	BAE SYSTEMS PLC	170,458	12.59	2,146,918.51	

BUNZL PLC	19,312	32.48	627,253.76	
DCC PLC	4,499	52.75	237,322.25	
MELROSE INDUSTRIES PLC	75,000	5.56	417,150.00	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	458,658	4.43	2,035,982.86	
SMITHS GROUP PLC	20,046	17.35	347,798.10	
SPIRAX GROUP PLC	3,672	86.30	316,893.60	
EXPERIAN PLC	52,941	34.95	1,850,287.95	
INTERTEK GROUP PLC	10,295	47.96	493,748.20	
RELX PLC	107,318	34.82	3,736,812.76	
RENTOKIL INITIAL PLC	130,328	4.73	617,363.73	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	5.06	258,254.54	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,048	49.68	300,464.64	
BURBERRY GROUP PLC	22,327	7.04	157,316.04	
PERSIMMON PLC	14,327	15.22	218,056.94	
TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.56	260,031.16	
COMPASS GROUP PLC	95,637	22.94	2,193,912.78	
ENTAIN PLC	33,614	6.45	216,877.52	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	10,117	153.50	1,552,959.50	
INTERCONTINENTAL HOTELS	8,641	80.76	697,847.16	
PEARSON	34,302	10.26	351,938.52	
WHITBREAD PLC	10,170	28.49	289,743.30	
AUTO TRADER GROUP PLC	43,890	8.06	354,016.74	
INFORMA PLC	79,688	8.78	699,820.01	
WPP PLC	56,693	7.41	420,321.90	
JD SPORTS FASHION PLC	114,330	1.21	138,796.62	
KINGFISHER PLC	96,593	2.77	268,045.57	
NEXT PLC	7,235	87.40	632,339.00	
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.73	224,401.24	
TESCO PLC	393,967	3.27	1,289,060.02	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	20,881	24.57	513,046.17	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	114,644	25.76	2,953,229.44	
COCA-COLA HBC AG-CDI	14,115	27.94	394,373.10	
DIAGEO	126,321	24.96	3,153,603.76	
IMPERIAL BRANDS PLC	45,617	20.86	951,570.62	
HALEON PLC	385,427	3.39	1,309,295.51	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	39,541	44.93	1,776,577.13	
UNILEVER PLC	141,262	43.97	6,211,290.14	
SMITH & NEPHEW PLC	54,631	11.11	607,223.56	
ASTRAZENECA	87,036	122.14	10,630,577.04	
GSK PLC	238,969	15.10	3,608,431.90	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	8,586	18.60	159,699.60	
BARCLAYS	873,251	2.28	1,994,505.28	

	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,087,112	6.63	7,207,552.56	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,573,042	0.59	2,131,676.85	
	NATWEST GROUP PLC	329,785	3.37	1,113,024.37	
	STANDARD CHARTERED PLC	135,187	7.21	975,239.01	
	3I GROUP PLC	55,147	30.12	1,661,027.64	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,246	10.96	199,976.16	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	26,627	94.36	2,512,523.72	
	M&G PLC	118,170	2.02	239,530.59	
	SCHRODERS PLC	42,161	3.77	159,199.93	
	WISE PLC - A	45,000	7.51	337,950.00	
	ADMIRAL GROUP PLC	9,872	26.28	259,436.16	
	AVIVA PLC	152,469	4.84	737,949.96	
	LEGAL & GENERAL GROUP	313,717	2.27	712,765.02	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	43,255	5.33	230,549.15	
	PRUDENTIAL	158,898	6.84	1,087,815.70	
	SAGE GROUP PLC	56,360	10.40	586,425.80	
	HALMA PLC	20,296	25.65	520,592.40	
	BT GROUP PLC	373,976	1.39	522,631.46	
	VODAFONE GROUP PLC	1,387,940	0.70	977,664.93	
	CENTRICA PLC	270,000	1.43	386,235.00	
	NATIONAL GRID PLC	273,012	9.55	2,608,902.67	
	SEVERN TRENT PLC	14,219	24.87	353,626.53	
	SSE PLC	65,158	18.48	1,204,445.63	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	10.06	349,242.96	
イギリスポンド 小計		15,276,938		109,007,810.23 (21,560,654,785)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	13,161	14.58	191,887.38	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	310	718.50	222,735.00	
	GIVAUDAN-REG	533	4,201.00	2,239,133.00	
	HOLCIM LTD	30,195	83.94	2,534,568.30	
	SIG GROUP AG	16,000	17.71	283,360.00	
	SIKA AG-BR	8,383	262.00	2,196,346.00	
	ABB LTD	88,585	48.37	4,284,856.45	
	GEBERIT AG-REG	1,930	553.40	1,068,062.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,332	225.50	300,366.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,021	228.80	462,404.80	
	VAT GROUP AG	1,440	434.30	625,392.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,959	29.82	296,977.38	
	SGS SA	8,675	92.10	798,967.50	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,430	268.20	919,926.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	31,083	133.40	4,146,472.20	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,572	176.00	276,672.00	

	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	34.65	104,088.60	
	AVOLTA AG	5,500	34.82	191,510.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	189	1,415.00	267,435.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	106,600.00	639,600.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	55	10,720.00	589,600.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	152,013	93.56	14,222,336.28	
	ALCON INC	27,668	81.12	2,244,428.16	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,788	264.80	738,262.40	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	6,820	114.45	780,549.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,950	86.65	168,967.50	
	LONZA GROUP AG-REG	4,282	522.60	2,237,773.20	
	NOVARTIS	111,494	96.26	10,732,412.44	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,944	296.40	576,201.60	
	ROCHE HOLDING GENUSS	39,348	273.50	10,761,678.00	
	SANDOZ GROUP AG	22,464	35.02	786,689.28	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,564	93.90	146,859.60	
	JULIUS BAER GROUP LTD	11,775	51.96	611,829.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,287	1,208.00	1,554,696.00	
	UBS GROUP AG	182,563	26.85	4,901,816.55	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	157.10	366,671.40	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,500	129.80	324,500.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,612	671.00	1,081,652.00	
	SWISS RE LTD	16,438	107.30	1,763,797.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,505	474.60	4,036,473.00	
	TEMENOS AG - REG	3,520	61.00	214,720.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,298	79.10	656,371.80	
	SWISSCOM	1,331	532.00	708,092.00	
	BKW AG	807	154.20	124,439.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,135	87.40	448,799.00	
スイスフラン 小計		845,803		82,830,374.62 (14,355,332,225)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	13,081	319.10	4,174,147.10	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,106	425.60	2,173,113.60	
	SCA SV CELLULOSA B	34,632	150.55	5,213,847.60	
	ALFA LAVAL AB	14,260	467.50	6,666,550.00	
	ASSA ABLOY AB-B	57,678	315.50	18,197,409.00	
	ATLAS COPCO A	156,971	184.30	28,929,755.30	
	ATLAS COPCO B	85,638	160.55	13,749,180.90	
	BEIJER REF AB	23,000	176.85	4,067,550.00	
	EPIROC AB-A	37,140	201.00	7,465,140.00	
	EPIROC AB-B	22,442	180.70	4,055,269.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	73.30	1,600,945.30	

	INDUTRADE AB	14,669	316.80	4,647,139.20	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,081	305.40	2,467,937.40	
	LIFCO AB-B SHS	13,590	318.60	4,329,774.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	80,939	46.91	3,796,848.49	
	SAAB AB-B	23,200	251.15	5,826,680.00	
	SANDVIK AB	56,973	217.70	12,403,022.10	
	SKANSKA B	19,869	209.10	4,154,607.90	
	SKF AB-B	18,340	194.70	3,570,798.00	
	TRELLEBORG AB-B SHS	14,847	390.40	5,796,268.80	
	VOLVO AB-A SHS	8,748	275.60	2,410,948.80	
	VOLVO B	87,756	270.60	23,746,773.60	
	SECURITAS B	25,545	109.00	2,784,405.00	
	VOLVO CAR AB-B	35,544	31.31	1,113,060.36	
	EVOLUTION AB	9,622	1,020.00	9,814,440.00	
	HENNES & MAURITZ B	33,524	164.65	5,519,726.60	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	31,655	303.40	9,604,127.00	
	GETINGE AB-B SHS	12,650	205.50	2,599,575.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	9,481	292.40	2,772,244.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	96,619	159.90	15,449,378.10	
	SVENSKA HANDELSBK A	81,670	106.30	8,681,521.00	
	SWEDBANK AB-A	50,623	224.20	11,349,676.60	
	EQT AB	22,258	336.60	7,492,042.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,848	360.40	2,468,019.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	357.40	3,084,719.40	
	INVESTOR AB-B SHS	95,842	296.65	28,431,529.30	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,093	535.00	2,189,755.00	
	ERICSSON (LM) B	160,922	71.00	11,425,462.00	
	HEXAGON AB-B SHS	127,535	113.65	14,494,352.75	
	TELE2 AB-B SHS	34,520	107.95	3,726,434.00	
	TELIA CO AB	138,487	31.16	4,315,254.92	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	32,478	78.52	2,550,172.56	
	SAGAX AB-B	9,400	266.40	2,504,160.00	
スウェーデンクローナ 小計		1,846,748		321,813,762.48 (4,579,409,840)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	17,052	261.60	4,460,803.20	
	EQUINOR ASA	50,840	288.00	14,641,920.00	
	NORSK HYDRO	72,015	61.00	4,392,915.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,449	316.30	2,988,718.70	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,500	1,096.00	4,932,000.00	
	MOWI ASA	23,314	178.05	4,151,057.70	
	ORKLA	39,803	90.35	3,596,201.05	
	SALMAR ASA	6,500	584.50	3,799,250.00	

	DNB BANK ASA	46,261	220.00	10,177,420.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	178.60	1,991,925.80	
	TELENOR ASA	38,789	128.50	4,984,386.50	
ノルウェークローネ 小計		319,676		60,116,597.95 (835,620,711)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	18,930	431.90	8,175,867.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	428	2,930.00	1,254,040.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	55,152	160.85	8,871,199.20	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	152	10,610.00	1,612,720.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	251	10,785.00	2,707,035.00	
	DSV A/S	10,213	1,234.00	12,602,842.00	
	PANDORA A/S	5,465	1,071.00	5,853,015.00	
	CARLSBERG AS-B	5,476	850.00	4,654,600.00	
	COLOPLAST-B	8,147	896.20	7,301,341.40	
	DEMANT A/S	4,463	255.80	1,141,635.40	
	GENMAB A/S	3,603	1,904.50	6,861,913.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	185,314	902.40	167,227,353.60	
	DANSKE BANK A/S	38,806	212.70	8,254,036.20	
	TRYG A/S	25,030	147.30	3,686,919.00	
	ORSTED A/S	11,432	397.00	4,538,504.00	
デンマーククローネ 小計		372,862		244,743,021.30 (5,450,427,084)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	12,821	33.10	424,375.10	
	SANTOS	176,138	7.90	1,391,490.20	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	105,494	27.24	2,873,656.56	
	BHP GROUP LTD	290,181	41.56	12,059,922.36	
	BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	21.33	459,640.17	
	FORTESCUE LTD	97,584	21.32	2,080,490.88	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	25,493	54.07	1,378,406.51	
	MINERAL RESOURCES LTD	10,000	52.66	526,600.00	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	58,122	14.35	834,050.70	
	ORICA LTD	26,961	17.53	472,626.33	
	PILBARA MINERALS LTD	131,710	2.89	380,641.90	
	RIO TINTO LTD	22,145	114.43	2,534,052.35	
	SOUTH32 LTD	246,137	2.96	728,565.52	
	REECE LTD	12,870	26.81	345,044.70	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	13,000	38.14	495,820.00	
	BRAMBLES LTD	82,936	15.22	1,262,285.92	
	COMPUTERSHARE LIMITED	28,589	27.35	781,909.15	
	AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	3.57	334,166.28	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	39,948	5.92	236,492.16	
	TRANSURBAN GROUP	167,820	12.88	2,161,521.60	

	ARISTOCRAT LEISURE LTD	31,473	52.78	1,661,144.94	
	LOTTERY CORP LTD/THE	123,601	4.97	614,296.97	
	CAR GROUP LTD	23,075	34.65	799,548.75	
	REA GROUP LTD	3,000	197.10	591,300.00	
	SEEK LTD	17,113	20.54	351,501.02	
	WESFARMERS LTD	63,823	72.30	4,614,402.90	
	COLES GROUP LTD	82,651	17.82	1,472,840.82	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	74,362	5.38	400,067.56	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	69,391	34.62	2,402,316.42	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	12.50	431,000.00	
	COCHLEAR LIMITED	4,260	342.66	1,459,731.60	
	PRO MEDICUS LTD	4,616	137.92	636,638.72	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,641	46.62	449,463.42	
	SONIC HEALTHCARE LTD	25,969	26.48	687,659.12	
	CSL LIMITED	27,778	310.39	8,622,013.42	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	166,585	29.49	4,912,591.65	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	94,297	132.78	12,520,755.66	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	177,800	37.59	6,683,502.00	
	WESTPAC BANKING	194,057	28.53	5,536,446.21	
	ASX LTD	11,055	64.16	709,288.80	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	20,561	208.73	4,291,697.53	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,345	34.78	359,799.10	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	137,266	7.08	971,843.28	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	129,252	3.83	495,035.16	
	QBE INSURANCE GROUP	78,253	16.95	1,326,388.35	
	SUNCORP GROUP LIMITED	66,731	17.21	1,148,440.51	
	WISETECH GLOBAL LTD	8,342	95.03	792,740.26	
	XERO LTD	7,073	135.87	961,008.51	
	TELSTRA GROUP LTD	199,810	3.90	779,259.00	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	113,883	10.64	1,211,715.12	
オーストラリアドル 小計		3,673,645		99,656,195.19 (10,025,413,236)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	64,661	7.71	498,536.31	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	36,015	33.00	1,188,495.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	104,543	4.20	439,080.60	
	MERCURY NZ LTD	40,719	6.94	282,589.86	
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	6.52	417,501.68	
ニュージーランドドル 小計		309,972		2,826,203.45 (256,534,487)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	139,448	40.95	5,710,395.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	84,500	95.10	8,035,950.00	
	MTR CORP	82,500	25.60	2,112,000.00	

	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	81,000	16.96	1,373,760.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	117,000	34.30	4,013,100.00	
	SANDS CHINA LTD	127,000	15.50	1,968,500.00	
	WH GROUP LTD	446,619	5.23	2,335,817.37	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	191,500	23.35	4,471,525.00	
	HANG SENG BANK	39,600	101.80	4,031,280.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	69,800	232.80	16,249,440.00	
	AIA GROUP LTD	649,400	51.60	33,509,040.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	51.90	1,660,800.00	
	CLP HOLDINGS	100,000	65.50	6,550,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	608,990	6.26	3,812,277.40	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	48.40	3,557,400.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	98,448	29.80	2,933,750.40	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	79,761	22.50	1,794,622.50	
	SINO LAND CO	198,600	8.02	1,592,772.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	80,000	68.75	5,500,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	31,000	69.60	2,157,600.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,000	12.54	865,260.00	
	WHARF HOLDINGS	77,000	24.40	1,878,800.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	81,000	20.10	1,628,100.00	
香港ドル 小計		3,557,666		117,742,190.27 (2,312,456,616)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	80,200	6.56	526,112.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	4.43	331,364.00	
	SINGAPORE AIRLINES	73,350	6.99	512,716.50	
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	0.85	271,745.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	106,600	3.10	330,460.00	
	DBS GROUP	111,980	36.74	4,114,145.20	
	OCBC BANK	199,350	15.11	3,012,178.50	
	UNITED OVERSEAS BANK	72,300	32.88	2,377,224.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.70	412,250.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	420,880	3.07	1,292,101.60	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	49,000	4.69	229,810.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	153,900	2.70	415,530.00	
シンガポールドル 小計		1,704,560		13,825,636.80 (1,578,058,184)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	39,375	16.90	665,437.50	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,248	673.40	840,403.20	
	BANK HAPOALIM BM	80,240	35.35	2,836,484.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	82,181	33.51	2,753,885.31	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,227	20.50	1,316,653.50	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,698	141.80	1,233,376.40	

	NICE LTD	3,165	666.00	2,107,890.00	
	AZRIELI GROUP	2,465	248.10	611,566.50	
イスラエルシェケル 小計		281,599		12,365,696.41 (519,281,345)	
合　計		62,077,951		530,220,263,004 (530,220,263,004)	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダドル	CONSTELLATION SOFTWA WRT	1,063.00	－	
	カナダドル 小計		1,063.00	－ (－)	
新株予約権証券合計				－ (－)	
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	96,405	754,851.15	
	オーストラリアドル 小計		96,405	754,851.15 (75,938,025)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	1,702,000.00	
	香港ドル 小計		185,000	1,702,000.00 (33,427,280)	
投資信託受益証券合計			281,405	109,365,305 (109,365,305)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,648	1,115,019.36	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	20,363	727,162.73	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	26,373	5,522,242.47	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	24,773	492,982.70	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,676	1,581,716.56	
		BXP INC	7,893	528,988.86	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,427	726,765.16	
		CROWN CASTLE INC	24,878	2,623,882.66	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	18,388	2,788,724.08	
		EQUINIX INC	5,500	4,367,825.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,979	589,561.14	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	18,842	1,319,128.42	
		ESSEX PROPERTY TRUST	3,594	1,027,740.24	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	11,358	1,838,519.46	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	15,190	737,626.40	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	48,337	1,003,476.12	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	40,506	695,893.08	
		INVITATION HOMES INC	35,025	1,259,849.25	
		IRON MOUNTAIN INC	16,160	1,565,904.00	
		KIMCO REALTY CORP	43,615	911,553.50	

	MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,844	981,498.04	
	PROLOGIS INC	52,154	6,419,114.32	
	PUBLIC STORAGE	8,723	2,578,082.65	
	REALTY INCOME CORP	50,639	2,899,589.14	
	REGENCY CENTERS CORP	10,530	682,238.70	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,725	1,176,201.25	
	SIMON PROPERTY GROUP	18,395	2,757,226.55	
	SUN COMMUNITIES INC	6,650	813,893.50	
	UDR INC	17,830	739,945.00	
	VENTAS INC	23,610	1,263,843.30	
	VICI PROPERTIES INC	56,023	1,692,454.83	
	WELLTOWER INC	32,100	3,516,555.00	
	WP CAREY INC	14,129	826,687.79	
アメリカドル 小計		696,877	57,771,891.26 (8,859,897,243)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,069	247,671.34	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	160,562.75	
カナダドル 小計		14,014	408,234.09 (45,322,148)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	3,076	141,742.08	
	GECINA SA	2,719	241,991.00	
	KLEPIERRE	11,603	290,307.06	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,185	444,454.10	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,235	187,386.50	
ユーロ 小計		30,818	1,305,880.74 (217,089,614)	
イギリスポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	199,218.40	
	SEGRO PLC	63,208	569,630.49	
イギリスポンド 小計		95,340	768,848.89 (152,070,621)	
オーストラリアドル	DEXUS	74,283	501,410.25	
	GOODMAN GROUP	100,493	3,542,378.25	
	GPT GROUP	111,587	478,708.23	
	MIRVAC GROUP	228,843	471,416.58	
	SCENTRE GROUP	297,027	980,189.10	
	STOCKLAND	158,290	699,641.80	
	VICINITY CENTERS	221,263	441,419.68	
オーストラリアドル 小計		1,191,786	7,115,163.89 (715,785,487)	
香港ドル	LINK REIT	147,800	4,751,770.00	
香港ドル 小計		147,800	4,751,770.00 (93,324,762)	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	207,909	557,196.12	

	シンガポールドル				
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	276,190	563,427.60	
	シンガポールドル 小計		484,099	1,120,623.72 (127,907,991)	
投資証券合計			2,660,734	10,211,397,866 (10,211,397,866)	
合計				10,320,763,171 (10,320,763,171)	

有価証券明細表注記

1.券面総額欄の数値は、証券数又は口数を表示しております。

2.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

5.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株予約権 証券 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式　581銘柄	97.9%	—	—	—	74.7%
	投資証券　33銘柄	—	—	—	2.1%	1.6%
カナダドル	株式　85銘柄	99.7%	—	—	—	3.2%
	新株予約権証券　1銘柄	—	—	—	—	—
	投資証券　2銘柄	—	—	—	0.3%	0.0%
ユーロ	株式　218銘柄	99.5%	—	—	—	8.8%
	投資証券　5銘柄	—	—	—	0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式　77銘柄	99.3%	—	—	—	4.0%
	投資証券　2銘柄	—	—	—	0.7%	0.0%
スイスフラン	株式　45銘柄	100.0%	—	—	—	2.7%
スウェーデンクローナ	株式　43銘柄	100.0%	—	—	—	0.8%
ノルウェークローネ	株式　11銘柄	100.0%	—	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式　15銘柄	100.0%	—	—	—	1.0%
オーストラリアドル	株式　50銘柄	92.7%	—	—	—	1.9%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	—	0.7%	—	0.0%
	投資証券　7銘柄	—	—	—	6.6%	0.1%
ニュージーランドドル	株式　5銘柄	100.0%	—	—	—	0.0%
香港ドル	株式　23銘柄	94.8%	—	—	—	0.4%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	—	1.4%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	—	3.8%	0.0%
	株式　12銘柄	92.5%	—	—	—	0.3%

シンガポールドル	投資証券　2銘柄	—	—	—	7.5%	0.0%
イスラエルシェケル	株式　　8銘柄	100.0%	—	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	2024年 7月25日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	330,481,938
コール・ローン	1,229,101,671
国債証券	181,696,518,510
派生商品評価勘定	4,299,387
未収利息	1,478,925,706
前払費用	120,381,363
差入委託証拠金	82,318,485
流動資産合計	184,942,027,060
資産合計	184,942,027,060
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	46,922,035
前受金	3,506,229
未払金	1,763,275
未払解約金	72,931,690
流動負債合計	125,123,229
負債合計	125,123,229
純資産の部	
元本等	
元本	59,179,059,833
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	125,637,843,998
元本等合計	184,816,903,831
純資産合計	184,816,903,831
負債純資産合計	184,942,027,060

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月25日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。 (1)先物取引

	2024年 7月25日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 7月25日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	59,179,059,833口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.1230円 (1万口当たり純資産額) (31,230円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2024年 7月25日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2024年 7月25日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	2024年 7月25日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 7月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月26日
期首元本額	58,940,295,467円
期中追加設定元本額	6,948,042,287円
期中一部解約元本額	6,709,277,921円
期末元本額	59,179,059,833円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	1,828,996,298円
ＤＣ外国債券インデックスファンド	1,775,252,829円
ＤＣ外国債券インデックスファンドＬ	14,353,801,385円
ＤＣバランスファンド３０	926,374,323円
ＤＣバランスファンド５０	1,136,297,521円
ＤＣバランスファンド７０	308,566,456円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	521,187,029円
外国債券インデックスｅ	937,854,543円
インデックスコレクション（外国債券）	10,269,256,580円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	5,201,668,240円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	1,232,811,666円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	405,327,584円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,041,470,887円
外国債券パッシブファンド私募Ａ（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	2,986,620,962円
外国債券インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	275,941,568円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	47,374,747円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	294,750,724円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	193,725,561円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	165,583,623円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	65,137,585円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	757,017,215円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	449,283,918円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	4,991,305,547円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	305,875,786円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	114,653,330円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	1,168,253,101円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	51,461,896円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	144,976,762円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	61,853,235円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	34,468,110円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	40,304,613円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	164,507,185円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	50,980,172円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	855,795,003円
私募外国債券インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	20,323,849円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 7月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△170,846,973
合計	△170,846,973

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2024年 7月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	848,026,944	—	851,533,173	3,506,229
合計		848,026,944	—	851,533,173	3,506,229

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2024年 7月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,035,699,539	—	989,570,662	△46,128,877
	アメリカドル	497,373,779	—	475,439,384	△21,934,395
	カナダドル	39,857,980	—	37,648,642	△2,209,338
	ユーロ	326,472,956	—	311,827,892	△14,645,064
	イギリスポンド	57,677,947	—	55,213,984	△2,463,963
	オフショア人民元	114,316,877	—	109,440,760	△4,876,117
合計		1,035,699,539	—	989,570,662	△46,128,877

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 06/30/25	4,310,000.00	4,131,241.32	
		T 0.25% 07/31/25	2,200,000.00	2,101,328.72	
		T 0.25% 09/30/25	3,290,000.00	3,120,359.37	
		T 0.375% 01/31/26	10,690,000.00	10,031,061.76	
		T 0.375% 07/31/27	4,000,000.00	3,564,531.24	
		T 0.375% 09/30/27	4,000,000.00	3,544,531.24	
		T 0.375% 11/30/25	3,770,000.00	3,558,894.74	
		T 0.5% 02/28/26	3,500,000.00	3,281,728.52	
		T 0.5% 04/30/27	2,000,000.00	1,804,765.62	
		T 0.5% 05/31/27	300,000.00	269,906.25	
		T 0.5% 06/30/27	2,500,000.00	2,243,066.40	
		T 0.5% 08/31/27	1,100,000.00	981,492.18	
		T 0.5% 10/31/27	1,580,000.00	1,401,293.35	
		T 0.625% 03/31/27	3,400,000.00	3,087,093.75	
		T 0.625% 05/15/30	7,400,000.00	6,048,199.22	
		T 0.625% 07/31/26	4,000,000.00	3,708,750.00	
		T 0.625% 08/15/30	9,130,000.00	7,399,936.30	
		T 0.625% 11/30/27	3,700,000.00	3,286,568.36	
		T 0.625% 12/31/27	3,000,000.00	2,657,226.57	
		T 0.75% 01/31/28	3,500,000.00	3,105,566.41	
		T 0.75% 03/31/26	2,750,000.00	2,582,368.16	
		T 0.75% 04/30/26	3,500,000.00	3,278,242.17	
		T 0.75% 08/31/26	3,000,000.00	2,781,210.93	
		T 0.875% 09/30/26	5,000,000.00	4,639,648.45	
		T 0.875% 11/15/30	6,160,000.00	5,036,281.21	
		T 1.125% 02/15/31	5,600,000.00	4,627,109.36	
		T 1.125% 02/29/28	3,880,000.00	3,481,542.19	
		T 1.125% 05/15/40	1,550,000.00	956,791.99	
		T 1.125% 08/15/40	3,600,000.00	2,202,398.42	
		T 1.125% 08/31/28	4,000,000.00	3,539,921.88	
		T 1.125% 10/31/26	6,850,000.00	6,373,577.15	
		T 1.25% 03/31/28	4,100,000.00	3,687,437.50	
		T 1.25% 04/30/28	5,300,000.00	4,755,921.87	
		T 1.25% 05/15/50	5,120,000.00	2,524,299.98	
		T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,373,164.04	
		T 1.25% 06/30/28	1,000,000.00	893,574.22	
		T 1.25% 08/15/31	6,550,000.00	5,370,232.40	
		T 1.25% 09/30/28	3,800,000.00	3,373,613.28	

		T 1.25% 11/30/26	3,000,000.00	2,793,750.00	
		T 1.25% 12/31/26	5,500,000.00	5,113,603.49	
		T 1.375% 08/15/50	2,300,000.00	1,170,753.91	
		T 1.375% 10/31/28	1,700,000.00	1,514,294.92	
		T 1.375% 11/15/31	12,110,000.00	9,949,121.87	
		T 1.375% 11/15/40	4,350,000.00	2,756,727.54	
		T 1.5% 01/31/27	4,850,000.00	4,526,129.90	
		T 1.5% 02/15/30	1,820,000.00	1,578,707.82	
		T 1.5% 08/15/26	5,300,000.00	4,996,285.14	
		T 1.5% 11/30/28	5,550,000.00	4,961,288.07	
		T 1.625% 02/15/26	4,450,000.00	4,252,878.88	
		T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	5,131,687.50	
		T 1.625% 05/15/31	4,290,000.00	3,638,372.46	
		T 1.625% 08/15/29	1,760,000.00	1,558,012.50	
		T 1.625% 09/30/26	2,150,000.00	2,027,298.83	
		T 1.625% 11/15/50	3,100,000.00	1,688,470.70	
		T 1.625% 11/30/26	3,030,000.00	2,845,832.81	
		T 1.75% 01/31/29	2,500,000.00	2,251,318.35	
		T 1.75% 08/15/41	4,800,000.00	3,184,125.02	
		T 1.75% 11/15/29	2,220,000.00	1,967,995.32	
		T 1.75% 12/31/26	4,300,000.00	4,045,695.33	
		T 1.875% 02/15/32	6,200,000.00	5,258,253.91	
		T 1.875% 02/15/41	4,750,000.00	3,262,749.01	
		T 1.875% 02/15/51	4,500,000.00	2,614,570.29	
		T 1.875% 02/28/27	3,000,000.00	2,821,582.02	
		T 1.875% 02/28/29	1,900,000.00	1,717,978.51	
		T 1.875% 06/30/26	3,980,000.00	3,790,950.00	
		T 1.875% 07/31/26	1,800,000.00	1,711,406.25	
		T 1.875% 11/15/51	3,400,000.00	1,963,234.39	
		T 1% 07/31/28	2,500,000.00	2,206,201.17	
		T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	3,706,142.58	
		T 2.25% 02/15/52	2,410,000.00	1,528,843.75	
		T 2.25% 03/31/26	1,500,000.00	1,444,599.61	
		T 2.25% 05/15/41	1,600,000.00	1,162,031.24	
		T 2.25% 08/15/27	1,820,000.00	1,715,918.75	
		T 2.25% 08/15/46	2,180,000.00	1,455,150.00	
		T 2.25% 08/15/49	2,110,000.00	1,361,444.54	
		T 2.25% 11/15/25	5,500,000.00	5,329,414.09	
		T 2.25% 11/15/27	5,260,000.00	4,938,544.14	
		T 2.375% 02/15/42	1,350,000.00	986,027.33	
		T 2.375% 03/31/29	5,400,000.00	4,987,722.63	
		T 2.375% 04/30/26	1,820,000.00	1,754,167.17	

		T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,419,296.88	
		T 2.375% 05/15/29	6,390,000.00	5,890,157.20	
		T 2.375% 05/15/51	1,980,000.00	1,298,524.21	
		T 2.375% 11/15/49	2,010,000.00	1,331,703.51	
		T 2.5% 02/15/45	1,750,000.00	1,250,224.60	
		T 2.5% 02/15/46	1,250,000.00	882,519.52	
		T 2.5% 02/28/26	650,000.00	629,205.07	
		T 2.5% 05/15/46	1,810,000.00	1,274,423.82	
		T 2.625% 01/31/26	1,350,000.00	1,310,607.41	
		T 2.625% 02/15/29	6,900,000.00	6,453,521.49	
		T 2.625% 05/31/27	2,900,000.00	2,772,445.29	
		T 2.625% 12/31/25	4,500,000.00	4,374,316.39	
		T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	4,441,972.67	
		T 2.75% 04/30/27	5,500,000.00	5,281,289.09	
		T 2.75% 05/31/29	6,000,000.00	5,625,351.54	
		T 2.75% 06/30/25	2,000,000.00	1,961,958.80	
		T 2.75% 07/31/27	5,000,000.00	4,788,281.25	
		T 2.75% 08/15/32	3,180,000.00	2,855,975.39	
		T 2.75% 08/15/42	2,330,000.00	1,795,374.23	
		T 2.75% 08/15/47	300,000.00	218,671.87	
		T 2.75% 08/31/25	5,000,000.00	4,890,136.70	
		T 2.75% 11/15/42	1,650,000.00	1,266,568.36	
		T 2.75% 11/15/47	1,400,000.00	1,018,281.25	
		T 2.875% 04/30/29	4,170,000.00	3,935,600.38	
		T 2.875% 05/15/28	4,460,000.00	4,248,846.87	
		T 2.875% 05/15/32	6,750,000.00	6,138,413.07	
		T 2.875% 05/15/43	1,350,000.00	1,050,205.08	
		T 2.875% 05/15/49	1,410,000.00	1,039,985.14	
		T 2.875% 05/15/52	2,700,000.00	1,972,265.62	
		T 2.875% 07/31/25	500,000.00	490,450.66	
		T 2.875% 08/15/28	10,200,000.00	9,692,390.67	
		T 2.875% 08/15/45	1,880,000.00	1,429,167.18	
		T 2% 02/15/50	3,370,000.00	2,040,429.68	
		T 2% 08/15/25	3,750,000.00	3,642,883.98	
		T 2% 08/15/51	6,090,000.00	3,639,964.43	
		T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,560,306.64	
		T 2% 11/15/41	4,140,000.00	2,852,476.18	
		T 3.125% 02/15/42	1,000,000.00	822,656.25	
		T 3.125% 02/15/43	3,600,000.00	2,920,640.61	
		T 3.125% 05/15/48	1,400,000.00	1,088,335.93	
		T 3.125% 08/15/25	2,500,000.00	2,457,439.22	
		T 3.125% 08/15/44	1,550,000.00	1,240,242.18	
		T 3.125% 08/31/29	4,300,000.00	4,091,886.70	

		T 3.125% 11/15/28	7,460,000.00	7,145,135.55	
		T 3.125% 11/15/41	870,000.00	718,905.46	
		T 3.25% 05/15/42	1,500,000.00	1,251,474.61	
		T 3.25% 06/30/27	1,850,000.00	1,799,414.06	
		T 3.375% 05/15/33	2,310,000.00	2,158,361.13	
		T 3.375% 05/15/44	1,800,000.00	1,502,085.93	
		T 3.375% 08/15/42	1,200,000.00	1,016,648.43	
		T 3.375% 11/15/48	2,100,000.00	1,703,953.12	
		T 3.5% 01/31/30	5,040,000.00	4,868,718.72	
		T 3.5% 02/15/33	6,000,000.00	5,670,351.54	
		T 3.5% 02/15/39	200,000.00	180,664.06	
		T 3.625% 02/15/44	2,300,000.00	1,996,238.28	
		T 3.625% 02/15/53	3,270,000.00	2,777,967.18	
		T 3.625% 05/15/53	1,650,000.00	1,401,597.64	
		T 3.625% 08/15/43	2,700,000.00	2,349,949.21	
		T 3.75% 04/15/26	5,800,000.00	5,723,988.27	
		T 3.75% 06/30/30	2,500,000.00	2,441,503.90	
		T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	995,886.71	
		T 3.75% 11/15/43	1,800,000.00	1,593,210.94	
		T 3.875% 02/15/43	830,000.00	752,479.29	
		T 3.875% 08/15/33	6,900,000.00	6,690,035.13	
		T 3.875% 08/15/40	680,000.00	632,612.50	
		T 3.875% 09/30/29	1,050,000.00	1,034,824.22	
		T 3.875% 11/30/29	3,880,000.00	3,822,103.10	
		T 3.875% 12/31/29	1,500,000.00	1,476,855.46	
		T 3% 02/15/47	2,100,000.00	1,611,421.87	
		T 3% 02/15/48	2,950,000.00	2,244,304.68	
		T 3% 02/15/49	1,940,000.00	1,467,882.80	
		T 3% 05/15/42	1,100,000.00	884,511.71	
		T 3% 05/15/45	600,000.00	467,179.68	
		T 3% 05/15/47	1,300,000.00	995,414.05	
		T 3% 07/15/25	3,900,000.00	3,832,911.38	
		T 3% 08/15/48	2,360,000.00	1,789,359.36	
		T 3% 08/15/52	2,570,000.00	1,928,102.35	
		T 3% 09/30/25	3,660,000.00	3,586,514.08	
		T 3% 10/31/25	1,000,000.00	978,867.19	
		T 3% 11/15/44	1,550,000.00	1,212,905.27	
		T 4.125% 03/31/31	3,560,000.00	3,542,339.05	
		T 4.125% 08/15/53	3,300,000.00	3,069,644.52	
		T 4.125% 08/31/30	3,400,000.00	3,384,660.15	
		T 4.125% 11/15/32	5,690,000.00	5,639,990.24	
		T 4.25% 01/31/26	1,300,000.00	1,293,017.58	

	T 4.25% 02/15/54	4,000,000.00	3,805,000.00	
	T 4.25% 05/15/39	850,000.00	832,900.38	
	T 4.25% 10/15/25	680,000.00	676,108.59	
	T 4.25% 11/15/40	650,000.00	631,617.18	
	T 4.375% 02/15/38	500,000.00	501,298.83	
	T 4.375% 05/15/40	750,000.00	742,031.25	
	T 4.375% 05/15/41	550,000.00	541,126.95	
	T 4.375% 11/15/39	650,000.00	644,160.15	
	T 4.375% 11/30/30	3,970,000.00	4,006,210.72	
	T 4.5% 02/15/36	210,000.00	215,430.46	
	T 4.5% 05/15/38	250,000.00	253,320.31	
	T 4.5% 08/15/39	750,000.00	754,277.34	
	T 4.5% 11/15/25	4,350,000.00	4,338,360.35	
	T 4.5% 11/15/33	6,250,000.00	6,352,050.75	
	T 4.625% 02/15/40	700,000.00	713,029.29	
	T 4.625% 03/15/26	2,170,000.00	2,171,864.85	
	T 4.625% 09/30/28	2,950,000.00	2,997,707.04	
	T 4.625% 10/15/26	5,800,000.00	5,827,300.77	
	T 4.625% 11/15/26	3,600,000.00	3,619,546.88	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	772,939.45	
	T 4.75% 11/15/53	2,500,000.00	2,581,445.30	
	T 4% 02/15/34	1,000,000.00	977,734.38	
	T 4% 02/28/30	2,400,000.00	2,376,984.38	
	T 4% 02/29/28	2,200,000.00	2,183,843.75	
	T 4% 06/30/28	2,000,000.00	1,985,625.00	
	T 4% 07/31/30	800,000.00	791,406.24	
	T 4% 11/15/52	3,500,000.00	3,183,769.54	
	T 4% 12/15/25	5,000,000.00	4,954,980.45	
	T 5.0% 05/15/37	300,000.00	319,974.60	
	T 5.25% 11/15/28	1,900,000.00	1,981,937.50	
	T 5.375% 02/15/31	750,000.00	803,730.46	
	T 5% 08/31/25	3,930,000.00	3,937,138.48	
	T 6.0% 02/15/26	600,000.00	614,109.37	
	T 6.125% 11/15/27	1,850,000.00	1,959,916.01	
	T 6.25% 05/15/30	2,920,000.00	3,227,056.25	
アメリカドル 小計		627,030,000.00	556,769,474.92 (85,386,166,673)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	1,130,000.00	1,069,038.55	
	CAN 0.5% 09/01/25	1,590,000.00	1,530,904.51	
	CAN 0.5% 12/01/30	1,570,000.00	1,320,151.81	
	CAN 1.25% 03/01/27	1,440,000.00	1,361,752.59	
	CAN 1.25% 06/01/30	1,290,000.00	1,150,608.24	
	CAN 1.5% 06/01/26	740,000.00	712,031.33	

		CAN 1.5% 06/01/31	2,010,000.00	1,787,173.20	
		CAN 1.5% 12/01/31	1,230,000.00	1,083,004.65	
		CAN 1.75% 12/01/53	1,520,000.00	1,050,190.07	
		CAN 1% 06/01/27	640,000.00	599,508.28	
		CAN 1% 09/01/26	1,060,000.00	1,005,573.14	
		CAN 2.25% 06/01/29	390,000.00	373,420.23	
		CAN 2.25% 12/01/29	240,000.00	229,097.28	
		CAN 2.5% 12/01/32	980,000.00	919,141.03	
		CAN 2.75% 06/01/33	330,000.00	314,485.69	
		CAN 2.75% 09/01/27	710,000.00	696,923.21	
		CAN 2.75% 12/01/48	520,000.00	462,055.92	
		CAN 2.75% 12/01/55	530,000.00	461,759.91	
		CAN 2.75% 12/01/64	350,000.00	304,582.94	
		CAN 2% 06/01/28	500,000.00	476,928.80	
		CAN 2% 06/01/32	1,190,000.00	1,079,290.80	
		CAN 2% 12/01/51	2,330,000.00	1,738,684.18	
		CAN 3.25% 09/01/28	1,010,000.00	1,007,317.99	
		CAN 3.25% 12/01/33	600,000.00	593,439.29	
		CAN 3.5% 03/01/28	780,000.00	783,981.07	
		CAN 3.5% 08/01/25	610,000.00	606,345.83	
		CAN 3.5% 09/01/29	350,000.00	353,320.59	
		CAN 3.5% 12/01/45	490,000.00	494,178.79	
		CAN 3% 04/01/26	970,000.00	958,077.81	
		CAN 3% 06/01/34	1,160,000.00	1,121,879.52	
		CAN 3% 10/01/25	1,880,000.00	1,858,415.56	
		CAN 4.0% 06/01/41	420,000.00	448,769.32	
		CAN 4% 03/01/29	1,000,000.00	1,029,453.08	
		CAN 5.75% 06/01/29	680,000.00	756,269.58	
		CAN 5.75% 06/01/33	2,170,000.00	2,562,939.56	
		CAN 5% 06/01/37	230,000.00	267,401.22	
	カナダドル 小計		34,640,000.00	32,568,095.57 (3,615,709,970)	
	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	5,250,000.00	5,266,761.09	
		MBONO 5.5% 03/04/27	15,140,000.00	13,514,940.37	
		MBONO 5.75% 03/05/26	28,180,000.00	26,101,533.93	
		MBONO 7.5% 05/26/33	13,260,000.00	11,335,443.60	
		MBONO 7.5% 06/03/27	20,520,000.00	19,198,879.92	
		MBONO 7.75% 05/29/31	22,210,000.00	19,787,475.12	
		MBONO 7.75% 11/13/42	15,680,000.00	12,466,058.32	
		MBONO 7.75% 11/23/34	7,300,000.00	6,266,178.52	
		MBONO 7% 09/03/26	3,040,000.00	2,830,513.60	
		MBONO 8.5% 03/01/29	3,700,000.00	3,482,588.00	

	MBONO 8.5% 05/31/29	15,940,000.00	15,031,678.38	
	MBONO 8.5% 11/18/38	13,720,000.00	12,001,586.87	
	MBONO 8% 07/31/53	11,430,000.00	9,064,828.16	
	MBONO 8% 11/07/47	14,310,000.00	11,507,841.55	
メキシコペソ 小計		189,680,000.00	167,856,307.43 (1,397,739,471)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	660,000.00	566,908.32	
	BGB 0.35% 06/22/32	860,000.00	709,225.66	
	BGB 0.4% 06/22/40	400,000.00	257,547.00	
	BGB 0.65% 06/22/71	340,000.00	140,418.47	
	BGB 0.8% 06/22/27	640,000.00	606,613.12	
	BGB 0.8% 06/22/28	810,000.00	755,132.62	
	BGB 0.9% 06/22/29	1,100,000.00	1,011,642.77	
	BGB 0% 10/22/27	530,000.00	486,505.81	
	BGB 0% 10/22/31	520,000.00	425,760.40	
	BGB 1.25% 04/22/33	310,000.00	271,864.96	
	BGB 1.4% 06/22/53	520,000.00	322,636.08	
	BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	328,832.00	
	BGB 1.6% 06/22/47	610,000.00	434,184.07	
	BGB 1.7% 06/22/50	610,000.00	425,829.10	
	BGB 1.9% 06/22/38	480,000.00	409,777.35	
	BGB 1% 06/22/26	1,000,000.00	967,104.40	
	BGB 1% 06/22/31	910,000.00	809,269.70	
	BGB 2.15% 06/22/66	420,000.00	304,531.50	
	BGB 2.25% 06/22/57	330,000.00	248,893.03	
	BGB 2.7% 10/22/29	210,000.00	209,976.32	
	BGB 2.75% 04/22/39	140,000.00	131,986.64	
	BGB 2.85% 10/22/34	400,000.00	394,776.00	
	BGB 3.3% 06/22/54	580,000.00	551,923.65	
	BGB 3.45% 06/22/43	280,000.00	282,293.76	
	BGB 3.5% 06/22/55	250,000.00	245,806.87	
	BGB 3.75% 06/22/45	450,000.00	471,343.81	
	BGB 3% 06/22/33	1,120,000.00	1,128,407.28	
	BGB 3% 06/22/34	350,000.00	351,353.97	
	BGB 4.25% 03/28/41	870,000.00	971,282.35	
	BGB 4.5% 03/28/26	510,000.00	523,539.83	
	BGB 4% 03/28/32	620,000.00	668,926.80	
	BGB 5.5% 03/28/28	1,040,000.00	1,141,015.20	
	BGB 5% 03/28/35	1,110,000.00	1,305,567.23	
	BKO 2.5% 03/19/26	1,070,000.00	1,065,118.66	
	BKO 3.1% 09/18/25	1,000,000.00	1,001,013.70	
	BTPS 0.25% 03/15/28	1,250,000.00	1,128,750.00	
	BTPS 0.45% 02/15/29	1,710,000.00	1,514,078.46	

		BTPS 0.5% 02/01/26	1,250,000.00	1,201,203.27	
		BTPS 0.5% 07/15/28	730,000.00	659,385.64	
		BTPS 0.6% 08/01/31	1,300,000.00	1,072,777.87	
		BTPS 0.85% 01/15/27	1,920,000.00	1,820,618.82	
		BTPS 0.9% 04/01/31	1,300,000.00	1,106,924.00	
		BTPS 0.95% 03/01/37	600,000.00	424,354.20	
		BTPS 0.95% 06/01/32	1,190,000.00	983,031.43	
		BTPS 0.95% 08/01/30	420,000.00	365,566.95	
		BTPS 0.95% 09/15/27	1,000,000.00	937,362.50	
		BTPS 0.95% 12/01/31	1,120,000.00	939,248.80	
		BTPS 0% 04/01/26	2,700,000.00	2,563,265.02	
		BTPS 0% 08/01/26	1,330,000.00	1,250,732.00	
		BTPS 1.1% 04/01/27	900,000.00	854,865.00	
		BTPS 1.2% 08/15/25	940,000.00	919,516.46	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,170,000.00	1,122,932.65	
		BTPS 1.35% 04/01/30	1,510,000.00	1,358,853.90	
		BTPS 1.45% 03/01/36	830,000.00	644,873.89	
		BTPS 1.5% 04/30/45	650,000.00	412,977.50	
		BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,314,313.50	
		BTPS 1.65% 03/01/32	1,300,000.00	1,143,636.00	
		BTPS 1.65% 12/01/30	820,000.00	739,259.52	
		BTPS 1.7% 09/01/51	750,000.00	454,883.25	
		BTPS 1.8% 03/01/41	890,000.00	643,922.34	
		BTPS 1.85% 07/01/25	820,000.00	808,901.71	
		BTPS 2.05% 08/01/27	1,040,000.00	1,010,149.66	
		BTPS 2.15% 03/01/72	360,000.00	218,799.18	
		BTPS 2.15% 09/01/52	510,000.00	337,318.59	
		BTPS 2.2% 06/01/27	1,110,000.00	1,084,672.02	
		BTPS 2.25% 09/01/36	1,190,000.00	1,003,681.70	
		BTPS 2.45% 09/01/33	1,360,000.00	1,238,016.16	
		BTPS 2.45% 09/01/50	970,000.00	699,279.54	
		BTPS 2.5% 11/15/25	660,000.00	654,492.30	
		BTPS 2.5% 12/01/32	960,000.00	887,199.36	
		BTPS 2.65% 12/01/27	770,000.00	759,838.31	
		BTPS 2.7% 03/01/47	940,000.00	736,295.42	
		BTPS 2.8% 03/01/67	500,000.00	365,596.87	
		BTPS 2.8% 06/15/29	700,000.00	686,618.10	
		BTPS 2.8% 12/01/28	1,260,000.00	1,243,251.45	
		BTPS 2.95% 02/15/27	220,000.00	219,236.60	
		BTPS 2.95% 09/01/38	850,000.00	753,081.72	
		BTPS 2% 02/01/28	750,000.00	723,191.02	
		BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,034,061.00	

		BTPS 3.1% 03/01/40	670,000.00	593,543.62	
		BTPS 3.25% 03/01/38	270,000.00	248,556.60	
		BTPS 3.25% 09/01/46	880,000.00	759,911.46	
		BTPS 3.35% 03/01/35	1,390,000.00	1,335,692.70	
		BTPS 3.4% 04/01/28	1,050,000.00	1,060,355.10	
		BTPS 3.45% 03/01/48	890,000.00	786,957.58	
		BTPS 3.5% 01/15/26	1,490,000.00	1,496,327.28	
		BTPS 3.5% 02/15/31	790,000.00	793,420.70	
		BTPS 3.5% 03/01/30	1,870,000.00	1,892,397.92	
		BTPS 3.6% 09/29/25	920,000.00	923,174.00	
		BTPS 3.7% 06/15/30	500,000.00	509,108.25	
		BTPS 3.85% 07/01/34	210,000.00	211,735.58	
		BTPS 3.85% 09/01/49	840,000.00	785,868.21	
		BTPS 3.85% 12/15/29	1,250,000.00	1,283,939.12	
		BTPS 3% 08/01/29	670,000.00	663,245.56	
		BTPS 4.05% 10/30/37	600,000.00	605,091.18	
		BTPS 4.15% 10/01/39	350,000.00	351,454.84	
		BTPS 4.2% 03/01/34	900,000.00	934,446.33	
		BTPS 4.35% 11/01/33	1,140,000.00	1,199,052.79	
		BTPS 4.4% 05/01/33	240,000.00	253,929.72	
		BTPS 4.45% 09/01/43	640,000.00	657,282.88	
		BTPS 4.5% 03/01/26	930,000.00	949,382.78	
		BTPS 4.5% 10/01/53	570,000.00	583,401.66	
		BTPS 4.75% 09/01/28	1,260,000.00	1,337,013.34	
		BTPS 4.75% 09/01/44	930,000.00	995,937.18	
		BTPS 4% 02/01/37	1,800,000.00	1,822,403.70	
		BTPS 4% 04/30/35	620,000.00	632,067.37	
		BTPS 4% 10/30/31	440,000.00	455,759.04	
		BTPS 4% 11/15/30	1,490,000.00	1,540,671.92	
		BTPS 5.0% 08/01/39	1,440,000.00	1,582,851.88	
		BTPS 5.25% 11/01/29	1,770,000.00	1,942,840.50	
		BTPS 5.75% 02/01/33	1,410,000.00	1,627,499.55	
		BTPS 5% 08/01/34	1,020,000.00	1,126,602.24	
		BTPS 5% 09/01/40	1,220,000.00	1,340,939.82	
		BTPS 6.5% 11/01/27	2,070,000.00	2,290,325.62	
		BTPS 6% 05/01/31	1,320,000.00	1,528,027.38	
		BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	381,922.80	
		DBR 0.25% 02/15/27	1,850,000.00	1,748,170.45	
		DBR 0.25% 02/15/29	1,750,000.00	1,595,295.62	
		DBR 0.25% 08/15/28	1,300,000.00	1,196,066.78	
		DBR 0.5% 02/15/26	1,330,000.00	1,284,893.38	
		DBR 0.5% 02/15/28	110,000.00	103,034.91	
		DBR 0.5% 08/15/27	580,000.00	547,573.65	

		DBR 0% 02/15/30	1,150,000.00	1,013,037.30	
		DBR 0% 02/15/31	1,380,000.00	1,189,289.52	
		DBR 0% 02/15/32	2,080,000.00	1,749,526.98	
		DBR 0% 05/15/35	1,280,000.00	983,849.59	
		DBR 0% 05/15/36	1,320,000.00	984,294.77	
		DBR 0% 08/15/26	1,950,000.00	1,850,123.43	
		DBR 0% 08/15/29	2,430,000.00	2,164,624.56	
		DBR 0% 08/15/30	1,880,000.00	1,638,792.24	
		DBR 0% 08/15/30	400,000.00	348,794.40	
		DBR 0% 08/15/31	1,860,000.00	1,584,329.40	
		DBR 0% 08/15/50	2,530,000.00	1,291,767.40	
		DBR 0% 08/15/52	1,560,000.00	757,362.04	
		DBR 0% 11/15/27	1,230,000.00	1,136,459.11	
		DBR 0% 11/15/28	1,250,000.00	1,131,627.50	
		DBR 1.25% 08/15/48	1,760,000.00	1,327,434.68	
		DBR 1.7% 08/15/32	1,310,000.00	1,249,654.85	
		DBR 1.8% 08/15/53	1,630,000.00	1,351,730.46	
		DBR 1.8% 08/15/53	290,000.00	240,835.21	
		DBR 1% 05/15/38	970,000.00	792,369.72	
		DBR 1% 08/15/25	1,130,000.00	1,106,794.03	
		DBR 2.1% 11/15/29	450,000.00	444,098.25	
		DBR 2.2% 02/15/34	1,600,000.00	1,571,149.60	
		DBR 2.3% 02/15/33	2,120,000.00	2,109,454.39	
		DBR 2.4% 11/15/30	800,000.00	801,793.60	
		DBR 2.5% 07/04/44	1,520,000.00	1,482,085.50	
		DBR 2.5% 08/15/46	1,600,000.00	1,557,290.40	
		DBR 2.5% 08/15/54	650,000.00	629,081.37	
		DBR 2.6% 08/15/33	1,410,000.00	1,434,620.01	
		DBR 3.25% 07/04/42	930,000.00	1,008,657.26	
		DBR 4.0% 01/04/37	1,400,000.00	1,615,255.60	
		DBR 4.25% 07/04/39	990,000.00	1,188,279.67	
		DBR 4.75% 07/04/28	1,180,000.00	1,283,681.76	
		DBR 4.75% 07/04/34	1,160,000.00	1,396,028.68	
		DBR 4.75% 07/04/40	1,100,000.00	1,401,749.80	
		DBR 5.5% 01/04/31	1,090,000.00	1,290,480.53	
		DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	1,656,423.75	
		DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	729,616.42	
		DBR 6.5% 07/04/27	1,270,000.00	1,412,385.16	
		FRTR 0.25% 11/25/26	1,800,000.00	1,696,068.89	
		FRTR 0.5% 05/25/26	2,710,000.00	2,596,196.93	
		FRTR 0.5% 05/25/29	1,830,000.00	1,639,513.54	
		FRTR 0.5% 05/25/40	1,460,000.00	947,853.90	

		FRTR 0.5% 05/25/72	640,000.00	230,752.00	
		FRTR 0.5% 06/25/44	1,100,000.00	637,318.00	
		FRTR 0.75% 02/25/28	4,320,000.00	4,021,072.19	
		FRTR 0.75% 05/25/28	2,910,000.00	2,695,383.86	
		FRTR 0.75% 05/25/52	1,930,000.00	988,928.14	
		FRTR 0.75% 05/25/53	1,750,000.00	872,068.75	
		FRTR 0.75% 11/25/28	2,690,000.00	2,465,573.30	
		FRTR 0% 02/25/26	2,790,000.00	2,664,723.42	
		FRTR 0% 02/25/27	2,140,000.00	1,991,109.50	
		FRTR 0% 05/25/32	1,850,000.00	1,471,608.40	
		FRTR 0% 11/25/29	2,460,000.00	2,119,431.85	
		FRTR 0% 11/25/30	3,230,000.00	2,699,368.31	
		FRTR 0% 11/25/31	3,590,000.00	2,904,638.47	
		FRTR 1.25% 05/25/34	2,200,000.00	1,858,173.90	
		FRTR 1.25% 05/25/36	2,320,000.00	1,874,511.28	
		FRTR 1.25% 05/25/38	1,310,000.00	1,008,844.10	
		FRTR 1.5% 05/25/31	2,940,000.00	2,689,450.26	
		FRTR 1.5% 05/25/50	1,950,000.00	1,280,559.15	
		FRTR 1.75% 05/25/66	850,000.00	531,224.50	
		FRTR 1.75% 06/25/39	1,660,000.00	1,354,254.97	
		FRTR 1% 05/25/27	2,850,000.00	2,710,848.75	
		FRTR 1% 11/25/25	1,520,000.00	1,480,195.00	
		FRTR 2.5% 05/25/30	3,520,000.00	3,453,127.70	
		FRTR 2.5% 05/25/43	760,000.00	656,415.80	
		FRTR 2.5% 09/24/26	1,670,000.00	1,657,063.34	
		FRTR 2.75% 02/25/29	2,210,000.00	2,200,950.05	
		FRTR 2.75% 10/25/27	3,080,000.00	3,072,738.90	
		FRTR 2% 05/25/48	1,580,000.00	1,192,483.27	
		FRTR 2% 11/25/32	1,960,000.00	1,816,196.76	
		FRTR 3.25% 05/25/45	1,800,000.00	1,734,390.00	
		FRTR 3.25% 05/25/55	410,000.00	379,374.39	
		FRTR 3.5% 04/25/26	1,400,000.00	1,413,921.60	
		FRTR 3.5% 11/25/33	1,600,000.00	1,652,825.92	
		FRTR 3% 05/25/33	2,110,000.00	2,102,129.70	
		FRTR 3% 05/25/54	970,000.00	858,627.26	
		FRTR 4.5% 04/25/41	1,840,000.00	2,090,742.68	
		FRTR 4.75% 04/25/35	1,590,000.00	1,818,002.82	
		FRTR 4% 04/25/55	820,000.00	875,603.79	
		FRTR 4% 04/25/60	1,020,000.00	1,098,322.94	
		FRTR 4% 10/25/38	1,420,000.00	1,526,137.90	
		FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	2,788,959.25	
		FRTR 5.75% 10/25/32	2,150,000.00	2,573,778.97	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	1,501,077.26	

		IRISH 0.2% 05/15/27	410,000.00	383,081.96	
		IRISH 0.2% 10/18/30	380,000.00	327,879.07	
		IRISH 0.35% 10/18/32	170,000.00	140,515.79	
		IRISH 0.4% 05/15/35	310,000.00	239,900.47	
		IRISH 0.55% 04/22/41	250,000.00	168,907.03	
		IRISH 0.9% 05/15/28	440,000.00	413,392.46	
		IRISH 0% 10/18/31	430,000.00	354,389.89	
		IRISH 1.1% 05/15/29	510,000.00	475,250.51	
		IRISH 1.3% 05/15/33	280,000.00	248,586.24	
		IRISH 1.35% 03/18/31	240,000.00	221,117.42	
		IRISH 1.5% 05/15/50	460,000.00	329,287.55	
		IRISH 1.7% 05/15/37	420,000.00	364,315.98	
		IRISH 1% 05/15/26	670,000.00	649,257.13	
		IRISH 2.4% 05/15/30	440,000.00	434,455.12	
		IRISH 2% 02/18/45	620,000.00	518,549.40	
		IRISH 3% 10/18/43	170,000.00	168,013.97	
		NETHER 0.25% 07/15/25	720,000.00	700,819.20	
		NETHER 0.25% 07/15/29	540,000.00	482,916.60	
		NETHER 0.5% 01/15/40	780,000.00	552,332.04	
		NETHER 0.5% 07/15/26	820,000.00	786,216.00	
		NETHER 0.5% 07/15/32	560,000.00	475,550.79	
		NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	853,667.82	
		NETHER 0.75% 07/15/28	450,000.00	419,788.01	
		NETHER 0% 01/15/26	870,000.00	834,834.60	
		NETHER 0% 01/15/27	750,000.00	703,618.50	
		NETHER 0% 01/15/29	1,040,000.00	929,010.16	
		NETHER 0% 01/15/38	530,000.00	362,729.88	
		NETHER 0% 01/15/52	970,000.00	458,240.10	
		NETHER 0% 07/15/30	850,000.00	730,806.62	
		NETHER 0% 07/15/31	800,000.00	670,421.35	
		NETHER 2.5% 01/15/30	420,000.00	418,218.15	
		NETHER 2.5% 01/15/33	820,000.00	811,441.66	
		NETHER 2.5% 07/15/33	590,000.00	582,138.25	
		NETHER 2.5% 07/15/34	600,000.00	588,636.00	
		NETHER 2.75% 01/15/47	960,000.00	942,589.68	
		NETHER 2% 01/15/54	560,000.00	465,409.28	
		NETHER 3.25% 01/15/44	240,000.00	252,727.20	
		NETHER 3.75% 01/15/42	1,010,000.00	1,128,441.69	
		NETHER 4% 01/15/37	950,000.00	1,067,146.87	
		NETHER 5.5% 01/15/28	780,000.00	854,545.69	
		OBL 0% 04/10/26	1,500,000.00	1,433,544.00	
		OBL 0% 04/16/27	1,210,000.00	1,131,755.35	

		OBL 0% 10/09/26	1,360,000.00	1,285,688.24	
		OBL 0% 10/10/25	1,970,000.00	1,902,918.77	
		OBL 1.3% 10/15/27	2,620,000.00	2,530,409.10	
		OBL 2.1% 04/12/29	200,000.00	197,529.50	
		OBL 2.1% 04/12/29	570,000.00	563,113.92	
		OBL 2.2% 04/13/28	900,000.00	893,156.62	
		OBL 2.4% 10/19/28	1,460,000.00	1,459,921.16	
		RAGB 0.25% 10/20/36	360,000.00	258,004.80	
		RAGB 0.5% 02/20/29	810,000.00	734,589.00	
		RAGB 0.5% 04/20/27	650,000.00	612,680.25	
		RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	124,713.40	
		RAGB 0.75% 02/20/28	590,000.00	551,536.42	
		RAGB 0.75% 03/20/51	460,000.00	263,094.01	
		RAGB 0.75% 10/20/26	900,000.00	861,479.17	
		RAGB 0.85% 06/30/20	200,000.00	90,313.00	
		RAGB 0.9% 02/20/32	720,000.00	626,415.12	
		RAGB 0% 02/20/30	990,000.00	852,171.43	
		RAGB 0% 02/20/31	850,000.00	709,386.71	
		RAGB 0% 10/20/28	420,000.00	375,491.97	
		RAGB 0% 10/20/40	330,000.00	199,051.71	
		RAGB 1.2% 10/20/25	680,000.00	665,119.56	
		RAGB 1.5% 02/20/47	530,000.00	386,579.35	
		RAGB 1.5% 11/02/86	200,000.00	119,215.00	
		RAGB 1.85% 05/23/49	360,000.00	277,699.14	
		RAGB 2.1% 09/20/17	280,000.00	208,718.65	
		RAGB 2.4% 05/23/34	460,000.00	439,683.87	
		RAGB 2.9% 02/20/33	720,000.00	720,903.96	
		RAGB 2.9% 02/20/34	320,000.00	319,232.00	
		RAGB 2% 07/15/26	260,000.00	256,133.54	
		RAGB 3.15% 06/20/44	420,000.00	416,679.90	
		RAGB 3.15% 10/20/53	190,000.00	187,088.25	
		RAGB 3.2% 07/15/39	130,000.00	130,638.30	
		RAGB 3.45% 10/20/30	150,000.00	155,828.70	
		RAGB 3.8% 01/26/62	210,000.00	237,784.57	
		RAGB 4.15% 03/15/37	770,000.00	855,839.60	
		RAGB 4.85% 03/15/26	470,000.00	484,311.12	
		RAGB 6.25% 07/15/27	540,000.00	594,049.51	
		RFGB 0.125% 04/15/36	270,000.00	193,050.27	
		RFGB 0.125% 04/15/52	240,000.00	110,151.00	
		RFGB 0.125% 09/15/31	290,000.00	240,239.78	
		RFGB 0.25% 09/15/40	210,000.00	133,906.08	
		RFGB 0.5% 04/15/26	500,000.00	480,551.25	
		RFGB 0.5% 04/15/43	180,000.00	113,282.32	

		RFGB 0.5% 09/15/27	380,000.00	355,408.01	
		RFGB 0.5% 09/15/28	290,000.00	265,345.28	
		RFGB 0.5% 09/15/29	290,000.00	259,172.71	
		RFGB 0.75% 04/15/31	320,000.00	280,634.33	
		RFGB 0.875% 09/15/25	380,000.00	370,905.36	
		RFGB 0% 09/15/30	330,000.00	279,009.88	
		RFGB 1.125% 04/15/34	310,000.00	263,493.99	
		RFGB 1.375% 04/15/27	140,000.00	135,125.20	
		RFGB 1.375% 04/15/47	330,000.00	236,778.66	
		RFGB 1.5% 09/15/32	260,000.00	234,705.90	
		RFGB 2.625% 07/04/42	350,000.00	325,294.37	
		RFGB 2.75% 04/15/38	170,000.00	162,953.58	
		RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	381,074.26	
		RFGB 2.875% 04/15/29	160,000.00	161,011.92	
		RFGB 2.95% 04/15/55	160,000.00	152,614.58	
		RFGB 3% 09/15/33	330,000.00	332,602.05	
		RFGB 3% 09/15/34	190,000.00	190,839.93	
		RFGB 4% 07/04/25	240,000.00	241,793.08	
		SPGB 0.1% 04/30/31	1,010,000.00	836,370.64	
		SPGB 0.5% 04/30/30	2,020,000.00	1,768,089.84	
		SPGB 0.5% 10/31/31	1,180,000.00	991,226.55	
		SPGB 0.6% 10/31/29	970,000.00	863,974.15	
		SPGB 0.7% 04/30/32	930,000.00	782,617.32	
		SPGB 0.8% 07/30/27	1,190,000.00	1,120,385.89	
		SPGB 0.8% 07/30/29	880,000.00	795,977.60	
		SPGB 0.85% 07/30/37	640,000.00	466,970.40	
		SPGB 0% 01/31/26	1,070,000.00	1,022,935.71	
		SPGB 0% 01/31/27	1,080,000.00	1,005,164.09	
		SPGB 0% 01/31/28	1,280,000.00	1,159,647.68	
		SPGB 1.2% 10/31/40	950,000.00	669,864.00	
		SPGB 1.25% 10/31/30	1,200,000.00	1,086,514.80	
		SPGB 1.3% 10/31/26	1,460,000.00	1,410,272.40	
		SPGB 1.4% 04/30/28	1,050,000.00	997,185.00	
		SPGB 1.4% 07/30/28	430,000.00	406,996.72	
		SPGB 1.45% 04/30/29	1,850,000.00	1,737,226.46	
		SPGB 1.45% 10/31/27	1,330,000.00	1,273,219.18	
		SPGB 1.45% 10/31/71	260,000.00	126,972.30	
		SPGB 1.5% 04/30/27	1,290,000.00	1,244,051.49	
		SPGB 1.85% 07/30/35	1,190,000.00	1,034,116.14	
		SPGB 1.9% 10/31/52	1,050,000.00	702,703.05	
		SPGB 1.95% 04/30/26	1,790,000.00	1,759,539.57	
		SPGB 1.95% 07/30/30	1,520,000.00	1,442,138.00	

	SPGB 1% 07/30/42	690,000.00	451,917.22	
	SPGB 1% 10/31/50	1,130,000.00	614,570.84	
	SPGB 2.15% 10/31/25	1,650,000.00	1,631,234.96	
	SPGB 2.35% 07/30/33	1,160,000.00	1,089,843.20	
	SPGB 2.55% 10/31/32	1,630,000.00	1,568,750.30	
	SPGB 2.7% 10/31/48	890,000.00	740,090.62	
	SPGB 2.8% 05/31/26	330,000.00	328,936.57	
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,020,000.00	892,359.75	
	SPGB 3.15% 04/30/33	1,580,000.00	1,583,635.26	
	SPGB 3.25% 04/30/34	870,000.00	872,545.62	
	SPGB 3.45% 07/30/43	580,000.00	558,347.15	
	SPGB 3.45% 07/30/66	840,000.00	760,070.01	
	SPGB 3.45% 10/31/34	700,000.00	711,886.00	
	SPGB 3.5% 05/31/29	390,000.00	400,978.96	
	SPGB 3.55% 10/31/33	1,330,000.00	1,370,215.21	
	SPGB 3.9% 07/30/39	540,000.00	559,911.42	
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,050,000.00	1,136,256.97	
	SPGB 4.65% 07/30/25	1,410,000.00	1,429,670.91	
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,240,000.00	1,408,517.24	
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,080,000.00	1,248,180.84	
	SPGB 4% 10/31/54	250,000.00	253,899.75	
	SPGB 5.15% 10/31/28	500,000.00	546,010.60	
	SPGB 5.15% 10/31/44	790,000.00	950,375.53	
	SPGB 5.75% 07/30/32	950,000.00	1,131,794.56	
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,360,000.00	1,437,508.03	
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	2,663,278.50	
ユーロ 小計		363,330,000.00	337,290,069.29 (56,071,101,118)	
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	780,000.00	736,444.80	
	UKT 0.125% 01/31/28	880,000.00	771,985.98	
	UKT 0.25% 07/31/31	1,730,000.00	1,340,980.78	
	UKT 0.375% 10/22/26	1,170,000.00	1,077,723.85	
	UKT 0.375% 10/22/30	1,250,000.00	1,008,687.50	
	UKT 0.5% 01/31/29	1,180,000.00	1,014,018.84	
	UKT 0.5% 10/22/61	1,050,000.00	313,950.00	
	UKT 0.625% 07/31/35	1,030,000.00	707,544.08	
	UKT 0.625% 10/22/50	640,000.00	257,152.00	
	UKT 0.875% 01/31/46	510,000.00	252,705.00	
	UKT 0.875% 07/31/33	1,500,000.00	1,137,720.00	
	UKT 0.875% 10/22/29	820,000.00	705,015.50	
	UKT 1.125% 01/31/39	1,120,000.00	728,336.00	
	UKT 1.125% 10/22/73	480,000.00	173,136.00	
	UKT 1.25% 07/22/27	740,000.00	683,171.70	

		UKT 1.25% 07/31/51	1,170,000.00	566,982.00	
		UKT 1.25% 10/22/41	1,190,000.00	729,589.00	
		UKT 1.5% 07/22/26	1,180,000.00	1,120,234.41	
		UKT 1.5% 07/22/47	860,000.00	482,546.00	
		UKT 1.5% 07/31/53	680,000.00	343,672.00	
		UKT 1.625% 10/22/28	480,000.00	437,941.92	
		UKT 1.625% 10/22/54	720,000.00	372,600.00	
		UKT 1.625% 10/22/71	710,000.00	322,340.00	
		UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	349,380.00	
		UKT 1.75% 07/22/57	980,000.00	514,568.60	
		UKT 1.75% 09/07/37	1,110,000.00	827,505.00	
		UKT 1% 01/31/32	1,880,000.00	1,515,168.14	
		UKT 2.5% 07/22/65	860,000.00	537,500.00	
		UKT 2% 09/07/25	840,000.00	816,916.80	
		UKT 3.25% 01/22/44	1,240,000.00	1,026,596.00	
		UKT 3.25% 01/31/33	1,760,000.00	1,655,227.55	
		UKT 3.5% 01/22/45	1,130,000.00	964,342.00	
		UKT 3.5% 07/22/68	800,000.00	645,600.00	
		UKT 3.5% 10/22/25	1,330,000.00	1,311,251.40	
		UKT 3.75% 01/29/38	1,060,000.00	995,022.00	
		UKT 3.75% 03/07/27	580,000.00	572,398.54	
		UKT 3.75% 07/22/52	880,000.00	758,648.00	
		UKT 3.75% 10/22/53	1,480,000.00	1,267,620.00	
		UKT 4.125% 01/29/27	1,870,000.00	1,863,360.37	
		UKT 4.125% 07/22/29	600,000.00	602,084.28	
		UKT 4.25% 03/07/36	850,000.00	850,159.63	
		UKT 4.25% 06/07/32	770,000.00	782,997.60	
		UKT 4.25% 07/31/34	550,000.00	553,267.66	
		UKT 4.25% 09/07/39	670,000.00	655,662.00	
		UKT 4.25% 12/07/27	600,000.00	604,186.80	
		UKT 4.25% 12/07/40	800,000.00	777,200.00	
		UKT 4.25% 12/07/46	1,020,000.00	965,736.00	
		UKT 4.25% 12/07/49	810,000.00	762,939.00	
		UKT 4.25% 12/07/55	1,000,000.00	936,900.00	
		UKT 4.375% 07/31/54	500,000.00	477,100.00	
		UKT 4.5% 06/07/28	1,600,000.00	1,623,350.72	
		UKT 4.5% 09/07/34	840,000.00	862,692.60	
		UKT 4.5% 12/07/42	930,000.00	923,304.00	
		UKT 4.625% 01/31/34	1,580,000.00	1,639,143.34	
		UKT 4.75% 10/22/43	630,000.00	642,474.00	
		UKT 4.75% 12/07/30	760,000.00	793,354.50	
		UKT 4.75% 12/07/38	810,000.00	840,961.92	

	UKT 4% 01/22/60	710,000.00	636,160.00	
	UKT 4% 10/22/63	660,000.00	588,846.72	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,070,000.00	1,158,705.99	
イギリスポンド 小計		58,030,000.00	48,582,808.52 (9,609,193,697)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	3,010,000.00	2,656,957.10	
	SGB 0.75% 05/12/28	3,240,000.00	3,092,798.31	
	SGB 0.75% 11/12/29	4,140,000.00	3,885,762.60	
	SGB 1.75% 11/11/33	1,970,000.00	1,923,303.84	
	SGB 1% 11/12/26	3,890,000.00	3,789,555.53	
	SGB 2.25% 06/01/32	2,560,000.00	2,601,842.68	
	SGB 3.5% 03/30/39	2,250,000.00	2,623,252.50	
スウェーデンクローナ 小計		21,060,000.00	20,573,472.56 (292,760,514)	
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	2,370,000.00	2,043,323.94	
	NGB 1.375% 08/19/30	3,280,000.00	2,914,188.98	
	NGB 1.5% 02/19/26	2,510,000.00	2,422,025.37	
	NGB 1.75% 02/17/27	2,420,000.00	2,316,175.95	
	NGB 1.75% 09/06/29	2,310,000.00	2,129,483.20	
	NGB 2.125% 05/18/32	1,630,000.00	1,481,262.50	
	NGB 2% 04/26/28	2,510,000.00	2,385,054.71	
	NGB 3.5% 10/06/42	1,200,000.00	1,208,603.40	
	NGB 3.625% 04/13/34	1,420,000.00	1,435,265.00	
	NGB 3% 08/15/33	2,330,000.00	2,241,885.31	
ノルウェークローネ 小計		21,980,000.00	20,577,268.36 (286,024,030)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	2,880,000.00	1,546,768.80	
	DGB 0.5% 11/15/27	3,770,000.00	3,549,194.11	
	DGB 0.5% 11/15/29	2,840,000.00	2,586,509.55	
	DGB 0% 11/15/31	3,330,000.00	2,823,128.70	
	DGB 1.75% 11/15/25	2,450,000.00	2,419,281.53	
	DGB 2.25% 11/15/26	910,000.00	905,121.03	
	DGB 2.25% 11/15/33	1,670,000.00	1,650,013.44	
	DGB 4.5% 11/15/39	5,220,000.00	6,455,036.34	
デンマーククローネ 小計		23,070,000.00	21,935,053.50 (488,493,641)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,080,000.00	971,165.16	
	POLGB 1.25% 10/25/30	2,040,000.00	1,604,081.07	
	POLGB 1.75% 04/25/32	2,940,000.00	2,267,030.32	
	POLGB 2.5% 07/25/26	3,600,000.00	3,428,519.40	
	POLGB 2.5% 07/25/27	2,260,000.00	2,096,478.82	
	POLGB 2.75% 04/25/28	3,870,000.00	3,551,866.65	
	POLGB 2.75% 10/25/29	4,370,000.00	3,869,259.18	

	POLGB 3.25% 07/25/25	2,940,000.00	2,904,495.82	
	POLGB 3.75% 05/25/27	730,000.00	703,427.63	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,100,000.00	1,118,398.27	
	POLGB 5% 10/25/34	470,000.00	448,732.50	
	POLGB 6% 10/25/33	1,690,000.00	1,748,542.43	
	POLGB 7.5% 07/25/28	1,530,000.00	1,650,278.95	
ポーランドズロチ 小計		28,620,000.00	26,362,276.20 (1,019,278,955)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/25	1,000,000.00	948,885.86	
	ACGB 0.5% 09/21/26	1,030,000.00	954,299.21	
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,140,000.00	914,677.73	
	ACGB 1.5% 06/21/31	1,190,000.00	1,000,234.54	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,060,000.00	577,937.46	
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,260,000.00	1,038,740.97	
	ACGB 1% 11/21/31	1,860,000.00	1,486,900.40	
	ACGB 1% 12/21/30	1,480,000.00	1,220,419.98	
	ACGB 2.25% 05/21/28	630,000.00	590,899.72	
	ACGB 2.5% 05/21/30	620,000.00	568,853.33	
	ACGB 2.75% 05/21/41	750,000.00	586,430.28	
	ACGB 2.75% 06/21/35	780,000.00	671,330.04	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,080,000.00	1,037,662.85	
	ACGB 2.75% 11/21/28	770,000.00	731,533.65	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,080,000.00	1,012,438.23	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,110,000.00	1,072,365.34	
	ACGB 3.25% 06/21/39	480,000.00	413,589.54	
	ACGB 3.5% 12/21/34	820,000.00	762,209.86	
	ACGB 3.75% 04/21/37	780,000.00	728,655.87	
	ACGB 3.75% 05/21/34	1,220,000.00	1,164,163.12	
	ACGB 3% 03/21/47	720,000.00	545,566.97	
	ACGB 3% 11/21/33	1,120,000.00	1,008,135.53	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,200,000.00	1,201,749.00	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,340,000.00	1,360,441.56	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,080,000.00	1,099,636.02	
	ACGB 4.75% 06/21/54	330,000.00	329,907.20	
オーストラリアドル 小計		25,930,000.00	23,027,664.26 (2,316,583,024)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	650,000.00	563,265.02	
	NZGB 0.5% 05/15/26	360,000.00	336,047.13	
	NZGB 1.5% 05/15/31	460,000.00	386,667.48	
	NZGB 1.75% 05/15/41	260,000.00	170,126.30	
	NZGB 2.75% 04/15/37	350,000.00	288,316.51	
	NZGB 2.75% 05/15/51	350,000.00	242,445.43	
	NZGB 2% 05/15/32	350,000.00	296,855.32	

	NZGB 3.5% 04/14/33	740,000.00	693,573.65	
	NZGB 3% 04/20/29	450,000.00	429,221.29	
	NZGB 4.25% 05/15/34	340,000.00	335,781.65	
	NZGB 4.5% 04/15/27	560,000.00	564,998.72	
	NZGB 4.5% 05/15/30	260,000.00	264,671.29	
	NZGB 4.5% 05/15/35	220,000.00	220,706.46	
	NZGB 5% 05/15/54	190,000.00	195,259.65	
ニュージーランドドル 小計		5,540,000.00	4,987,935.90 (452,754,941)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	320,000.00	308,416.00	
	SIGB 1.25% 11/01/26	90,000.00	86,277.60	
	SIGB 1.625% 07/01/31	390,000.00	355,524.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	330,000.00	264,660.00	
	SIGB 1.875% 10/01/51	400,000.00	315,156.00	
	SIGB 2.125% 06/01/26	770,000.00	755,216.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	450,000.00	413,325.00	
	SIGB 2.375% 07/01/39	230,000.00	209,988.85	
	SIGB 2.625% 05/01/28	280,000.00	275,576.00	
	SIGB 2.625% 08/01/32	180,000.00	174,654.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	410,000.00	390,949.35	
	SIGB 2.75% 04/01/42	300,000.00	286,800.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	530,000.00	526,555.00	
	SIGB 2.875% 08/01/28	80,000.00	79,592.00	
	SIGB 2.875% 09/01/27	80,000.00	79,480.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	460,000.00	456,458.00	
	SIGB 3.375% 05/01/34	70,000.00	71,817.55	
	SIGB 3.375% 09/01/33	400,000.00	410,080.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	580,000.00	585,800.00	
	SIGB 3% 04/01/29	80,000.00	79,919.60	
	SIGB 3% 08/01/72	270,000.00	272,565.00	
シンガポールドル 小計		6,700,000.00	6,398,809.95 (730,360,167)	
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	960,000.00	896,976.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	920,000.00	921,012.00	
	MGS 3.519% 04/20/28	400,000.00	399,657.56	
	MGS 3.582% 07/15/32	950,000.00	935,375.05	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,180,000.00	1,187,029.73	
	MGS 3.757% 05/22/40	1,110,000.00	1,075,391.67	
	MGS 3.828% 07/05/34	250,000.00	250,422.07	
	MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	860,777.18	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,890,000.00	1,915,978.05	
	MGS 3.892% 03/15/27	300,000.00	303,320.82	

		MGS 3.899% 11/16/27	1,820,000.00	1,844,408.93	
		MGS 3.9% 11/30/26	1,140,000.00	1,153,363.99	
		MGS 3.906% 07/15/26	750,000.00	757,627.05	
		MGS 3.955% 09/15/25	1,450,000.00	1,461,281.00	
		MGS 4.065% 06/15/50	1,340,000.00	1,319,962.41	
		MGS 4.232% 06/30/31	950,000.00	976,915.21	
		MGS 4.254% 05/31/35	1,480,000.00	1,532,339.01	
		MGS 4.392% 04/15/26	380,000.00	386,626.13	
		MGS 4.457% 03/31/53	670,000.00	701,386.15	
		MGS 4.498% 04/15/30	1,040,000.00	1,082,669.74	
		MGS 4.642% 11/07/33	1,160,000.00	1,234,820.00	
		MGS 4.696% 10/15/42	780,000.00	842,573.23	
		MGS 4.736% 03/15/46	640,000.00	694,118.27	
		MGS 4.762% 04/07/37	1,160,000.00	1,255,780.73	
		MGS 4.893% 06/08/38	1,490,000.00	1,636,349.58	
		MGS 4.921% 07/06/48	950,000.00	1,060,267.16	
		MGS 4.935% 09/30/43	820,000.00	908,322.28	
	マレーシアリンギット 小計		26,840,000.00	27,594,751.00 (905,897,042)	
	イスラエルシェケル	ILGOV 0.5% 02/27/26	350,000.00	330,587.70	
		ILGOV 1.3% 04/30/32	1,310,000.00	1,032,197.47	
		ILGOV 1.5% 05/31/37	1,400,000.00	952,615.57	
		ILGOV 1.75% 08/31/25	1,290,000.00	1,257,009.54	
		ILGOV 1% 03/31/30	2,160,000.00	1,792,955.30	
		ILGOV 2.25% 09/28/28	1,320,000.00	1,216,190.97	
		ILGOV 2.8% 11/29/52	600,000.00	388,255.50	
		ILGOV 2% 03/31/27	1,290,000.00	1,219,945.00	
		ILGOV 3.75% 02/28/29	1,360,000.00	1,324,840.31	
		ILGOV 3.75% 03/31/47	1,440,000.00	1,173,934.36	
		ILGOV 3.75% 09/30/27	240,000.00	236,444.23	
		ILGOV 4% 03/30/35	440,000.00	413,022.58	
		ILGOV 5.5% 01/31/42	1,060,000.00	1,117,907.16	
		ILGOV 6.25% 10/30/26	1,550,000.00	1,619,067.38	
	イスラエルシェケル 小計		15,810,000.00	14,074,973.07 (591,060,196)	
	オフショア人民元	CGB 1.85% 05/15/27	25,000,000.00	25,102,985.00	
		CGB 1.99% 03/15/26	4,400,000.00	4,435,973.08	
		CGB 2.12% 06/25/31	9,500,000.00	9,562,137.60	
		CGB 2.18% 08/15/26	23,000,000.00	23,282,863.20	
		CGB 2.18% 08/25/25	14,360,000.00	14,466,691.92	
		CGB 2.22% 09/25/25	12,250,000.00	12,355,395.32	
		CGB 2.27% 05/25/34	8,550,000.00	8,573,085.00	
		CGB 2.28% 11/25/25	23,020,000.00	23,263,296.07	

		CGB 2.3% 05/15/26	12,000,000.00	12,153,758.40	
		CGB 2.33% 12/15/25	16,300,000.00	16,485,428.80	
		CGB 2.35% 02/25/34	12,500,000.00	12,572,570.00	
		CGB 2.37% 01/15/29	29,300,000.00	29,896,589.02	
		CGB 2.37% 01/20/27	19,900,000.00	20,221,508.38	
		CGB 2.39% 11/15/26	14,500,000.00	14,743,146.15	
		CGB 2.4% 07/15/28	17,600,000.00	17,946,899.52	
		CGB 2.44% 10/15/27	7,000,000.00	7,133,984.20	
		CGB 2.46% 02/15/26	3,200,000.00	3,244,855.68	
		CGB 2.48% 04/15/27	16,380,000.00	16,699,508.28	
		CGB 2.48% 09/25/28	10,800,000.00	11,049,973.56	
		CGB 2.5% 07/25/27	26,400,000.00	26,971,000.32	
		CGB 2.52% 08/25/33	20,700,000.00	21,160,599.84	
		CGB 2.54% 12/25/30	23,400,000.00	24,161,492.16	
		CGB 2.55% 10/15/28	13,800,000.00	14,168,003.22	
		CGB 2.6% 09/01/32	14,750,000.00	15,254,534.07	
		CGB 2.6% 09/15/30	12,500,000.00	12,929,372.50	
		CGB 2.62% 06/25/30	13,000,000.00	13,450,702.20	
		CGB 2.62% 09/25/29	20,000,000.00	20,656,996.00	
		CGB 2.67% 05/25/33	19,900,000.00	20,673,425.44	
		CGB 2.67% 11/25/33	12,000,000.00	12,402,152.40	
		CGB 2.68% 05/21/30	21,550,000.00	22,364,415.44	
		CGB 2.69% 08/12/26	28,920,000.00	29,581,062.03	
		CGB 2.69% 08/15/32	12,700,000.00	13,221,956.03	
		CGB 2.75% 06/15/29	17,630,000.00	18,315,426.19	
		CGB 2.79% 12/15/29	9,740,000.00	10,145,926.18	
		CGB 2.8% 03/24/29	29,320,000.00	30,482,936.75	
		CGB 2.8% 03/25/30	19,000,000.00	19,838,293.30	
		CGB 2.8% 11/15/32	6,000,000.00	6,297,866.40	
		CGB 2.85% 06/04/27	11,760,000.00	12,131,126.78	
		CGB 2.88% 02/25/33	5,100,000.00	5,387,168.25	
		CGB 2.89% 11/18/31	22,500,000.00	23,813,399.25	
		CGB 2.91% 10/14/28	20,300,000.00	21,148,761.27	
		CGB 3.01% 05/13/28	15,960,000.00	16,656,457.69	
		CGB 3.02% 05/27/31	13,850,000.00	14,745,248.76	
		CGB 3.02% 10/22/25	30,000,000.00	30,584,655.00	
		CGB 3.03% 03/11/26	22,150,000.00	22,703,792.08	
		CGB 3.12% 10/25/52	8,200,000.00	9,284,788.66	
		CGB 3.19% 04/15/53	4,600,000.00	5,271,178.64	
		CGB 3.27% 11/19/30	5,930,000.00	6,407,011.57	
		CGB 3.28% 12/03/27	11,140,000.00	11,706,672.86	
		CGB 3.32% 04/15/52	7,220,000.00	8,451,566.65	
		CGB 3.39% 03/16/50	11,760,000.00	13,812,649.20	

		CGB 3.53% 10/18/51	6,510,000.00	7,876,885.17	
		CGB 3.72% 04/12/51	6,850,000.00	8,525,384.64	
		CGB 3.81% 09/14/50	8,230,000.00	10,352,479.96	
		CGB 3.86% 07/22/49	5,810,000.00	7,344,979.92	
		CGB 3% 10/15/53	14,900,000.00	16,657,751.50	
		CGB 4.08% 10/22/48	8,080,000.00	10,476,864.93	
	オフショア人民元 小計		841,720,000.00	878,605,632.43 (18,533,395,071)	
合計				181,696,518,510 (181,696,518,510)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券　200銘柄	100.0%	47.0%
カナダドル	国債証券　36銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券　14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券　360銘柄	100.0%	30.9%
イギリスポンド	国債証券　60銘柄	100.0%	5.3%
スウェーデンクローナ	国債証券　7銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券　10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券　13銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券　26銘柄	100.0%	1.3%
ニュージーランドドル	国債証券　14銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券　21銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券　27銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券　14銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券　57銘柄	100.0%	10.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

２【ファンドの現況】

【インデックスコレクション（バランス株式３０）】

【純資産額計算書】

（2024年 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	167,149,206,691円
Ⅱ　負債総額	144,360,453円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	167,004,846,238円
Ⅳ　発行済口数	86,885,124,237口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9221円
（1万口当たり純資産額）	（19,221円）

【インデックスコレクション（バランス株式５０）】

【純資産額計算書】

（2024年 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	38,446,924,473円
Ⅱ　負債総額	36,061,288円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	38,410,863,185円
Ⅳ　発行済口数	14,190,349,364口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7068円
（1万口当たり純資産額）	（27,068円）

【インデックスコレクション（バランス株式７０）】

【純資産額計算書】

（2024年 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	30,508,542,371円
Ⅱ　負債総額	42,473,978円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	30,466,068,393円
Ⅳ　発行済口数	8,339,506,653口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.6532円
（1万口当たり純資産額）	（36,532円）

（参考）

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

（2024年 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	426,714,212,252円
Ⅱ　負債総額	278,822,976円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	426,435,389,276円
Ⅳ　発行済口数	130,329,781,090口

Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.2720円
（1万口当たり純資産額）	（32,720円）

日本債券マザーファンド

純資産額計算書

（2024年 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	419,612,152,446円
Ⅱ　負債総額	10,223,250,971円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	409,388,901,475円
Ⅳ　発行済口数	318,339,924,606口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2860円
（1万口当たり純資産額）	（12,860円）

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

（2024年 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	549,267,573,818円
Ⅱ　負債総額	412,326,004円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	548,855,247,814円
Ⅳ　発行済口数	79,489,810,083口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	6.9047円
（1万口当たり純資産額）	（69,047円）

外国債券マザーファンド

純資産額計算書

（2024年 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	181,787,475,571円
Ⅱ　負債総額	78,197,326円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	181,709,278,245円
Ⅳ　発行済口数	59,679,344,595口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.0448円
（1万口当たり純資産額）	（30,448円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

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

②受益権の譲渡

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

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

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

③受益権の譲渡の対抗要件

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

④受益権の再分割

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

⑤償還金

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

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2024年 8月30日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

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

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

［DO（実行）］

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

［CHECK（検証・評価）］

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

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

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

委託会社の機構は2024年10月25日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年 8月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	530	15,487,993
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	60	209,161
単位型公社債投資信託	52	173,949
合計	642	15,871,103

3【委託会社等の経理状況】

(1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
なお、財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自　2023年4月1日　至　2024年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

		前事業年度 （2023年3月31日）		当事業年度 （2024年3月31日）
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		23,067		14,909
金銭の信託		14,693		18,596
前払費用		198		429
未収委託者報酬		9,147		10,943
未収運用受託報酬		5,815		5,967
未収収益		176		185
短期差入証拠金		3,541		3,660
その他		1,566		4,074
流動資産合計		58,207		58,767
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	255	※1	219
器具備品	※1	560	※1	436
有形固定資産合計		816		655
無形固定資産				
ソフトウェア		7,203		7,463
その他		40		61
無形固定資産合計		7,244		7,524
投資その他の資産				
投資有価証券		4,063		5,753
関係会社株式		5,636		6,077
繰延税金資産		1,181		1,196
その他		31		31
投資その他の資産合計		10,911		13,058
固定資産合計		18,972		21,238
資産合計		77,179		80,005

（単位：百万円）

	前事業年度 （2023年3月31日）	当事業年度 （2024年3月31日）
負債の部		
流動負債		

預り金	49	86
未払金	7,174	8,475
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,586	5,524
その他未払金	2,588	2,951
未払費用	1,089	797
未払法人税等	726	694
賞与引当金	613	719
その他	303	957
流動負債合計	9,958	11,730
固定負債		
退職給付引当金	904	975
資産除去債務	153	154
その他	27	42
固定負債合計	1,086	1,171
負債合計	11,044	12,902
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	44,755	45,974
利益剰余金合計	47,355	48,574
株主資本合計	66,595	67,813
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	49	360
繰延ヘッジ損益	△510	△1,071
評価・換算差額等合計	△460	△710
純資産合計	66,134	67,103
負債・純資産合計	77,179	80,005

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	当事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	40,724	44,551
運用受託報酬	10,918	11,077

その他営業収益	351	356
営業収益合計	51,993	55,985
営業費用		
支払手数料	20,123	22,341
広告宣伝費	307	342
公告費	2	0
調査費	5,309	5,796
調査費	1,104	1,172
委託調査費	4,191	4,610
図書費	13	14
営業雑経費	5,842	5,887
通信費	77	78
印刷費	419	439
協会費	58	56
諸会費	38	29
情報機器関連費	5,153	5,193
その他営業雑経費	94	89
営業費用合計	31,585	34,369
一般管理費		
給料	6,451	6,981
役員報酬	318	385
給料・手当	5,144	5,432
賞与	987	1,163
退職給付費用	252	278
福利費	671	747
交際費	7	13
旅費交通費	122	191
租税公課	289	276
不動産賃借料	327	328
寄付金	－	0
減価償却費	1,698	2,239
業務委託費	1,277	1,544
諸経費	1,454	1,637
一般管理費合計	12,553	14,239
営業利益	7,854	7,376

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	当事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）
営業外収益		
受取利息	57	138
収益分配金	4	0
金銭の信託運用益	－	4,007
投資有価証券売却益	738	1
投資有価証券償還益	121	1
デリバティブ利益	565	－

その他	11	12
営業外収益合計	1,499	4,162
営業外費用		
金銭の信託運用損	158	－
投資有価証券売却損	16	33
投資有価証券償還損	－	1
為替差損	1,227	1,273
デリバティブ費用	－	3,613
その他	32	3
営業外費用合計	1,435	4,925
経常利益	7,918	6,613
税引前当期純利益	7,918	6,613
法人税、住民税及び事業税	2,350	1,931
法人税等調整額	119	95
法人税等合計	2,470	2,027
当期純利益	5,448	4,585

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2022年4月1日　至　2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
剰余金の配当			△2,641	△2,641	△2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	－	－	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	941	△509	431	64,219
当期変動額				
剰余金の配当				△2,641
当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△891	△0	△891	△891
当期変動額合計	△891	△0	△891	1,915
当期末残高	49	△510	△460	66,134

当事業年度（自　2023年4月1日　至　2024年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当期変動額					
剰余金の配当			△3,367	△3,367	△3,367
当期純利益			4,585	4,585	4,585
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	－	－	1,218	1,218	1,218
当期末残高	500	2,100	45,974	48,574	67,813

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	49	△510	△460	66,134
当期変動額				
剰余金の配当				△3,367
当期純利益				4,585
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	310	△560	△250	△250
当期変動額合計	310	△560	△250	968
当期末残高	360	△1,071	△710	67,103

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

２．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

３．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

４．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

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

５．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

６．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

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

（2）退職給付引当金

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

過去勤務費用　　：発生事業年度に損益処理

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

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

７．収益及び費用の計上基準

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

(1) 投資信託委託業務
当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。
(2) 投資一任業務
当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。
(3) 投資助言業務
当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。
(4) 成功報酬
当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

８．ヘッジ会計の会計処理
(1) ヘッジ会計の方法
繰延ヘッジ処理によっております。
(2) ヘッジ手段とヘッジ対象
ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。
(3) ヘッジ方針
自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。
(4) ヘッジ有効性評価の方法
ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

９．グループ通算制度の適用
グループ通算制度を適用しております。

（貸借対照表関係）

※1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024年3月31日)	
建　　物	184	百万円	220	百万円
器具備品	681	〃	823	〃
計	866	〃	1,044	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2022年4月1日　至 2023年3月31日）

１．発行済株式に関する事項

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

２．自己株式に関する事項
該当事項はありません。

３.配当に関する事項
(1) 配当金支払額

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

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

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

当事業年度（自 2023年4月1日　至 2024年3月31日）

１．発行済株式に関する事項

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

２．自己株式に関する事項
該当事項はありません。

３.配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

（2）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2024年6月20日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	利益剰余金	981,032	2024年3月31日	2024年6月21日

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク
未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。
金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針８．ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。
未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理
営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。
デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理
有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理
当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明
金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

２．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項
貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31 号 2021年6月17日）第24-16 項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（（1）*2、*3及び（注2）参照）。

また、金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。
レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価
レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

（１）時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2023年3月31日）

区　分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	－	13,733
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	－	3,844	－	3,844
資産計	1,029	16,547	－	17,577
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(10)	－	－	(10)
通貨関連取引	－	(136)	－	(136)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	－	(147)

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額960百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,693百万円であります。
(*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額218百万円）は上記に含めておりません。
(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2024年3月31日）

区　分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,530	16,048	－	17,579
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	－	4,517	－	4,517
資産計	1,530	20,565	－	22,096
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(268)	(262)	－	(530)
通貨関連取引	－	21	－	21
デリバティブ取引計	(268)	(241)	－	(509)

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額1,017百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は18,596百万円であります。
(*3) 投資有価証券のうち、非上場株式（貸借対照表計上額876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額359百万円）は上記に含めておりません。
(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

（２）時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位:百万円）

区分	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
投資有価証券	0	876
関係会社株式	5,636	6,077

（注3） 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2023年3月31日）

（単位:百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,067	－	－	－
未収委託者報酬	9,147	－	－	－
未収運用受託報酬	5,815	－	－	－
投資有価証券				
投資信託	－	594	2,144	38

当事業年度（2024年3月31日）

（単位:百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	14,909	－	－	－
未収委託者報酬	10,943	－	－	－
未収運用受託報酬	5,967	－	－	－
投資有価証券				
投資信託	－	1,829	807	－

（有価証券関係）

１．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位:百万円）

区分	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
子会社株式	5,636	6,077

２．その他有価証券

前事業年度（2023年3月31日）

（単位:百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	△292
小計	2,857	3,150	△292
合計	3,844	3,772	71

当事業年度（2024年3月31日）

（単位: 百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	3,394	2,593	800
小計	3,394	2,593	800
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,123	1,410	△287
小計	1,123	1,410	△287
合計	4,517	4,004	513

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

ん。
なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位:百万円）

区分	前事業年度 （2023年3月31日）	当事業年度 （2024年3月31日）
非上場株式	0	876
組合出資金等	218	359

3．事業年度中に売却したその他有価証券
前事業年度（自　2022年4月1日　至　2023年3月31日）

（単位:百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	3,429	738	16

当事業年度（自　2023年4月1日　至　2024年3月31日）

（単位:百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	185	1	33

（デリバティブ取引関係）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
(1) 通貨関連
前事業年度（2023年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
店頭	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	5,923	－	△21	△21
	英ポンド	256	－	△6	△6
	カナダドル	109	－	△1	△1
	スイスフラン	163	－	△2	△2
	香港ドル	202	－	△0	△0
	ユーロ	651	－	△19	△19
	買建				
	米ドル	152	－	3	3
合計		7,458	－	△48	△48

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2024年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
店頭	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	6,735	－	4	4
	英ポンド	288	－	0	0
	カナダドル	145	－	△0	△0
	スイスフラン	180	－	0	0
	香港ドル	217	－	0	0
	ユーロ	664	－	3	3
合計		8,231	－	10	10

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連
前事業年度（2023年3月31日）

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)

市場取引	株価指数先物取引 売建 債券先物取引 売建	12,195 182	－ －	△9 △0	△9 △0
合計		12,378	－	△10	△10

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2024年3月31日）

種類		契約額等 （百万円）	契約額等の うち1年超 （百万円）	時価 （百万円）	評価損益 （百万円）
市場取引	株価指数先物取引 売建	10,306	－	△268	△268
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	4,184	－	△262	△262
合計		14,490	－	△530	△530

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

前事業年度（2023年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 （百万円）	契約額等の うち1年超 （百万円）	時価 （百万円）
原則的 処理方法	為替予約取引 売建 米ドル 英ポンド スイスフラン 香港ドル ユーロ	投資有価証券 関係会社株式	 1,729 3,228 20 83 21	 － － － － －	 △6 △81 △0 △0 △0
合計			5,082	－	△88

当事業年度（2024年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 （百万円）	契約額等の うち1年超 （百万円）	時価 （百万円）
原則的 処理方法	為替予約取引 売建 米ドル 英ポンド スイスフラン 香港ドル ユーロ シンガポールドル	投資有価証券 関係会社株式	 2,126 4,586 28 83 63 448	 － － － － － －	 1 7 0 0 0 1
合計			7,337	－	10

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2．確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	当事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）
退職給付債務の期首残高	820	911
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理計算上の差異の発生額	6	11
退職給付の支払額	△57	△85
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
退職給付債務の期末残高	911	993

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

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

（単位：百万円）

	前事業年度 （2023年3月31日）	当事業年度 （2024年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	911	993
未認識数理計算上の差異	△6	△17
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975
退職給付引当金	904	975
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	当事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理差異償却	―	0
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
確定給付制度に係る退職給付費用	142	155

(5) 年金資産に関する事項

該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	当事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）
割引率	0.4%	0.4%

3．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度109百万円、当事業年度122百万円であります。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 （2023年3月31日）		当事業年度 （2024年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	58	百万円	63	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	187	〃	220	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	277	〃	298	〃
税務上の費用認識差額	412	〃	256	〃
繰延ヘッジ損益	225	〃	472	〃
その他	75	〃	78	〃
繰延税金資産 合計	1,236	〃	1,390	〃
繰延税金負債				

有価証券評価差額	△21	〃	△159	〃
その他	△32	〃	△35	〃
繰延税金負債 合計	△54	〃	△194	〃
繰延税金資産の純額	1,181	〃	1,196	〃

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

３．法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理
当社は、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号　2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（収益認識関係）

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

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

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

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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

［関連情報］

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

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

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

３．主要な顧客ごとの情報
前事業年度（自 2022年4月1日　至 2023年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887百万円

当事業年度（自 2023年4月1日　至 2024年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,223百万円

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
２．取引条件及び取引条件の決定方針等
① 運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。
② 投信販売代行手数料等
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,926	未収運用受託報酬	5,520
							投信販売代行手数料等	10,187	未払手数料	2,482

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
２．取引条件及び取引条件の決定方針等
① 運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。
② 投信販売代行手数料等
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
該当事項はありません。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記
（1）親会社情報
前事業年度（2023年3月31日）
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2024年3月31日）
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

	前事業年度 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
1株当たり純資産額	22,044,962円63銭	22,367,677円92銭
1株当たり当期純利益金額	1,816,227円49銭	1,528,527円02銭

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

	前事業年度 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2024年10月25日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2024年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円）（2024年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

①名称　　：株式会社日本カストディ銀行
②設立年月日　：2000年6月20日
③資本金の額　：51,000百万円（2024年3月末日現在）
④事業の内容　：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2023年10月25日	有価証券届出書
2023年10月25日	有価証券報告書
2024年 4月25日	有価証券届出書
2024年 4月25日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2024年６月３日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　三　上　和　彦

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　田　中　洋　一

監査意見
　当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年４月１日から2024年３月31日までの第38期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

　当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2024年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
　その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

　当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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

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

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

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

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

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

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

２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年10月7日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　中島紀子

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式３０）の2023年7月26日から2024年7月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスコレクション（バランス株式３０）の2024年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年10月7日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　中島紀子

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式５０）の2023年7月26日から2024年7月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスコレクション（バランス株式５０）の2024年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年10月7日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　中島紀子

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式７０）の2023年7月26日から2024年7月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスコレクション（バランス株式７０）の2024年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。