

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2025年3月10日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	北添 道生
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	グローバル・インデックス・バランス・ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

グローバル・インデックス・バランス・ファンド

ただし、愛称として“投資生活”という名称を用いることがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。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「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1口単位です。

### （７）【申込期間】

2025年 3月11日から2025年 9月10日までとします。

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

### （８）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（ 9 ）【払込期日】

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

（ 10 ）【払込取扱場所】

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

（ 11 ）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ）【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、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。

< 申込みコース >

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、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。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所）で金融商品取引所が有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### <ファンドの目的>

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

###### <信託金限度額>

上限 1兆円

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

(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  
一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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



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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

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

#### [ 特殊型 ]

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

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

#### < ファンドの特色 >

## ● 国内外の株式及び外国の公社債に分散投資します。

日本株式マザーファンド、外国株式マザーファンド、外国債券マザーファンド（以下これらを「マザーファンド」といいます。）の各受益証券への投資を通じて、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資します。

各マザーファンドは、それぞれの資産の市場全体の動きと連動することを旨とするインデックス運用を行います。実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

### <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。
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。

## ● 3つの資産への均等配分を基本配分比率とします。

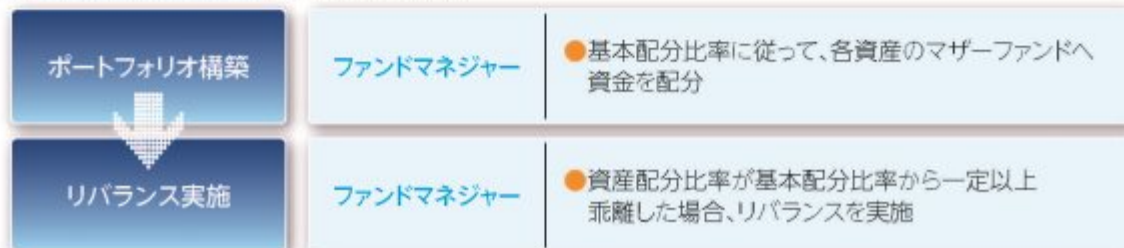
### 基本配分比率



基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設け、一定以上乖離した場合には、リバランスを行います。また、市況動向等の変化に応じて、当該基本配分比率の見直しを行う場合があります。

### ポートフォリオ構築プロセス

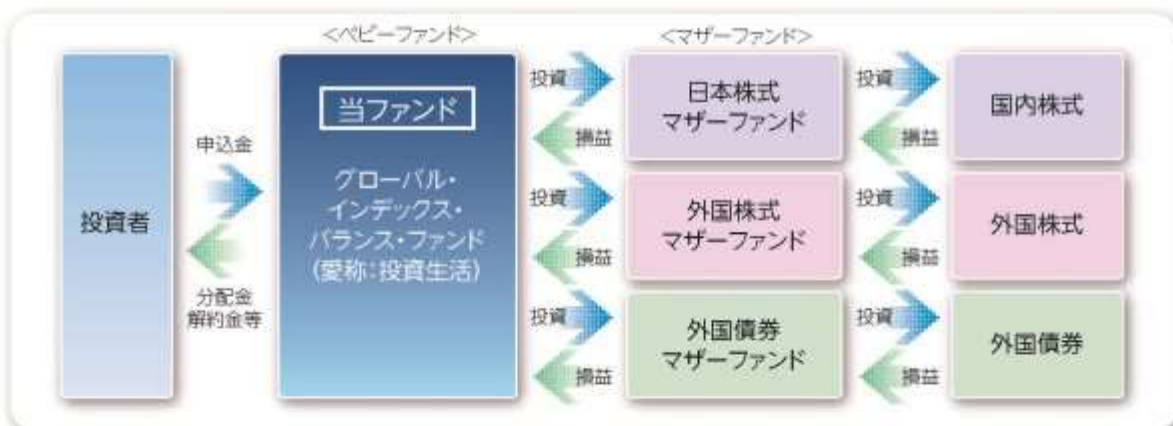
ファンドマネジャーは基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

## ● ファンドの仕組み

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ペーパーファンドとし、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。



## ● 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、信託財産の純資産総額の75%以下とします。
- 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、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

## ● 分配方針

年1回、毎決算時(決算日は6月10日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。)に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。

ただし、分配を行わないことがあります。

分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた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。

※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。

### ◆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に係る商標又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る商標又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、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。

#### 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。

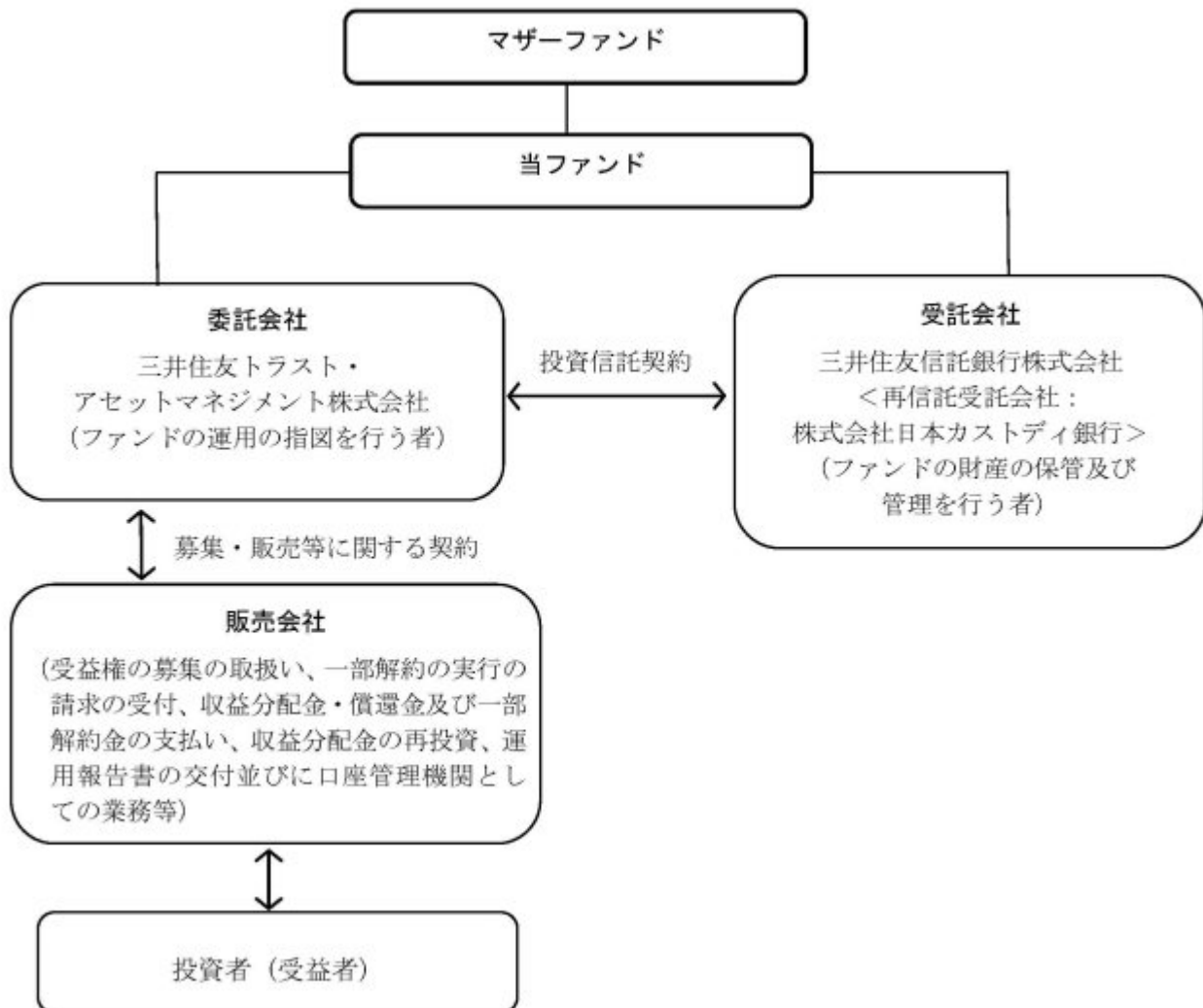
## (2) 【ファンドの沿革】

- |            |   |
|------------|---|
| 2008年3月3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                                      |
| 2010年9月11日 | ファンドの名称を「ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド」から、「グローバル・インデックス・バランス・ファンド」に変更 |

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  
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、中央三井外国株式マザーファンドの名称を外国株式マザーファンド、中央三井外国債券マザーファンドの名称を外国債券マザーファンドに変更

### (3)【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2024年12月30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

#### 八．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】

#### 運用方針

当ファンドは、日本株式マザーファンド、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を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

従って当ファンドでは、基本的に各マザーファンドを通じて、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資することになります。このほか、国内外の株式や外国の公社債等に直接投資することもあります。

#### 投資態度

- A．主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- B．各資産への配分は、3つの資産への均等配分を基本とします。
- C．上記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、一定以上乖離した場合にはリバランスを行います。また、市況動向等の変化に応じて、当該基本配分比率の見直しを行う場合があります。
- 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。
- E．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．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- G．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。
- H．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、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。
- I．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（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。

J. 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。

## (2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記（5）投資制限＜約款に定める投資制限＞J.、K.及びL.に定めるものに限りません。）
3. 金銭債権（上記1.、2.及び下記4.に掲げるものに該当するものを除きます。）
4. 約束手形（上記1.に掲げるものに該当するものを除きます。）

B. 次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

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

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

17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
  19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  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.の証券又は証券並びに上記12.及び17.の証券又は証券のうち上記1.の証券又は証券の性質を有するものを以下「株式」といい、上記2.から6.までの証券並びに上記12.及び17.の証券又は証券のうち上記2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記13.の証券及び上記14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 運用指図できる金融商品

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で上記5.の権利の性質を有するもの

#### B. 金融商品による運用の特例

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

### (参考)マザーファンドの概要

#### 「日本株式マザーファンド」の概要

##### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

##### 2. 運用方法

###### (1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

###### (2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

### 3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

### 「外国株式マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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



様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

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

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

### 3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

## 「外国債券マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

## （２）投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

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

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

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

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

## ３．投資制限

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

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

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

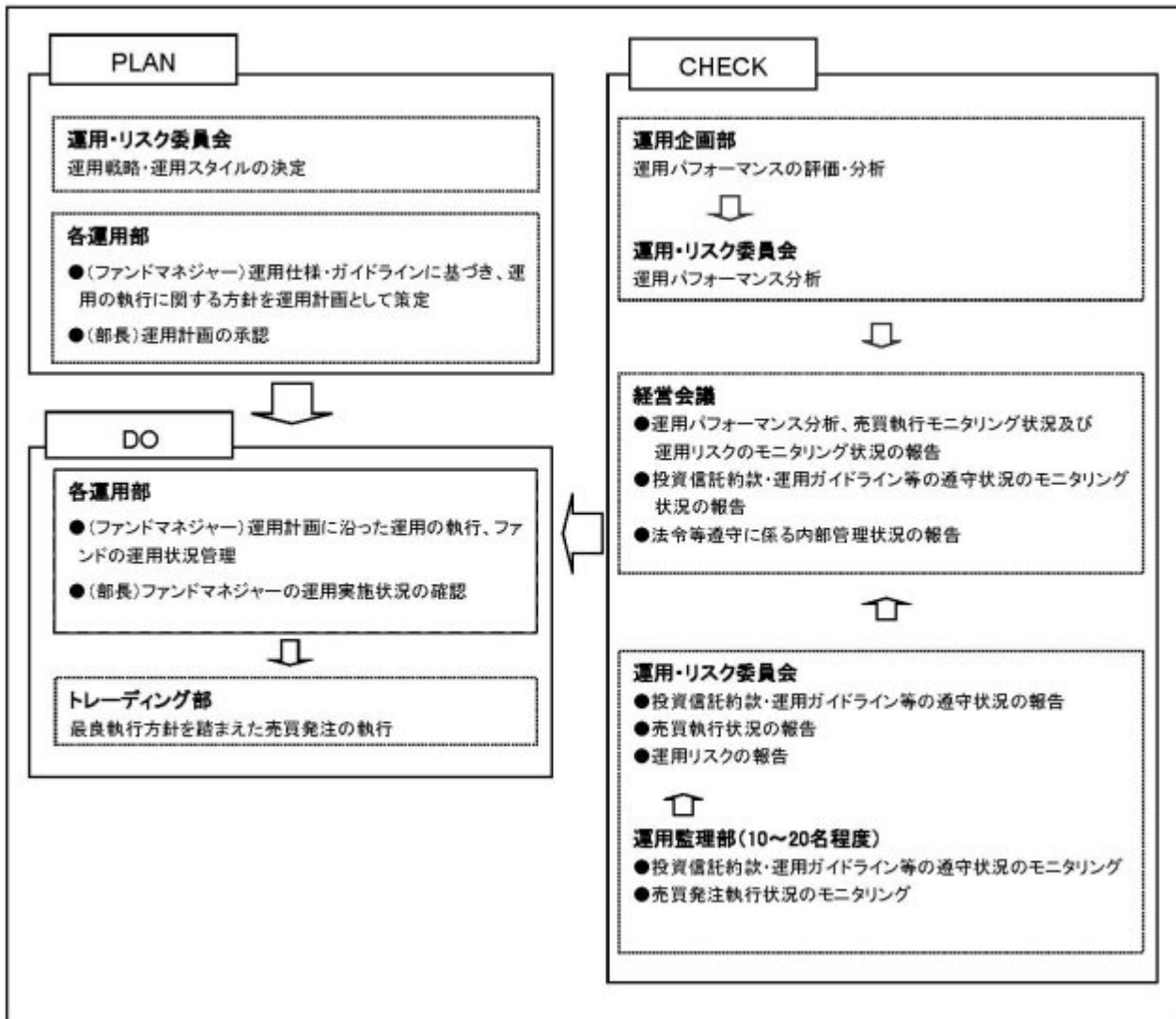
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## （３）【運用体制】

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



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

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

#### (4) 【分配方針】

- ・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた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。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

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 >

#### A．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

#### 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、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

#### 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、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債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て、ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

#### I．信用取引の指図範囲

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

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

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

#### J．先物取引等の運用指図

イ．委託会社は、信託財産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、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。）。

- ．委託会社は、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、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、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、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。
- ．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の指図をすることができます。
- ．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。
- ．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られたときは、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

委託会社は、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係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、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。

#### 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、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

U．受託会社による資金の立替え

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

ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日まで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、受託会社がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託会社又は受託会社の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託会社の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

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

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

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### 為替変動リスク

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

##### 金利変動リスク

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

##### 信用リスク

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

##### 有価証券の貸付等に係るリスク

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

##### 流動性リスク

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

##### カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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



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

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

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

ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要性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。

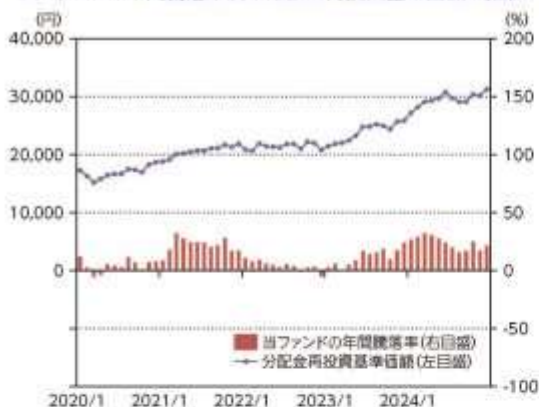
## （２）リスクの管理体制

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】

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。

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



\*2020年1月～2024年12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、日本の株式市場を正確に把握するとともに、投資対象としての信頼性を有するマーケットベンチマークとして、時価総額ベースの時価総額加重方式により算出されます。 配当込み 指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。 同指数の指数値及び 同指数に係る権利又は債権は、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。)の固有財産であり、指数の算出、数値値の公表、利用及び資料等に関するすべての権利・ノウハウ及び 同指数に係る権利又は債権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過程、選定又は中絶に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、管理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 同指数に関する権利を 同指数に対して、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主体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された 同債券ポートフォリオのパフォーマンスを算出して算出されます。 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 同スポンサーではなく、本ファンドの 同推進、販売あるいは 同提供を行っておりません。このインデックスのデータは、 同提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、 同データの正確性及び完全性を保証せず。またデータの 同提供、 同選定又は 同選定につき 同責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JFストラテジック・アセット・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・デベロップメント・インデックス	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づいて作成されていますが、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 同研究を 同提供して使用しています。J.P. Morganからの 同提供による 同承諾なしに本指数を複製・使用・ 同提供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>

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.2%の率を乗じて得た額を信託財産留保

額（ ）として当該基準価額から控除します。また、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せん。

### （３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

イ．当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に以下の率を乗じて得た額（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。

合計		100億円以下の部分	100億円超の部分	主な役務
		年率0.66% (税抜0.6%) ( )	年率0.55% (税抜0.5%)	
配分	委託会社	年率0.33% (税抜0.3%)	年率0.275% (税抜0.25%)	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0.275% (税抜0.25%)	年率0.22% (税抜0.2%)	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0.055% (税抜0.05%)	年率0.055% (税抜0.05%)	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

2025年3月10日現在、合計で49.5%（税抜45%）以内とし、その配分は委託会社29.7%（税抜27%）、受託会社19.8%（税抜18%）です。（品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

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

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

### （４）【その他の手数料等】

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

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

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（原則として配当控除の適用が可能です。）のいずれかを選択することもできます。

	税 率（内 訳）
2037年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
2038年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り、）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税率（所得税のみ）
2037年12月31日まで	15.315%
2038年1月1日以降	15%

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### 個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」についてをご参照ください。）

#### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2024年12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
0.68%	0.66%	0.02%

※対象期間は2023年6月13日～2024年6月10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12月30日現在の状況について記載してあります。

## 【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

## (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	5,011,824,620	99.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		17,499,908	0.35
合計(純資産総額)		5,029,324,528	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	218,730,299	7.1185	1,557,031,634	7.8645	1,720,204,436	34.20
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	485,862,049	3.2875	1,597,271,487	3.3973	1,650,619,139	32.82
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	511,151,584	3.1421	1,606,089,393	3.2104	1,641,001,045	32.63

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.65
合計	99.65

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3)【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額(円)	1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)
第8期計算期間末 (2015年 6月10日)	3,184,301,741	3,188,483,833	15,228
第9期計算期間末 (2016年 6月10日)	2,877,411,328	2,877,411,328	13,131
第10期計算期間末 (2017年 6月12日)	3,275,045,188	3,275,045,188	14,905

第11期計算期間末	(2018年 6月11日)	3,448,836,583	3,448,836,583	16,204	16,204
第12期計算期間末	(2019年 6月10日)	3,163,412,591	3,163,412,591	15,823	15,823
第13期計算期間末	(2020年 6月10日)	3,240,366,584	3,240,366,584	17,000	17,000
第14期計算期間末	(2021年 6月10日)	3,676,026,407	3,676,026,407	20,530	20,530
第15期計算期間末	(2022年 6月10日)	3,867,088,369	3,867,088,369	21,589	21,589
第16期計算期間末	(2023年 6月12日)	4,249,557,428	4,249,557,428	23,676	23,676
第17期計算期間末	(2024年 6月10日)	4,963,243,354	4,963,243,354	29,807	29,807
	2023年12月末日	4,423,136,222		25,717	
	2024年 1月末日	4,595,780,252		27,043	
	2月末日	4,712,779,586		28,033	
	3月末日	4,822,531,364		28,944	
	4月末日	4,857,970,183		29,154	
	5月末日	4,908,550,703		29,532	
	6月末日	5,088,327,510		30,605	
	7月末日	4,899,821,253		29,581	
	8月末日	4,793,838,339		28,975	
	9月末日	4,770,554,327		28,946	
	10月末日	4,930,225,972		30,239	
	11月末日	4,892,586,601		30,033	
	12月末日	5,029,324,528		31,129	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第8期計算期間	2014年 6月11日～2015年 6月10日	20
第9期計算期間	2015年 6月11日～2016年 6月10日	0
第10期計算期間	2016年 6月11日～2017年 6月12日	0
第11期計算期間	2017年 6月13日～2018年 6月11日	0
第12期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	0
第13期計算期間	2019年 6月11日～2020年 6月10日	0
第14期計算期間	2020年 6月11日～2021年 6月10日	0
第15期計算期間	2021年 6月11日～2022年 6月10日	0
第16期計算期間	2022年 6月11日～2023年 6月12日	0
第17期計算期間	2023年 6月13日～2024年 6月10日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第8期計算期間	2014年 6月11日～2015年 6月10日	23.6
第9期計算期間	2015年 6月11日～2016年 6月10日	13.8
第10期計算期間	2016年 6月11日～2017年 6月12日	13.5
第11期計算期間	2017年 6月13日～2018年 6月11日	8.7
第12期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	2.4
第13期計算期間	2019年 6月11日～2020年 6月10日	7.4
第14期計算期間	2020年 6月11日～2021年 6月10日	20.8

第15期計算期間	2021年 6月11日～2022年 6月10日	5.2
第16期計算期間	2022年 6月11日～2023年 6月12日	9.7
第17期計算期間	2023年 6月13日～2024年 6月10日	25.9
第18期中間計算期間	2024年 6月11日～2024年12月10日	2.4

(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8期計算期間	2014年 6月11日～2015年 6月10日	355,749,941	290,314,770	2,091,046,497
第9期計算期間	2015年 6月11日～2016年 6月10日	331,285,768	230,971,419	2,191,360,846
第10期計算期間	2016年 6月11日～2017年 6月12日	259,687,608	253,825,441	2,197,223,013
第11期計算期間	2017年 6月13日～2018年 6月11日	217,108,019	285,901,685	2,128,429,347
第12期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	164,740,715	293,882,676	1,999,287,386
第13期計算期間	2019年 6月11日～2020年 6月10日	138,119,120	231,301,778	1,906,104,728
第14期計算期間	2020年 6月11日～2021年 6月10日	106,278,424	221,795,479	1,790,587,673
第15期計算期間	2021年 6月11日～2022年 6月10日	83,743,586	83,139,097	1,791,192,162
第16期計算期間	2022年 6月11日～2023年 6月12日	76,767,682	73,076,833	1,794,883,011
第17期計算期間	2023年 6月13日～2024年 6月10日	55,465,033	185,196,401	1,665,151,643
第18期中間計算期間	2024年 6月11日～2024年12月10日	21,356,956	57,443,604	1,629,064,995

(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	427,255,190,940	98.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,162,605,878	1.42
合計(純資産総額)		433,417,796,818	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	5,851,650,000	1.35

(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	5,710,100	2,967.35	16,943,865,235	3,146.00	17,963,974,600	4.14
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	3,761,600	2,938.59	11,053,800,144	3,369.00	12,672,830,400	2.92
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,789,000	1,330.67	9,033,918,630	1,846.00	12,532,494,000	2.89
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,793,700	2,424.08	6,772,152,296	3,937.00	10,998,796,900	2.54
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	861,500	6,427.82	5,537,566,930	11,145.00	9,601,417,500	2.22
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2,207,000	2,477.50	5,467,842,500	3,764.00	8,307,148,000	1.92
日本	株式	キーエンス	電気機器	107,500	66,596.38	7,159,110,850	64,630.00	6,947,725,000	1.60
日本	株式	任天堂	その他製品	678,200	8,087.50	5,484,942,500	9,264.00	6,282,844,800	1.45
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	764,000	6,651.62	5,081,837,680	7,832.00	5,983,648,000	1.38
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,032,900	3,892.18	4,020,232,722	5,728.00	5,916,451,200	1.37
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,428,000	2,597.13	3,708,701,640	3,873.00	5,530,644,000	1.28
日本	株式	三井物産	卸売業	1,668,800	2,985.21	4,981,718,448	3,311.00	5,525,396,800	1.27
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	227,300	28,647.23	6,511,515,379	24,185.00	5,497,250,500	1.27
日本	株式	三菱商事	卸売業	2,099,200	2,612.71	5,484,600,832	2,604.00	5,466,316,800	1.26
日本	株式	信越化学工業	化学	964,900	5,880.04	5,673,650,596	5,296.00	5,110,110,400	1.18
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	32,045,200	189.02	6,057,183,704	158.00	5,063,141,600	1.17
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	531,400	6,780.95	3,603,396,830	9,185.00	4,880,909,000	1.13
日本	株式	第一三共	医薬品	1,016,700	4,480.69	4,555,517,523	4,352.00	4,424,678,400	1.02
日本	株式	三菱重工業	機械	1,897,200	983.64	1,866,161,808	2,223.00	4,217,475,600	0.97
日本	株式	HOYA	精密機器	209,700	18,605.47	3,901,567,059	19,815.00	4,155,205,500	0.96
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	958,600	4,360.78	4,180,243,708	4,181.00	4,007,906,600	0.92
日本	株式	KDDI	情報・通信業	792,400	5,034.07	3,988,997,068	5,042.00	3,995,280,800	0.92
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,545,100	1,604.36	4,083,256,636	1,535.00	3,906,728,500	0.90
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	63,900	39,954.66	2,553,102,774	53,820.00	3,439,098,000	0.79
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	17,236,900	198.25	3,417,215,425	198.90	3,428,419,410	0.79
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	1,255,500	1,942.00	2,438,181,000	2,487.00	3,122,428,500	0.72
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	338,500	6,195.90	2,097,312,150	9,198.00	3,113,523,000	0.72
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,103,500	2,208.73	2,437,333,555	2,687.00	2,965,104,500	0.68
日本	株式	富士通	電気機器	998,300	2,072.29	2,068,767,107	2,799.50	2,794,740,850	0.64
日本	株式	キヤノン	電気機器	535,800	3,787.04	2,029,096,032	5,161.00	2,765,263,800	0.64

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.24
		建設業	2.12

食料品	3.01
繊維製品	0.40
パルプ・紙	0.13
化学	5.07
医薬品	4.28
石油・石炭製品	0.54
ゴム製品	0.56
ガラス・土石製品	0.65
鉄鋼	0.81
非鉄金属	0.82
金属製品	0.48
機械	5.47
電気機器	17.36
輸送用機器	7.78
精密機器	2.37
その他製品	2.62
電気・ガス業	1.23
陸運業	2.21
海運業	0.68
空運業	0.33
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	7.39
卸売業	6.71
小売業	4.53
銀行業	8.43
証券、商品先物取引業	0.87
保険業	3.24
その他金融業	1.19
不動産業	1.76
サービス業	5.07
小計	98.58
合計	98.58

(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	210円		5,787,315,500	5,851,650,000	1.35

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

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

## 外国株式マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	455,449,471,917	72.59
	イギリス	21,382,089,486	3.41
	カナダ	19,581,461,289	3.12
	スイス	15,786,168,826	2.52
	フランス	14,934,233,128	2.38
	ドイツ	13,684,239,810	2.18
	アイルランド	11,199,389,278	1.79
	オーストラリア	10,053,637,017	1.60
	オランダ	9,678,618,571	1.54
	スウェーデン	4,642,629,182	0.74
	デンマーク	4,381,957,620	0.70
	スペイン	3,873,738,733	0.62
	イタリア	3,310,642,230	0.53
	香港	2,202,950,644	0.35
	シンガポール	1,837,883,557	0.29
	フィンランド	1,460,014,458	0.23
	イスラエル	1,397,848,863	0.22
	ベルギー	1,109,408,965	0.18
	ケイマン	934,571,088	0.15
	ルクセンブルク	921,602,177	0.15
	ノルウェー	852,907,593	0.14
	ジャージー	830,007,161	0.13
	バミューダ	701,107,327	0.11
	リベリア	533,561,933	0.09
	キュラソー	493,379,997	0.08
	ニュージーランド	440,863,218	0.07
	オーストリア	284,142,565	0.05
パナマ	228,266,097	0.04	
ポルトガル	222,333,655	0.04	
マン島	45,290,341	0.01	
	小計	602,454,416,726	96.03
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	63,363,415	0.01
	香港	36,006,365	0.01
	小計	99,369,780	0.02
投資証券	アメリカ	9,455,023,668	1.51
	オーストラリア	687,850,072	0.11

	フランス	192,386,839	0.03
	シンガポール	154,449,469	0.02
	イギリス	146,399,291	0.02
	香港	99,100,195	0.02
	カナダ	23,564,561	0.00
	ベルギー	22,718,455	0.00
	小計	10,781,492,550	1.72
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		14,050,818,875	2.24
合計(純資産総額)		627,386,097,931	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	11,630,880,492	1.85
	買建	カナダ	359,801,910	0.06
	買建	ドイツ	1,913,145,505	0.30
	買建	イギリス	892,654,455	0.14
	買建	オーストラリア	406,657,250	0.06

(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		2,292,284,804	0.37
	売建		63,216,000	0.01

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

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

#### 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	880,318	30,331.92	26,701,743,090	40,429.22	35,590,575,550	5.67
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,420,170	10,944.40	15,542,918,042	21,672.24	30,778,267,637	4.91
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	408,854	64,200.22	26,248,518,892	68,101.23	27,843,462,498	4.44

アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	546,923	26,864.37	14,692,744,581	35,392.77	19,357,122,681	3.09
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	126,513	72,163.96	9,129,680,002	94,877.94	12,003,293,557	1.91
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	166,472	29,488.24	4,908,966,760	68,279.97	11,366,704,631	1.81
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	339,109	22,868.54	7,754,927,971	30,490.77	10,339,696,830	1.65
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	256,905	19,547.39	5,021,824,618	38,240.01	9,824,051,054	1.57
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	290,164	23,026.26	6,681,392,462	30,693.24	8,906,075,381	1.42
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	164,735	27,864.98	4,590,338,930	38,148.27	6,284,355,357	1.00
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	46,902	112,448.35	5,274,052,872	123,881.83	5,810,305,619	0.93
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	金融サービス	76,865	62,749.87	4,823,268,811	72,210.75	5,550,479,437	0.88
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	96,719	44,125.20	4,267,745,773	50,405.63	4,875,182,979	0.78
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	257,240	16,148.59	4,154,064,886	16,843.00	4,332,694,966	0.69
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	53,460	81,121.96	4,336,780,161	80,670.21	4,312,629,865	0.69
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	47,929	72,886.05	3,493,355,537	84,183.39	4,034,825,987	0.64
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	25,594	113,098.18	2,894,635,015	148,641.74	3,804,336,847	0.61
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	255,397	9,011.96	2,301,627,874	14,498.77	3,702,944,609	0.59
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	136,261	25,190.87	3,432,534,091	26,816.25	3,654,009,777	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	57,715	56,478.62	3,259,663,676	62,142.59	3,586,559,859	0.57
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	24,876	88,276.22	2,195,959,409	143,556.25	3,571,105,499	0.57
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	138,939	25,033.34	3,478,108,567	22,944.00	3,187,817,666	0.51
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	55,344	45,082.88	2,495,067,010	53,536.02	2,962,897,546	0.47
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	101,944	27,417.37	2,795,036,730	28,157.62	2,870,500,597	0.46
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	402,482	5,238.92	2,108,571,643	7,013.70	2,822,888,486	0.45
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	186,690	18,041.22	3,368,115,860	14,059.74	2,624,814,541	0.42
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	23,068	137,437.45	3,170,407,179	112,953.70	2,605,616,136	0.42

アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	96,597	18,429.89	1,780,272,248	26,726.09	2,581,660,386	0.41
ドイツ	株式	SAP SE	ソフトウェア・サービス	60,284	27,589.60	1,663,211,533	39,498.34	2,381,117,929	0.38
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	236,265	9,531.97	2,252,071,253	9,878.34	2,333,906,236	0.37

(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	3.72
		素材	3.09
		資本財	6.74
		商業・専門サービス	1.48
		運輸	1.43
		自動車・自動車部品	2.34
		耐久消費財・アパレル	1.16
		消費者サービス	1.94
		メディア・娯楽	6.91
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.14
		生活必需品流通・小売り	1.80
		食品・飲料・タバコ	2.70
		家庭用品・パーソナル用品	1.44
		ヘルスケア機器・サービス	3.67
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.55
		銀行	5.55
		金融サービス	7.11
		保険	2.92
		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	10.06
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.21		
電気通信サービス	1.09		
公益事業	2.47		
半導体・半導体製造装置	9.21		
不動産管理・開発	0.27		
		小計	96.03
新株予約権証券			
投資信託受益証券			0.02
投資証券			1.72
合計			97.76

(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。

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	244	アメリカドル	74,897,137.4	11,847,229,194	73,529,400	11,630,880,492	1.85
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	11	カナダドル	3,325,231.5	365,010,661	3,277,780	359,801,910	0.06
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	30	スイスフラン	3,510,560	615,576,696	3,471,000	608,639,850	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	161	ユーロ	7,988,305.2	1,317,431,293	7,909,930	1,304,505,655	0.21
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	20	オーストラリアドル	4,160,465	409,805,803	4,128,500	406,657,250	0.06
	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	55	イギリスポンド	4,523,871.25	900,340,856	4,485,250	892,654,455	0.14

(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	11,287,500.00	1,749,309,587	1,782,855,950	0.28
	カナダドル	買建	500,000.00	54,838,500	54,846,300	0.01
	ユーロ	買建	1,800,000.00	290,173,320	296,523,120	0.05
	イギリスポンド	買建	520,000.00	101,659,780	103,312,654	0.02
	スイスフラン	買建	200,000.00	35,061,800	35,066,900	0.01
	オーストラリアドル	買建	200,000.00	19,675,800	19,679,880	0.00
	アメリカドル	売建	400,000.00	63,180,000	63,216,000	0.01

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

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

### 外国債券マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	89,647,965,561	46.13
	中国	21,941,282,206	11.29
	フランス	13,925,691,989	7.17
	イタリア	13,179,552,508	6.78
	ドイツ	11,075,843,857	5.70
	イギリス	9,745,875,915	5.02
	スペイン	8,325,200,482	4.28

カナダ	3,645,345,451	1.88
ベルギー	2,973,514,546	1.53
オランダ	2,516,989,726	1.30
オーストラリア	2,316,475,769	1.19
オーストリア	2,098,974,548	1.08
メキシコ	1,426,758,792	0.73
ポルトガル	1,116,844,830	0.57
ポーランド	1,017,343,573	0.52
マレーシア	972,246,105	0.50
フィンランド	942,494,317	0.48
アイルランド	897,547,122	0.46
シンガポール	735,331,543	0.38
イスラエル	629,755,536	0.32
ニュージーランド	523,016,212	0.27
デンマーク	425,537,552	0.22
スウェーデン	316,069,757	0.16
ノルウェー	291,668,083	0.15
小計	190,687,325,980	98.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	3,641,506,691	1.87
合計(純資産総額)	194,328,832,671	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	585,160,952	0.30
	買建	ドイツ	528,603,233	0.27

(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		1,389,246,030	0.71

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

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



アメリカ	国債証券	T 0.375% 01/31/26	10,690,000	14,666.59	1,567,859,459	15,166.74	1,621,324,848	0.375	2026/1/31	0.83
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,110,000	12,992.38	1,573,377,970	12,881.47	1,559,946,601	1.375	2031/11/15	0.80
アメリカ	国債証券	T 4.125% 02/15/27	9,800,000	16,003.88	1,568,380,458	15,750.64	1,543,563,696	4.125	2027/2/15	0.79
アメリカ	国債証券	T 4.125% 03/31/29	9,000,000	15,945.28	1,435,075,693	15,621.81	1,405,963,781	4.125	2029/3/31	0.72
アメリカ	国債証券	T 4.375% 05/15/34	8,600,000	16,172.04	1,390,795,853	15,525.11	1,335,160,312	4.375	2034/5/15	0.69
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	9,130,000	12,719.27	1,161,270,124	12,804.54	1,169,055,182	0.625	2030/8/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 0.5% 05/31/27	8,100,000	14,448.82	1,170,354,833	14,429.29	1,168,772,553	0.500	2027/5/31	0.60
アメリカ	国債証券	T 4.25% 02/15/54	7,900,000	15,356.74	1,213,182,893	14,383.25	1,136,277,384	4.250	2054/2/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	7,460,000	15,184.35	1,132,752,749	15,093.21	1,125,953,788	3.125	2028/11/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/33	6,900,000	15,413.17	1,063,509,206	15,003.62	1,035,249,784	3.875	2033/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.125% 10/31/26	6,850,000	14,570.16	998,056,635	14,931.94	1,022,838,227	1.125	2026/10/31	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	6,900,000	14,796.62	1,020,967,252	14,746.26	1,017,492,537	2.625	2029/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 4.5% 11/15/33	6,250,000	16,214.53	1,013,408,218	15,694.42	980,901,366	4.500	2033/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.5% 10/31/27	6,750,000	14,136.79	954,233,578	14,199.43	958,461,894	0.500	2027/10/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	7,400,000	12,822.46	948,862,503	12,933.68	957,092,806	0.625	2030/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	6,750,000	14,475.94	977,126,054	14,160.50	955,834,313	2.875	2032/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/29	6,390,000	14,477.79	925,131,298	14,536.49	928,882,024	2.375	2029/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 4.625% 10/15/26	5,800,000	15,764.86	914,361,963	15,895.85	921,959,549	4.625	2026/10/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 3.75% 04/15/26	5,800,000	15,627.38	906,388,083	15,706.77	910,993,222	3.750	2026/4/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/29	6,000,000	14,832.77	889,966,400	14,747.19	884,831,735	2.750	2029/5/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	6,000,000	15,111.75	906,705,059	14,664.39	879,863,890	3.500	2033/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	5,690,000	15,853.83	902,083,357	15,377.75	874,994,141	4.125	2032/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.25% 05/31/28	6,000,000	14,064.73	843,884,125	14,244.54	854,672,488	1.250	2028/5/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/28/29	5,950,000	14,392.97	856,382,024	14,285.01	849,958,296	1.875	2029/2/28	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	6,550,000	12,955.62	848,593,220	12,865.10	842,664,093	1.250	2031/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.75% 04/30/27	5,500,000	14,899.23	819,457,762	15,267.15	839,693,277	2.750	2027/4/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	5,590,000	15,041.33	840,810,693	15,004.54	838,754,176	2.875	2028/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	5,400,000	14,907.22	804,990,382	15,256.33	823,842,222	1.625	2026/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	6,200,000	13,443.44	833,493,669	13,259.93	822,115,834	1.875	2032/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.25% 12/31/26	5,500,000	14,568.00	801,240,397	14,893.94	819,166,949	1.250	2026/12/31	0.42

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.13
合計	98.13

(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	15	アメリカドル	1,604,854.55	253,855,892	1,590,585.9	251,598,877	0.13
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	9	アメリカドル	992,220.55	156,949,447	975,937.5	154,373,794	0.08

アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	10	アメリカドル	1,172,090.5	185,401,275	1,132,812.5	179,188,281	0.09
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	5	ユーロ	536,795.5	88,528,314	534,750	88,190,970	0.05
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	8	ユーロ	950,846.8	156,813,654	941,200	155,222,704	0.08
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	13	ユーロ	1,768,037.3	291,584,711	1,729,260	285,189,559	0.15

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	4,290,000.00	655,795,434	677,219,400	0.35
	カナダドル	買建	450,000.00	48,361,412	49,326,840	0.03
	ユーロ	買建	2,540,000.00	407,916,819	418,333,174	0.22
	イギリスポンド	買建	380,000.00	73,737,122	75,462,870	0.04
	オフショア人民元	買建	7,810,000.00	164,365,507	168,903,746	0.09

(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：2008年3月3日  
作成基準日：2024年12月30日

## 基準価額・純資産の推移



基準価額 31,129円

純資産総額 50.29億円

## 分配の推移

(1万口当たり・税引前)

決算期	分配金
2020年6月	0円
2021年6月	0円
2022年6月	0円
2023年6月	0円
2024年6月	0円
設定来 分配金合計額	60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。

※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。  
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

## 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式 マザーファンド	34.2%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア	-	-	1.9%
		NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体/半導体製造装置	-	-	1.7%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	1.5%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	一般消費財/サービス/流通/小売	-	-	1.1%
日本株式 マザーファンド	32.8%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.4%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	1.0%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.9%
		日立製作所	日本	株式	電気機器	-	-	0.8%
外国債券 マザーファンド	32.6%	T 0.375% 01/31/26	アメリカ	国債	-	0.375%	2026/01/31	0.3%
		T 4.125% 02/15/27	アメリカ	国債	-	4.125%	2027/02/15	0.3%
		T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.3%
		T 4.125% 03/31/29	アメリカ	国債	-	4.125%	2029/03/31	0.2%

※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)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。  
※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】

## &lt; 申込手続 &gt;

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 >

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」（ ）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

「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、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 >

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 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 >

ありません。

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

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

#### < 問い合わせ先 >

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては

では、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、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から、当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（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。

### <受付不可日>

ありません。

### <一部解約受付の中止等>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。

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

### <一部解約の制限>

当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の

一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

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

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式、国内上場投信の評価方法

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。

外国上場株式、外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みません。）の評価方法

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。

公社債等の評価方法

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 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。）

c. 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。

## 外貨建資産等の円換算

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、為替予約の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物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。（2008年 3月 3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6月11日から翌年6月10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2008年3月3日から2008年6月10日までとします。なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

### （5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

#### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・ 受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
- ・ 投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・ やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

## (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

## <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

### (1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

### (2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。



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

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管

理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

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

#### 4【受益者の権利等】

##### (1)収益分配金に対する請求権

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

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

上記の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者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。

上記に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が収益分配金について支払開始日から5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。

##### (2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

##### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

(1)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17期計算期間(2023年6月13日から2024年6月10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【財務諸表】

## 【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第16期 ( 2023年 6月12日現在 )	第17期 ( 2024年 6月10日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	17,254,883	27,408,405
親投資信託受益証券	4,232,527,808	4,941,296,609
未収入金	13,269,778	10,451,893
未収利息	-	50
流動資産合計	4,263,052,469	4,979,156,957
資産合計	4,263,052,469	4,979,156,957
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	270,066	453,647
未払受託者報酬	1,092,981	1,277,693
未払委託者報酬	12,022,724	14,054,551
未払利息	35	-
その他未払費用	109,235	127,712
流動負債合計	13,495,041	15,913,603
負債合計	13,495,041	15,913,603
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,794,883,011	1,665,151,643
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	2,454,674,417	3,298,091,711
( 分配準備積立金 )	1,929,863,034	2,741,059,488
元本等合計	4,249,557,428	4,963,243,354
純資産合計	4,249,557,428	4,963,243,354
負債純資産合計	4,263,052,469	4,979,156,957

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期		第17期	
	自 至	2022年 6月11日 2023年 6月12日	自 至	2023年 6月13日 2024年 6月10日
<b>営業収益</b>				
受取利息		62		4,216
有価証券売買等損益		402,864,286		1,082,373,194
営業収益合計		402,864,348		1,082,377,410
<b>営業費用</b>				
支払利息		7,439		4,111
受託者報酬		2,162,661		2,482,674
委託者報酬		23,789,104		27,309,296
その他費用		216,143		248,150
営業費用合計		26,175,347		30,044,231
営業利益又は営業損失（ ）		376,689,001		1,052,333,179
経常利益又は経常損失（ ）		376,689,001		1,052,333,179
当期純利益又は当期純損失（ ）		376,689,001		1,052,333,179
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		3,243,235		45,887,426
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,075,896,207		2,454,674,417
剰余金増加額又は欠損金減少額		89,708,906		89,962,236
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		89,708,906		89,962,236
剰余金減少額又は欠損金増加額		84,376,462		252,990,695
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		84,376,462		252,990,695
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,454,674,417		3,298,091,711

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月11日から翌年6月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第17期計算期間は2023年6月13日から2024年6月10日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第16期 (2023年6月12日現在)	第17期 (2024年6月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,794,883,011口	1,665,151,643口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.3676円 (23,676円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.9807円 (29,807円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自 2022年6月11日 至 2023年6月12日			第17期 自 2023年6月13日 至 2024年6月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	81,460,806円	費用控除後の配当等収益額	A	92,970,999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	291,984,960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	913,474,754円
収益調整金額	C	946,123,974円	収益調整金額	C	934,415,977円
分配準備積立金額	D	1,556,417,268円	分配準備積立金額	D	1,734,613,735円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,875,987,008円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,675,475,465円
当ファンドの期末残存口数	F	1,794,883,011口	当ファンドの期末残存口数	F	1,665,151,643口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	16,023円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	22,072円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第17期 自 2023年6月13日 至 2024年6月10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17期 (2024年6月10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。

第17期 (2024年 6月10日現在)	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （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16期 自 2022年 6月11日 至 2023年 6月12日	第17期 自 2023年 6月13日 至 2024年 6月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,791,192,162円	1,794,883,011円
期中追加設定元本額	76,767,682円	55,465,033円
期中一部解約元本額	73,076,833円	185,196,401円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第16期 (2023年 6月12日現在)	第17期 (2024年 6月10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	396,930,730	1,007,205,979
合計	396,930,730	1,007,205,979

## （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	479,820,554	1,608,166,568	
	外国株式マザーファンド	235,623,837	1,684,286,311	
	外国債券マザーファンド	523,442,454	1,648,843,730	
合計		1,238,886,845	4,941,296,609	

(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 6月10日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	3,310,267,570
株式	425,264,969,020
派生商品評価勘定	95,946,150
未収入金	1,152,000
未収配当金	2,960,842,918
未収利息	6,103
差入委託証拠金	334,826,326
流動資産合計	431,968,010,087
資産合計	431,968,010,087
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	30,550
前受金	96,032,200
未払解約金	518,686,901
流動負債合計	614,749,651
負債合計	614,749,651
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	128,699,406,748
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	302,653,853,688
元本等合計	431,353,260,436
純資産合計	431,353,260,436
負債純資産合計	431,968,010,087

### 注記表

#### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 6月10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 6月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	128,699,406,748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 3.3516円 (1万口当たり純資産額) (33,516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 6月10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 6月10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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 6月13日
期首元本額	134,033,097,855円
期中追加設定元本額	7,966,734,130円
期中一部解約元本額	13,300,425,237円
期末元本額	128,699,406,748円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	571,392,444円

区分	2024年 6月10日現在
DC日本株式インデックスファンド	273,248,162円
DC日本株式インデックスファンドL	54,009,740,220円
DC日本株式インデックスファンドA	642,281,232円
DCバランスファンド30	1,855,322,893円
DCバランスファンド50	3,225,728,407円
DCバランスファンド70	2,251,071,525円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	479,820,554円
日本株式インデックスe	1,325,186,894円
インデックスコレクション（国内株式）	23,830,106,234円
インデックスコレクション（バランス株式30）	10,153,689,091円
インデックスコレクション（バランス株式50）	3,379,248,263円
インデックスコレクション（バランス株式70）	3,629,048,342円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,956,876,739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）	2,645,029,566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）	565,053,194円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	19,854,704円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	273,781,753円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	39,259,492円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	100,433,636円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	25,173,817円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	335,587,009円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	273,201,816円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	4,921,446,393円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	518,037,294円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	34,154,567円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	763,379,187円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	12,687,027円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	97,813,524円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,266,795,948円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	30,016,264円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	34,436,889円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	10,112,837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）	163,571,957円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	2,527,962,680円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	51,505,617円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	17,433,096円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	5,449,549円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	65,005,012円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	2,877,223円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	36,264,832,905
合計	36,264,832,905

(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 6月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益 (円)
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引	5,798,627,800	-	96,032,200
	買建			

合計	5,798,627,800	-	5,894,660,000	96,032,200
----	---------------	---	---------------	------------

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,800	3,845.00	22,301,000	
ニッスイ	152,200	886.40	134,910,080	
マルハニチロ	22,600	3,215.00	72,659,000	
雪国まいたけ	13,000	980.00	12,740,000	
カネコ種苗	4,400	1,418.00	6,239,200	
サカタのタネ	17,300	3,375.00	58,387,500	
ホクト	12,200	1,856.00	22,643,200	
ホクリヨウ	800	1,003.00	802,400	
住石ホールディングス	15,100	1,397.00	21,094,700	
日鉄鉱業	6,100	5,240.00	31,964,000	
三井松島ホールディングス	9,000	4,580.00	41,220,000	
I N P E X	511,000	2,346.00	1,198,806,000	
石油資源開発	17,600	6,410.00	112,816,000	
K & O エナジーグループ	6,900	3,800.00	26,220,000	
ショーボンドホールディングス	20,700	5,818.00	120,432,600	
ミライト・ワン	45,900	1,972.50	90,537,750	
タマホーム	9,600	3,875.00	37,200,000	
サンヨーホームズ	600	735.00	441,000	
日本アクア	2,100	920.00	1,932,000	
ファーストコーポレーション	1,500	762.00	1,143,000	
ベステラ	1,200	1,033.00	1,239,600	
キャンディル	900	615.00	553,500	
ダイセキ環境ソリューション	1,000	978.00	978,000	
第一カッター興業	3,900	1,569.00	6,119,100	
安藤・間	88,200	1,119.00	98,695,800	
東急建設	46,300	762.00	35,280,600	
コムシスホールディングス	48,600	3,072.00	149,299,200	
ビーアールホールディングス	22,300	357.00	7,961,100	
高松コンストラクショングループ	11,300	2,961.00	33,459,300	
東建コーポレーション	3,800	10,980.00	41,724,000	
ソネック	500	937.00	468,500	

ヤマウラ	7,700	1,316.00	10,133,200
オリエンタル白石	56,300	346.00	19,479,800
大成建設	97,500	5,968.00	581,880,000
大林組	380,700	1,845.00	702,391,500
清水建設	301,800	844.00	254,719,200
飛島建設	11,000	1,452.00	15,972,000
長谷工コーポレーション	97,700	1,790.00	174,883,000
松井建設	9,900	818.00	8,098,200
銭高組	500	4,340.00	2,170,000
鹿島建設	236,000	2,706.00	638,616,000
不動テトラ	7,400	2,462.00	18,218,800
大末建設	1,400	1,738.00	2,433,200
鉄建建設	7,600	2,561.00	19,463,600
西松建設	20,300	4,380.00	88,914,000
三井住友建設	79,200	395.00	31,284,000
大豊建設	3,700	3,315.00	12,265,500
佐田建設	2,300	747.00	1,718,100
ナカノフドー建設	2,500	528.00	1,320,000
奥村組	17,300	4,895.00	84,683,500
東鉄工業	13,200	3,100.00	40,920,000
イチケン	900	2,562.00	2,305,800
富士ピー・エス	1,600	448.00	716,800
浅沼組	7,900	3,675.00	29,032,500
戸田建設	144,000	1,074.50	154,728,000
熊谷組	17,600	3,645.00	64,152,000
北野建設	700	3,585.00	2,509,500
植木組	1,000	1,633.00	1,633,000
矢作建設工業	14,500	1,572.00	22,794,000
ピーエス三菱	13,500	1,013.00	13,675,500
日本ハウスホールディングス	22,700	325.00	7,377,500
新日本建設	14,900	1,581.00	23,556,900
東亜道路工業	21,000	1,170.00	24,570,000
日本道路	11,500	1,758.00	20,217,000
東亜建設工業	32,800	1,009.00	33,095,200
日本国土開発	30,300	463.00	14,028,900
若築建設	3,700	3,425.00	12,672,500
東洋建設	26,800	1,370.00	36,716,000
五洋建設	150,900	656.80	99,111,120
世紀東急工業	13,700	1,698.00	23,262,600
福田組	4,000	5,590.00	22,360,000
住友林業	92,000	5,400.00	496,800,000
日本基礎技術	2,100	701.00	1,472,100

巴コーポレーション	4,500	850.00	3,825,000
大和ハウス工業	294,300	4,171.00	1,227,525,300
ライト工業	21,200	2,056.00	43,587,200
積水ハウス	322,800	3,555.00	1,147,554,000
日特建設	10,200	1,097.00	11,189,400
北陸電気工事	7,300	1,125.00	8,212,500
ユアテック	23,400	1,583.00	37,042,200
日本リーテック	8,300	1,185.00	9,835,500
四電工	4,500	3,625.00	16,312,500
中電工	16,500	3,225.00	53,212,500
関電工	66,700	1,763.00	117,592,100
きんでん	74,000	3,307.00	244,718,000
東京エネシス	9,900	1,421.00	14,067,900
トーエネック	3,500	5,700.00	19,950,000
住友電設	10,100	3,495.00	35,299,500
日本電設工業	20,000	1,953.00	39,060,000
エクシオグループ	104,000	1,578.50	164,164,000
新日本空調	6,400	4,160.00	26,624,000
九電工	23,000	6,152.00	141,496,000
三機工業	23,000	2,231.00	51,313,000
日揮ホールディングス	105,300	1,228.50	129,361,050
中外炉工業	3,500	3,020.00	10,570,000
ヤマト	3,000	1,047.00	3,141,000
太平電業	6,600	5,630.00	37,158,000
高砂熱学工業	28,500	6,090.00	173,565,000
三晃金属工業	500	4,510.00	2,255,000
朝日工業社	9,400	1,423.00	13,376,200
明星工業	19,300	1,253.00	24,182,900
大気社	12,300	5,260.00	64,698,000
ダイダン	14,000	3,095.00	43,330,000
日比谷総合設備	7,700	3,490.00	26,873,000
フィル・カンパニー	1,600	640.00	1,024,000
テスホールディングス	22,900	419.00	9,595,100
インフロニア・ホールディングス	122,700	1,340.00	164,418,000
東洋エンジニアリング	15,600	893.00	13,930,800
レイズネクスト	15,400	1,831.00	28,197,400
ニッポン	32,000	2,287.00	73,184,000
日清製粉グループ本社	98,800	1,801.00	177,938,800
日東富士製粉	1,900	7,000.00	13,300,000
昭和産業	9,800	3,155.00	30,919,000
鳥越製粉	3,200	698.00	2,233,600
中部飼料	14,800	1,541.00	22,806,800

フィード・ワン	15,600	902.00	14,071,200
東洋精糖	700	1,650.00	1,155,000
日本甜菜製糖	6,200	2,022.00	12,536,400
D M三井製糖ホールディングス	10,600	3,305.00	35,033,000
塩水港精糖	4,700	277.00	1,301,900
ウェルネオシュガー	5,300	2,376.00	12,592,800
森永製菓	45,200	2,554.00	115,440,800
中村屋	2,700	3,265.00	8,815,500
江崎グリコ	30,600	4,149.00	126,959,400
名糖産業	4,200	1,851.00	7,774,200
井村屋グループ	6,000	2,489.00	14,934,000
不二家	7,300	2,533.00	18,490,900
山崎製パン	71,500	3,568.00	255,112,000
第一屋製パン	700	649.00	454,300
モロゾフ	3,500	4,400.00	15,400,000
亀田製菓	6,100	4,115.00	25,101,500
寿スピリッツ	50,500	1,784.00	90,092,000
カルビー	48,900	3,195.00	156,235,500
森永乳業	37,300	3,304.00	123,239,200
六甲バター	7,800	1,467.00	11,442,600
ヤクルト本社	152,700	2,832.00	432,446,400
明治ホールディングス	131,000	3,543.00	464,133,000
雪印メグミルク	25,800	2,544.00	65,635,200
プリマハム	14,400	2,408.00	34,675,200
日本ハム	46,000	4,876.00	224,296,000
林兼産業	1,200	516.00	619,200
丸大食品	10,800	1,710.00	18,468,000
S Foods	11,800	2,916.00	34,408,800
柿安本店	4,200	2,657.00	11,159,400
伊藤ハム米久ホールディングス	16,300	4,190.00	68,297,000
サッポロホールディングス	35,200	5,596.00	196,979,200
アサヒグループホールディングス	246,900	5,880.00	1,451,772,000
キリンホールディングス	445,100	2,219.00	987,676,900
宝ホールディングス	72,000	1,060.50	76,356,000
オエノンホールディングス	31,900	374.00	11,930,600
養命酒製造	3,500	2,237.00	7,829,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	83,700	1,925.50	161,164,350
ライフドリンク カンパニー	1,600	5,990.00	9,584,000
サントリー食品インターナショナル	75,200	5,645.00	424,504,000
ダイドーグループホールディングス	12,100	2,658.00	32,161,800
伊藤園	36,200	3,671.00	132,890,200
キーコーヒー	12,000	2,050.00	24,600,000

ユニカフェ	1,200	917.00	1,100,400
ジャパンフーズ	600	1,994.00	1,196,400
日清オイリオグループ	15,100	4,940.00	74,594,000
不二製油グループ本社	24,900	2,540.50	63,258,450
かどや製油	400	3,645.00	1,458,000
J - オイルミルズ	11,800	1,955.00	23,069,000
キッコーマン	354,100	1,839.50	651,366,950
味の素	253,900	5,898.00	1,497,502,200
ブルドックソース	5,700	1,959.00	11,166,300
キューピー	57,400	3,101.00	177,997,400
ハウス食品グループ本社	36,800	2,917.00	107,345,600
カゴメ	46,000	3,634.00	167,164,000
アリアケジャパン	10,700	5,090.00	54,463,000
ピエトロ	500	1,802.00	901,000
エバラ食品工業	2,500	2,900.00	7,250,000
やまみ	500	3,100.00	1,550,000
ニチレイ	49,000	3,700.00	181,300,000
東洋水産	54,000	9,844.00	531,576,000
イトアンドホールディングス	5,000	2,105.00	10,525,000
大冷	500	1,907.00	953,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,900	1,692.00	8,290,800
日清食品ホールディングス	112,700	4,102.00	462,295,400
永谷園ホールディングス	5,200	3,095.00	16,094,000
一正蒲鉾	1,500	774.00	1,161,000
フジッコ	11,000	1,860.00	20,460,000
ロック・フィールド	12,000	1,511.00	18,132,000
日本たばこ産業	649,300	4,571.00	2,967,950,300
ケンコーマヨネーズ	7,400	1,913.00	14,156,200
わらべや日洋ホールディングス	7,200	2,338.00	16,833,600
なとり	6,700	2,135.00	14,304,500
イフジ産業	700	1,354.00	947,800
ファーマフーズ	14,200	862.00	12,240,400
ユーグレナ	66,500	551.00	36,641,500
紀文食品	8,700	1,231.00	10,709,700
ピクルスホールディングス	6,300	1,178.00	7,421,400
ミヨシ油脂	1,400	1,391.00	1,947,400
理研ビタミン	9,200	2,650.00	24,380,000
片倉工業	10,100	2,140.00	21,614,000
ゲンゼ	7,800	5,570.00	43,446,000
東洋紡	47,200	1,045.00	49,324,000
ユニチカ	36,200	255.00	9,231,000
富士紡ホールディングス	4,600	4,950.00	22,770,000

倉敷紡績	7,800	4,635.00	36,153,000
シキボウ	4,400	1,099.00	4,835,600
日本毛織	28,100	1,337.00	37,569,700
トーア紡コーポレーション	1,400	431.00	603,400
帝国繊維	12,400	2,328.00	28,867,200
帝人	104,600	1,476.00	154,389,600
東レ	728,700	782.80	570,426,360
住江織物	800	2,515.00	2,012,000
日本フェルト	2,600	467.00	1,214,200
イチカワ	600	1,745.00	1,047,000
日東製網	400	1,480.00	592,000
アツギ	2,600	636.00	1,653,600
ダイニック	1,100	828.00	910,800
セーレン	21,100	2,520.00	53,172,000
ソトー	1,200	719.00	862,800
東海染工	400	836.00	334,400
小松マテーレ	15,800	733.00	11,581,400
ワコールホールディングス	22,300	3,973.00	88,597,900
ホギメディカル	14,400	3,900.00	56,160,000
T S Iホールディングス	35,400	957.00	33,877,800
マツオカコーポレーション	1,100	1,594.00	1,753,400
ワールド	15,100	2,050.00	30,955,000
三陽商会	3,600	2,523.00	9,082,800
ナイガイ	1,400	263.00	368,200
オンワードホールディングス	64,200	632.00	40,574,400
ルックホールディングス	2,700	2,761.00	7,454,700
ゴールドウイン	19,300	8,531.00	164,648,300
デサント	18,700	3,390.00	63,393,000
キング	1,400	688.00	963,200
ヤマトインターナショナル	3,000	352.00	1,056,000
特種東海製紙	5,900	3,625.00	21,387,500
王子ホールディングス	452,800	645.60	292,327,680
日本製紙	61,300	977.00	59,890,100
三菱製紙	4,900	837.00	4,101,300
北越コーポレーション	53,400	1,172.00	62,584,800
中越パルプ工業	1,500	1,576.00	2,364,000
大王製紙	48,000	848.10	40,708,800
阿波製紙	1,000	536.00	536,000
レンゴー	99,000	1,036.50	102,613,500
トーモク	6,300	2,694.00	16,972,200
ザ・パック	8,100	3,660.00	29,646,000
北の達人コーポレーション	45,800	175.00	8,015,000



クラレ	158,400	1,863.00	295,099,200
旭化成	735,400	1,025.00	753,785,000
共和レザー	2,100	783.00	1,644,300
巴川コーポレーション	1,000	996.00	996,000
レゾナック・ホールディングス	105,100	3,449.00	362,489,900
住友化学	806,700	323.50	260,967,450
住友精化	5,000	5,080.00	25,400,000
日産化学	50,700	4,621.00	234,284,700
ラサ工業	4,200	3,040.00	12,768,000
クレハ	23,800	2,816.00	67,020,800
多木化学	4,200	4,050.00	17,010,000
テイカ	7,800	1,660.00	12,948,000
石原産業	18,000	1,636.00	29,448,000
片倉コープアグリ	900	1,167.00	1,050,300
日本曹達	12,800	5,150.00	65,920,000
東ソー	145,100	2,100.00	304,710,000
トクヤマ	35,100	3,015.00	105,826,500
セントラル硝子	11,600	3,620.00	41,992,000
東亜合成	52,300	1,514.50	79,208,350
大阪ソーダ	7,600	10,020.00	76,152,000
関東電化工業	21,000	905.00	19,005,000
デンカ	39,500	2,165.00	85,517,500
信越化学工業	974,800	6,206.00	6,049,608,800
日本カーバイド工業	3,400	1,897.00	6,449,800
堺化学工業	8,300	2,770.00	22,991,000
第一稀元素化学工業	10,600	830.00	8,798,000
エア・ウォーター	102,600	2,222.00	227,977,200
日本酸素ホールディングス	105,500	4,730.00	499,015,000
日本化学工業	3,800	2,403.00	9,131,400
東邦アセチレン	3,800	370.00	1,406,000
日本パーカライズニング	48,400	1,273.00	61,613,200
高压ガス工業	15,800	958.00	15,136,400
チタン工業	500	1,010.00	505,000
四国化成ホールディングス	12,300	2,037.00	25,055,100
戸田工業	2,500	1,949.00	4,872,500
ステラ ケミファ	5,900	4,140.00	24,426,000
保土谷化学工業	3,300	5,240.00	17,292,000
日本触媒	63,300	1,565.50	99,096,150
大日精化工業	7,600	3,275.00	24,890,000
カネカ	26,800	4,225.00	113,230,000
三菱瓦斯化学	79,300	2,932.00	232,507,600
三井化学	89,700	4,683.00	420,065,100

東京応化工業	51,900	4,217.00	218,862,300
大阪有機化学工業	9,100	3,440.00	31,304,000
三菱ケミカルグループ	794,700	837.10	665,243,370
KHネオケム	16,600	2,249.00	37,333,400
ダイセル	139,700	1,585.50	221,494,350
住友ベークライト	30,400	4,570.00	138,928,000
積水化学工業	218,400	2,239.50	489,106,800
日本ゼオン	74,500	1,422.50	105,976,250
アイカ工業	27,400	3,421.00	93,735,400
UBE	51,700	2,791.50	144,320,550
積水樹脂	15,700	2,450.00	38,465,000
タキロンシーアイ	25,600	700.00	17,920,000
旭有機材	7,200	4,885.00	35,172,000
ニチバン	5,900	1,825.00	10,767,500
リケンテクノス	20,400	1,012.00	20,644,800
大倉工業	5,000	2,950.00	14,750,000
積水化成成品工業	15,300	455.00	6,961,500
群栄化学工業	2,600	3,220.00	8,372,000
タイガースポリマー	1,700	845.00	1,436,500
ミライアル	1,200	1,510.00	1,812,000
ダイキアクシス	1,500	727.00	1,090,500
ダイキョーニシカワ	24,000	695.00	16,680,000
竹本容器	1,400	874.00	1,223,600
森六ホールディングス	5,600	2,795.00	15,652,000
恵和	7,800	1,682.00	13,119,600
日本化薬	83,000	1,229.50	102,048,500
カーリットホールディングス	10,600	1,290.00	13,674,000
日本精化	6,500	2,659.00	17,283,500
扶桑化学工業	11,500	3,865.00	44,447,500
トリケミカル研究所	13,200	4,065.00	53,658,000
ADEKA	37,900	3,279.00	124,274,100
日油	98,400	2,063.00	202,999,200
新日本理化	5,000	185.00	925,000
ハリマ化成グループ	5,800	886.00	5,138,800
花王	245,800	6,740.00	1,656,692,000
第一工業製薬	4,200	3,975.00	16,695,000
石原ケミカル	4,900	2,027.00	9,932,300
日華化学	1,500	1,129.00	1,693,500
ニイタカ	700	1,885.00	1,319,500
三洋化成工業	6,700	3,955.00	26,498,500
有機合成薬品工業	2,900	305.00	884,500
大日本塗料	12,100	1,223.00	14,798,300

日本ペイントホールディングス	577,200	1,082.50	624,819,000
関西ペイント	93,900	2,736.00	256,910,400
神東塗料	3,000	128.00	384,000
中国塗料	22,300	2,067.00	46,094,100
日本特殊塗料	2,600	1,285.00	3,341,000
藤倉化成	12,500	561.00	7,012,500
太陽ホールディングス	18,900	3,145.00	59,440,500
D I C	42,500	3,212.00	136,510,000
サカタインクス	24,200	1,821.00	44,068,200
a r t i e n c e	23,700	3,425.00	81,172,500
富士フィルムホールディングス	605,800	3,728.00	2,258,422,400
資生堂	227,300	5,072.00	1,152,865,600
ライオン	138,500	1,276.50	176,795,250
高砂香料工業	7,700	3,665.00	28,220,500
マンダム	23,500	1,217.00	28,599,500
ミルボン	14,800	3,280.00	48,544,000
ファンケル	47,600	1,959.50	93,272,200
コーセー	22,100	10,510.00	232,271,000
コタ	11,000	1,473.00	16,203,000
シーボン	500	1,398.00	699,000
ポーラ・オルビスホールディングス	55,800	1,342.50	74,911,500
ノエビアホールディングス	9,700	5,480.00	53,156,000
アジュバンホールディングス	900	869.00	782,100
新日本製薬	6,200	1,656.00	10,267,200
I - n e	2,200	1,676.00	3,687,200
アクシージア	5,400	970.00	5,238,000
エステー	8,400	1,557.00	13,078,800
アグロ カネショウ	4,400	1,200.00	5,280,000
コニシ	31,400	1,235.00	38,779,000
長谷川香料	20,800	3,030.00	63,024,000
小林製薬	31,700	5,581.00	176,917,700
荒川化学工業	9,200	1,136.00	10,451,200
メック	9,000	4,255.00	38,295,000
日本高純度化学	2,500	3,255.00	8,137,500
タカラバイオ	29,300	1,008.00	29,534,400
J C U	12,000	3,750.00	45,000,000
新田ゼラチン	2,500	807.00	2,017,500
O A T アグリオ	3,200	1,554.00	4,972,800
デクセリアルズ	26,900	6,892.00	185,394,800
アース製薬	9,900	4,745.00	46,975,500
北興化学工業	11,000	1,562.00	17,182,000
大成ラミック	3,100	2,810.00	8,711,000

クミアイ化学工業	43,200	788.00	34,041,600
日本農薬	20,000	746.00	14,920,000
アキレス	6,900	1,615.00	11,143,500
有沢製作所	18,500	1,560.00	28,860,000
日東電工	69,900	12,250.00	856,275,000
レック	13,900	1,307.00	18,167,300
三光合成	13,700	682.00	9,343,400
きもと	6,000	213.00	1,278,000
藤森工業	8,600	4,480.00	38,528,000
前澤化成工業	7,000	1,835.00	12,845,000
未来工業	3,900	4,135.00	16,126,500
ウェーブロックホールディングス	1,400	640.00	896,000
JSP	7,600	2,222.00	16,887,200
エフピコ	20,600	2,418.00	49,810,800
天馬	7,900	2,740.00	21,646,000
信越ポリマー	23,500	1,460.00	34,310,000
東リ	8,100	397.00	3,215,700
ニフコ	32,600	3,818.00	124,466,800
バルカー	9,100	3,600.00	32,760,000
ユニ・チャーム	226,800	5,236.00	1,187,524,800
ショーエイコーポレーション	1,100	585.00	643,500
協和キリン	131,500	2,727.50	358,666,250
武田薬品工業	963,300	4,241.00	4,085,355,300
アステラス製薬	954,700	1,576.50	1,505,084,550
住友ファーマ	80,700	351.00	28,325,700
塩野義製薬	132,500	6,286.00	832,895,000
わかもと製薬	3,800	254.00	965,200
日本新薬	28,500	3,148.00	89,718,000
中外製薬	340,700	4,811.00	1,639,107,700
科研製薬	18,600	3,806.00	70,791,600
エーザイ	132,400	6,872.00	909,852,800
ロート製薬	105,400	2,966.50	312,669,100
小野薬品工業	222,600	2,247.00	500,182,200
久光製薬	24,200	3,820.00	92,444,000
持田製薬	12,200	3,110.00	37,942,000
参天製薬	192,000	1,620.00	311,040,000
扶桑薬品工業	3,700	2,294.00	8,487,800
日本ケミファ	400	1,564.00	625,600
ツムラ	34,300	4,042.00	138,640,600
キッセイ薬品工業	18,000	3,215.00	57,870,000
生化学工業	18,400	813.00	14,959,200
栄研化学	19,500	2,039.00	39,760,500

鳥居薬品	5,800	3,730.00	21,634,000
JCRファーマ	36,800	579.00	21,307,200
東和薬品	16,700	2,819.00	47,077,300
富士製薬工業	8,000	1,488.00	11,904,000
ゼリア新薬工業	15,100	2,046.00	30,894,600
ネクセラファーマ	47,600	1,517.00	72,209,200
第一三共	948,200	5,788.00	5,488,181,600
杏林製薬	23,600	1,690.00	39,884,000
大幸薬品	22,600	388.00	8,768,800
ダイト	8,300	2,292.00	19,023,600
大塚ホールディングス	226,400	6,541.00	1,480,882,400
ペプチドリーム	52,800	2,100.00	110,880,000
セルソース	3,000	1,220.00	3,660,000
あすか製薬ホールディングス	11,200	2,309.00	25,860,800
サワイグループホールディングス	24,900	5,808.00	144,619,200
日本コークス工業	110,400	124.00	13,689,600
ニチレキ	13,500	2,389.00	32,251,500
ユシロ化学工業	5,600	1,800.00	10,080,000
ビーピー・カストロール	1,400	983.00	1,376,200
富士石油	29,100	518.00	15,073,800
MORESCO	1,300	1,372.00	1,783,600
出光興産	565,200	1,074.50	607,307,400
ENEOSホールディングス	1,723,200	799.70	1,378,043,040
コスモエネルギーホールディングス	32,300	7,792.00	251,681,600
横浜ゴム	55,000	3,769.00	207,295,000
TOYO TIRE	62,500	2,775.00	173,437,500
ブリヂストン	318,600	6,712.00	2,138,443,200
住友ゴム工業	106,800	1,716.00	183,268,800
藤倉コンポジット	7,400	1,415.00	10,471,000
オカモト	5,100	4,850.00	24,735,000
フコク	5,700	2,394.00	13,645,800
ニッタ	11,100	3,970.00	44,067,000
住友理工	16,900	1,339.00	22,629,100
三ツ星ベルト	12,600	4,380.00	55,188,000
バンドー化学	16,100	1,883.00	30,316,300
日東紡績	13,800	6,670.00	92,046,000
AGC	97,100	5,371.00	521,524,100
日本板硝子	51,900	451.00	23,406,900
石塚硝子	600	2,908.00	1,744,800
日本山村硝子	1,400	1,704.00	2,385,600
日本電気硝子	44,400	3,722.00	165,256,800
オハラ	5,200	1,376.00	7,155,200

住友大阪セメント	18,100	3,855.00	69,775,500
太平洋セメント	64,400	3,944.00	253,993,600
日本ヒューム	9,600	1,120.00	10,752,000
日本コンクリート工業	21,300	357.00	7,604,100
三谷セキサン	4,600	5,760.00	26,496,000
アジアパイルホールディングス	15,500	984.00	15,252,000
東海カーボン	100,500	955.60	96,037,800
日本カーボン	5,800	5,440.00	31,552,000
東洋炭素	7,700	6,970.00	53,669,000
ノリタケカンパニーリミテド	12,000	3,935.00	47,220,000
TOTO	71,800	3,831.00	275,065,800
日本碍子	126,600	2,088.50	264,404,100
日本特殊陶業	91,200	4,901.00	446,971,200
MARUWA	4,000	36,600.00	146,400,000
品川リフラクトリーズ	13,400	2,020.00	27,068,000
黒崎播磨	8,800	2,995.00	26,356,000
ヨータイ	6,300	1,794.00	11,302,200
東京窯業	4,000	432.00	1,728,000
ニッカトー	1,700	565.00	960,500
フジインコーポレーテッド	29,300	2,941.00	86,171,300
クニミネ工業	1,100	1,154.00	1,269,400
エーアンドエーマテリアル	800	1,379.00	1,103,200
ニチアス	27,500	4,595.00	126,362,500
ニチハ	13,700	3,565.00	48,840,500
日本製鉄	501,500	3,405.00	1,707,607,500
神戸製鋼所	225,200	2,003.50	451,188,200
中山製鋼所	25,600	941.00	24,089,600
合同製鐵	6,300	5,210.00	32,823,000
JFEホールディングス	311,400	2,335.00	727,119,000
東京製鐵	31,500	1,691.00	53,266,500
共英製鋼	12,800	2,121.00	27,148,800
大和工業	21,100	8,178.00	172,555,800
東京鐵鋼	4,900	5,390.00	26,411,000
大阪製鐵	5,200	2,387.00	12,412,400
淀川製鋼所	12,700	5,380.00	68,326,000
中部鋼鈹	7,400	2,794.00	20,675,600
丸一鋼管	34,100	3,787.00	129,136,700
モリ工業	1,700	5,210.00	8,857,000
大同特殊鋼	70,500	1,540.00	108,570,000
日本高周波鋼業	1,500	460.00	690,000
日本冶金工業	8,200	4,705.00	38,581,000
山陽特殊製鋼	11,100	2,152.00	23,887,200

愛知製鋼	6,500	3,690.00	23,985,000
日本金属	1,000	727.00	727,000
大太平洋金属	9,500	1,287.00	12,226,500
新日本電工	55,800	286.00	15,958,800
栗本鐵工所	5,200	4,750.00	24,700,000
虹技	500	1,198.00	599,000
三菱製鋼	7,900	1,503.00	11,873,700
日亜鋼業	3,800	318.00	1,208,400
日本精線	8,000	1,245.00	9,960,000
エンビプロ・ホールディングス	6,100	520.00	3,172,000
シンニッタン	4,800	233.00	1,118,400
新家工業	800	5,250.00	4,200,000
大紀アルミニウム工業所	14,200	1,297.00	18,417,400
日本軽金属ホールディングス	32,800	1,818.00	59,630,400
三井金属鉱業	32,700	4,968.00	162,453,600
三菱マテリアル	80,100	2,976.50	238,417,650
住友金属鉱山	129,900	4,850.00	630,015,000
D O W Aホールディングス	27,700	5,721.00	158,471,700
古河機械金属	14,800	1,874.00	27,735,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,500	2,930.00	57,135,000
東邦チタニウム	23,200	1,286.00	29,835,200
U A C J	15,700	4,120.00	64,684,000
C Kサンエツ	2,700	3,820.00	10,314,000
古河電気工業	37,400	4,163.00	155,696,200
住友電気工業	419,000	2,659.50	1,114,330,500
フジクラ	132,200	3,259.00	430,839,800
S W C C	12,500	4,730.00	59,125,000
タツタ電線	20,100	715.00	14,371,500
カナレ電気	700	1,556.00	1,089,200
平河ヒューテック	6,800	1,463.00	9,948,400
リョービ	12,000	2,418.00	29,016,000
アーレスティ	4,100	704.00	2,886,400
A R Eホールディングス	42,200	2,042.00	86,172,400
稲葉製作所	5,500	2,026.00	11,143,000
宮地エンジニアリンググループ	5,600	4,520.00	25,312,000
トーカロ	31,000	1,919.00	59,489,000
アルファC o	1,400	1,389.00	1,944,600
S U M C O	199,000	2,393.00	476,207,000
川田テクノロジーズ	7,800	2,739.00	21,364,200
R S Technologies	7,500	3,630.00	27,225,000
ジェイテックコーポレーション	600	1,835.00	1,101,000
信和	2,400	739.00	1,773,600

東洋製罐グループホールディングス	64,200	2,482.50	159,376,500
ホッカンホールディングス	5,500	1,710.00	9,405,000
コロナ	6,300	934.00	5,884,200
横河ブリッジホールディングス	17,500	2,718.00	47,565,000
駒井ハルテック	700	1,813.00	1,269,100
高田機工	300	3,685.00	1,105,500
三和ホールディングス	112,500	2,969.50	334,068,750
文化シャッター	29,300	1,761.00	51,597,300
三協立山	12,900	800.00	10,320,000
アルインコ	8,500	1,085.00	9,222,500
東洋シャッター	900	976.00	878,400
LIXIL	174,800	1,695.50	296,373,400
日本フィルコン	2,400	525.00	1,260,000
ノーリツ	17,700	1,767.00	31,275,900
長府製作所	11,100	2,185.00	24,253,500
リンナイ	53,600	3,703.00	198,480,800
ダイニチ工業	1,900	678.00	1,288,200
日東精工	16,200	580.00	9,396,000
三洋工業	400	3,315.00	1,326,000
岡部	20,000	779.00	15,580,000
ジーテクト	13,400	1,882.00	25,218,800
東プレ	19,700	2,178.00	42,906,600
高周波熱錬	16,600	1,100.00	18,260,000
東京製綱	7,300	1,306.00	9,533,800
サンコール	7,500	443.00	3,322,500
モリテック スチール	3,300	230.00	759,000
パイオラックス	13,900	2,265.00	31,483,500
エイチワン	11,500	885.00	10,177,500
日本発條	99,100	1,636.00	162,127,600
中央発條	8,300	1,175.00	9,752,500
アドバネクス	500	1,068.00	534,000
立川ブラインド工業	5,100	1,370.00	6,987,000
三益半導体工業	8,700	3,690.00	32,103,000
日本ドライケミカル	900	2,549.00	2,294,100
日本製綱所	30,200	4,577.00	138,225,400
三浦工業	45,800	3,232.00	148,025,600
タクマ	37,100	1,667.00	61,845,700
ツガミ	24,400	1,442.00	35,184,800
オークマ	9,600	6,593.00	63,292,800
芝浦機械	11,000	3,595.00	39,545,000
アマダ	166,100	1,751.00	290,841,100
アイダエンジニアリング	24,200	871.00	21,078,200



F U J I	51,600	2,483.00	128,122,800
牧野フライス製作所	12,100	6,600.00	79,860,000
オーエスジー	48,300	1,910.50	92,277,150
ダイジェット工業	400	841.00	336,400
旭ダイヤモンド工業	25,300	898.00	22,719,400
D M G 森精機	75,000	4,420.00	331,500,000
ソディック	26,700	714.00	19,063,800
ディスコ	52,800	59,400.00	3,136,320,000
日東工器	5,300	2,248.00	11,914,400
日進工具	9,600	972.00	9,331,200
パンチ工業	3,600	462.00	1,663,200
富士ダイス	4,300	794.00	3,414,200
豊和工業	2,000	816.00	1,632,000
リケンN P R	11,900	2,683.00	31,927,700
東洋機械金属	3,100	712.00	2,207,200
エンシュウ	900	713.00	641,700
島精機製作所	17,500	1,550.00	27,125,000
オプトラン	18,000	2,033.00	36,594,000
N C ホールディングス	900	2,204.00	1,983,600
イワキポンプ	7,300	2,485.00	18,140,500
フリュー	10,400	1,071.00	11,138,400
ヤマシンフィルタ	26,100	367.00	9,578,700
日阪製作所	11,200	1,045.00	11,704,000
やまびこ	17,900	2,115.00	37,858,500
野村マイクロ・サイエンス	14,800	4,515.00	66,822,000
平田機工	5,200	6,650.00	34,580,000
P E G A S U S	12,100	530.00	6,413,000
マルマエ	4,800	2,135.00	10,248,000
タツモ	6,600	3,665.00	24,189,000
ナプテスコ	68,800	2,609.00	179,499,200
三井海洋開発	13,900	2,682.00	37,279,800
レオン自動機	12,300	1,563.00	19,224,900
S M C	32,800	77,990.00	2,558,072,000
ホソカワミクロン	7,000	4,170.00	29,190,000
ユニオンツール	4,800	5,780.00	27,744,000
瑞光	7,900	1,070.00	8,453,000
オイレス工業	14,900	2,294.00	34,180,600
日精エー・エス・ビー機械	3,700	4,955.00	18,333,500
サトーホールディングス	15,600	2,164.00	33,758,400
技研製作所	10,300	1,885.00	19,415,500
日本エアテック	5,100	1,183.00	6,033,300
カワタ	1,200	905.00	1,086,000

日精樹脂工業	8,200	1,022.00	8,380,400	
オカダアイヨン	1,200	2,410.00	2,892,000	
ワイエイシイホールディングス	3,600	2,383.00	8,578,800	
小松製作所	513,800	4,602.00	2,364,507,600	
住友重機械工業	64,900	4,126.00	267,777,400	
日立建機	43,700	4,190.00	183,103,000	
日工	16,300	740.00	12,062,000	
巴工業	4,300	4,340.00	18,662,000	
井関農機	10,300	1,023.00	10,536,900	
TOWA	12,200	11,340.00	138,348,000	
丸山製作所	600	2,351.00	1,410,600	
北川鉄工所	4,300	1,411.00	6,067,300	
ローツェ	5,700	29,700.00	169,290,000	
タカキタ	1,200	470.00	564,000	
クボタ	573,100	2,215.00	1,269,416,500	
荏原実業	5,800	3,460.00	20,068,000	
三菱化工機	3,900	4,060.00	15,834,000	
月島ホールディングス	14,800	1,384.00	20,483,200	
帝国電機製作所	7,500	2,401.00	18,007,500	
新東工業	22,200	1,066.00	23,665,200	
澁谷工業	10,300	3,775.00	38,882,500	
アイチ コーポレーション	15,200	1,200.00	18,240,000	
小森コーポレーション	27,000	1,286.00	34,722,000	
鶴見製作所	8,400	4,400.00	36,960,000	
日本ギア工業	1,400	545.00	763,000	
酒井重工業	1,400	5,990.00	8,386,000	
荏原製作所	45,000	11,760.00	529,200,000	
石井鐵工所	400	2,825.00	1,130,000	
西島製作所	9,400	3,285.00	30,879,000	
北越工業	11,000	2,389.00	26,279,000	
ダイキン工業	130,900	22,900.00	2,997,610,000	
オルガノ	13,200	8,300.00	109,560,000	
トーヨーカネツ	3,700	3,835.00	14,189,500	
栗田工業	61,300	6,681.00	409,545,300	
椿本チエイン	15,100	5,910.00	89,241,000	
大同工業	1,600	848.00	1,356,800	
木村化工機	8,400	694.00	5,829,600	
アネスト岩田	17,000	1,522.00	25,874,000	
ダイフク	185,000	2,885.00	533,725,000	
サムコ	2,600	4,090.00	10,634,000	
加藤製作所	1,900	1,312.00	2,492,800	
油研工業	600	2,381.00	1,428,600	

タダノ	63,100	1,107.50	69,883,250
フジテック	25,600	4,103.00	105,036,800
C K D	30,300	3,135.00	94,990,500
平和	32,400	2,022.00	65,512,800
理想科学工業	8,800	3,190.00	28,072,000
S A N K Y O	105,500	1,614.50	170,329,750
日本金銭機械	13,300	1,297.00	17,250,100
マースグループホールディングス	5,500	3,780.00	20,790,000
フクシマガリレイ	7,200	6,530.00	47,016,000
オーイズミ	1,400	372.00	520,800
ダイコク電機	5,400	3,930.00	21,222,000
竹内製作所	19,900	5,810.00	115,619,000
アマノ	31,100	3,955.00	123,000,500
J U K I	17,000	489.00	8,313,000
ジャノメ	11,100	677.00	7,514,700
マックス	15,400	3,805.00	58,597,000
グローリー	26,300	2,759.50	72,574,850
新晃工業	11,000	3,845.00	42,295,000
大和冷機工業	16,800	1,503.00	25,250,400
セガサミーホールディングス	97,900	2,321.00	227,225,900
T P R	13,400	2,404.00	32,213,600
ツバキ・ナカシマ	22,000	781.00	17,182,000
ホシザキ	64,700	5,589.00	361,608,300
大豊工業	9,500	803.00	7,628,500
日本精工	202,900	751.90	152,560,510
N T N	237,800	317.40	75,477,720
ジェイテクト	97,500	1,110.00	108,225,000
不二越	8,100	3,430.00	27,783,000
日本トムソン	29,200	602.00	17,578,400
T H K	63,200	3,010.00	190,232,000
ユーシン精機	8,700	721.00	6,272,700
前澤給装工業	7,900	1,330.00	10,507,000
イーグル工業	12,100	1,849.00	22,372,900
前澤工業	2,300	1,385.00	3,185,500
日本ピラー工業	10,200	5,260.00	53,652,000
キッツ	36,700	1,149.00	42,168,300
マキタ	125,000	4,487.00	560,875,000
三井E & S	54,400	1,485.00	80,784,000
日立造船	96,700	1,090.00	105,403,000
三菱重工業	1,916,800	1,405.00	2,693,104,000
I H I	81,600	3,870.00	315,792,000
スター精密	20,200	2,142.00	43,268,400

日清紡ホールディングス	82,400	1,079.00	88,909,600
イビデン	57,200	6,383.00	365,107,600
コニカミノルタ	245,100	485.10	118,898,010
ブラザー工業	146,500	3,008.00	440,672,000
ミネベアミツミ	190,700	3,315.00	632,170,500
日立製作所	526,800	17,150.00	9,034,620,000
三菱電機	1,220,000	2,686.50	3,277,530,000
富士電機	66,600	9,283.00	618,247,800
東洋電機製造	1,300	1,082.00	1,406,600
安川電機	119,100	5,990.00	713,409,000
シンフォニアテクノロジー	12,100	3,345.00	40,474,500
明電舎	20,300	4,115.00	83,534,500
オリジン	800	1,331.00	1,064,800
山洋電気	4,800	7,030.00	33,744,000
デンヨー	8,300	2,753.00	22,849,900
PHCホールディングス	20,600	1,184.00	24,390,400
KOKUSAI ELECTRIC	56,700	4,570.00	259,119,000
ソシオネクスト	79,800	4,257.00	339,708,600
東芝テック	14,000	3,115.00	43,610,000
芝浦メカトロニクス	6,300	7,500.00	47,250,000
マブチモーター	54,000	2,416.00	130,464,000
ニデック	242,000	7,052.00	1,706,584,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,200	389.00	2,800,800
トレックス・セミコンダクター	5,700	1,853.00	10,562,100
東光高岳	6,700	2,060.00	13,802,000
ダブル・スコープ	31,400	485.00	15,229,000
ダイヘン	10,400	8,740.00	90,896,000
ヤーマン	19,200	959.00	18,412,800
JVCケンウッド	86,700	939.00	81,411,300
ミマキエンジニアリング	10,500	1,997.00	20,968,500
I - P E X	7,700	2,029.00	15,623,300
大崎電気工業	24,000	662.00	15,888,000
オムロン	83,700	5,122.00	428,711,400
日東工業	14,800	3,375.00	49,950,000
I D E C	16,200	2,910.00	47,142,000
正興電機製作所	1,300	1,551.00	2,016,300
不二電機工業	800	1,126.00	900,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	42,800	3,237.00	138,543,600
サクサホールディングス	800	2,679.00	2,143,200
メルコホールディングス	2,900	3,485.00	10,106,500
テクノメディカ	2,700	1,782.00	4,811,400
日本電気	144,000	12,305.00	1,771,920,000

富士通	1,008,600	2,480.50	2,501,832,300
沖電気工業	49,600	1,038.00	51,484,800
岩崎通信機	1,700	1,321.00	2,245,700
電気興業	4,400	2,119.00	9,323,600
サンケン電気	10,200	6,399.00	65,269,800
ナカヨ	600	1,194.00	716,400
アイホン	5,900	3,020.00	17,818,000
ルネサスエレクトロニクス	683,300	2,980.00	2,036,234,000
セイコーエプソン	140,600	2,500.50	351,570,300
ワコム	80,400	712.00	57,244,800
アルバック	24,000	11,180.00	268,320,000
アクセル	3,500	1,420.00	4,970,000
E I Z O	8,000	4,825.00	38,600,000
日本信号	25,000	1,020.00	25,500,000
京三製作所	23,000	639.00	14,697,000
能美防災	14,900	2,292.00	34,150,800
ホーチキ	8,200	2,170.00	17,794,000
星和電機	1,800	562.00	1,011,600
エレコム	26,300	1,573.00	41,369,900
パナソニック ホールディングス	1,294,800	1,357.50	1,757,691,000
シャープ	184,800	979.10	180,937,680
アンリツ	77,200	1,142.50	88,201,000
富士通ゼネラル	31,100	2,078.00	64,625,800
ソニーグループ	760,800	13,360.00	10,164,288,000
T D K	173,600	8,455.00	1,467,788,000
帝国通信工業	4,900	1,968.00	9,643,200
タムラ製作所	43,700	702.00	30,677,400
アルプスアルパイン	98,000	1,485.00	145,530,000
池上通信機	1,200	784.00	940,800
日本電波工業	13,300	1,112.00	14,789,600
鈴木	5,900	1,469.00	8,667,100
メイコー	10,900	7,240.00	78,916,000
日本トリム	2,500	3,275.00	8,187,500
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	8,100	1,708.00	13,834,800
S M K	2,600	2,427.00	6,310,200
ヨコオ	9,700	2,090.00	20,273,000
ホシデン	25,000	2,011.00	50,275,000
ヒロセ電機	16,200	17,545.00	284,229,000
日本航空電子工業	26,200	2,425.00	63,535,000
T O A	12,500	1,087.00	13,587,500
マクセル	23,800	1,837.00	43,720,600

古野電気	14,300	2,124.00	30,373,200
スミダコーポレーション	14,800	1,179.00	17,449,200
アイコム	4,200	3,035.00	12,747,000
リオン	4,500	2,984.00	13,428,000
横河電機	119,900	3,966.00	475,523,400
新電元工業	4,200	3,005.00	12,621,000
アズビル	74,700	4,221.00	315,308,700
東亜ディーケーケー	1,800	855.00	1,539,000
日本光電工業	46,600	4,716.00	219,765,600
チノー	4,500	2,558.00	11,511,000
共和電業	3,400	450.00	1,530,000
日本電子材料	6,700	3,315.00	22,210,500
堀場製作所	20,700	12,455.00	257,818,500
アドバンテスト	310,900	5,348.00	1,662,693,200
小野測器	1,700	707.00	1,201,900
エスベック	8,700	3,185.00	27,709,500
キーエンス	108,600	70,620.00	7,669,332,000
日置電機	5,100	6,800.00	34,680,000
シスメックス	281,000	2,600.00	730,600,000
日本マイクロニクス	19,500	5,760.00	112,320,000
メガチップス	8,600	4,195.00	36,077,000
O B A R A G R O U P	6,000	4,145.00	24,870,000
澤藤電機	500	1,235.00	617,500
原田工業	1,800	575.00	1,035,000
コーセル	11,700	1,340.00	15,678,000
イリソ電子工業	10,000	3,040.00	30,400,000
オブテックスグループ	20,000	1,687.00	33,740,000
千代田インテグレ	4,300	3,080.00	13,244,000
レーザーテック	49,700	37,400.00	1,858,780,000
スタンレー電気	69,500	2,866.50	199,221,750
ウシオ電機	48,100	2,079.50	100,023,950
岡谷電機産業	3,300	248.00	818,400
ヘリオス テクノ ホールディング	3,900	883.00	3,443,700
エノモト	1,100	1,485.00	1,633,500
日本セラミック	8,900	2,583.00	22,988,700
遠藤照明	1,700	1,582.00	2,689,400
古河電池	8,100	1,180.00	9,558,000
山一電機	9,800	3,365.00	32,977,000
図研	9,100	3,970.00	36,127,000
日本電子	27,200	6,996.00	190,291,200
カシオ計算機	78,400	1,175.50	92,159,200
ファナック	529,200	4,364.00	2,309,428,800

日本シイエムケイ	23,400	594.00	13,899,600
エンプラス	3,200	7,820.00	25,024,000
大真空	16,300	696.00	11,344,800
ローム	200,700	2,052.50	411,936,750
浜松ホトニクス	87,100	4,677.00	407,366,700
三井ハイテック	9,600	6,976.00	66,969,600
新光電気工業	38,400	5,657.00	217,228,800
京セラ	674,400	1,821.00	1,228,082,400
太陽誘電	52,900	3,460.00	183,034,000
村田製作所	987,400	3,083.00	3,044,154,200
双葉電子工業	20,900	567.00	11,850,300
北陸電気工業	1,400	1,390.00	1,946,000
ニチコン	28,600	1,143.00	32,689,800
日本ケミコン	11,600	1,603.00	18,594,800
K O A	16,500	1,493.00	24,634,500
市光工業	19,800	541.00	10,711,800
小糸製作所	112,500	2,177.50	244,968,750
ミツバ	20,300	1,097.00	22,269,100
S C R E E Nホールディングス	37,100	15,140.00	561,694,000
キャノン電子	12,000	2,291.00	27,492,000
キャノン	541,300	4,571.00	2,474,282,300
リコー	272,100	1,471.50	400,395,150
象印マホービン	29,500	1,512.00	44,604,000
M U T O Hホールディングス	500	2,555.00	1,277,500
東京エレクトロン	229,700	34,780.00	7,988,966,000
イノテック	7,300	1,723.00	12,577,900
トヨタ紡織	45,700	2,182.50	99,740,250
芦森工業	800	2,456.00	1,964,800
ユニプレス	19,500	1,352.00	26,364,000
豊田自動織機	92,600	14,060.00	1,301,956,000
モリタホールディングス	19,100	1,835.00	35,048,500
三櫻工業	16,600	975.00	16,185,000
デンソー	895,400	2,475.00	2,216,115,000
東海理化電機製作所	30,600	2,165.00	66,249,000
川崎重工業	88,600	5,736.00	508,209,600
名村造船所	23,800	2,439.00	58,048,200
日本車輛製造	3,600	2,358.00	8,488,800
三菱ロジスネクスト	17,300	1,413.00	24,444,900
近畿車輛	500	1,922.00	961,000
日産自動車	1,429,400	545.10	779,165,940
いすゞ自動車	305,000	2,015.00	614,575,000
トヨタ自動車	5,959,000	3,272.00	19,497,848,000

日野自動車	163,200	434.80	70,959,360
三菱自動車工業	423,400	440.20	186,380,680
エフテック	2,600	654.00	1,700,400
レシップホールディングス	1,600	612.00	979,200
GMB	700	1,338.00	936,600
ファルテック	700	556.00	389,200
武蔵精密工業	26,600	1,688.00	44,900,800
日産車体	11,000	996.00	10,956,000
新明和工業	31,200	1,402.00	43,742,400
極東開発工業	17,900	2,468.00	44,177,200
トピー工業	8,800	2,449.00	21,551,200
ティラド	2,400	3,575.00	8,580,000
曙ブレーキ工業	66,200	135.00	8,937,000
タチエス	20,000	1,923.00	38,460,000
NOK	42,200	2,111.50	89,105,300
フタバ産業	29,100	860.00	25,026,000
カヤバ	10,200	5,390.00	54,978,000
大同メタル工業	21,300	598.00	12,737,400
プレス工業	43,400	647.00	28,079,800
ミクニ	4,600	408.00	1,876,800
太平洋工業	24,900	1,539.00	38,321,100
アイシン	83,700	5,795.00	485,041,500
マツダ	359,000	1,567.50	562,732,500
今仙電機製作所	2,300	622.00	1,430,600
本田技研工業	2,571,400	1,708.00	4,391,951,200
スズキ	797,300	1,881.00	1,499,721,300
SUBARU	336,600	3,426.00	1,153,191,600
安永	1,600	603.00	964,800
ヤマハ発動機	469,000	1,506.50	706,548,500
TBK	4,000	305.00	1,220,000
エクセディ	17,800	2,618.00	46,600,400
豊田合成	31,100	2,914.50	90,640,950
愛三工業	18,000	1,356.00	24,408,000
盟和産業	500	1,008.00	504,000
日本プラスト	3,100	427.00	1,323,700
ヨロズ	10,200	1,096.00	11,179,200
エフ・シー・シー	19,200	2,289.00	43,948,800
シマノ	43,700	26,175.00	1,143,847,500
テイ・エス テック	38,700	1,869.50	72,349,650
ジャムコ	4,600	1,434.00	6,596,400
テルモ	605,000	2,720.00	1,645,600,000
クリエートメディック	1,200	988.00	1,185,600



日機装	25,300	1,201.00	30,385,300
日本エム・ディ・エム	7,300	631.00	4,606,300
島津製作所	144,200	4,083.00	588,768,600
JMS	10,100	531.00	5,363,100
長野計器	7,900	2,988.00	23,605,200
ブイ・テクノロジー	5,700	3,055.00	17,413,500
東京計器	8,300	2,999.00	24,891,700
愛知時計電機	4,500	2,135.00	9,607,500
インターアクション	5,200	1,508.00	7,841,600
オーバル	3,200	456.00	1,459,200
東京精密	22,200	11,325.00	251,415,000
マニー	43,400	1,941.50	84,261,100
ニコン	156,900	1,604.50	251,746,050
トプコン	52,800	1,719.50	90,789,600
オリンパス	622,000	2,666.50	1,658,563,000
理研計器	15,400	3,815.00	58,751,000
タムロン	6,600	8,670.00	57,222,000
HOYA	213,600	19,030.00	4,064,808,000
シード	2,200	578.00	1,271,600
ノーリツ鋼機	10,300	4,380.00	45,114,000
A & Dホロンホールディングス	15,800	2,844.00	44,935,200
朝日インテック	132,300	2,271.00	300,453,300
シチズン時計	99,800	1,052.00	104,989,600
リズム	800	3,780.00	3,024,000
大研医器	3,100	539.00	1,670,900
メニコン	37,300	1,289.00	48,079,700
シンシア	400	458.00	183,200
松風	4,900	4,050.00	19,845,000
セイコーグループ	15,100	4,725.00	71,347,500
ニプロ	90,500	1,247.50	112,898,750
KYORITSU	5,400	164.00	885,600
中本パックス	1,200	1,618.00	1,941,600
パラマウントベッドホールディングス	22,600	2,921.00	66,014,600
トランザクション	7,200	1,918.00	13,809,600
粧美堂	1,000	566.00	566,000
ニホンフラッシュ	10,200	906.00	9,241,200
前田工織	9,200	3,195.00	29,394,000
永大産業	4,300	242.00	1,040,600
アートネイチャー	9,800	820.00	8,036,000
フルヤ金属	3,400	13,000.00	44,200,000
バンダイナムコホールディングス	297,300	3,072.00	913,305,600
アイフィスジャパン	1,000	591.00	591,000

SHOEI	30,500	2,049.00	62,494,500
フランスベッドホールディングス	12,900	1,191.00	15,363,900
パイロットコーポレーション	15,300	4,383.00	67,059,900
萩原工業	7,300	1,557.00	11,366,100
フジシールインターナショナル	22,000	2,354.00	51,788,000
タカラトミー	49,400	3,000.00	148,200,000
広済堂ホールディングス	24,600	634.00	15,596,400
エステールホールディングス	800	648.00	518,400
タカノ	1,300	925.00	1,202,500
プロネクサス	9,400	1,253.00	11,778,200
ホクシン	2,800	119.00	333,200
ウッドワン	1,300	923.00	1,199,900
TOPPANホールディングス	133,400	4,200.00	560,280,000
大日本印刷	112,500	4,979.00	560,137,500
共同印刷	3,100	3,660.00	11,346,000
NISSHA	18,600	1,956.00	36,381,600
光村印刷	300	1,563.00	468,900
TAKARA & COMPANY	6,400	2,819.00	18,041,600
アシックス	92,500	9,373.00	867,002,500
ツツミ	1,900	2,073.00	3,938,700
ローランド	8,000	4,090.00	32,720,000
小松ウオール工業	4,200	3,210.00	13,482,000
ヤマハ	68,400	3,646.00	249,386,400
河合楽器製作所	3,200	3,310.00	10,592,000
クリナップ	10,600	725.00	7,685,000
ピジョン	69,100	1,514.50	104,651,950
キングジム	9,600	900.00	8,640,000
リンテック	21,800	3,230.00	70,414,000
イトーキ	20,700	1,544.00	31,960,800
任天堂	685,200	8,739.00	5,987,962,800
三菱鉛筆	15,400	2,430.00	37,422,000
タカラスタANDARD	22,200	1,686.00	37,429,200
コクヨ	44,400	2,683.00	119,125,200
ナカバヤシ	11,700	540.00	6,318,000
グローブライド	9,700	2,186.00	21,204,200
オカムラ	32,700	2,209.00	72,234,300
美津濃	10,800	8,440.00	91,152,000
東京電力ホールディングス	978,300	922.50	902,481,750
中部電力	399,900	2,024.50	809,597,550
関西電力	419,100	2,829.00	1,185,633,900
中国電力	188,500	1,117.00	210,554,500
北陸電力	111,000	1,072.00	118,992,000

東北電力	285,700	1,545.00	441,406,500
四国電力	101,100	1,495.50	151,195,050
九州電力	250,200	1,782.50	445,981,500
北海道電力	104,800	1,435.50	150,440,400
沖縄電力	27,700	1,131.00	31,328,700
電源開発	89,100	2,543.00	226,581,300
エフオン	7,100	406.00	2,882,600
イーレックス	19,300	657.00	12,680,100
レノバ	29,000	1,028.00	29,812,000
東京瓦斯	211,300	3,582.00	756,876,600
大阪瓦斯	216,300	3,581.00	774,570,300
東邦瓦斯	47,000	4,002.00	188,094,000
北海道瓦斯	6,500	3,525.00	22,912,500
広島ガス	22,900	383.00	8,770,700
西部ガスホールディングス	11,200	2,002.00	22,422,400
静岡ガス	21,600	948.00	20,476,800
メタウォーター	13,000	1,938.00	25,194,000
SBSホールディングス	9,700	2,685.00	26,044,500
東武鉄道	119,200	2,758.50	328,813,200
相鉄ホールディングス	38,800	2,435.50	94,497,400
東急	304,300	1,848.00	562,346,400
京浜急行電鉄	134,300	1,167.00	156,728,100
小田急電鉄	179,500	1,573.50	282,443,250
京王電鉄	52,200	3,758.00	196,167,600
京成電鉄	70,000	5,475.00	383,250,000
富士急行	13,400	2,965.00	39,731,000
東日本旅客鉄道	598,100	2,736.00	1,636,401,600
西日本旅客鉄道	257,500	3,156.00	812,670,000
東海旅客鉄道	418,000	3,517.00	1,470,106,000
西武ホールディングス	131,300	2,366.50	310,721,450
鴻池運輸	18,500	2,346.00	43,401,000
西日本鉄道	29,000	2,541.00	73,689,000
ハマキョウレックス	8,800	4,075.00	35,860,000
サカイ引越センター	12,000	2,392.00	28,704,000
近鉄グループホールディングス	108,300	3,402.00	368,436,600
阪急阪神ホールディングス	144,500	4,181.00	604,154,500
南海電気鉄道	48,300	2,662.50	128,598,750
京阪ホールディングス	59,700	2,931.00	174,980,700
神戸電鉄	2,900	2,740.00	7,946,000
名古屋鉄道	111,800	1,774.00	198,333,200
山陽電気鉄道	8,200	2,078.00	17,039,600
アルプス物流	8,600	5,680.00	48,848,000

ヤマトホールディングス	131,700	1,744.00	229,684,800
山九	27,600	5,668.00	156,436,800
丸運	2,100	403.00	846,300
丸全昭和運輸	6,700	5,120.00	34,304,000
センコーグループホールディングス	57,400	1,132.00	64,976,800
トナミホールディングス	2,400	5,560.00	13,344,000
ニッコンホールディングス	33,400	2,955.00	98,697,000
日本石油輸送	400	3,030.00	1,212,000
福山通運	12,400	3,765.00	46,686,000
セイノーホールディングス	60,900	2,071.50	126,154,350
エスライングループ本社	1,000	1,473.00	1,473,000
神奈川中央交通	3,100	3,020.00	9,362,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	27,700	1,200.00	33,240,000
C & F ロジホールディングス	10,400	5,730.00	59,592,000
九州旅客鉄道	76,600	3,558.00	272,542,800
S Gホールディングス	181,900	1,492.50	271,485,750
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	36,800	7,645.00	281,336,000
日本郵船	281,000	4,950.00	1,390,950,000
商船三井	235,400	5,116.00	1,204,306,400
川崎汽船	261,200	2,423.00	632,887,600
N S ユナイテッド海運	5,900	5,030.00	29,677,000
飯野海運	40,100	1,276.00	51,167,600
共栄タンカー	1,000	1,228.00	1,228,000
乾汽船	13,100	1,114.00	14,593,400
日本航空	266,100	2,625.00	698,512,500
A N Aホールディングス	294,800	2,989.00	881,157,200
パスコ	700	1,810.00	1,267,000
ランコム	3,100	6,300.00	19,530,000
日新	8,200	4,480.00	36,736,000
三菱倉庫	26,600	5,410.00	143,906,000
三井倉庫ホールディングス	10,100	4,470.00	45,147,000
住友倉庫	28,900	2,621.00	75,746,900
澁澤倉庫	4,600	3,110.00	14,306,000
東陽倉庫	1,000	1,499.00	1,499,000
日本トランスシティ	21,800	998.00	21,756,400
ケイヒン	600	2,249.00	1,349,400
中央倉庫	5,400	1,246.00	6,728,400
川西倉庫	700	1,208.00	845,600
安田倉庫	7,400	1,783.00	13,194,200
ファイズホールディングス	500	1,052.00	526,000
東洋埠頭	1,000	1,383.00	1,383,000
上組	50,000	3,315.00	165,750,000

サンリツ	900	911.00	819,900
キムラユニティー	1,700	1,724.00	2,930,800
キューソー流通システム	4,200	1,618.00	6,795,600
東海運	2,100	294.00	617,400
エーアイティー	6,800	1,831.00	12,450,800
内外トランスライン	4,300	2,692.00	11,575,600
日本コンセプト	3,900	1,927.00	7,515,300
NEC ネットエスアイ	42,400	2,206.00	93,534,400
クロスキャット	6,400	1,330.00	8,512,000
システナ	164,700	291.00	47,927,700
デジタルアーツ	6,900	3,605.00	24,874,500
日鉄ソリューションズ	18,600	5,090.00	94,674,000
キューブシステム	5,800	1,118.00	6,484,400
コア	4,800	1,892.00	9,081,600
手間いらず	1,800	2,986.00	5,374,800
ラクーンホールディングス	8,100	632.00	5,119,200
ソリトンシステムズ	5,600	1,164.00	6,518,400
ソフトクリエイティブホールディングス	9,000	2,040.00	18,360,000
T I S	115,000	2,970.00	341,550,000
テクミラホールディングス	1,700	395.00	671,500
グリー	29,400	521.00	15,317,400
GMOペパボ	1,300	1,428.00	1,856,400
コーエーテクモホールディングス	68,200	1,398.50	95,377,700
三菱総合研究所	5,300	4,725.00	25,042,500
電算	400	1,486.00	594,400
A G S	1,500	1,026.00	1,539,000
ファインデックス	8,700	1,044.00	9,082,800
ブレインパッド	8,200	1,076.00	8,823,200
K L a b	20,000	223.00	4,460,000
ポルトゥウィンホールディングス	18,600	483.00	8,983,800
ネクソン	238,800	2,757.50	658,491,000
アイスタイル	32,500	465.00	15,112,500
エムアップホールディングス	13,300	1,300.00	17,290,000
エイチーム	6,500	710.00	4,615,000
エニグモ	13,900	342.00	4,753,800
テクノスジャパン	3,200	645.00	2,064,000
コロブラ	37,000	618.00	22,866,000
ブロードリーフ	51,700	536.00	27,711,200
クロス・マーケティンググループ	1,700	596.00	1,013,200
デジタルハーツホールディングス	6,800	1,095.00	7,446,000
メディアドゥ	4,800	1,452.00	6,969,600
じげん	31,800	642.00	20,415,600

ブイキューブ	13,100	247.00	3,235,700
エンカレッジ・テクノロジー	900	611.00	549,900
サイバーリンクス	1,400	737.00	1,031,800
フィックスターズ	10,900	1,849.00	20,154,100
CARTA HOLDINGS	5,100	1,608.00	8,200,800
オブティム	9,900	670.00	6,633,000
セレス	4,400	1,888.00	8,307,200
SHIFT	7,200	14,775.00	106,380,000
ティーガイア	11,400	1,940.00	22,116,000
セック	1,200	4,335.00	5,202,000
テクマトリックス	19,900	1,956.00	38,924,400
プロシップ	4,900	1,401.00	6,864,900
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	28,300	2,747.00	77,740,100
GMOペイメントゲートウェイ	24,900	7,166.00	178,433,400
ザッパラス	900	439.00	395,100
システムリサーチ	7,000	1,551.00	10,857,000
インターネットイニシアティブ	52,000	2,205.50	114,686,000
さくらインターネット	12,200	5,220.00	63,684,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,300	2,981.00	9,837,300
SRAホールディングス	5,600	4,075.00	22,820,000
システムインテグレータ	1,100	373.00	410,300
朝日ネット	11,700	655.00	7,663,500
eBASE	15,300	688.00	10,526,400
アバントグループ	13,800	1,296.00	17,884,800
アドソル日進	4,600	1,718.00	7,902,800
ODKソリューションズ	700	598.00	418,600
フリービット	4,800	1,402.00	6,729,600
コムチュア	15,700	1,825.00	28,652,500
アステリア	8,500	542.00	4,607,000
アイル	5,100	2,319.00	11,826,900
マークラインズ	5,900	2,920.00	17,228,000
メディカル・データ・ビジョン	13,000	515.00	6,695,000
gumi	16,200	341.00	5,524,200
ショーケース	900	305.00	274,500
モバイルファクトリー	800	679.00	543,200
テラスカイ	4,700	1,920.00	9,024,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,700	1,790.00	10,203,000
PCIホールディングス	1,500	973.00	1,459,500
アイビーシー	600	461.00	276,600
ネオジャパン	3,600	1,440.00	5,184,000
PR TIMES	2,200	1,795.00	3,949,000
ラクス	51,500	1,755.00	90,382,500

ランドコンピュータ	1,800	816.00	1,468,800
ダブルスタンダード	3,300	1,756.00	5,794,800
オープンドア	6,400	589.00	3,769,600
アカツキ	5,200	2,144.00	11,148,800
ベネフィットジャパン	300	1,191.00	357,300
U b i c o mホールディングス	3,400	1,258.00	4,277,200
カナミックネットワーク	11,800	545.00	6,431,000
ノムラシステムコーポレーション	4,000	130.00	520,000
チェンジホールディングス	23,700	1,254.00	29,719,800
シンクロ・フード	2,300	529.00	1,216,700
オークネット	4,000	2,458.00	9,832,000
キャピタル・アセット・プランニング	700	851.00	595,700
セグエグループ	3,300	614.00	2,026,200
エイトレッド	600	1,530.00	918,000
マクロミル	21,400	854.00	18,275,600
ビーグリー	800	1,087.00	869,600
オロ	3,900	2,582.00	10,069,800
ユーザーローカル	4,000	2,050.00	8,200,000
テモナ	900	215.00	193,500
ニーズウェル	4,000	395.00	1,580,000
マネーフォワード	24,300	5,042.00	122,520,600
サインポスト	1,400	664.00	929,600
S u n A s t e r i s k	7,700	877.00	6,752,900
プラスアルファ・コンサルティング	13,700	1,822.00	24,961,400
電算システムホールディングス	4,800	2,577.00	12,369,600
A p p i e r G r o u p	37,300	1,242.00	46,326,600
ビジョナル	12,700	7,910.00	100,457,000
ソルクシーズ	3,000	316.00	948,000
フェイス	1,000	431.00	431,000
プロトコーポレーション	11,900	1,353.00	16,100,700
ハイマックス	3,400	1,358.00	4,617,200
野村総合研究所	235,700	4,225.00	995,832,500
C Eホールディングス	1,700	580.00	986,000
日本システム技術	6,800	1,573.00	10,696,400
インテージホールディングス	12,300	1,449.00	17,822,700
東邦システムサイエンス	3,300	1,463.00	4,827,900
ソースネクスト	49,900	201.00	10,029,900
インフォコム	14,000	5,510.00	77,140,000
シンプレクス・ホールディングス	16,500	2,919.00	48,163,500
H E R O Z	3,700	1,364.00	5,046,800
ラクスル	26,300	924.00	24,301,200
メルカリ	53,100	2,123.00	112,731,300

I P S	3,100	2,165.00	6,711,500
F I G	4,200	334.00	1,402,800
システムサポート	4,200	1,864.00	7,828,800
イーソル	7,900	848.00	6,699,200
東海ソフト	600	1,280.00	768,000
ウイングアーク1st	11,300	2,702.00	30,532,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,900	929.00	2,694,100
サーバーワークス	2,200	3,105.00	6,831,000
東名	400	2,352.00	940,800
ヴィッツ	400	789.00	315,600
トピラシステムズ	1,000	775.00	775,000
Sansan	35,700	1,603.00	57,227,100
Link-Uグループ	700	657.00	459,900
ギフトィ	9,600	1,077.00	10,339,200
メドレー	14,600	3,540.00	51,684,000
ベース	3,800	2,815.00	10,697,000
JMDC	18,600	3,180.00	59,148,000
フォーカスシステムズ	7,300	1,116.00	8,146,800
クレスコ	8,700	2,283.00	19,862,100
フジ・メディア・ホールディングス	104,600	1,823.50	190,738,100
オービック	36,400	20,265.00	737,646,000
ジャストシステム	15,600	2,773.00	43,258,800
TDCソフト	19,200	1,038.00	19,929,600
LINEヤフー	1,549,700	377.80	585,476,660
トレンドマイクロ	51,500	7,118.00	366,577,000
IDホールディングス	7,300	1,462.00	10,672,600
日本オラクル	20,800	11,405.00	237,224,000
アルファシステムズ	2,900	2,947.00	8,546,300
フューチャー	23,200	1,495.00	34,684,000
CAC Holdings	5,800	1,952.00	11,321,600
SBテクノロジー	4,600	2,938.00	13,514,800
トーセ	1,100	690.00	759,000
オービックビジネスコンサルタント	15,300	6,292.00	96,267,600
アイティフォー	13,900	1,405.00	19,529,500
東計電算	3,000	3,735.00	11,205,000
エクスネット	500	1,504.00	752,000
大塚商会	108,000	2,903.00	313,524,000
サイボウズ	15,000	1,844.00	27,660,000
電通総研	13,200	5,250.00	69,300,000
ACCESS	11,300	1,384.00	15,639,200
デジタルガレージ	17,400	2,370.00	41,238,000
EMシステムズ	18,200	629.00	11,447,800



ウェザーニューズ	3,400	4,465.00	15,181,000
C I J	27,100	456.00	12,357,600
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,555.00	6,399,000
日本エンタープライズ	3,800	133.00	505,400
WOWOW	8,200	1,098.00	9,003,600
スカラ	10,100	719.00	7,261,900
インテリジェント ウェイブ	1,900	1,053.00	2,000,700
ANYCOLOR	15,400	2,361.00	36,359,400
I M A G I C A G R O U P	10,900	530.00	5,777,000
ネットワンシステムズ	42,400	2,773.00	117,575,200
システムソフト	38,000	61.00	2,318,000
アルゴグラフィックス	10,000	4,455.00	44,550,000
マーベラス	17,700	642.00	11,363,400
エイベックス	18,500	1,217.00	22,514,500
B I P R O G Y	35,600	4,249.00	151,264,400
都築電気	5,700	2,324.00	13,246,800
T B S ホールディングス	54,700	3,865.00	211,415,500
日本テレビホールディングス	96,400	2,183.50	210,489,400
朝日放送グループホールディングス	10,200	669.00	6,823,800
テレビ朝日ホールディングス	26,400	2,059.00	54,357,600
スカパーJ S A Tホールディングス	84,500	898.00	75,881,000
テレビ東京ホールディングス	7,800	3,170.00	24,726,000
日本BS放送	1,300	903.00	1,173,900
ビジョン	16,400	1,197.00	19,630,800
スマートバリュー	1,100	391.00	430,100
U - N E X T H O L D I N G S	12,200	4,775.00	58,255,000
ワイヤレスゲート	1,600	234.00	374,400
日本通信	107,200	184.00	19,724,800
クロップス	500	1,149.00	574,500
日本電信電話	32,376,200	151.20	4,895,281,440
K D D I	841,100	4,299.00	3,615,888,900
ソフトバンク	1,737,200	1,959.50	3,404,043,400
光通信	11,000	27,765.00	305,415,000
エムティーアイ	7,500	847.00	6,352,500
G M O インターネットグループ	39,900	2,422.00	96,637,800
ファイバーゲート	5,900	1,174.00	6,926,600
アйдママーケティングコミュニケーション	1,000	229.00	229,000
K A D O K A W A	57,500	3,233.00	185,897,500
学研ホールディングス	18,200	989.00	17,999,800
ゼンリン	18,600	912.00	16,963,200
昭文社ホールディングス	1,600	364.00	582,400
インプレスホールディングス	3,700	160.00	592,000

アイネット	6,600	2,212.00	14,599,200
松竹	5,700	9,730.00	55,461,000
東宝	60,500	5,133.00	310,546,500
東映	18,000	3,850.00	69,300,000
N T Tデータグループ	284,600	2,374.50	675,782,700
ピー・シー・エー	6,300	2,225.00	14,017,500
ビジネスブレイン太田昭和	4,300	2,137.00	9,189,100
D T S	22,800	4,255.00	97,014,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	49,700	4,693.00	233,242,100
シーイーシー	13,700	2,055.00	28,153,500
カブコン	194,700	2,976.50	579,524,550
アイ・エス・ピー	5,600	1,409.00	7,890,400
S C S K	76,200	3,076.00	234,391,200
N S W	4,400	3,160.00	13,904,000
アイネス	8,100	1,681.00	13,616,100
T K C	17,300	3,265.00	56,484,500
富士ソフト	21,900	6,650.00	145,635,000
N S D	38,400	3,035.00	116,544,000
コナミグループ	40,800	11,280.00	460,224,000
福井コンピュータホールディングス	6,700	2,453.00	16,435,100
J B C Cホールディングス	7,200	3,150.00	22,680,000
ミロク情報サービス	9,900	1,819.00	18,008,100
ソフトバンクグループ	536,900	9,724.00	5,220,815,600
リョーサン菱洋ホールディングス	21,500	2,949.00	63,403,500
高千穂交易	3,000	3,765.00	11,295,000
オルバヘルスケアホールディングス	600	2,145.00	1,287,000
伊藤忠食品	2,600	7,190.00	18,694,000
エレマテック	10,300	1,985.00	20,445,500
あらた	17,600	3,260.00	57,376,000
トーメンデバイス	1,700	7,120.00	12,104,000
東京エレクトロン デバイス	11,400	4,370.00	49,818,000
円谷フィールズホールディングス	19,700	1,586.00	31,244,200
双日	127,800	3,964.00	506,599,200
アルフレッサ ホールディングス	115,300	2,191.00	252,622,300
横浜冷凍	28,900	1,031.00	29,795,900
ラサ商事	4,000	1,763.00	7,052,000
アルコニックス	15,100	1,463.00	22,091,300
神戸物産	88,800	3,452.00	306,537,600
ハイパー	900	300.00	270,000
あい ホールディングス	18,400	2,328.00	42,835,200
ディーブイエックス	1,100	1,002.00	1,102,200
ダイワボウホールディングス	50,800	2,760.00	140,208,000

マクニカホールディングス	27,200	6,661.00	181,179,200
ラクト・ジャパン	4,500	2,898.00	13,041,000
グリムス	4,800	2,483.00	11,918,400
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15,200	1,294.00	19,668,800
八洲電機	9,300	1,554.00	14,452,200
メディアスホールディングス	6,700	966.00	6,472,200
レスター	9,800	3,055.00	29,939,000
ジオリーブグループ	900	1,191.00	1,071,900
大光	2,000	609.00	1,218,000
OCHIホールディングス	900	1,445.00	1,300,500
TOKAIホールディングス	62,400	968.00	60,403,200
黒谷	1,100	684.00	752,400
Cominix	800	870.00	696,000
三洋貿易	11,800	1,532.00	18,077,600
ビューティガレージ	3,600	2,069.00	7,448,400
ウイン・パートナーズ	7,400	1,207.00	8,931,800
ミタチ産業	1,100	1,105.00	1,215,500
シップヘルスケアホールディングス	41,300	2,451.50	101,246,950
明治電機工業	4,300	1,650.00	7,095,000
デリカフーズホールディングス	1,700	571.00	970,700
スターティアホールディングス	1,000	2,057.00	2,057,000
コメダホールディングス	28,200	2,691.00	75,886,200
ピーバンドットコム	500	372.00	186,000
アセンテック	4,400	601.00	2,644,400
富士興産	1,100	1,722.00	1,894,200
協栄産業	400	2,895.00	1,158,000
フルサト・マルカホールディングス	10,200	2,153.00	21,960,600
ヤマエグループホールディングス	6,500	2,425.00	15,762,500
小野建	11,300	1,600.00	18,080,000
南陽	1,600	1,128.00	1,804,800
佐島電機	5,600	2,032.00	11,379,200
エコートレーディング	700	1,323.00	926,100
伯東	6,600	5,120.00	33,792,000
コンドーテック	8,800	1,379.00	12,135,200
中山福	2,100	375.00	787,500
ナガイレーベン	14,500	2,501.00	36,264,500
三菱食品	10,600	5,150.00	54,590,000
松田産業	8,700	2,768.00	24,081,600
第一興商	44,400	1,650.00	73,260,000
メディバルホールディングス	116,800	2,343.50	273,720,800
S P K	5,100	2,230.00	11,373,000
萩原電気ホールディングス	4,900	4,035.00	19,771,500

アズワン	35,600	2,743.50	97,668,600
スズデン	4,000	1,925.00	7,700,000
尾家産業	900	1,952.00	1,756,800
シモジマ	7,700	1,295.00	9,971,500
ドウシシャ	10,600	2,223.00	23,563,800
小津産業	900	1,630.00	1,467,000
高速	6,100	2,277.00	13,889,700
たけびし	4,400	2,142.00	9,424,800
リックス	1,600	2,992.00	4,787,200
丸文	10,300	1,254.00	12,916,200
ハピネット	9,800	3,650.00	35,770,000
橋本総業ホールディングス	4,500	1,397.00	6,286,500
日本ライフライン	30,800	1,105.00	34,034,000
タカショー	10,000	506.00	5,060,000
I D O M	30,400	1,355.00	41,192,000
進和	7,000	2,733.00	19,131,000
エスケイジャパン	900	820.00	738,000
ダイトロン	4,500	3,095.00	13,927,500
シークス	16,400	1,325.00	21,730,000
田中商事	1,100	815.00	896,500
オーハシテクニカ	5,800	1,682.00	9,755,600
白銅	3,200	2,864.00	9,164,800
ダイコー通産	400	1,198.00	479,200
伊藤忠商事	771,800	7,373.00	5,690,481,400
丸紅	952,400	3,001.00	2,858,152,400
高島	2,600	1,051.00	2,732,600
長瀬産業	52,600	2,967.50	156,090,500
蝶理	6,600	3,545.00	23,397,000
豊田通商	100,600	9,320.00	937,592,000
三共生興	15,900	729.00	11,591,100
兼松	48,000	2,721.00	130,608,000
ツカモトコーポレーション	500	1,210.00	605,000
三井物産	860,000	7,712.00	6,632,320,000
日本紙パルプ商事	5,500	6,300.00	34,650,000
カメイ	12,200	2,107.00	25,705,400
東都水産	300	6,410.00	1,923,000
O U G ホールディングス	600	2,692.00	1,615,200
スターゼン	7,900	2,831.00	22,364,900
山善	34,800	1,402.00	48,789,600
椿本興業	5,700	2,220.00	12,654,000
住友商事	694,900	4,059.00	2,820,599,100
内田洋行	4,700	7,370.00	34,639,000

三菱商事	2,204,800	3,260.00	7,187,648,000
第一実業	10,800	2,286.00	24,688,800
キヤノンマーケティングジャパン	26,600	4,415.00	117,439,000
西華産業	4,500	4,220.00	18,990,000
佐藤商事	8,000	1,644.00	13,152,000
東京産業	10,500	655.00	6,877,500
ユアサ商事	9,000	5,520.00	49,680,000
神鋼商事	2,900	7,010.00	20,329,000
トルク	2,800	238.00	666,400
阪和興業	20,600	6,240.00	128,544,000
正栄食品工業	7,600	4,475.00	34,010,000
カナデン	8,000	1,597.00	12,776,000
R Y O D E N	9,300	2,631.00	24,468,300
岩谷産業	26,100	9,418.00	245,809,800
ナイス	1,200	1,822.00	2,186,400
ニチモウ	1,200	2,094.00	2,512,800
極東貿易	6,900	1,712.00	11,812,800
アステナホールディングス	21,600	487.00	10,519,200
三愛オブリ	26,800	2,127.00	57,003,600
稲畑産業	22,700	3,355.00	76,158,500
G S I クレオス	6,200	2,179.00	13,509,800
明和産業	13,600	719.00	9,778,400
クワザワホールディングス	1,400	894.00	1,251,600
ワキタ	19,000	1,713.00	32,547,000
東邦ホールディングス	31,000	3,876.00	120,156,000
サンゲツ	26,400	3,045.00	80,388,000
ミツウロコグループホールディングス	14,700	1,513.00	22,241,100
シナネンホールディングス	3,200	4,735.00	15,152,000
伊藤忠エネクス	28,500	1,533.00	43,690,500
サンリオ	93,300	2,681.00	250,137,300
サンワテクノス	5,900	2,252.00	13,286,800
新光商事	15,400	947.00	14,583,800
トーヨー	4,500	3,130.00	14,085,000
三信電気	4,600	2,125.00	9,775,000
東陽テクニカ	10,600	1,613.00	17,097,800
モスフードサービス	16,900	3,525.00	59,572,500
加賀電子	10,500	5,730.00	60,165,000
ソーダニッカ	6,000	1,092.00	6,552,000
立花エレテック	7,600	3,045.00	23,142,000
フォーバル	4,500	1,400.00	6,300,000
P A L T A C	15,500	4,202.00	65,131,000
三谷産業	20,100	356.00	7,155,600

西本Wismettacホールディングス	2,900	4,210.00	12,209,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	300	2,630.00	789,000	
コア商事ホールディングス	6,500	689.00	4,478,500	
KPPグループホールディングス	29,700	822.00	24,413,400	
ヤマタネ	5,100	2,776.00	14,157,600	
丸紅建材リース	300	3,115.00	934,500	
泉州電業	7,100	5,130.00	36,423,000	
トラスコ中山	24,100	2,367.00	57,044,700	
オートバックスセブン	40,000	1,541.00	61,640,000	
モリト	8,200	1,445.00	11,849,000	
加藤産業	14,200	4,190.00	59,498,000	
北恵	1,000	861.00	861,000	
イエローハット	18,200	2,150.00	39,130,000	
JKホールディングス	8,800	1,017.00	8,949,600	
日伝	7,100	3,465.00	24,601,500	
北沢産業	2,400	371.00	890,400	
杉本商事	5,200	2,435.00	12,662,000	
因幡電機産業	29,800	3,900.00	116,220,000	
東テク	11,400	2,513.00	28,648,200	
ミスミグループ本社	173,400	2,565.50	444,857,700	
アルテック	2,100	277.00	581,700	
タキヒヨー	900	1,150.00	1,035,000	
蔵王産業	700	2,573.00	1,801,100	
スズケン	41,000	4,663.00	191,183,000	
ジェコス	6,900	998.00	6,886,200	
サンエー	8,800	4,900.00	43,120,000	
カワチ薬品	9,100	2,864.00	26,062,400	
エービーシー・マート	50,300	3,010.00	151,403,000	
ハードオフコーポレーション	3,600	2,145.00	7,722,000	
アスクル	27,800	2,175.00	60,465,000	
ゲオホールディングス	13,000	1,627.00	21,151,000	
アダストリア	13,900	3,670.00	51,013,000	
くら寿司	13,500	4,440.00	59,940,000	
キャンドゥ	4,200	3,140.00	13,188,000	
IKホールディングス	1,800	385.00	693,000	
パルグループホールディングス	22,700	1,843.00	41,836,100	
エディオン	45,600	1,582.00	72,139,200	
サーラコーポレーション	24,400	816.00	19,910,400	
ワッツ	2,000	688.00	1,376,000	
ハローズ	5,300	4,255.00	22,551,500	
あみやき亭	2,800	6,130.00	17,164,000	
大黒天物産	3,600	8,370.00	30,132,000	

ハニーズホールディングス	9,300	1,575.00	14,647,500
ファーマライズホールディングス	1,200	640.00	768,000
アルペン	9,600	2,041.00	19,593,600
ハブ	1,500	870.00	1,305,000
クオールホールディングス	15,900	1,451.00	23,070,900
ジーンズホールディングス	6,900	3,845.00	26,530,500
ビックカメラ	68,900	1,609.00	110,860,100
D C Mホールディングス	60,800	1,561.00	94,908,800
MonotaRO	162,900	1,641.50	267,400,350
東京一番フーズ	1,600	512.00	819,200
きちりホールディングス	1,100	923.00	1,015,300
J.フロント リテイリング	131,900	1,664.00	219,481,600
ドトール・日レスホールディングス	20,500	2,185.00	44,792,500
マツキヨココカラ&カンパニー	209,000	2,144.50	448,200,500
ブロンコビリー	6,800	4,060.00	27,608,000
Z O Z O	73,200	3,757.00	275,012,400
トレジャー・ファクトリー	5,800	1,756.00	10,184,800
物語コーポレーション	19,200	3,405.00	65,376,000
三越伊勢丹ホールディングス	190,300	3,264.00	621,139,200
Hamee	4,300	1,356.00	5,830,800
マーケットエンタープライズ	600	861.00	516,600
ウエルシアホールディングス	59,700	2,151.00	128,414,700
クリエイティブSDホールディングス	16,300	3,420.00	55,746,000
丸善C H Iホールディングス	5,200	338.00	1,757,600
ミサワ	1,200	629.00	754,800
ティーライフ	700	1,409.00	986,300
チムニー	1,200	1,308.00	1,569,600
シュッピン	10,300	1,319.00	13,585,700
オイシックス・ラ・大地	15,600	1,265.00	19,734,000
ネクステージ	26,300	2,534.00	66,644,200
ジョイフル本田	33,500	2,110.00	70,685,000
エターナルホスピタリティグループ	4,300	3,645.00	15,673,500
ホットランド	8,900	2,555.00	22,739,500
すかいらーくホールディングス	157,100	2,260.00	355,046,000
S F Pホールディングス	5,600	2,094.00	11,726,400
綿半ホールディングス	9,000	1,646.00	14,814,000
ヨシックスホールディングス	2,000	2,830.00	5,660,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	32,300	888.00	28,682,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,600	541.00	3,029,600
B E E N O S	4,800	2,231.00	10,708,800
あさひ	10,400	1,446.00	15,038,400
日本調剤	7,700	1,414.00	10,887,800

コスモス薬品	9,800	13,045.00	127,841,000	
トーエル	2,000	820.00	1,640,000	
セブン&アイ・ホールディングス	1,175,500	2,048.00	2,407,424,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	77,700	1,123.00	87,257,100	
ツルハホールディングス	24,100	9,300.00	224,130,000	
サンマルクホールディングス	9,400	2,162.00	20,322,800	
フェリシモ	1,100	923.00	1,015,300	
トリドールホールディングス	32,300	3,650.00	117,895,000	
TOKYO BASE	13,000	310.00	4,030,000	
ウイルプラスホールディングス	1,000	1,063.00	1,063,000	
JMホールディングス	8,700	2,822.00	24,551,400	
サツドラホールディングス	1,800	873.00	1,571,400	
アレンザホールディングス	8,800	1,127.00	9,917,600	
串カツ田中ホールディングス	3,200	1,701.00	5,443,200	
バロックジャパンリミテッド	9,200	793.00	7,295,600	
クスリのアオキホールディングス	34,600	3,191.00	110,408,600	
力の源ホールディングス	5,200	1,441.00	7,493,200	
FOOD & LIFE COMPANIES	61,300	2,717.00	166,552,100	
メディカルシステムネットワーク	12,200	600.00	7,320,000	
はるやまホールディングス	2,200	590.00	1,298,000	
ノジマ	33,400	1,705.00	56,947,000	
カップ・クリエイト	18,000	1,696.00	30,528,000	
ライトオン	2,900	394.00	1,142,600	
良品計画	136,800	2,613.00	357,458,400	
パリミキホールディングス	5,400	390.00	2,106,000	
アドヴァングループ	10,000	994.00	9,940,000	
アルビス	3,800	2,635.00	10,013,000	
コナカ	4,600	286.00	1,315,600	
ハウス オブ ローゼ	600	1,588.00	952,800	
G-7ホールディングス	12,700	1,569.00	19,926,300	
イオン北海道	34,000	932.00	31,688,000	
コジマ	19,300	889.00	17,157,700	
ヒマラヤ	1,600	913.00	1,460,800	
コーナン商事	14,100	4,200.00	59,220,000	
エコス	4,400	2,288.00	10,067,200	
ワタミ	12,100	903.00	10,926,300	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	231,900	3,912.00	907,192,800	
西松屋チェーン	22,700	2,290.00	51,983,000	
ゼンショーホールディングス	58,500	6,179.00	361,471,500	
幸楽苑ホールディングス	8,000	1,330.00	10,640,000	



ハークスレイ	1,400	817.00	1,143,800
サイゼリヤ	17,000	5,430.00	92,310,000
V Tホールディングス	44,200	495.00	21,879,000
魚力	3,800	2,404.00	9,135,200
フジ・コーポレーション	5,600	1,902.00	10,651,200
ユナイテッドアローズ	13,600	1,853.00	25,200,800
ハイデイ日高	17,100	3,055.00	52,240,500
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	3,700	134.00	495,800
コロワイド	49,400	2,041.50	100,850,100
巻番屋	45,600	1,150.00	52,440,000
P L A N T	1,000	1,544.00	1,544,000
スギホールディングス	69,500	2,431.00	168,954,500
薬王堂ホールディングス	5,700	2,800.00	15,960,000
スクロール	17,300	1,074.00	18,580,200
ヨンドシーホールディングス	10,600	1,913.00	20,277,800
木曽路	17,500	2,548.00	44,590,000
S R S ホールディングス	19,100	1,243.00	23,741,300
千趣会	21,100	334.00	7,047,400
リテールパートナーズ	17,200	1,670.00	28,724,000
上新電機	10,900	2,576.00	28,078,400
日本瓦斯	60,900	2,402.00	146,281,800
ロイヤルホールディングス	20,200	2,628.00	53,085,600
いなげや	11,200	1,255.00	14,056,000
チヨダ	11,200	904.00	10,124,800
ライフコーポレーション	12,100	4,150.00	50,215,000
リンガーハット	14,800	2,355.00	34,854,000
M r M a x H D	14,800	666.00	9,856,800
A O K I ホールディングス	23,600	1,261.00	29,759,600
オークワ	16,600	950.00	15,770,000
コメリ	17,700	3,670.00	64,959,000
青山商事	24,700	1,532.00	37,840,400
しまむら	27,000	7,472.00	201,744,000
はせがわ	2,500	345.00	862,500
高島屋	73,200	2,733.00	200,055,600
松屋	19,500	1,037.00	20,221,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	50,800	2,468.00	125,374,400
近鉄百貨店	5,000	2,305.00	11,525,000
丸井グループ	76,200	2,315.00	176,403,000
アクシアル リテイリング	31,600	1,006.00	31,789,600
イオン	389,300	3,535.00	1,376,175,500
イズミ	20,400	3,317.00	67,666,800
平和堂	19,200	2,316.00	44,467,200

フジ	17,700	1,997.00	35,346,900
ヤオコー	13,100	9,210.00	120,651,000
ゼビオホールディングス	15,800	1,147.00	18,122,600
ケーズホールディングス	77,300	1,426.50	110,268,450
Olympicグループ	2,200	544.00	1,196,800
日産東京販売ホールディングス	6,100	527.00	3,214,700
シルバーライフ	2,500	934.00	2,335,000
Genky DrugStores	5,100	5,970.00	30,447,000
ナルミヤ・インターナショナル	800	1,320.00	1,056,000
ブックオフグループホールディングス	5,800	1,594.00	9,245,200
ギフトホールディングス	4,900	3,060.00	14,994,000
アインホールディングス	15,900	6,087.00	96,783,300
元気寿司	6,600	3,280.00	21,648,000
ヤマダホールディングス	353,700	434.70	153,753,390
アークランズ	34,300	1,958.00	67,159,400
ニトリホールディングス	41,800	17,105.00	714,989,000
グルメ杵屋	9,500	1,109.00	10,535,500
愛眼	2,800	179.00	501,200
ケーユーホールディングス	5,600	1,267.00	7,095,200
吉野家ホールディングス	42,400	2,985.00	126,564,000
松屋フーズホールディングス	5,500	5,620.00	30,910,000
サガミホールディングス	17,400	1,571.00	27,335,400
関西フードマーケット	7,900	2,567.00	20,279,300
王将フードサービス	8,500	8,570.00	72,845,000
ミニストップ	8,400	1,641.00	13,784,400
アークス	21,100	2,937.00	61,970,700
パローホールディングス	22,000	2,366.00	52,052,000
ベルク	5,700	7,360.00	41,952,000
大庄	4,700	1,243.00	5,842,100
ファーストリテイリング	64,600	41,490.00	2,680,254,000
サンドラッグ	38,800	3,941.00	152,910,800
サクスパー ホールディングス	10,000	796.00	7,960,000
ヤマザワ	1,000	1,265.00	1,265,000
やまや	900	3,105.00	2,794,500
ベルーナ	28,000	745.00	20,860,000
いよぎんホールディングス	127,200	1,433.00	182,277,600
しずおかフィナンシャルグループ	237,500	1,551.00	368,362,500
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	90,000	1,639.50	147,555,000
楽天銀行	49,600	2,866.00	142,153,600
京都フィナンシャルグループ	135,400	2,681.00	363,007,400
島根銀行	1,000	565.00	565,000
じもとホールディングス	3,100	400.00	1,240,000

めぶきフィナンシャルグループ	495,300	606.50	300,399,450
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,700	4,725.00	64,732,500
九州フィナンシャルグループ	206,900	984.20	203,630,980
ゆうちょ銀行	1,174,500	1,536.00	1,804,032,000
富山第一銀行	33,900	1,190.00	40,341,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	573,500	919.10	527,103,850
西日本フィナンシャルホールディングス	59,800	1,992.00	119,121,600
三十三フィナンシャルグループ	9,600	2,169.00	20,822,400
第四北越フィナンシャルグループ	16,800	4,895.00	82,236,000
ひろぎんホールディングス	152,100	1,230.50	187,159,050
おきなわフィナンシャルグループ	9,100	2,538.00	23,095,800
十六フィナンシャルグループ	13,900	4,665.00	64,843,500
北國フィナンシャルホールディングス	11,300	5,200.00	58,760,000
プロクレアホールディングス	12,200	1,838.00	22,423,600
あいちフィナンシャルグループ	21,900	2,728.00	59,743,200
あおぞら銀行	76,800	2,377.50	182,592,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,509,200	1,649.50	10,736,925,400
りそなホールディングス	1,236,100	1,047.50	1,294,814,750
三井住友トラスト・ホールディングス	383,500	3,634.00	1,393,639,000
三井住友フィナンシャルグループ	749,300	10,365.00	7,766,494,500
千葉銀行	297,900	1,429.50	425,848,050
群馬銀行	207,400	1,010.50	209,577,700
武蔵野銀行	14,400	3,205.00	46,152,000
千葉興業銀行	17,800	1,007.00	17,924,600
筑波銀行	46,900	314.00	14,726,600
七十七銀行	31,100	4,310.00	134,041,000
秋田銀行	7,200	2,548.00	18,345,600
山形銀行	11,900	1,140.00	13,566,000
岩手銀行	6,800	2,789.00	18,965,200
東邦銀行	84,500	317.00	26,786,500
東北銀行	1,700	1,200.00	2,040,000
ふくおかフィナンシャルグループ	93,100	4,346.00	404,612,600
スルガ銀行	80,100	1,089.00	87,228,900
八十二銀行	229,400	1,025.00	235,135,000
山梨中央銀行	12,000	1,981.00	23,772,000
大垣共立銀行	20,400	2,214.00	45,165,600
福井銀行	9,600	2,076.00	19,929,600
清水銀行	4,300	1,667.00	7,168,100
富山銀行	600	1,773.00	1,063,800
滋賀銀行	17,800	4,465.00	79,477,000
南都銀行	16,100	3,415.00	54,981,500
百五銀行	100,600	677.00	68,106,200

紀陽銀行	38,200	1,888.00	72,121,600
ほくほくフィナンシャルグループ	66,100	2,093.00	138,347,300
山陰合同銀行	66,900	1,418.00	94,864,200
鳥取銀行	1,200	1,401.00	1,681,200
百十四銀行	10,500	3,280.00	34,440,000
四国銀行	15,700	1,141.00	17,913,700
阿波銀行	15,000	2,797.00	41,955,000
大分銀行	6,400	3,405.00	21,792,000
宮崎銀行	6,400	3,435.00	21,984,000
佐賀銀行	6,300	2,615.00	16,474,500
琉球銀行	22,700	1,261.00	28,624,700
セブン銀行	335,000	264.30	88,540,500
みずほフィナンシャルグループ	1,442,700	3,147.00	4,540,176,900
高知銀行	1,200	950.00	1,140,000
山口フィナンシャルグループ	104,800	1,787.00	187,277,600
名古屋銀行	6,800	7,190.00	48,892,000
北洋銀行	162,000	558.00	90,396,000
大光銀行	1,100	1,668.00	1,834,800
愛媛銀行	14,400	1,279.00	18,417,600
トマト銀行	1,300	1,235.00	1,605,500
京葉銀行	44,000	885.00	38,940,000
栃木銀行	53,400	366.00	19,544,400
北日本銀行	3,500	2,641.00	9,243,500
東和銀行	19,600	703.00	13,778,800
福島銀行	3,700	270.00	999,000
大東銀行	1,500	752.00	1,128,000
トモニホールディングス	87,300	411.00	35,880,300
フィデアホールディングス	11,000	1,614.00	17,754,000
池田泉州ホールディングス	148,300	407.00	60,358,100
F P G	36,300	2,118.00	76,883,400
ジャパンインベストメントアドバイザー	17,400	1,422.00	24,742,800
マーキュリアホールディングス	1,900	874.00	1,660,600
S B I ホールディングス	171,500	4,150.00	711,725,000
ジャフコ グループ	31,900	1,832.00	58,440,800
大和証券グループ本社	828,000	1,315.00	1,088,820,000
野村ホールディングス	1,797,500	962.70	1,730,453,250
岡三証券グループ	93,900	799.00	75,026,100
丸三証券	35,600	1,013.00	36,062,800
東洋証券	28,500	402.00	11,457,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	127,000	599.00	76,073,000
光世証券	900	647.00	582,300
水戸証券	31,300	538.00	16,839,400

いちよし証券	20,100	838.00	16,843,800
松井証券	52,700	811.00	42,739,700
マネックスグループ	104,700	746.00	78,106,200
極東証券	14,300	1,473.00	21,063,900
岩井コスモホールディングス	12,200	2,252.00	27,474,400
アイザワ証券グループ	15,500	2,009.00	31,139,500
マネーパートナーズグループ	3,900	253.00	986,700
スパークス・グループ	11,900	1,717.00	20,432,300
かんぽ生命保険	108,900	2,986.50	325,229,850
F P パートナー	2,100	4,650.00	9,765,000
S O M P O ホールディングス	482,400	3,433.00	1,656,079,200
アニコム ホールディングス	36,300	645.00	23,413,500
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	717,900	3,174.00	2,278,614,600
第一生命ホールディングス	502,500	4,164.00	2,092,410,000
東京海上ホールディングス	1,043,600	5,587.00	5,830,593,200
T & D ホールディングス	287,000	2,792.50	801,447,500
アドバンスクリエイト	6,200	1,044.00	6,472,800
N E X Y Z . G r o u p	1,700	607.00	1,031,900
全国保証	28,000	5,689.00	159,292,000
あんしん保証	3,000	223.00	669,000
イントラスト	1,700	782.00	1,329,400
日本モーゲージサービス	2,600	415.00	1,079,000
C a s a	1,800	895.00	1,611,000
S B I アルヒ	10,600	856.00	9,073,600
プレミアグループ	18,200	2,148.00	39,093,600
ネットプロテクションズホールディングス	36,800	169.00	6,219,200
クレディセゾン	67,800	3,430.00	232,554,000
芙蓉総合リース	9,900	12,515.00	123,898,500
みずほリース	89,800	1,095.00	98,331,000
東京センチュリー	80,100	1,495.00	119,749,500
日本証券金融	39,500	1,668.00	65,886,000
アイフル	158,200	393.00	62,172,600
リコーリース	10,200	5,070.00	51,714,000
イオンフィナンシャルサービス	61,600	1,313.00	80,880,800
アコム	191,600	385.20	73,804,320
ジャックス	11,500	4,865.00	55,947,500
オリエントコーポレーション	35,200	1,026.00	36,115,200
オリックス	641,100	3,468.00	2,223,334,800
三菱HCキャピタル	476,600	1,039.50	495,425,700
九州リースサービス	1,700	1,094.00	1,859,800
日本取引所グループ	275,600	3,747.00	1,032,673,200
イー・ギャランティ	17,600	1,281.00	22,545,600

アサックス	2,000	838.00	1,676,000	
NECキャピタルソリューション	5,300	3,865.00	20,484,500	
robot home	31,900	180.00	5,742,000	
大東建託	39,200	16,835.00	659,932,000	
サムティホールディングス	17,200	2,532.00	43,550,400	
いちご	124,000	387.00	47,988,000	
日本駐車場開発	115,400	192.00	22,156,800	
スター・マイカ・ホールディングス	13,000	612.00	7,956,000	
SREホールディングス	4,700	4,215.00	19,810,500	
ADワークスグループ	9,000	229.00	2,061,000	
ヒューリック	249,600	1,489.50	371,779,200	
野村不動産ホールディングス	59,600	4,169.00	248,472,400	
三重交通グループホールディングス	23,600	593.00	13,994,800	
ディア・ライフ	18,700	882.00	16,493,400	
地主	8,300	2,377.00	19,729,100	
プレサンスコーポレーション	14,300	1,889.00	27,012,700	
ハウスコム	900	999.00	899,100	
JPMC	6,500	1,247.00	8,105,500	
サンセイランディック	1,400	1,023.00	1,432,200	
フージャースホールディングス	16,500	1,151.00	18,991,500	
オープンハウスグループ	39,300	4,678.00	183,845,400	
東急不動産ホールディングス	321,700	1,135.50	365,290,350	
飯田グループホールディングス	102,600	2,153.50	220,949,100	
イーランド	800	1,559.00	1,247,200	
ムゲンエステート	2,600	1,160.00	3,016,000	
And Doホールディングス	6,500	1,170.00	7,605,000	
シーアールイー	5,000	1,308.00	6,540,000	
ケイアイスター不動産	5,300	3,435.00	18,205,500	
グッドコムアセット	10,400	710.00	7,384,000	
ジェイ・エス・ビー	5,500	2,950.00	16,225,000	
ロードスターキャピタル	7,100	2,984.00	21,186,400	
テンポイノベーション	1,500	868.00	1,302,000	
フェイスネットワーク	1,200	1,649.00	1,978,800	
霞ヶ関キャピタル	4,400	15,370.00	67,628,000	
パーク24	69,600	1,649.50	114,805,200	
バラカ	3,600	2,013.00	7,246,800	
三井不動産	1,483,100	1,515.00	2,246,896,500	
三菱地所	698,800	2,652.00	1,853,217,600	
平和不動産	17,400	3,795.00	66,033,000	
東京建物	93,500	2,574.50	240,715,750	
京阪神ビルディング	19,000	1,641.00	31,179,000	
住友不動産	154,600	4,922.00	760,941,200	

テーオーシー	19,600	716.00	14,033,600
レオパレス21	106,900	511.00	54,625,900
スターツコーポレーション	15,500	3,460.00	53,630,000
フジ住宅	14,000	747.00	10,458,000
空港施設	14,400	599.00	8,625,600
明和地所	5,000	915.00	4,575,000
ゴールドクレスト	8,900	2,612.00	23,246,800
エスリード	5,100	4,180.00	21,318,000
日神グループホールディングス	17,900	525.00	9,397,500
日本エスコン	20,000	1,050.00	21,000,000
MIRARTHホールディングス	49,100	490.00	24,059,000
AVANTIA	2,400	841.00	2,018,400
イオンモール	55,600	1,932.00	107,419,200
毎日コムネット	1,800	754.00	1,357,200
ファースト住建	1,800	1,076.00	1,936,800
カチタス	29,000	1,624.00	47,096,000
トーセイ	17,900	2,423.00	43,371,700
穴吹興産	1,000	2,228.00	2,228,000
サンフロンティア不動産	16,000	1,996.00	31,936,000
FJネクストホールディングス	11,600	1,243.00	14,418,800
インテリックス	900	549.00	494,100
ランドビジネス	1,300	242.00	314,600
サンネクスタグループ	1,500	1,030.00	1,545,000
グランディハウス	7,300	589.00	4,299,700
日本空港ビルデング	37,900	5,631.00	213,414,900
明豊ファシリティワークス	2,000	883.00	1,766,000
LIFULL	28,200	167.00	4,709,400
MIXI	24,000	2,859.00	68,616,000
ジェイエイシーリクルートメント	40,500	655.00	26,527,500
日本M&Aセンターホールディングス	178,000	737.20	131,221,600
メンバーズ	4,000	840.00	3,360,000
中広	900	495.00	445,500
UTグループ	14,400	2,937.00	42,292,800
アイティメディア	4,300	1,886.00	8,109,800
ケアネット	17,400	527.00	9,169,800
E・Jホールディングス	6,600	1,764.00	11,642,400
オープンアップグループ	33,600	1,997.00	67,099,200
コシダカホールディングス	33,600	855.00	28,728,000
アルトナー	1,600	2,105.00	3,368,000
パソナグループ	13,600	2,162.00	29,403,200
CDS	1,000	1,832.00	1,832,000
リンクアンドモチベーション	32,100	455.00	14,605,500

エス・エム・エス	39,200	1,940.00	76,048,000
サニーサイドアップグループ	1,500	671.00	1,006,500
パーソルホールディングス	1,136,400	223.30	253,758,120
リニカル	2,800	402.00	1,125,600
クックパッド	31,400	190.00	5,966,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	2,000	777.00	1,554,000
学情	5,800	1,797.00	10,422,600
スタジオアリス	5,700	2,088.00	11,901,600
エプロ	1,200	824.00	988,800
N J S	2,500	3,685.00	9,212,500
総合警備保障	186,500	976.50	182,117,250
カカクコム	72,500	1,993.00	144,492,500
アイロムグループ	4,500	2,787.00	12,541,500
セントケア・ホールディング	7,700	840.00	6,468,000
サイネックス	800	735.00	588,000
ルネサンス	8,500	958.00	8,143,000
ディップ	17,100	2,744.00	46,922,400
デジタルホールディングス	5,900	1,062.00	6,265,800
新日本科学	10,300	1,385.00	14,265,500
キャリアデザインセンター	800	1,749.00	1,399,200
エムスリー	220,600	1,551.50	342,260,900
ツカダ・グローバルホールディング	2,400	490.00	1,176,000
ウェルネット	3,600	620.00	2,232,000
ワールドホールディングス	5,100	2,114.00	10,781,400
ディー・エヌ・エー	39,800	1,567.00	62,366,600
博報堂DYホールディングス	142,400	1,108.50	157,850,400
ぐるなび	21,300	318.00	6,773,400
タカミヤ	15,400	480.00	7,392,000
ファンコミュニケーションズ	16,000	412.00	6,592,000
ライク	4,200	1,532.00	6,434,400
A o b a - B B T	1,800	348.00	626,400
エスプール	32,600	315.00	10,269,000
W D B ホールディングス	5,800	1,790.00	10,382,000
ティア	2,800	460.00	1,288,000
C D G	500	1,296.00	648,000
アドウェイズ	15,700	396.00	6,217,200
バリューコマース	9,900	1,206.00	11,939,400
インフォマート	116,300	301.00	35,006,300
J P ホールディングス	28,800	542.00	15,609,600
エコナックホールディングス	4,500	128.00	576,000
C L ホールディングス	2,700	1,328.00	3,585,600
プレステージ・インターナショナル	50,700	661.00	33,512,700



アミューズ	6,400	1,606.00	10,278,400
ドリームインキュベータ	3,800	2,130.00	8,094,000
クイック	7,800	2,128.00	16,598,400
T A C	2,700	177.00	477,900
電通グループ	109,700	4,151.00	455,364,700
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,900	971.00	4,757,900
イオンファンタジー	4,100	2,300.00	9,430,000
シーティーエス	13,500	796.00	10,746,000
H . U . グループホールディングス	32,700	2,495.50	81,602,850
アルプス技研	10,700	2,534.00	27,113,800
日本空調サービス	12,100	1,016.00	12,293,600
オリエンタルランド	590,400	4,412.00	2,604,844,800
ダスキン	24,400	3,711.00	90,548,400
明光ネットワークジャパン	13,800	732.00	10,101,600
ファルコホールディングス	5,000	2,301.00	11,505,000
ラウンドワン	105,300	774.00	81,502,200
リゾートトラスト	48,500	2,452.00	118,922,000
ビー・エム・エル	13,800	2,839.00	39,178,200
リソー教育	58,000	243.00	14,094,000
早稲田アカデミー	6,300	1,598.00	10,067,400
ユー・エス・エス	250,400	1,235.50	309,369,200
東京個別指導学院	13,600	411.00	5,589,600
サイバーエージェント	246,700	954.30	235,425,810
楽天グループ	957,400	839.00	803,258,600
クリーク・アンド・リバー社	5,700	1,684.00	9,598,800
S B I グローバルアセットマネジメント	21,500	673.00	14,469,500
テー・オー・ダブリュー	22,300	362.00	8,072,600
山田コンサルティンググループ	4,900	1,983.00	9,716,700
セントラルスポーツ	4,300	2,507.00	10,780,100
フルキャストホールディングス	10,800	1,476.00	15,940,800
エン・ジャパン	18,200	2,612.00	47,538,400
リソルホールディングス	400	4,860.00	1,944,000
テクノプロ・ホールディングス	65,400	2,620.00	171,348,000
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	1,235.00	7,286,500
K e e P e r 技研	6,900	3,970.00	27,393,000
ファーストロジック	1,500	504.00	756,000
三機サービス	800	1,165.00	932,000
G u n o s y	9,100	743.00	6,761,300
デザインワン・ジャパン	2,200	146.00	321,200
イー・ガーディアン	4,400	1,898.00	8,351,200
リブセンス	2,400	222.00	532,800

ジャパンマテリアル	34,200	1,936.00	66,211,200
ベクトル	13,400	1,292.00	17,312,800
ウチヤマホールディングス	2,000	342.00	684,000
チャーム・ケア・コーポレーション	9,400	1,561.00	14,673,400
キャリアリンク	4,200	2,399.00	10,075,800
I B J	8,800	607.00	5,341,600
アサンテ	5,600	1,726.00	9,665,600
バリューHR	9,900	1,551.00	15,354,900
M & A キャピタルパートナーズ	9,100	2,068.00	18,818,800
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,400	1,054.00	4,637,600
E R I ホールディングス	1,100	2,287.00	2,515,700
アビスト	600	3,300.00	1,980,000
シグマクシス・ホールディングス	14,700	1,457.00	21,417,900
ウィルグループ	9,500	975.00	9,262,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	5,600	140.00	784,000
メドピア	9,200	600.00	5,520,000
レアジョブ	1,000	432.00	432,000
リクルートホールディングス	803,500	7,937.00	6,377,379,500
エラン	14,900	872.00	12,992,800
土木管理総合試験所	2,200	325.00	715,000
日本郵政	1,167,500	1,496.50	1,747,163,750
ベルシステム24ホールディングス	12,100	1,519.00	18,379,900
鎌倉新書	9,800	537.00	5,262,600
S M N	1,200	303.00	363,600
グローバルキッズCOMPANY	900	669.00	602,100
エアトリ	8,300	1,321.00	10,964,300
アトラエ	6,900	719.00	4,961,100
ストライク	4,800	4,200.00	20,160,000
ソラスト	31,100	461.00	14,337,100
セラク	3,600	1,125.00	4,050,000
インソース	24,400	904.00	22,057,600
ベイカレント・コンサルティング	82,000	3,171.00	260,022,000
Orchestra Holdings	2,600	1,348.00	3,504,800
アイモバイル	14,500	481.00	6,974,500
キャリアインデックス	2,100	171.00	359,100
MS - Japan	3,700	1,047.00	3,873,900
船場	900	1,239.00	1,115,100
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	36,200	2,697.00	97,631,400
フルテック	700	1,130.00	791,000
GameWith	2,100	259.00	543,900
MS & Consulting	800	606.00	484,800
エル・ティー・エス	1,400	2,111.00	2,955,400

ミダックホールディングス	6,900	1,566.00	10,805,400
キュービーネットホールディングス	5,500	1,092.00	6,006,000
オープングループ	15,800	260.00	4,108,000
スプリックス	1,300	781.00	1,015,300
マネジメントソリューションズ	4,900	1,724.00	8,447,600
プロレド・パートナーズ	3,000	639.00	1,917,000
テノ・ホールディングス	800	419.00	335,200
フロンティア・マネジメント	2,900	1,260.00	3,654,000
コプロ・ホールディングス	1,300	1,480.00	1,924,000
ギークス	800	477.00	381,600
アンビスホールディングス	24,000	2,223.00	53,352,000
カーブスホールディングス	30,700	745.00	22,871,500
フォーラムエンジニアリング	14,700	851.00	12,509,700
Fast Fitness Japan	3,900	1,323.00	5,159,700
ダイレクトマーケティングミックス	12,000	236.00	2,832,000
ポピンズ	1,800	1,246.00	2,242,800
LITALICO	8,800	1,666.00	14,660,800
コンフィデンス・インターワークス	400	1,844.00	737,600
アドバンテッジリスクマネジメント	2,200	487.00	1,071,400
リログループ	56,000	1,665.00	93,240,000
東祥	8,000	723.00	5,784,000
ID&Eホールディングス	6,800	4,235.00	28,798,000
ビーウィズ	2,400	1,816.00	4,358,400
TREホールディングス	21,500	1,189.00	25,563,500
人・夢・技術グループ	4,300	1,727.00	7,426,100
NISSOホールディングス	9,900	840.00	8,316,000
大栄環境	20,300	2,486.00	50,465,800
日本管財ホールディングス	11,800	2,615.00	30,857,000
M&A総研ホールディングス	11,900	3,450.00	41,055,000
エイチ・アイ・エス	32,500	1,766.00	57,395,000
ラックランド	5,100	1,908.00	9,730,800
共立メンテナンス	35,100	3,151.00	110,600,100
イチネンホールディングス	11,900	1,645.00	19,575,500
建設技術研究所	5,800	4,930.00	28,594,000
スペース	7,400	1,089.00	8,058,600
燦ホールディングス	10,100	1,172.00	11,837,200
スバル興業	3,000	2,638.00	7,914,000
東京テアトル	1,400	1,110.00	1,554,000
タナベコンサルティンググループ	3,200	1,044.00	3,340,800
ナガワ	3,100	7,880.00	24,428,000
東京都競馬	9,400	4,110.00	38,634,000
カナモト	17,400	2,989.00	52,008,600

ニシオホールディングス	9,500	4,075.00	38,712,500	
トランス・コスモス	13,900	3,410.00	47,399,000	
乃村工藝社	48,800	807.00	39,381,600	
藤田観光	4,500	6,230.00	28,035,000	
KNT-CTホールディングス	6,700	1,323.00	8,864,100	
トーカイ	9,900	2,168.00	21,463,200	
セコム	113,600	9,682.00	1,099,875,200	
セントラル警備保障	6,100	2,976.00	18,153,600	
丹青社	21,800	847.00	18,464,600	
メイテックグループホールディングス	38,000	3,046.00	115,748,000	
応用地質	10,500	2,644.00	27,762,000	
船井総研ホールディングス	22,400	2,210.00	49,504,000	
進学会ホールディングス	1,600	239.00	382,400	
オオバ	2,700	1,036.00	2,797,200	
いであ	1,100	2,378.00	2,615,800	
学究社	4,500	2,093.00	9,418,500	
イオンディライト	12,000	3,845.00	46,140,000	
ナック	9,800	568.00	5,566,400	
ダイセキ	22,800	3,245.00	73,986,000	
ステップ	4,100	1,909.00	7,826,900	
合 計	173,710,800		425,264,969,020	

## (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。

## 外国株式マザーファンド

## 貸借対照表

	2024年 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	8,684,060,110
コール・ローン	1,174,013,046
株式	538,282,156,012
投資信託受益証券	117,998,445
投資証券	9,926,019,428
派生商品評価勘定	356,220,879
未収入金	2,368,743
未収配当金	784,437,501
未収利息	2,164
差入委託証拠金	4,087,354,850
流動資産合計	563,414,631,178

	2024年 6月10日現在
項目	金額（円）
資産合計	563,414,631,178
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,116,845
前受金	339,520,725
未払解約金	267,634,131
流動負債合計	612,271,701
負債合計	612,271,701
純資産の部	
元本等	
元本	78,733,268,013
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	484,069,091,464
元本等合計	562,802,359,477
純資産合計	562,802,359,477
負債純資産合計	563,414,631,178

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

2024年 6月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 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 6月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	78,733,268,013口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 7,1482円 (71,482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 6月10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 6月10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。

2024年 6月10日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2024年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 6月13日
期首元本額	77,311,262,891円
期中追加設定元本額	8,344,019,841円
期中一部解約元本額	6,922,014,719円
期末元本額	78,733,268,013円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,391,100,837円
DC外国株式インデックスファンド	5,168,984,246円
DC外国株式インデックスファンドL	30,395,315,774円
DCバランスファンド30	458,546,058円
DCバランスファンド50	1,007,517,810円
DCバランスファンド70	827,149,274円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	235,623,837円
外国株式インデックスe	4,180,848,939円
インデックスコレクション（外国株式）	19,438,514,318円
インデックスコレクション（バランス株式30）	2,529,151,827円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,118,137,333円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,326,560,801円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	4,945,082,076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）	1,552,971,152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）	273,272,871円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	9,351,624円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	133,542,300円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	18,161,457円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	46,520,137円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	58,302,238円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	110,473,145円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	115,573,587円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	2,332,233,087円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	286,255,005円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	47,459,055円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	353,579,633円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	5,875,208円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	46,445,397円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	41,707,949円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	143,552,708円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	4,683,908円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	34,367,679円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	90,324,445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）	6,082,298円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

2024年 6月10日現在	

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	38,326,687,242
投資信託受益証券	2,530,603
投資証券	53,041,607
合計	38,382,259,452

(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 6月10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	13,810,480,376	-	14,150,001,101	339,520,725
合計		13,810,480,376	-	14,150,001,101	339,520,725

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2024年 6月10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	997,945,870	-	1,009,715,434	11,769,564
	アメリカドル	738,806,530	-	746,847,874	8,041,344
	ユーロ	200,835,960	-	202,986,360	2,150,400
	イギリスポンド	58,303,380	-	59,881,200	1,577,820
	売建	316,343,850	-	316,530,105	186,255
	ユーロ	25,375,650	-	25,378,905	3,255
	イギリスポンド	199,493,000	-	199,672,150	179,150
	スイスフラン	35,004,400	-	35,008,940	4,540
	ノルウェークローネ	26,335,800	-	26,328,060	7,740
	香港ドル	30,135,000	-	30,142,050	7,050
合計		1,314,289,720	-	1,326,245,539	11,583,309

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。



## 附属明細表

第1 有価証券明細表  
(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	17,739	28.85	511,770.15	
	BAKER HUGHES CO	56,594	31.64	1,790,634.16	
	CHENIERE ENERGY INC	13,711	159.59	2,188,138.49	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	5,333	88.29	470,850.57	
	CHEVRON CORP	99,356	156.08	15,507,484.48	
	CHORD ENERGY CORP	3,500	168.96	591,360.00	
	CONOCOPHILLIPS	66,583	112.00	7,457,296.00	
	COTERRA ENERGY INC	41,058	27.58	1,132,379.64	
	DEVON ENERGY CORPORATION	36,666	46.79	1,715,602.14	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	9,733	190.30	1,852,189.90	
	EOG RESOURCES INC	33,038	120.19	3,970,837.22	
	EQT CORPORATION	22,739	40.54	921,839.06	
	EXXON MOBIL	253,667	112.75	28,600,954.25	
	HALLIBURTON CO	51,295	34.08	1,748,133.60	
	HESS CORP	15,786	147.54	2,329,066.44	
	HF SINCLAIR CORP	8,443	53.25	449,589.75	
	KINDER MORGAN INC	105,760	19.62	2,075,011.20	
	MARATHON OIL CORP	36,460	27.87	1,016,140.20	
	MARATHON PETROLEUM CORP	21,104	175.10	3,695,310.40	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	38,623	59.48	2,297,296.04	
	ONEOK INC	31,717	78.65	2,494,542.05	
	OVINTIV INC	13,202	47.63	628,811.26	
	PHILLIPS 66	24,974	138.07	3,448,160.18	
	SCHLUMBERGER	78,329	44.55	3,489,556.95	
	TARGA RESOURCES CORP	11,099	118.01	1,309,792.99	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,050	582.07	611,173.50	
	VALERO ENERGY CORP	18,652	154.43	2,880,428.36	
	WILLIAMS COS	67,360	40.70	2,741,552.00	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	12,269	279.53	3,429,553.57	
	ALBEMARLE CORP	6,375	114.94	732,742.50	
	AMCOR PLC	82,838	10.01	829,208.38	
	AVERY DENNISON CORP	4,953	226.29	1,120,814.37	
	BALL CORP	17,147	68.47	1,174,055.09	
	CELANESE CORP-SERIES A	6,990	146.47	1,023,825.30	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	77.86	808,108.94	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	27,048	15.80	427,358.40	
	CORTEVA INC	40,775	52.90	2,156,997.50	

CROWN HOLDINGS INC	6,218	82.21	511,181.78
DOW INC	38,891	55.73	2,167,395.43
DUPONT DE NEMOURS INC	23,669	80.01	1,893,756.69
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,266	103.30	647,277.80
ECOLAB INC	14,774	239.19	3,533,793.06
FREEMPORT-MCMORAN INC	81,305	49.27	4,005,897.35
INT'L PAPER CO	17,345	45.21	784,167.45
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,928	98.48	1,371,629.44
LINDE PLC	27,416	433.70	11,890,319.20
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,698	96.06	1,411,889.88
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,496	550.87	1,925,841.52
MOSAIC CO/THE	18,682	28.28	528,326.96
NEWMONT CORPORATION	65,758	40.36	2,653,992.88
NUCOR CORP	14,369	161.00	2,313,409.00
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,174	183.58	949,842.92
PPG INDUSTRIES INC	12,407	128.41	1,593,182.87
RELIANCE INC	3,200	286.96	918,272.00
RPM INTERNATIONAL INC	6,687	108.14	723,132.18
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	13,583	291.95	3,965,556.85
STEEL DYNAMICS INC	9,667	125.52	1,213,401.84
VULCAN MATERIALS CO	7,535	247.59	1,865,590.65
WESTLAKE CORP	2,096	153.01	320,708.96
WESTROCK CO	14,176	51.86	735,167.36
3 M COMPANY	32,049	100.86	3,232,462.14
AECOM	7,200	85.80	617,760.00
AERCAP HOLDINGS NV	10,161	90.39	918,452.79
ALLEGION PLC	4,638	116.93	542,321.34
AMETEK INC	12,923	170.00	2,196,910.00
AXON ENTERPRISE INC	4,329	280.50	1,214,284.50
BOEING CO	32,250	190.24	6,135,240.00
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	6,900	146.28	1,009,332.00
CARLISLE COS INC	2,870	408.85	1,173,399.50
CARRIER GLOBAL CORP	47,961	62.71	3,007,634.31
CATERPILLAR	28,272	328.94	9,299,791.68
CNH INDUSTRIAL NV	57,411	10.31	591,907.41
CUMMINS INC	7,929	271.87	2,155,657.23
DEERE&CO	15,208	368.58	5,605,364.64
DOVER CORP	7,491	177.22	1,327,555.02
EATON CORP	22,922	314.83	7,216,533.26
EMCOR GROUP INC	2,930	376.00	1,101,680.00
EMERSON ELECTRIC CO	32,395	107.98	3,498,012.10
FASTENAL CO	31,790	63.89	2,031,063.10

FERGUSON PLC	11,566	198.68	2,297,932.88
FORTIVE CORP	20,480	72.75	1,489,920.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,412	65.99	423,127.88
GE VERNOVA INC	15,289	162.08	2,478,041.12
GENERAL DYNAMICS CORP	12,920	299.14	3,864,888.80
GENERAL ELECTRIC CO	61,157	161.92	9,902,541.44
GRACO INC	8,952	78.35	701,389.20
GRAINGER (WW) INC	2,535	892.25	2,261,853.75
HEICO CORP	2,252	222.52	501,115.04
HEICO CORP-CLASS A	4,228	176.78	747,425.84
HONEYWELL INTL INC	37,375	208.78	7,803,152.50
HOWMET AEROSPACE INC	22,727	83.78	1,904,068.06
HUBBELL INC	2,787	366.68	1,021,937.16
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	249.21	496,675.53
IDEX CORP	3,918	201.79	790,613.22
ILLINOIS TOOL WORKS	17,252	240.42	4,147,725.84
INGERSOLL-RAND INC	22,994	89.13	2,049,455.22
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,600	37.88	363,648.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	39,654	69.95	2,773,797.30
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	10,469	221.90	2,323,071.10
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,584	497.03	787,295.52
LOCKHEED MARTIN CORP	12,498	470.13	5,875,684.74
MASCO CORP	12,110	66.03	799,623.30
NORDSON CORP	3,191	226.15	721,644.65
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,890	440.04	3,471,915.60
OTIS WORLDWIDE CORP	23,094	98.66	2,278,454.04
OWENS CORNING	4,965	176.89	878,258.85
PACCAR INC	29,938	107.67	3,223,424.46
PARKER HANNIFIN CORP	7,433	516.14	3,836,468.62
PENTAIR PLC	9,772	77.55	757,818.60
QUANTA SERVICES INC	8,208	269.32	2,210,578.56
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,432	255.91	1,646,013.12
RTX CORP	75,277	108.11	8,138,196.47
SMITH (A.O.) CORP	6,846	81.08	555,073.68
SNAP-ON INC	2,772	268.19	743,422.68
STANLEY BLACK&DECKER	8,223	82.46	678,068.58
TEXTRON	10,911	85.60	933,981.60
TORO CO	5,600	95.98	537,488.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	13,119	319.03	4,185,354.57
TRANSDIGM GROUP INC	3,041	1,310.00	3,983,710.00
UNITED RENTALS INC	3,678	643.40	2,366,425.20
VERTIV HOLDINGS CO-A	21,018	87.68	1,842,858.24

WABTEC CORP	10,381	163.17	1,693,867.77
WATSCO INC	2,000	462.63	925,260.00
XYLEM INC	12,709	137.32	1,745,199.88
AUTOMATIC DATA PROCESS	23,247	252.32	5,865,683.04
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,038	151.74	1,067,946.12
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	6,756	198.04	1,337,958.24
CINTAS CORP	5,087	682.17	3,470,198.79
COPART INC	46,764	53.76	2,514,032.64
DAYFORCE INC	9,041	51.53	465,882.73
EQUIFAX INC	6,976	233.28	1,627,361.28
JACOBS SOLUTIONS INC	6,625	139.06	921,272.50
LEIDOS HOLDINGS	6,940	144.85	1,005,259.00
PAYCHEX INC	17,989	122.58	2,205,091.62
PAYCOM SOFTWARE INC	2,625	145.33	381,491.25
PAYLOCITY HOLDING CORP	2,200	139.51	306,922.00
REPUBLIC SERVICES INC	12,099	186.95	2,261,908.05
ROLLINS INC	15,210	46.57	708,329.70
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	12,962	61.64	798,977.68
TRANSUNION	10,758	71.31	767,152.98
VERALTO CORP	12,852	99.22	1,275,175.44
VERISK ANALYTICS INC	8,140	264.00	2,148,960.00
WASTE CONNECTIONS INC	13,987	165.54	2,315,407.98
WASTE MANAGEMENT INC	22,353	200.55	4,482,894.15
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,274	86.98	545,712.52
CSX CORP	112,980	32.75	3,700,095.00
DELTA AIR LINES INC	7,841	50.44	395,500.04
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,512	125.47	1,068,000.64
FEDEX CORP	13,559	247.73	3,358,971.07
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	134,628	3.67	494,084.76
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,321	159.96	691,187.16
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,000	48.04	480,400.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,643	224.07	2,832,917.01
OLD DOMINION FREIGHT LINE	11,264	168.53	1,898,321.92
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,754	27.75	187,423.50
U-HAUL HOLDING CO	5,076	60.39	306,539.64
UBER TECHNOLOGIES INC	107,529	69.31	7,452,834.99
UNION PACIFIC CORP	34,272	227.97	7,812,987.84
UNITED PARCEL SERVICE B	40,861	137.64	5,624,108.04
APTIV PLC	16,326	81.42	1,329,262.92
FORD MOTOR COMPANY	217,837	12.15	2,646,719.55
GENERAL MOTORS CO	65,358	45.72	2,988,167.76
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	40,190	11.52	462,988.80

TESLA INC	162,662	177.48	28,869,251.76
DECKERS OUTDOOR CORP	1,400	1,044.31	1,462,034.00
DR HORTON INC	17,138	140.22	2,403,090.36
GARMIN LTD	9,152	163.26	1,494,155.52
LENNAR CORP-CL A	14,595	154.02	2,247,921.90
LULULEMON ATHLETICA INC	6,410	317.86	2,037,482.60
NIKE B	69,265	96.55	6,687,535.75
NVR INC	188	7,497.67	1,409,561.96
PULTE GROUP INC	12,386	111.54	1,381,534.44
AIRBNB INC-CLASS A	25,073	146.66	3,677,206.18
BOOKING HOLDINGS INC	1,935	3,813.09	7,378,329.15
CAESARS ENTERTAINMENT INC	12,243	36.06	441,482.58
CARNIVAL CORPORATION	57,539	16.70	960,901.30
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,518	3,169.02	4,810,572.36
DARDEN RESTAURANTS INC	6,950	148.54	1,032,353.00
DOMINO'S PIZZA INC	1,797	513.55	922,849.35
DOORDASH INC - A	14,879	113.27	1,685,344.33
DRAFTKINGS INC	24,000	36.89	885,360.00
EXPEDIA GROUP INC	8,454	123.06	1,040,349.24
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	14,280	202.18	2,887,130.40
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,200	145.15	464,480.00
LAS VEGAS SANDS CORP	19,449	45.02	875,593.98
MARRIOTT INTL A	14,322	231.10	3,309,814.20
MCDONALD'S CORP	40,896	256.21	10,477,964.16
MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,799	40.69	642,861.31
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,495	154.57	2,240,492.15
STARBUCKS CORP	64,570	81.43	5,257,935.10
WYNN RESORTS LTD	5,210	93.14	485,259.40
YUM BRANDS INC	14,772	139.97	2,067,636.84
ALPHABET INC-CL A	333,825	174.46	58,239,109.50
ALPHABET INC-CL C	289,456	175.95	50,929,783.20
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	5,239	276.83	1,450,312.37
COMCAST CORP-CL A	224,579	38.96	8,749,597.84
ELECTRONIC ARTS INC	14,435	136.82	1,974,996.70
FOX CORP - CLASS A	15,560	34.11	530,751.60
FOX CORP- CLASS B	6,975	31.77	221,595.75
INTERPUBLIC GROUP OF COS	22,646	30.72	695,685.12
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	12,328	71.89	886,259.92
LIVE NATION ENTERTAINMENT	8,618	90.53	780,187.54
MATCH GROUP INC	14,456	32.02	462,881.12
META PLATFORMS INC-CLASS A	123,975	492.96	61,114,716.00
NETFLIX INC	24,501	641.47	15,716,656.47

NEWS CORP-CLASS A	22,307	27.19	606,527.33
OMNICOM GROUP	10,921	91.09	994,793.89
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	30,808	12.01	370,004.08
PINTEREST INC- CLASS A	35,629	44.11	1,571,595.19
ROBLOX CORP -CLASS A	24,726	35.63	880,987.38
ROKU INC	6,927	57.35	397,263.45
SEA LTD-ADR	19,867	72.47	1,439,761.49
SNAP INC - A	62,654	15.59	976,775.86
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,959	164.77	1,476,174.43
THE WALT DISNEY CO	102,577	101.54	10,415,668.58
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	26,248	94.17	2,471,774.16
WARNER BROS DISCOVERY INC	122,994	8.27	1,017,160.38
AMAZON.COM	529,993	184.30	97,677,709.90
AUTOZONE INC	975	2,800.70	2,730,682.50
BATH & BODY WORKS INC	13,789	45.84	632,087.76
BEST BUY COMPANY INC	10,832	87.92	952,349.44
BURLINGTON STORES INC	3,549	229.21	813,466.29
CARMAX INC	9,366	69.17	647,846.22
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,000	219.05	876,200.00
EBAY	29,667	53.08	1,574,724.36
ETSY INC	6,573	65.28	429,085.44
GENUINE PARTS CO	7,768	145.19	1,127,835.92
GLOBAL-E ONLINE LTD	6,000	30.00	180,000.00
HOME DEPOT	56,243	327.03	18,393,148.29
LKQ CORP	13,325	42.21	562,448.25
LOWES COMPANIES	31,948	216.67	6,922,173.16
MERCADOLIBRE INC	2,509	1,600.16	4,014,801.44
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,383	978.70	3,310,942.10
POOL CORP	2,087	340.86	711,374.82
ROSS STORES INC	18,500	144.27	2,669,087.50
TJX COMPANIES INC	64,603	107.44	6,940,946.32
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,763	270.93	1,561,369.59
ULTA BEAUTY INC	2,749	382.61	1,051,794.89
WILLIAMS-SONOMA INC	3,500	292.52	1,023,820.00
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	19,000	20.07	381,330.00
COSTCO WHOLESALE CORP	25,209	845.58	21,316,226.22
DOLLAR GENERAL CORP	12,157	126.61	1,539,197.77
DOLLAR TREE INC	11,506	111.29	1,280,502.74
KROGER CO	38,327	51.98	1,992,237.46
SYSCO CORP	28,275	72.66	2,054,461.50
TARGET (DAYTON HUDSON)	26,160	146.00	3,819,360.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	40,229	15.84	637,227.36

WALMART INC	252,213	65.88	16,615,792.44
ALTRIA GROUP INC	100,574	46.70	4,696,805.80
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	30,271	61.27	1,854,704.17
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	10,307	43.89	452,374.23
BUNGE GLOBAL SA	8,498	104.13	884,896.74
CAMPBELL SOUP CO (US)	10,059	42.86	431,128.74
CELSIUS HOLDINGS INC	9,664	73.20	707,404.80
COCA-COLA CO	230,231	63.91	14,714,063.21
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	12,052	74.43	897,030.36
CONAGRA BRANDS INC	26,163	29.72	777,564.36
CONSTELLATION BRANDS INC-A	9,454	250.93	2,372,292.22
GENERAL MILLS INC	31,192	67.46	2,104,212.32
HERSHEY FOODS CORPORATION	7,990	196.06	1,566,519.40
HORMEL FOODS CORP	15,714	30.64	481,476.96
JM SMUCKER CO	5,275	114.98	606,519.50
KELLANOVA	16,208	59.63	966,483.04
KEURIG DR PEPPER INC	60,387	34.63	2,091,201.81
KRAFT HEINZ CO/THE	49,492	34.39	1,702,029.88
LAMB WESTON HOLDINGS INC	8,000	85.84	686,720.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,652	68.58	936,254.16
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	10,122	51.94	525,736.68
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	76,844	67.81	5,210,791.64
MONSTER BEVERAGE CORP	43,508	52.69	2,292,436.52
PEPSICO INC	77,137	171.04	13,193,512.48
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	87,258	103.61	9,040,801.38
TYSON FOODS INC	14,778	55.86	825,499.08
CHURCH & DWIGHT CO INC	14,150	107.38	1,519,427.00
CLOROX COMPANY	6,394	132.97	850,210.18
COLGATE-PALMOLIVE CO	43,378	93.89	4,072,760.42
ESTEE LAUDER CO-CL A	13,683	120.47	1,648,391.01
KENVUE INC	99,317	18.39	1,826,439.63
KIMBERLY-CLARK CORP	18,647	134.48	2,507,648.56
PROCTER & GAMBLE CO	133,078	167.06	22,232,010.68
ABBOTT LABORATORIES	97,490	107.58	10,487,974.20
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,193	255.54	1,071,479.22
BAXTER INTERNATIONAL	26,594	33.16	881,857.04
BECTON DICKINSON & CO	16,036	240.63	3,858,742.68
BOSTON SCIENTIFIC CORP	81,576	77.11	6,290,325.36
CARDINAL HEALTH	14,569	98.51	1,435,192.19
CENCORA INC	9,745	235.47	2,294,655.15
CENTENE CORP	29,946	69.81	2,090,530.26
COOPER COS INC/THE	10,244	94.38	966,828.72

CVS HEALTH CORP	73,487	61.78	4,540,026.86
DAVITA INC	3,582	143.18	512,870.76
DEXCOM INC	22,165	115.79	2,566,485.35
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	34,369	88.14	3,029,283.66
ELEVANCE HEALTH INC	13,315	538.94	7,175,986.10
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	25,756	76.34	1,966,213.04
HCA HEALTHCARE INC	11,263	337.44	3,800,586.72
HENRY SCHEIN INC	7,493	68.51	513,345.43
HOLOGIC INC	12,961	74.51	965,724.11
HUMANA INC	6,841	351.80	2,406,663.80
IDEXX LABORATORIES INC	4,914	497.51	2,444,764.14
INSULET CORP	3,546	191.42	678,775.32
INTUITIVE SURGICAL INC	20,303	417.61	8,478,735.83
LABCORP HOLDINGS INC	5,238	196.60	1,029,790.80
MCKESSON CORP	7,488	586.90	4,394,707.20
MEDTRONIC PLC	76,021	84.07	6,391,085.47
MOLINA HEALTHCARE INC	3,516	309.56	1,088,412.96
QUEST DIAGNOSTICS	6,246	142.34	889,055.64
RESMED INC	8,586	210.91	1,810,873.26
SOLVENTUM CORP	8,012	56.41	451,956.92
STERIS PLC	5,851	226.85	1,327,299.35
STRYKER CORP	19,207	349.33	6,709,581.31
TELEFLEX INC	2,672	212.57	567,987.04
THE CIGNA GROUP	15,977	338.10	5,401,823.70
UNITEDHEALTH GROUP INC	52,063	490.69	25,546,793.47
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	187.53	730,991.94
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	8,403	183.14	1,538,925.42
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,864	113.34	1,344,665.76
ABBVIE INC	100,779	169.42	17,073,978.18
AGILENT TECHNOLOGIES	15,996	132.98	2,127,148.08
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,056	152.78	1,078,015.68
AMGEN	29,982	305.02	9,145,109.64
AVANTOR INC	34,993	24.01	840,181.93
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,302	287.02	373,700.04
BIO-TECHNE CORP	8,884	77.63	689,664.92
BIOGEN INC	8,034	225.43	1,811,104.62
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	10,231	80.69	825,539.39
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	114,226	41.48	4,738,094.48
CATALENT INC	11,603	56.39	654,293.17
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,641	214.79	567,260.39
DANAHER CORP	40,172	263.08	10,568,449.76
ELI LILLY & CO	45,828	849.99	38,953,341.72



EXACT SCIENCES CORP	9,063	42.93	389,074.59
GILEAD SCIENCES INC	70,144	64.70	4,538,316.80
ILLUMINA INC	8,558	113.70	973,044.60
INCYTE CORP	10,628	59.16	628,752.48
IQVIA HOLDINGS INC	10,091	219.23	2,212,249.93
JOHNSON & JOHNSON	135,984	147.08	20,000,526.72
MERCK & CO	144,010	130.67	18,817,786.70
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,168	1,438.58	1,680,261.44
MODERNA INC	17,875	151.01	2,699,303.75
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,281	134.97	847,746.57
PFIZER	316,987	28.58	9,059,488.46
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,128	1,002.95	6,146,077.60
REPLIGEN CORP	2,737	145.78	398,999.86
REVVITY INC	6,426	110.92	712,771.92
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	23,158	27.46	635,918.68
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56,857	16.82	956,334.74
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	21,601	581.09	12,552,125.09
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,421	275.00	665,775.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,517	483.04	7,012,291.68
VIATRIS INC	63,857	10.47	668,582.79
WATERS CORP	3,306	302.09	998,709.54
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,264	314.68	1,341,795.52
ZOETIS INC	26,169	176.92	4,629,819.48
BANK OF AMERICA CORP	401,937	39.78	15,989,053.86
CITIGROUP	107,016	61.78	6,611,448.48
CITIZENS FINANCIAL GROUP	25,193	34.15	860,340.95
FIFTH THIRD BANCORP	37,082	36.13	1,339,772.66
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	573	1,688.80	967,682.40
HUNTINGTON BANCSHARES INC	78,770	13.40	1,055,518.00
JPMORGAN CHASE & CO	162,226	199.95	32,437,088.70
KEY CORP	48,984	13.93	682,347.12
M & T BANK CORP	9,606	146.82	1,410,352.92
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	23,164	155.88	3,610,804.32
REGIONS FINL CORP	49,382	18.60	918,505.20
TRUIST FINANCIAL CORP	76,097	36.17	2,752,428.49
US BANCORP	85,114	39.02	3,321,148.28
WELLS FARGO & CO	200,438	58.36	11,697,561.68
ALLY FINANCIAL INC	18,129	38.64	700,504.56
AMERICAN EXPRESS	32,633	232.67	7,592,720.11
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,866	426.63	2,502,611.58
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	22,034	112.36	2,475,740.24
ARES MANAGEMENT CORP - A	9,376	132.93	1,246,351.68

BANK NEW YORK CO	45,067	60.31	2,717,990.77
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	74,385	413.72	30,774,562.20
BLACKROCK INC	8,457	768.69	6,500,811.33
BLACKSTONE INC	39,953	117.62	4,699,271.86
BLOCK INC	30,502	65.10	1,985,680.20
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,406	139.80	2,852,758.80
CARLYLE GROUP INC/THE	10,351	40.68	421,078.68
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,992	172.68	1,034,698.56
CME GROUP INC	19,867	199.36	3,960,685.12
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	10,291	244.16	2,512,650.56
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,500	28.90	563,550.00
CORPAY INC	3,879	259.01	1,004,699.79
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,285	124.90	1,784,196.50
EQUITABLE HOLDINGS INC	18,461	40.16	741,393.76
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,972	409.93	808,381.96
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	31,029	77.51	2,405,057.79
FISERV INC	34,179	151.42	5,175,384.18
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	22.89	337,581.72
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,286	74.90	171,221.40
GLOBAL PAYMENTS INC	15,111	97.71	1,476,495.81
GOLDMAN SACHS GROUP INC	18,693	454.91	8,503,632.63
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	32,467	133.79	4,343,759.93
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,514	164.78	579,036.92
KKR & CO INC	36,018	97.99	3,529,403.82
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,096	280.06	1,147,125.76
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,112	198.76	419,781.12
MASTERCARD INC-CLASS A	47,345	449.79	21,295,307.55
MOODY'S CORP	9,174	403.70	3,703,543.80
MORGAN STANLEY	70,454	97.14	6,843,901.56
MSCI INC	4,355	491.69	2,141,309.95
NASDAQ INC	24,462	58.78	1,437,876.36
NORTHERN TRUST CORP	11,862	82.29	976,123.98
PAYPAL HOLDINGS INC	57,102	67.30	3,842,964.60
PRICE T ROWE GROUP INC	11,505	115.55	1,329,402.75
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,494	120.03	1,379,624.82
ROBINHOOD MARKETS INC - A	24,000	22.18	532,320.00
S&P GLOBAL INC	18,434	428.74	7,903,393.16
SCHWAB (CHARLES) CORP	86,629	73.93	6,404,481.97
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	65.26	410,420.14
STATE STREET CORP	17,821	74.76	1,332,297.96
SYNCHRONY FINANCIAL	23,931	43.70	1,045,784.70
TOAST INC-CLASS A	20,887	22.02	459,931.74

TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	6,542	105.31	688,938.02
VISA INC-CLASS A SHARES	88,763	278.67	24,735,585.21
AFLAC	31,141	88.79	2,765,009.39
ALLSTATE CORP	14,193	165.06	2,342,696.58
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,803	128.15	487,354.45
AMERICAN INT'L GROUP	40,246	76.02	3,059,500.92
AON PLC	11,563	283.12	3,273,716.56
ARCH CAPITAL GROUP LTD	20,703	100.57	2,082,100.71
ARTHUR J GALLAGHER & CO	11,870	253.53	3,009,401.10
ASSURANT INC	2,684	173.34	465,244.56
BROWN & BROWN INC	13,365	90.28	1,206,592.20
CHUBB LTD	23,361	267.22	6,242,526.42
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,751	115.97	898,883.47
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,444	357.48	516,201.12
EVEREST GROUP LTD	2,474	382.81	947,071.94
FNF GROUP	12,836	49.23	631,916.28
HARTFORD FINANCIAL SVCS	16,673	100.85	1,681,472.05
LOEWS CORP	10,482	75.25	788,770.50
MARKEL GROUP INC	702	1,601.43	1,124,203.86
MARSH & MCLENNAN COS	27,850	209.99	5,848,221.50
METLIFE INC	35,762	70.05	2,505,128.10
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,725	79.27	1,008,710.75
PROGRESSIVE CORP	32,935	212.53	6,999,675.55
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,869	117.84	2,459,202.96
TRAVELERS COS INC/THE	12,320	212.95	2,623,544.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,009	255.49	1,535,239.41
WR BERKLEY CORP	11,919	80.20	955,903.80
WEYERHAEUSER CO	40,664	29.36	1,193,895.04
ACCENTURE PLC-CL A	35,320	288.40	10,186,288.00
ADOBE INC	25,550	465.43	11,891,736.50
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	8,949	89.18	798,071.82
ANSYS INC	4,871	324.30	1,579,665.30
APPLOVIN CORP-CLASS A	12,000	81.91	982,920.00
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,805	202.56	365,620.80
ATLASSIAN CORP-CL A	9,024	163.36	1,474,160.64
AUTODESK INC	12,108	216.05	2,615,933.40
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	11,819	50.82	600,641.58
CADENCE DESIGN SYSTEMS	15,429	294.42	4,542,606.18
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,676	156.41	887,783.16
CLOUDFLARE INC - CLASS A	16,221	70.73	1,147,311.33
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	28,407	65.94	1,873,157.58
CONFLUENT INC-CLASS A	9,000	25.78	232,020.00

CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	13,273	349.12	4,633,869.76
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,100	239.97	503,937.00
DATADOG INC - CLASS A	14,659	109.47	1,604,720.73
DOCUSIGN INC	14,042	52.05	730,886.10
DYNATRACE INC	14,980	46.18	691,776.40
EPAM SYSTEMS INC	3,061	176.98	541,735.78
FAIR ISAAC CORP	1,345	1,310.32	1,762,380.40
FORTINET INC	36,982	59.72	2,208,565.04
GARTNER INC	4,549	434.44	1,976,267.56
GEN DIGITAL INC	29,838	24.72	737,595.36
GODADDY INC - CLASS A	8,747	139.36	1,218,981.92
HUBSPOT INC	2,683	596.65	1,600,811.95
INTL BUSINESS MACHINES CORP	51,075	170.01	8,683,260.75
INTUIT INC	15,703	573.90	9,011,951.70
MANHATTAN ASSOCIATES INC	3,500	220.55	771,925.00
MICROSOFT CORP	399,405	423.85	169,287,809.25
MICROSTRATEGY INC-CL A	954	1,596.20	1,522,774.80
MONDAY.COM LTD	2,400	223.24	535,776.00
MONGODB INC	4,115	227.02	934,187.30
OKTA INC	9,345	87.42	816,939.90
ORACLE CORP	93,656	125.92	11,793,163.52
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	103,887	23.31	2,421,605.97
PALO ALTO NETWORKS INC	18,608	301.90	5,617,755.20
PTC INC	7,030	174.48	1,226,594.40
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,903	554.03	3,270,439.09
SALESFORCE INC	54,562	241.85	13,195,819.70
SAMSARA INC-CL A	13,000	30.56	397,280.00
SERVICENOW INC	11,509	698.81	8,042,604.29
SNOWFLAKE INC-CLASS A	17,647	131.21	2,315,462.87
SYNOPSYS INC	8,405	571.45	4,803,037.25
TWILIO INC - A	10,378	57.03	591,857.34
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,478	481.84	1,193,999.52
UIPATH INC - CLASS A	24,000	12.00	288,000.00
UNITY SOFTWARE INC	13,116	17.27	226,513.32
VERISIGN INC	5,329	180.46	961,671.34
WIX.COM LTD	3,273	169.60	555,100.80
WORKDAY INC-CLASS A	12,333	215.56	2,658,501.48
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	12,443	62.84	781,918.12
ZSCALER INC	5,230	180.99	946,577.70
AMPHENOL CORPORATION	33,054	130.64	4,318,174.56
APPLE INC	830,085	196.89	163,435,435.65
ARISTA NETWORKS INC	14,708	296.79	4,365,187.32

CDW CORP/DE	7,411	224.24	1,661,842.64
CISCO SYSTEMS	228,543	45.84	10,476,411.12
CORNING	43,885	36.93	1,620,673.05
DELL TECHNOLOGIES -C	14,009	129.97	1,820,749.73
F5 INC	4,047	165.57	670,061.79
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	75,299	20.03	1,508,238.97
HP INC	58,493	36.45	2,132,069.85
JABIL INC	7,400	113.88	842,712.00
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	35.55	579,749.40
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	10,642	135.81	1,445,290.02
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,289	371.06	3,446,776.34
NETAPP INC	10,843	120.98	1,311,786.14
PURE STORAGE INC - CLASS A	19,185	64.94	1,245,873.90
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	12,680	96.11	1,218,674.80
SUPER MICRO COMPUTER INC	3,099	769.11	2,383,471.89
TE CONNECTIVITY LTD	17,335	149.17	2,585,861.95
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,404	389.06	935,300.24
TRIMBLE IMS HOLDINGS	13,869	54.99	762,656.31
WESTERN DIGITAL CORP	17,228	74.98	1,291,755.44
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,892	300.83	870,000.36
AT&T INC	395,564	18.10	7,159,708.40
T-MOBILE US INC	29,432	179.82	5,292,462.24
VERIZON COMMUNICATIONS	235,548	40.94	9,643,335.12
AES CORP	45,182	19.87	897,766.34
ALLIANT ENERGY CORPORATION	16,537	50.13	828,999.81
AMEREN CORPORATION	14,991	71.07	1,065,410.37
AMERICAN ELECTRIC POWER	30,895	88.30	2,728,028.50
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,087	128.25	1,421,907.75
ATMOS ENERGY CORP	9,420	114.78	1,081,227.60
CENTERPOINT ENERGY INC	36,651	30.17	1,105,760.67
CMS ENERGY CORP	17,231	60.63	1,044,715.53
CONSOLIDATED EDISON INC	18,713	91.61	1,714,297.93
CONSTELLATION ENERGY	18,305	198.00	3,624,390.00
DOMINION ENERGY INC	48,379	51.44	2,488,615.76
DTE ENERGY COMPANY	10,982	112.33	1,233,608.06
DUKE ENERGY CORP	43,568	102.62	4,470,948.16
EDISON INTL	21,304	73.98	1,576,069.92
ENERGY CORP	12,274	108.47	1,331,360.78
ESSENTIAL UTILITIES INC	12,969	36.97	479,463.93
EVERGY INC	11,724	52.96	620,903.04
EVERSOURCE ENERGY	18,286	58.58	1,071,193.88
EXELON CORP	54,634	36.17	1,976,111.78

FIRSTENERGY CORP	30,792	38.82	1,195,345.44	
NEXTERA ENERGY INC	117,427	75.39	8,852,821.53	
NISOURCE INC	25,553	28.28	722,638.84	
NRG ENERGY INC	12,298	77.89	957,891.22	
PG&E CORP	115,431	18.05	2,083,529.55	
PPL CORPORATION	45,254	28.41	1,285,666.14	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	28,637	72.88	2,087,064.56	
SEMPRA	35,873	75.33	2,702,313.09	
SOUTHERN CO	61,651	77.94	4,805,078.94	
VISTRA CORP	19,603	85.07	1,667,627.21	
WEC ENERGY GROUP INC	18,373	79.85	1,467,084.05	
XCEL ENERGY INC	31,146	54.74	1,704,932.04	
ADVANCED MICRO DEVICES	92,019	167.87	15,447,229.53	
ANALOG DEVICES	27,639	234.77	6,488,808.03	
APPLIED MATERIALS	47,292	221.73	10,486,055.16	
BROADCOM INC	24,925	1,406.64	35,060,502.00	
ENPHASE ENERGY INC	7,104	122.75	872,016.00	
ENTEGRIS INC	8,008	130.08	1,041,680.64	
FIRST SOLAR INC	5,850	267.34	1,563,939.00	
INTEL CORP	239,854	30.74	7,373,111.96	
KLA CORP	7,545	768.97	5,801,878.65	
LAM RESEARCH CORP	7,358	962.72	7,083,693.76	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	8,500	60.77	516,545.00	
MARVELL TECHNOLOGY INC	50,387	67.99	3,425,812.13	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	29,374	92.85	2,727,375.90	
MICRON TECHNOLOGY	63,416	130.94	8,303,691.04	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,625	751.64	1,973,055.00	
NVIDIA CORP	141,478	1,208.88	171,029,924.64	
NXP SEMICONDUCTORS NV	14,362	271.89	3,904,884.18	
ON SEMICONDUCTOR CORP	24,703	72.31	1,786,273.93	
QORVO INC	5,297	99.49	526,998.53	
QUALCOMM	62,632	206.62	12,941,023.84	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,922	90.81	810,206.82	
TERADYNE INC	9,235	140.90	1,301,211.50	
TEXAS INSTRUMENTS	50,935	195.61	9,963,395.35	
CBRE GROUP INC-A	16,391	85.63	1,403,561.33	
COSTAR GROUP INC	22,748	76.21	1,733,625.08	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	64,300	3.42	219,906.00	
ZILLOW GROUP INC-C	7,537	42.63	321,302.31	
アメリカドル 小計	19,152,501		2,591,910,940.26 (406,955,936,730)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	36,244	25.04	907,549.76

CAMECO CORP	22,453	73.49	1,650,070.97
CANADIAN NATURAL RESOURCES	61,177	96.74	5,918,262.98
CENOVUS ENERGY INC	83,349	26.02	2,168,740.98
ENBRIDGE	120,448	49.21	5,927,246.08
IMPERIAL OIL	11,645	88.89	1,035,124.05
KEYERA CORP	10,963	36.61	401,355.43
MEG ENERGY CORP	18,392	28.31	520,677.52
PARKLAND CORP	8,544	39.11	334,155.84
PEMBINA PIPELINE CORP	32,665	50.97	1,664,935.05
SUNCOR ENERGY	73,948	52.25	3,863,783.00
TC ENERGY CORP	57,598	54.18	3,120,659.64
TOURMALINE OIL CORP	16,980	66.61	1,131,037.80
AGNICO EAGLE MINES	27,843	87.76	2,443,501.68
BARRICK GOLD CORP	101,706	22.23	2,260,924.38
CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	72.06	526,182.12
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	30,312	16.92	512,879.04
FRANCO-NEVADA CORP	11,522	161.83	1,864,605.26
IVANHOE MINES LTD-CL A	35,897	18.01	646,504.97
KINROSS GOLD CORP	74,937	10.18	762,858.66
LUNDIN MINING CORP	30,173	15.18	458,026.14
NUTRIEN LTD	27,026	76.24	2,060,462.24
PAN AMERICAN SILVER CORP	24,343	27.37	666,267.91
TECK RESOURCES LTD-CL B	24,191	67.68	1,637,246.88
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,575	107.34	383,740.50
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	26,120	72.35	1,889,782.00
CAE INC	16,864	25.44	429,020.16
STANTEC INC	6,135	112.99	693,193.65
TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,269	120.22	513,219.18
WSP GLOBAL INC	7,506	207.96	1,560,947.76
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	20,483	24.90	510,026.70
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	10,920	50.14	547,528.80
RB GLOBAL INC	9,865	100.00	986,500.00
THOMSON REUTERS CORP	8,466	235.05	1,989,933.30
AIR CANADA	6,737	17.79	119,851.23
CANADIAN NATL RAILWAY CO	31,884	170.91	5,449,294.44
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	52,627	106.29	5,593,723.83
TFI INTERNATIONAL INC	4,630	193.75	897,062.50
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,682	60.19	883,709.58
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,366	86.17	117,708.22
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	52.77	527,700.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	17,311	94.61	1,637,793.71
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,586	138.69	358,652.34

DOLLARAMA INC	16,822	127.12	2,138,412.64
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	45,716	80.14	3,663,680.24
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	32.92	241,303.60
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	160.93	1,459,313.24
METRO INC	13,489	75.19	1,014,237.91
WESTON (GEORGE) LTD	3,705	195.26	723,438.30
SAPUTO INC	17,963	29.84	536,015.92
BANK MONTREAL	42,340	116.89	4,949,122.60
BANK NOVA SCOTIA	67,781	64.60	4,378,652.60
CANADIAN IMPERIAL BANK	50,581	67.39	3,408,653.59
NATIONAL BANK OF CANADA	19,372	117.74	2,280,859.28
ROYAL BANK OF CANADA	80,323	146.35	11,755,271.05
TORONTO-DOMINION BANK	99,612	76.45	7,615,337.40
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	18,244	52.20	952,336.80
BROOKFIELD CORP	80,503	57.14	4,599,941.42
IGM FINANCIAL INC	3,890	37.21	144,746.90
ONEX CORP	3,361	96.75	325,176.75
TMX GROUP LTD	16,225	37.00	600,325.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,198	1,561.81	1,871,048.38
GREAT-WEST LIFECO INC	15,674	39.92	625,706.08
IA FINANCIAL CORP INC	5,415	87.15	471,917.25
INTACT FINANCIAL CORP	9,967	228.54	2,277,858.18
MANULIFE FINANCIAL CORP	100,823	35.59	3,588,290.57
POWER CORP OF CANADA	29,992	39.99	1,199,380.08
SUN LIFE FINANCIAL INC	32,024	67.52	2,162,260.48
CGI INC - CL A	11,043	139.38	1,539,173.34
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,145	3,841.84	4,398,906.80
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	4,402	125.42	552,098.84
OPEN TEXT CORP	15,045	38.11	573,364.95
SHOPIFY INC - CLASS A	69,109	84.74	5,856,296.66
BCE INC	3,102	47.09	146,073.18
QUEBECOR INC -CL B	9,679	28.92	279,916.68
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	18,199	53.86	980,198.14
TELUS CORP	23,120	22.76	526,211.20
ALTAGAS INCOME LTD	14,516	31.11	451,592.76
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,264	41.77	261,647.28
CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	31.31	187,171.18
EMERA INC	19,067	47.58	907,207.86
FORTIS INC	29,864	55.07	1,644,610.48
HYDRO ONE LTD	20,457	40.86	835,873.02
NORTHLAND POWER INC	13,044	24.05	313,708.20
FIRSTSERVICE CORP	2,028	205.96	417,686.88



	カナダドル 小計	2,263,164		150,427,469.99 (17,157,757,227)
ユーロ	ENI	123,037	13.99	1,721,533.70
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	30,121	19.08	574,708.68
	NESTE OIL OYJ	21,882	18.94	414,554.49
	OMV AG	7,462	41.20	307,434.40
	REPSOL SA	71,632	14.59	1,045,469.04
	TENARIS SA	27,420	14.90	408,695.10
	TOTALENERGIES SE	121,586	64.94	7,895,794.84
	AIR LIQUIDE	29,475	187.28	5,520,078.00
	AKZO NOBEL	9,224	62.10	572,810.40
	ARCELORMITTAL	29,386	23.40	687,632.40
	ARKEMA	4,377	89.55	391,960.35
	BASF SE	48,561	46.80	2,272,654.80
	COVESTRO AG	10,438	48.40	505,199.20
	DSM-FIRMENICH AG	10,830	99.78	1,080,617.40
	EVONIK INDUSTRIES AG	19,273	18.42	355,008.66
	HEIDELBERG MATERIALS AG	8,131	95.52	776,673.12
	OCI NV	5,799	24.80	143,815.20
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	14,165	43.62	617,877.30
	STORA ENSO OYJ R	26,361	12.78	336,893.58
	SYENSQO SA	3,676	92.85	341,316.60
	SYMRISE AG	7,051	110.15	776,667.65
	UMICORE	12,057	16.43	198,096.51
	UPM KYMMENE OYJ	32,788	34.02	1,115,447.76
	VOESTALPINE AG	5,948	26.12	155,361.76
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	12,595	41.26	519,669.70
	AIRBUS SE	33,517	150.00	5,027,550.00
	ALSTOM	16,908	17.70	299,271.60
	BOUYGUES ORD	11,344	34.64	392,956.16
	BRENTAG SE	8,989	65.18	585,903.02
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	29,498	38.38	1,132,133.24
	DASSAULT AVIATION SA	1,210	193.10	233,651.00
	EIFFAGE	4,432	99.60	441,427.20
	FERROVIAL SE	29,779	36.14	1,076,213.06
	GEA GROUP AG	7,649	37.96	290,356.04
	IMCD NV	3,050	140.75	429,287.50
	KINGSPAN GROUP PLC	9,798	86.80	850,466.40
	KNORR-BREMSE AG	5,221	71.55	373,562.55
	KONE OYJ-B	19,254	47.20	908,788.80
	LEGRAND SA	15,620	98.50	1,538,570.00
	LEONARDO SPA	26,079	24.17	630,329.43

METSO CORPORATION	35,225	10.88	383,248.00
MTU AERO ENGINES AG	3,474	228.70	794,503.80
PRYSMIAN SPA	15,275	58.52	893,893.00
RATIONAL AG	268	799.50	214,266.00
REXEL SA	15,000	27.05	405,750.00
RHEINMETALL AG	2,442	532.80	1,301,097.60
SAFRAN SA	18,948	208.60	3,952,552.80
SAINT-GOBAIN	25,279	79.68	2,014,230.72
SCHNEIDER ELECTRIC SE	31,187	226.85	7,074,770.95
SIEMENS	42,875	174.44	7,479,115.00
SIEMENS ENERGY AG	37,924	23.02	873,010.48
THALES SA	5,540	172.85	957,589.00
VINCI S.A.	28,324	110.75	3,136,883.00
WARTSILA OYJ	30,397	19.27	585,750.19
BUREAU VERITAS SA	15,662	28.20	441,668.40
RANDSTAD NV	5,866	47.48	278,517.68
TELEPERFORMANCE	3,110	104.60	325,306.00
WOLTERS KLUWER	14,750	149.55	2,205,862.50
ADP	1,532	131.70	201,764.40
AENA SME SA	4,116	184.70	760,225.20
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	38,499	6.29	242,389.70
DHL GROUP	56,431	39.50	2,229,024.50
GETLINK	18,582	16.48	306,324.27
INPOST SA	16,994	16.91	287,368.54
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,499	91.18	1,595,558.82
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,480	86.35	300,498.00
CONTINENTAL AG	6,262	61.04	382,232.48
DR ING HC F PORSCHE AG	5,800	75.38	437,204.00
FERRARI NV	6,834	382.80	2,616,055.20
MERCEDES-BENZ GROUP AG	43,736	65.11	2,847,650.96
MICHELIN	41,067	37.64	1,545,761.88
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	8,889	49.44	439,472.16
RENAULT SA	11,301	51.22	578,837.22
STELLANTIS NV	121,390	20.19	2,450,864.10
VOLKSWAGEN AG-PFD	11,635	112.60	1,310,101.00
VOLKSWAGEN STAMM	1,657	124.70	206,627.90
ADIDAS AG	9,192	231.00	2,123,352.00
HERMES INTERNATIONAL	1,765	2,201.00	3,884,765.00
KERING	4,318	328.10	1,416,735.80
LVMH	15,508	762.50	11,824,850.00
MONCLER SPA	12,416	61.46	763,087.36
PUMA SE	6,274	47.47	297,826.78

SEB SA	1,310	110.40	144,624.00
ACCOR	12,281	38.96	478,467.76
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	25,319	67.64	1,712,577.16
DELIVERY HERO SE	8,935	28.38	253,575.30
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,332	33.18	176,915.76
SODEXO	4,698	87.75	412,249.50
BOLLORE SE	51,405	6.17	317,168.85
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	4,722	82.80	390,981.60
PUBLICIS GROUPE	13,443	103.35	1,389,334.05
SCOUT24 SE	4,128	71.95	297,009.60
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	47,953	28.23	1,353,713.19
VIVENDI SE	41,539	9.93	412,648.42
D'IETEREN GROUP	1,617	201.40	325,663.80
INDITEX	58,730	45.67	2,682,199.10
PROSUS	83,321	33.91	2,825,831.71
ZALANDO SE	11,285	23.42	264,294.70
CARREFOUR	30,831	14.86	458,148.66
JERONIMO MARTINS	13,062	19.96	260,717.52
KESKO OYJ-B SHS	14,326	16.23	232,510.98
KONINKLIJKE AHOLD NV	52,445	28.08	1,472,655.60
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	50,369	57.80	2,911,328.20
DANONE (GROUPE)	35,678	60.02	2,141,393.56
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	26,648	9.75	259,924.59
HEINEKEN HOLDING NV	7,127	76.55	545,571.85
HEINEKEN NV	16,000	94.50	1,512,000.00
JDE PEET'S BV	9,274	20.62	191,229.88
KERRY GROUP PLC-A	8,173	77.30	631,772.90
LOTUS BAKERIES	24	9,840.00	236,160.00
PERNOD-RICARD	11,584	137.45	1,592,220.80
REMY COINTREAU	1,020	83.70	85,374.00
BEIERSDORF AG	5,845	145.05	847,817.25
HENKEL AG & CO KGAA	6,247	74.75	466,963.25
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	10,083	84.54	852,416.82
LOREAL	13,589	455.35	6,187,751.15
AMPLIFON SPA	6,606	34.00	224,604.00
BIOMERIEUX	2,374	93.80	222,681.20
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,091	85.15	178,048.65
DIASORIN ITALIA SPA	1,418	101.55	143,997.90
ESSILORLUXOTTICA	16,595	208.80	3,465,036.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	9,705	39.75	385,773.75
FRESENIUS SE&CO KGAA	23,936	30.30	725,260.80
KONINKLIJKE PHILIPS	44,833	24.38	1,093,028.54

SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,577	55.10	803,192.70
ARGENX SE	3,157	354.60	1,119,472.20
BAYER	54,521	28.09	1,531,494.89
EUROFINS SCIENTIFIC	6,490	54.92	356,430.80
GRIFOLS SA	14,240	9.34	133,115.52
IPSEN	1,866	122.90	229,331.40
MERCK KGAA	8,023	171.30	1,374,339.90
ORION OYJ-CLASS B	5,393	38.94	210,003.42
QIAGEN N.V.	12,712	41.32	525,323.40
RECORDATI SPA	5,195	49.70	258,191.50
SANOFI	63,904	91.13	5,823,571.52
SARTORIUS AG-VORZUG	1,716	244.00	418,704.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,435	184.65	264,972.75
UCB (GROUPE)	6,718	130.00	873,340.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	19,718	15.98	315,192.23
AIB GROUP PLC	86,175	5.12	441,646.87
BANCO BILBAO VIZCAYA	328,517	9.89	3,250,347.19
BANCO BPM SPA	78,110	6.50	508,183.66
BANCO DE SABADELL SA	357,639	1.92	687,024.51
BANCO SANTANDER SA	904,812	4.73	4,283,380.00
BANK OF IRELAND GROUP PLC	52,138	10.21	532,328.98
BNP PARIBAS	59,550	66.37	3,952,333.50
CAIXABANK	240,435	5.26	1,264,688.10
COMMERZBANK AG	56,376	15.57	878,056.20
CREDIT AGRICOLE SA	64,475	14.64	943,914.00
ERSTE GROUP BANK AG	18,119	44.93	814,086.67
FINECOBANK SPA	42,306	14.78	625,494.21
ING GROEP NV-CVA	187,019	16.38	3,064,493.33
INTESA SANPAOLO	853,697	3.58	3,062,211.13
KBC GROEP NV	12,855	66.42	853,829.10
MEDIOBANCA	29,447	14.34	422,417.21
NORDEA BANK ABP	180,364	11.28	2,035,407.74
SOCIETE GENERALE	41,916	26.02	1,090,654.32
UNICREDIT SPA	89,900	36.57	3,287,643.00
ADYEN NV	1,178	1,231.80	1,451,060.40
AMUNDI SA	2,812	65.95	185,451.40
DEUTSCHE BANK NAMEN	111,998	15.29	1,713,121.40
DEUTSCHE BOERSE	10,526	187.95	1,978,361.70
EDENRED	15,236	46.30	705,426.80
EURAZEO SA	2,340	75.60	176,904.00
EURONEXT NV	4,500	93.90	422,550.00
EXOR NV	6,325	99.80	631,235.00

GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,582	69.35	387,111.70
NEXI SPA	36,598	6.18	226,395.22
SOFINA	752	218.00	163,936.00
AEGON LTD	95,201	5.94	566,065.14
AGEAS	8,621	43.80	377,599.80
ALLIANZ SE-REG	21,940	261.50	5,737,310.00
ASR NEDERLAND NV	9,000	45.69	411,210.00
ASSICURAZIONI GENERALI	58,531	23.79	1,392,452.49
AXA SA	100,654	33.18	3,339,699.72
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,976	234.50	697,872.00
MUENCHENER RUECKVERSICH.	7,773	462.00	3,591,126.00
NN GROUP NV	13,557	42.57	577,121.49
POSTE ITALIANE SPA	25,777	12.79	329,816.71
SAMPO OYJ-A SHS	25,899	40.40	1,046,319.60
TALANX AG	5,000	75.00	375,000.00
BECHTLE AG	4,296	46.74	200,795.04
CAPGEMINI SA	9,097	195.25	1,776,189.25
DASSAULT SYSTEMES SA	38,993	37.14	1,448,200.02
NEMETSCHKE SE	3,320	93.95	311,914.00
SAP SE	58,571	177.36	10,388,152.56
NOKIA OYJ	300,315	3.62	1,087,891.08
CELLNEX TELECOM SA	30,696	33.63	1,032,306.48
DEUTSCHE TELEKOM	183,125	22.59	4,136,793.75
ELISA A	7,825	43.72	342,109.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,877	9.85	146,538.45
KPN (KON.)	173,861	3.51	610,252.11
ORANGE	104,881	10.06	1,055,102.86
TELECOM ITALIA ORD	489,749	0.23	115,923.58
TELEFONICA	280,413	4.37	1,227,648.11
ACCIONA SA	1,278	118.60	151,570.80
E.ON SE	123,229	12.33	1,519,413.57
EDP RENOVAVEIS SA	15,623	14.38	224,658.74
ELIA GROUP SA/NV	1,604	93.50	149,974.00
ENDESA	17,138	18.43	315,939.03
ENEL	451,639	6.71	3,030,497.69
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	189,324	3.70	701,824.06
ENGIE	100,082	15.00	1,501,230.00
FORTUM OYJ	26,655	13.88	369,971.40
IBERDROLA SA	327,283	12.17	3,984,670.52
REDEIA CORP SA	23,296	16.98	395,566.08
RWE STAMM	33,396	34.18	1,141,475.28
SNAM SPA	115,930	4.38	508,121.19

	TERNA SPA	80,424	7.73	621,999.21
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,814	30.94	1,139,025.16
	VERBUND AG	3,916	75.70	296,441.20
	ASM INTERNATIONAL NV	2,534	687.40	1,741,871.60
	ASML HOLDING NV	22,598	958.90	21,669,222.20
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	4,300	147.75	635,325.00
	INFINEON TECHNOLOGIES	72,297	38.01	2,748,008.97
	STMICROELECTRONICS NV	37,319	41.40	1,545,193.19
	LEG IMMOBILIEN SE	3,774	76.50	288,711.00
	VONOVIA SE	43,373	26.68	1,157,191.64
	ユーロ 小計	10,418,383		298,510,351.72 (50,516,906,821)
イギリスポンド	BP PLC	965,605	4.62	4,467,854.33
	SHELL PLC-NEW	362,521	27.32	9,905,886.32
	ANGLO AMERICAN PLC	74,016	23.82	1,763,431.20
	ANTOFAGASTA PLC	22,358	21.45	479,579.10
	CRH PLC	38,902	60.80	2,365,241.60
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,013	43.19	346,081.47
	ENDEAVOUR MINING PLC	13,000	16.52	214,760.00
	GLENCORE PLC	587,098	4.69	2,757,892.85
	MONDI PLC	23,525	15.04	353,933.62
	RIO TINTO PLC REG	61,891	53.52	3,312,406.32
	ASHTREAD GROUP PLC	25,115	55.58	1,395,891.70
	BAE SYSTEMS PLC	170,458	13.95	2,377,889.10
	BUNZL PLC	19,312	29.46	568,931.52
	DCC PLC	4,499	56.35	253,518.65
	MELROSE INDUSTRIES PLC	75,000	6.20	465,000.00
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	458,658	4.56	2,095,608.40
	SMITHS GROUP PLC	20,046	17.32	347,196.72
	SPIRAX GROUP PLC	3,672	88.15	323,686.80
	EXPERIAN PLC	52,941	36.63	1,939,228.83
	INTERTEK GROUP PLC	10,295	48.40	498,278.00
	RELX PLC	107,318	35.31	3,789,398.58
	RENTOKIL INITIAL PLC	130,328	4.21	549,202.19
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	5.01	255,399.78
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,048	51.95	314,193.60
	BURBERRY GROUP PLC	22,327	10.32	230,414.64
	PERSIMMON PLC	14,327	14.41	206,523.70
	TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.49	248,490.83
	COMPASS GROUP PLC	95,637	22.40	2,142,268.80
	ENTAIN PLC	33,614	7.16	240,810.69
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	10,117	148.10	1,498,327.70

INTERCONTINENTAL HOTELS	8,641	79.38	685,922.58
PEARSON	34,302	9.61	329,916.63
WHITBREAD PLC	10,170	30.24	307,540.80
AUTO TRADER GROUP PLC	43,890	8.19	359,459.10
INFORMA PLC	79,688	8.32	663,641.66
WPP PLC	56,693	7.72	437,783.34
JD SPORTS FASHION PLC	114,330	1.25	143,484.15
KINGFISHER PLC	96,593	2.61	252,977.06
NEXT PLC	7,235	92.46	668,948.10
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.63	216,363.48
TESCO PLC	393,967	3.07	1,211,842.49
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	20,881	25.60	534,553.60
BRITISH AMERICAN TOBACCO	114,644	24.37	2,793,874.28
COCA-COLA HBC AG-CDI	14,115	27.04	381,669.60
DIAGEO	126,321	26.70	3,372,770.70
IMPERIAL BRANDS PLC	45,617	19.87	906,409.79
HALEON PLC	385,427	3.30	1,273,065.38
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	39,541	45.06	1,781,717.46
UNILEVER PLC	141,262	43.96	6,209,877.52
SMITH & NEPHEW PLC	54,631	10.38	567,069.78
ASTRAZENECA	87,036	125.56	10,928,240.16
GSK PLC	238,969	16.29	3,892,805.01
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	8,586	19.49	167,341.14
BARCLAYS	873,251	2.17	1,897,137.79
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,087,112	6.94	7,551,079.95
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,573,042	0.54	1,958,027.01
NATWEST GROUP PLC	329,785	3.16	1,045,088.66
STANDARD CHARTERED PLC	135,187	7.46	1,008,495.02
3I GROUP PLC	55,147	29.26	1,613,601.22
HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,246	10.58	193,133.91
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	26,627	94.32	2,511,458.64
M&G PLC	118,170	1.98	234,331.11
SCHRODERS PLC	42,161	3.84	162,235.52
WISE PLC - A	45,000	8.54	384,300.00
ADMIRAL GROUP PLC	9,872	27.30	269,505.60
AVIVA PLC	152,469	4.77	728,649.35
LEGAL & GENERAL GROUP	313,717	2.49	781,469.04
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	43,255	4.91	212,555.07
PRUDENTIAL	158,898	7.31	1,162,497.76
SAGE GROUP PLC	56,360	10.60	597,416.00
HALMA PLC	20,296	22.96	465,996.16
BT GROUP PLC	373,976	1.32	493,835.30

	VODAFONE GROUP PLC	1,387,940	0.71	992,654.68	
	CENTRICA PLC	270,000	1.33	360,315.00	
	NATIONAL GRID PLC	273,012	8.69	2,373,020.30	
	SEVERN TRENT PLC	14,219	24.10	342,677.90	
	SSE PLC	65,158	17.87	1,164,373.46	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	10.10	350,805.18	
	イギリスポンド 小計	15,315,840		112,649,260.48 (22,498,310,303)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	13,161	13.92	183,201.12	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	310	732.50	227,075.00	
	GIVAUDAN-REG	533	4,314.00	2,299,362.00	
	HOLCIM LTD	30,195	79.98	2,414,996.10	
	SIG GROUP AG	16,000	17.45	279,200.00	
	SIKA AG-BR	8,383	270.90	2,270,954.70	
	ABB LTD	88,585	50.44	4,468,227.40	
	GEBERIT AG-REG	1,930	550.80	1,063,044.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,332	230.50	307,026.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,021	235.00	474,935.00	
	VAT GROUP AG	1,440	489.70	705,168.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,959	33.28	331,435.52	
	SGS SA	8,675	83.90	727,832.50	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,430	268.60	921,298.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	31,083	150.10	4,665,558.30	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,572	188.85	296,872.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	37.00	111,148.00	
	AVOLTA AG	5,500	36.62	201,410.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	189	1,565.00	295,785.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	108,800.00	652,800.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	55	10,740.00	590,700.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	152,013	98.02	14,900,314.26	
	ALCON INC	27,668	82.16	2,273,202.88	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,788	288.40	804,059.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	6,820	116.75	796,235.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,950	78.45	152,977.50	
	LONZA GROUP AG-REG	4,282	500.20	2,141,856.40	
	NOVARTIS	111,494	94.95	10,586,355.30	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,944	268.80	522,547.20	
	ROCHE HOLDING GENUSS	39,348	242.60	9,545,824.80	
	SANDOZ GROUP AG	22,464	32.18	722,891.52	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,564	96.20	150,456.80	
	JULIUS BAER GROUP LTD	11,775	51.32	604,293.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,287	1,165.00	1,499,355.00	



	UBS GROUP AG	182,563	28.42	5,188,440.46	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	155.70	363,403.80	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,500	121.20	303,000.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,612	637.40	1,027,488.80	
	SWISS RE LTD	16,438	113.65	1,868,178.70	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,505	479.60	4,078,998.00	
	TEMENOS AG - REG	3,520	61.40	216,128.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,298	90.94	754,620.12	
	SWISSCOM	1,331	503.50	670,158.50	
	BKW AG	807	143.40	115,723.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,135	84.00	431,340.00	
	スイスフラン 小計	845,803		83,205,877.88 (14,566,020,981)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	13,081	352.00	4,604,512.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,106	429.00	2,190,474.00	
	SCA SV CELLULOSA B	34,632	157.10	5,440,687.20	
	ALFA LAVAL AB	14,260	480.80	6,856,208.00	
	ASSA ABLOY AB-B	57,678	309.50	17,851,341.00	
	ATLAS COPCO A	156,971	204.40	32,084,872.40	
	ATLAS COPCO B	85,638	176.50	15,115,107.00	
	BEIJER REF AB	23,000	170.20	3,914,600.00	
	EPIROC AB-A	37,140	218.10	8,100,234.00	
	EPIROC AB-B	22,442	199.00	4,465,958.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	85.68	1,871,336.88	
	INDUTRADE AB	14,669	275.40	4,039,842.60	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,081	297.40	2,403,289.40	
	LIFCO AB-B SHS	13,590	283.60	3,854,124.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	80,939	50.72	4,105,226.08	
	SAAB AB-B	23,200	272.20	6,315,040.00	
	SANDVIK AB	56,973	224.80	12,807,530.40	
	SKANSKA B	19,869	184.10	3,657,882.90	
	SKF AB-B	18,340	225.60	4,137,504.00	
	TRELLEBORG AB-B SHS	14,847	417.80	6,203,076.60	
	VOLVO AB-A SHS	8,748	281.80	2,465,186.40	
	VOLVO B	87,756	275.20	24,150,451.20	
	SECURITAS B	25,545	108.65	2,775,464.25	
	VOLVO CAR AB-B	35,544	35.71	1,269,453.96	
	EVOLUTION AB	9,622	1,130.00	10,872,860.00	
	HENNES & MAURITZ B	33,524	187.20	6,275,692.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	31,655	283.60	8,977,358.00	
	GETINGE AB-B SHS	12,650	188.70	2,387,055.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	9,481	281.00	2,664,161.00	

	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	96,619	152.45	14,729,566.55	
	SVENSKA HANDELSBK A	81,670	100.20	8,183,334.00	
	SWEDBANK AB-A	50,623	220.20	11,147,184.60	
	EQT AB	22,258	314.80	7,006,818.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,848	367.60	2,517,324.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	366.20	3,160,672.20	
	INVESTOR AB-B SHS	95,842	288.80	27,679,169.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,093	533.50	2,183,615.50	
	ERICSSON (LM) B	160,922	66.20	10,653,036.40	
	HEXAGON AB-B SHS	127,535	117.80	15,023,623.00	
	TELE2 AB-B SHS	34,520	103.60	3,576,272.00	
	TELIA CO AB	138,487	27.26	3,775,155.62	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	32,478	69.50	2,257,221.00	
	SAGAX AB-B	9,400	272.00	2,556,800.00	
	スウェーデンクローナ 小計	1,846,748		326,306,322.74 (4,852,175,019)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	17,052	258.80	4,413,057.60	
	EQUINOR ASA	50,840	298.15	15,157,946.00	
	NORSK HYDRO	72,015	67.70	4,875,415.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,449	316.30	2,988,718.70	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,500	932.00	4,194,000.00	
	MOWI ASA	23,314	187.50	4,371,375.00	
	ORKLA	39,803	88.15	3,508,634.45	
	SALMAR ASA	6,500	601.00	3,906,500.00	
	DNB BANK ASA	46,261	202.50	9,367,852.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	185.20	2,065,535.60	
	TELENOR ASA	38,789	125.90	4,883,535.10	
	ノルウェークローネ 小計	319,676		59,732,570.45 (873,887,505)	
デンマークク ローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	18,930	422.00	7,988,460.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	428	2,832.00	1,212,096.00	
	VESTAS WIND SYSSEMS A/S	55,152	188.40	10,390,636.80	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	152	11,850.00	1,801,200.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	251	12,175.00	3,055,925.00	
	DSV A/S	10,213	1,109.50	11,331,323.50	
	PANDORA A/S	5,465	1,118.50	6,112,602.50	
	CARLSBERG AS-B	5,476	969.40	5,308,434.40	
	COLOPLAST-B	8,147	840.80	6,849,997.60	
	DEMANT A/S	4,463	334.00	1,490,642.00	
	GENMAB A/S	3,603	1,930.00	6,953,790.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	185,314	984.00	182,348,976.00	
	DANSKE BANK A/S	38,806	210.70	8,176,424.20	

	TRYG A/S	25,030	144.30	3,611,829.00
	ORSTED A/S	11,432	397.40	4,543,076.80
	デンマーククローネ 小計	372,862		261,175,413.80 (5,923,458,384)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	12,821	34.46	441,811.66
	SANTOS	176,138	7.55	1,329,841.90
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	105,494	27.21	2,870,491.74
	BHP GROUP LTD	290,181	44.53	12,921,759.93
	BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	21.14	455,545.86
	FORTESCUE LTD	97,584	24.37	2,378,122.08
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	25,493	46.44	1,183,894.92
	MINERAL RESOURCES LTD	10,000	68.63	686,300.00
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	58,122	14.56	846,256.32
	ORICA LTD	26,961	18.27	492,577.47
	PILBARA MINERALS LTD	131,710	3.65	480,741.50
	RIO TINTO LTD	22,145	125.31	2,774,989.95
	SOUTH32 LTD	246,137	3.87	952,550.19
	REECE LTD	12,870	25.98	334,362.60
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	13,000	40.17	522,210.00
	BRAMBLES LTD	82,936	14.65	1,215,012.40
	COMPUTERSHARE LIMITED	28,589	27.15	776,191.35
	AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	3.77	352,887.08
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	39,948	6.20	247,677.60
	TRANSURBAN GROUP	167,820	12.80	2,148,096.00
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	31,473	47.18	1,484,896.14
	LOTTERY CORP LTD/THE	123,601	5.17	639,017.17
	CAR GROUP LTD	23,075	36.63	845,237.25
	REA GROUP LTD	3,000	188.41	565,230.00
	SEEK LTD	17,113	23.19	396,850.47
	WESFARMERS LTD	63,823	67.14	4,285,076.22
	COLES GROUP LTD	82,651	16.98	1,403,413.98
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	74,362	5.12	380,733.44
	WOOLWORTHS GROUP LTD	69,391	32.44	2,251,044.04
	TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	12.07	416,173.60
	COCHLEAR LIMITED	4,260	332.07	1,414,618.20
	PRO MEDICUS LTD	4,616	125.87	581,015.92
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,641	49.30	475,301.30	
SONIC HEALTHCARE LTD	25,969	24.98	648,705.62	
CSL LIMITED	27,778	289.00	8,027,842.00	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	166,585	29.18	4,860,950.30	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	94,297	125.55	11,838,988.35	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	177,800	35.23	6,263,894.00	

	WESTPAC BANKING	194,057	26.97	5,233,717.29
	ASX LTD	11,055	64.32	711,057.60
	MACQUARIE GROUP LIMITED	20,561	196.27	4,035,507.47
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,345	32.00	331,040.00
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	137,266	6.56	900,464.96
	MEDIBANK PRIVATE LTD	129,252	3.79	489,865.08
	QBE INSURANCE GROUP	78,253	18.58	1,453,940.74
	SUNCORP GROUP LIMITED	66,731	16.53	1,103,063.43
	WISETECH GLOBAL LTD	8,342	100.08	834,867.36
	XERO LTD	7,073	129.29	914,468.17
	TELSTRA GROUP LTD	199,810	3.56	711,323.60
	ORIGIN ENERGY LIMITED	113,883	10.35	1,178,689.05
	オーストラリアドル 小計	3,673,645		98,088,313.30 (10,125,656,581)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	64,661	7.67	495,949.87
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	36,015	30.00	1,080,450.00
	SPARK NEW ZEALAND LTD	104,543	4.07	425,490.01
	MERCURY NZ LTD	40,719	6.65	270,781.35
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	6.30	403,414.20
	ニュージーランドドル 小計	309,972		2,676,085.43 (256,342,223)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	139,448	38.65	5,389,665.20
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	84,500	97.05	8,200,725.00
	MTR CORP	82,500	25.90	2,136,750.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	81,000	21.55	1,745,550.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	117,000	40.00	4,680,000.00
	SANDS CHINA LTD	127,000	18.58	2,359,660.00
	WH GROUP LTD	446,619	5.32	2,376,013.08
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	191,500	24.95	4,777,925.00
	HANG SENG BANK	39,600	108.20	4,284,720.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	69,800	270.80	18,901,840.00
	AIA GROUP LTD	649,400	58.35	37,892,490.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	45.60	1,459,200.00
	CLP HOLDINGS	100,000	65.60	6,560,000.00
	HONG KONG & CHINA GAS	608,990	5.91	3,599,130.90
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	44.05	3,237,675.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	98,448	30.45	2,997,741.60
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	79,761	22.75	1,814,562.75
	SINO LAND CO	198,600	8.48	1,684,128.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	80,000	73.60	5,888,000.00
	SWIRE PACIFIC A	31,000	68.35	2,118,850.00
SWIRE PROPERTIES LTD	69,000	13.98	964,620.00	

	WHARF HOLDINGS	77,000	23.05	1,774,850.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	81,000	22.10	1,790,100.00	
	香港ドル 小計	3,557,666		126,634,196.53 (2,545,347,350)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	80,200	6.63	531,726.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	4.09	305,932.00	
	SINGAPORE AIRLINES	73,350	6.80	498,780.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	0.89	284,533.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	106,600	3.10	330,460.00	
	DBS GROUP	111,980	35.52	3,977,529.60	
	OCBC BANK	199,350	14.27	2,844,724.50	
	UNITED OVERSEAS BANK	72,300	30.76	2,223,948.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.67	410,975.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	420,880	2.52	1,060,617.60	
	SEMCORP INDUSTRIES LTD	49,000	5.06	247,940.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	153,900	2.64	406,296.00	
	シンガポールドル 小計	1,704,560		13,123,461.70 (1,523,108,964)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	39,375	17.27	680,006.25	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,248	690.00	861,120.00	
	BANK HAPOLIM BM	80,240	33.15	2,659,956.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	82,181	30.90	2,539,392.90	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,227	18.76	1,204,898.52	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,698	131.50	1,143,787.00	
	NICE LTD	3,165	644.50	2,039,842.50	
	AZRIELI GROUP	2,465	218.80	539,342.00	
	イスラエルシェケル 小計	281,599		11,668,345.17 (487,247,924)	
	合 計	60,062,419		538,282,156,012 (538,282,156,012)	

## (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	827,154.90	
		オーストラリアドル 小計	96,405	827,154.90 (85,387,200)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	1,622,450.00	

		香港ドル 小計	185,000	1,622,450.00 (32,611,245)	
		投資信託受益証券合計	281,405	117,998,445 (117,998,445)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,648	1,104,599.52	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	20,363	725,940.95	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	26,373	5,123,218.98	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	24,773	489,019.02	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,676	1,513,783.96	
		BOSTON PROPERTIES	7,893	467,739.18	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,427	685,696.63	
		CROWN CASTLE INC	24,878	2,503,224.36	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	18,388	2,691,083.80	
		EQUINIX INC	5,500	4,143,645.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,979	559,122.33	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	18,842	1,226,048.94	
		ESSEX PROPERTY TRUST	3,594	963,443.58	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	11,358	1,682,119.80	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	15,190	663,651.10	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	48,337	932,420.73	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	40,506	721,411.86	
		INVITATION HOMES INC	35,025	1,226,225.25	
		IRON MOUNTAIN INC	16,160	1,381,195.20	
		KIMCO REALTY CORP	43,615	819,525.85	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,844	935,301.04	
		PROLOGIS INC	52,154	5,747,370.80	
		PUBLIC STORAGE	8,723	2,388,531.86	
		REALTY INCOME CORP	50,639	2,700,071.48	
		REGENCY CENTERS CORP	10,530	644,857.20	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	5,725	1,107,157.75	
		SIMON PROPERTY GROUP	18,395	2,792,177.05	
		SUN COMMUNITIES INC	6,650	768,141.50	
		UDR INC	17,830	707,316.10	
		VENTAS INC	23,610	1,173,653.10	
		VICI PROPERTIES INC	56,023	1,589,372.51	
		WELLTOWER INC	32,100	3,332,301.00	
		WP CAREY INC	14,129	794,191.09	
		アメリカドル 小計	696,877	54,303,558.52 (8,526,201,723)	
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,069	223,694.97	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	152,512.25	
			14,014	376,207.22	

カナダドル 小計			(42,910,195)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	3,076	149,124.48	
	GECINA SA	2,719	271,084.30	
	KLEPIERRE	11,603	309,568.04	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,185	490,965.30	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,235	188,110.00	
ユーロ 小計		30,818	1,408,852.12	(238,420,044)
イギリスポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	207,894.04	
	SEGRO PLC	63,208	572,032.40	
イギリスポンド 小計		95,340	779,926.44	(155,766,908)
オーストラリアドル	DEXUS	74,283	517,009.68	
	GOODMAN GROUP	100,493	3,548,407.83	
	GPT GROUP	111,587	478,708.23	
	MIRVAC GROUP	228,843	456,541.78	
	SCENTRE GROUP	297,027	953,456.67	
	STOCKLAND	158,290	726,551.10	
	VICINITY CENTERS	221,263	429,250.22	
オーストラリアドル 小計		1,191,786	7,109,925.51	(733,957,610)
香港ドル	LINK REIT	147,800	5,010,420.00	
香港ドル 小計		147,800	5,010,420.00	(100,709,442)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	207,909	550,958.85	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	276,190	552,380.00	
シンガポールドル 小計		484,099	1,103,338.85	(128,053,506)
投資証券合計		2,660,734	9,926,019,428	(9,926,019,428)
合計			10,044,017,873	(10,044,017,873)

## 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 580銘柄	97.9%				74.2%
	投資証券 33銘柄				2.1%	1.6%

カナダドル	株式	85銘柄	99.8%				3.1%
	新株予約権 証券	1銘柄					
	投資証券	2銘柄				0.2%	0.0%
ユーロ	株式	218銘柄	99.5%				9.2%
	投資証券	5銘柄				0.5%	0.0%
イギリスポ ンド	株式	78銘柄	99.3%				4.1%
	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%				0.9%
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%				1.1%
オーストラ リアドル	株式	50銘柄	92.5%				1.8%
	投資信託受 益証券	1銘柄			0.8%		0.0%
	投資証券	7銘柄				6.7%	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	95.0%				0.5%
	投資信託受 益証券	1銘柄			1.2%		0.0%
	投資証券	1銘柄				3.8%	0.0%
シンガポ ールドル	株式	12銘柄	92.2%				0.3%
	投資証券	2銘柄				7.8%	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 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	360,892,807
コール・ローン	1,326,622,036
国債証券	182,419,034,990
派生商品評価勘定	4,050,606
未収入金	6,137,753



	2024年 6月10日現在
項目	金額（円）
未収利息	1,210,065,000
前払費用	116,446,608
差入委託証拠金	74,944,820
流動資産合計	185,518,194,620
資産合計	185,518,194,620
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,167,717
前受金	2,044,615
未払金	459,298
未払解約金	177,896,461
流動負債合計	184,568,091
負債合計	184,568,091
純資産の部	
元本等	
元本	58,835,582,589
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	126,498,043,940
元本等合計	185,333,626,529
純資産合計	185,333,626,529
負債純資産合計	185,518,194,620

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2024年 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	58,835,582,589口

		2024年 6月10日現在
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,1500円 (31,500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 6月10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 6月10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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 6月13日
期首元本額	57,835,795,349円
期中追加設定元本額	7,908,509,796円
期中一部解約元本額	6,908,722,556円
期末元本額	58,835,582,589円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	1,836,241,003円

区分	2024年 6月10日現在
DC外国債券インデックスファンド	1,787,490,441円
DC外国債券インデックスファンドL	14,348,186,442円
DCバランスファンド30	940,721,823円
DCバランスファンド50	1,135,454,184円
DCバランスファンド70	308,392,594円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	523,442,454円
外国債券インデックスe	942,388,265円
インデックスコレクション（外国債券）	10,099,023,136円
インデックスコレクション（バランス株式30）	5,154,906,632円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,234,367,336円
インデックスコレクション（バランス株式70）	392,986,304円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	6,752,489,650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）	2,925,987,061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）	281,660,321円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	48,659,034円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	299,890,397円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	197,034,131円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	168,157,333円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	65,857,269円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	786,279,627円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	461,068,736円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	5,052,084,500円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	297,696,513円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	125,093,537円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,198,270,554円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	53,103,156円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	148,989,081円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	62,821,338円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	36,036,578円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	42,330,620円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	169,973,431円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	55,070,769円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	884,312,741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）	19,115,598円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,892,617,497
合計	1,892,617,497

(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 6月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引	債券先物取引			
	買建	797,716,864	-	799,761,479
合計		797,716,864	-	799,761,479

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2024年 6月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	937,258,341	-	935,096,615	2,161,726
	アメリカドル	450,105,890	-	450,343,180	237,290
	カナダドル	35,582,189	-	35,340,000	242,189
	ユーロ	297,983,504	-	296,021,775	1,961,729
	イギリスポンド	52,003,426	-	51,897,040	106,386
	オフショア人民元	101,583,332	-	101,494,620	88,712
	合計		937,258,341	-	935,096,615

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 05/31/25	1,180,000.00	1,125,028.87	
		T 0.25% 06/30/25	4,310,000.00	4,095,762.70	
		T 0.25% 07/31/25	2,200,000.00	2,082,695.31	
		T 0.25% 09/30/25	3,290,000.00	3,090,608.00	
		T 0.375% 01/31/26	10,690,000.00	9,920,821.14	
		T 0.375% 07/31/27	4,000,000.00	3,507,578.12	
		T 0.375% 09/30/27	4,000,000.00	3,486,875.00	
		T 0.375% 11/30/25	3,770,000.00	3,523,403.69	
		T 0.5% 02/28/26	3,500,000.00	3,244,882.83	
		T 0.5% 04/30/27	2,000,000.00	1,777,265.62	
		T 0.5% 05/31/27	300,000.00	265,734.37	
		T 0.5% 06/30/27	2,500,000.00	2,208,544.92	
		T 0.5% 08/31/27	1,100,000.00	965,679.68	
		T 0.5% 10/31/27	1,580,000.00	1,378,735.16	
		T 0.625% 03/31/27	3,400,000.00	3,041,539.05	
		T 0.625% 05/15/30	7,400,000.00	5,938,066.43	

T 0.625% 07/31/26	4,000,000.00	3,661,718.76	
T 0.625% 08/15/30	9,130,000.00	7,262,094.76	
T 0.625% 11/30/27	3,700,000.00	3,233,669.90	
T 0.625% 12/31/27	3,000,000.00	2,614,453.14	
T 0.75% 01/31/28	3,500,000.00	3,056,074.21	
T 0.75% 03/31/26	2,750,000.00	2,553,364.24	
T 0.75% 04/30/26	3,500,000.00	3,240,371.08	
T 0.75% 08/31/26	3,000,000.00	2,745,585.93	
T 0.875% 09/30/26	5,000,000.00	4,579,394.55	
T 0.875% 11/15/30	6,160,000.00	4,946,768.78	
T 1.125% 02/15/31	5,600,000.00	4,547,375.00	
T 1.125% 02/29/28	3,880,000.00	3,427,737.50	
T 1.125% 05/15/40	1,550,000.00	950,949.21	
T 1.125% 08/15/40	3,600,000.00	2,188,546.88	
T 1.125% 08/31/28	4,000,000.00	3,483,203.12	
T 1.125% 10/31/26	6,850,000.00	6,292,233.40	
T 1.25% 03/31/28	4,100,000.00	3,630,902.35	
T 1.25% 04/30/28	5,300,000.00	4,682,218.75	
T 1.25% 05/15/50	5,120,000.00	2,534,200.01	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,289,726.54	
T 1.25% 06/30/28	1,000,000.00	879,453.12	
T 1.25% 08/15/31	6,550,000.00	5,278,634.78	
T 1.25% 09/30/28	3,800,000.00	3,319,210.92	
T 1.25% 11/30/26	3,000,000.00	2,757,539.07	
T 1.25% 12/31/26	5,500,000.00	5,045,927.75	
T 1.375% 08/15/50	2,300,000.00	1,174,347.66	
T 1.375% 10/31/28	1,700,000.00	1,490,123.04	
T 1.375% 11/15/31	12,110,000.00	9,780,244.17	
T 1.375% 11/15/40	4,650,000.00	2,932,224.62	
T 1.5% 01/31/27	4,850,000.00	4,466,357.43	
T 1.5% 02/15/30	1,820,000.00	1,552,332.03	
T 1.5% 08/15/26	5,300,000.00	4,938,523.46	
T 1.5% 11/30/28	5,550,000.00	4,881,723.61	
T 1.625% 02/15/26	4,450,000.00	4,212,029.30	
T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	5,077,898.42	
T 1.625% 05/15/31	4,290,000.00	3,576,955.06	
T 1.625% 08/15/29	1,760,000.00	1,533,056.25	
T 1.625% 09/30/26	2,150,000.00	2,003,783.20	
T 1.625% 11/15/50	3,100,000.00	1,693,496.08	
T 1.625% 11/30/26	3,030,000.00	2,811,626.96	
T 1.75% 01/31/29	2,500,000.00	2,215,869.15	
T 1.75% 08/15/41	4,800,000.00	3,169,687.48	

T 1.75% 11/15/29	2,220,000.00	1,937,383.58
T 1.75% 12/31/26	4,300,000.00	3,995,472.66
T 1.875% 02/15/32	6,200,000.00	5,173,003.91
T 1.875% 02/15/41	4,750,000.00	3,245,029.28
T 1.875% 02/15/51	4,500,000.00	2,623,271.49
T 1.875% 02/28/27	3,000,000.00	2,785,312.50
T 1.875% 02/28/29	1,900,000.00	1,691,222.66
T 1.875% 06/30/26	3,980,000.00	3,751,305.45
T 1.875% 07/31/26	1,800,000.00	1,692,984.38
T 1.875% 11/15/51	3,400,000.00	1,970,007.80
T 1% 07/31/28	2,500,000.00	2,170,556.65
T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	3,661,429.66
T 2.25% 02/15/52	2,410,000.00	1,533,080.07
T 2.25% 03/31/26	1,500,000.00	1,431,152.34
T 2.25% 05/15/41	1,600,000.00	1,156,875.00
T 2.25% 08/15/27	1,820,000.00	1,693,168.75
T 2.25% 08/15/46	2,180,000.00	1,452,765.62
T 2.25% 08/15/49	2,110,000.00	1,363,422.66
T 2.25% 11/15/25	5,500,000.00	5,289,667.95
T 2.25% 11/15/27	5,260,000.00	4,871,766.81
T 2.375% 02/15/42	1,350,000.00	981,492.18
T 2.375% 03/31/29	5,400,000.00	4,912,734.34
T 2.375% 04/30/26	1,820,000.00	1,737,673.42
T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,376,687.50
T 2.375% 05/15/29	1,390,000.00	1,262,320.89
T 2.375% 05/15/51	1,980,000.00	1,302,159.37
T 2.375% 11/15/49	2,010,000.00	1,333,744.92
T 2.5% 02/15/45	1,750,000.00	1,246,533.20
T 2.5% 02/15/46	1,250,000.00	880,517.57
T 2.5% 02/28/26	650,000.00	623,771.48
T 2.5% 05/15/46	1,810,000.00	1,271,666.39
T 2.625% 01/31/26	1,350,000.00	1,300,060.54
T 2.625% 02/15/29	6,900,000.00	6,361,072.25
T 2.625% 05/31/27	2,900,000.00	2,737,328.12
T 2.625% 12/31/25	4,500,000.00	4,340,566.39
T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	4,384,144.91
T 2.75% 04/30/27	5,500,000.00	5,217,265.62
T 2.75% 05/31/29	6,000,000.00	5,542,968.72
T 2.75% 06/30/25	2,000,000.00	1,951,115.22
T 2.75% 07/31/27	5,000,000.00	4,726,660.15
T 2.75% 08/15/32	3,180,000.00	2,813,554.67
T 2.75% 08/15/42	2,330,000.00	1,787,637.88
T 2.75% 08/15/47	300,000.00	218,566.40

T 2.75% 08/31/25	5,000,000.00	4,860,546.90
T 2.75% 11/15/42	1,650,000.00	1,261,541.01
T 2.75% 11/15/47	1,400,000.00	1,018,007.81
T 2.875% 04/30/29	4,170,000.00	3,878,833.00
T 2.875% 05/15/28	4,460,000.00	4,194,664.83
T 2.875% 05/15/32	6,750,000.00	6,046,787.09
T 2.875% 05/15/43	1,350,000.00	1,046,408.20
T 2.875% 05/15/49	1,410,000.00	1,041,362.11
T 2.875% 05/15/52	2,700,000.00	1,977,539.07
T 2.875% 07/31/25	500,000.00	487,695.31
T 2.875% 08/15/28	10,200,000.00	9,563,894.54
T 2.875% 08/15/45	1,880,000.00	1,425,935.93
T 2% 02/15/50	3,370,000.00	2,044,378.88
T 2% 08/15/25	3,750,000.00	3,616,992.18
T 2% 08/15/51	6,090,000.00	3,651,026.37
T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,530,880.85
T 2% 11/15/41	4,140,000.00	2,839,296.08
T 3.125% 02/15/42	1,000,000.00	818,828.12
T 3.125% 02/15/43	3,600,000.00	2,910,515.61
T 3.125% 05/15/48	1,400,000.00	1,088,992.18
T 3.125% 08/15/25	2,500,000.00	2,443,359.37
T 3.125% 08/15/44	1,550,000.00	1,236,851.56
T 3.125% 08/31/29	4,300,000.00	4,033,937.50
T 3.125% 11/15/28	7,460,000.00	7,048,825.76
T 3.125% 11/15/41	870,000.00	714,929.29
T 3.25% 05/15/42	1,500,000.00	1,245,117.18
T 3.25% 06/30/27	1,850,000.00	1,777,662.11
T 3.375% 05/15/33	2,310,000.00	2,129,621.47
T 3.375% 05/15/44	1,800,000.00	1,496,742.18
T 3.375% 08/15/42	1,200,000.00	1,011,609.37
T 3.375% 11/15/48	2,100,000.00	1,706,414.05
T 3.5% 01/31/30	5,040,000.00	4,799,812.50
T 3.5% 02/15/33	6,000,000.00	5,595,234.36
T 3.5% 02/15/39	200,000.00	179,382.81
T 3.625% 02/15/44	2,300,000.00	1,989,500.00
T 3.625% 02/15/53	3,270,000.00	2,777,520.11
T 3.625% 05/15/53	1,650,000.00	1,401,468.75
T 3.625% 08/15/43	2,700,000.00	2,341,722.66
T 3.75% 04/15/26	5,800,000.00	5,680,375.00
T 3.75% 06/30/30	2,500,000.00	2,406,787.10
T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	990,644.53
T 3.75% 11/15/43	1,800,000.00	1,587,726.55

T 3.875% 02/15/43	830,000.00	748,961.52
T 3.875% 08/15/33	4,000,000.00	3,829,296.88
T 3.875% 08/15/40	680,000.00	628,043.75
T 3.875% 09/30/29	1,050,000.00	1,020,673.82
T 3.875% 11/30/29	3,880,000.00	3,769,662.50
T 3.875% 12/31/29	1,500,000.00	1,456,816.41
T 3% 02/15/47	2,100,000.00	1,609,289.05
T 3% 02/15/48	2,950,000.00	2,245,111.33
T 3% 02/15/49	1,940,000.00	1,469,853.12
T 3% 05/15/42	1,100,000.00	880,601.56
T 3% 05/15/45	600,000.00	465,984.37
T 3% 05/15/47	1,300,000.00	994,500.00
T 3% 07/15/25	6,100,000.00	5,963,107.39
T 3% 08/15/48	2,360,000.00	1,791,295.31
T 3% 08/15/52	2,570,000.00	1,931,013.67
T 3% 09/30/25	3,660,000.00	3,564,067.95
T 3% 10/31/25	1,000,000.00	972,578.12
T 3% 11/15/44	1,550,000.00	1,208,515.62
T 4.125% 03/31/31	3,560,000.00	3,493,528.10
T 4.125% 08/15/53	3,300,000.00	3,068,291.02
T 4.125% 08/31/30	3,400,000.00	3,339,105.45
T 4.125% 11/15/32	5,690,000.00	5,564,642.18
T 4.25% 01/31/26	1,300,000.00	1,284,791.01
T 4.25% 02/15/54	3,150,000.00	2,994,714.82
T 4.25% 05/15/39	850,000.00	828,218.75
T 4.25% 10/15/25	680,000.00	672,615.62
T 4.25% 11/15/40	650,000.00	627,376.95
T 4.375% 02/15/38	500,000.00	497,392.58
T 4.375% 05/15/40	750,000.00	737,373.04
T 4.375% 05/15/41	550,000.00	537,582.03
T 4.375% 11/15/39	650,000.00	640,833.98
T 4.375% 11/30/30	3,970,000.00	3,952,243.53
T 4.5% 02/15/36	600,000.00	608,695.31
T 4.5% 05/15/38	250,000.00	251,630.86
T 4.5% 08/15/39	750,000.00	750,644.53
T 4.5% 11/15/25	4,350,000.00	4,316,950.17
T 4.5% 11/15/33	6,250,000.00	6,276,855.50
T 4.625% 02/15/40	700,000.00	708,996.09
T 4.625% 03/15/26	2,170,000.00	2,158,132.81
T 4.625% 09/30/28	2,950,000.00	2,962,214.82
T 4.625% 10/15/26	5,800,000.00	5,779,609.40
T 4.625% 11/15/26	3,600,000.00	3,588,679.69
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	767,446.29



	T 4.75% 11/15/53	2,500,000.00	2,581,445.30
	T 4% 02/15/34	1,000,000.00	965,703.12
	T 4% 02/28/30	2,400,000.00	2,344,453.12
	T 4% 02/29/28	2,200,000.00	2,157,761.71
	T 4% 06/30/28	2,000,000.00	1,961,015.62
	T 4% 07/31/30	800,000.00	780,515.62
	T 4% 11/15/52	3,500,000.00	3,185,000.00
	T 4% 12/15/25	5,000,000.00	4,925,976.55
	T 5.0% 05/15/37	300,000.00	317,753.90
	T 5.25% 11/15/28	1,900,000.00	1,958,781.25
	T 5.375% 02/15/31	750,000.00	794,296.87
	T 5% 08/31/25	3,930,000.00	3,923,629.10
	T 6.0% 02/15/26	600,000.00	611,484.37
	T 6.125% 11/15/27	1,850,000.00	1,941,560.55
	T 6.25% 05/15/30	2,920,000.00	3,190,442.19
	アメリカドル 小計	622,350,000.00	546,661,100.36 (85,831,259,367)
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	1,130,000.00	1,060,276.31
	CAN 0.5% 09/01/25	1,590,000.00	1,520,327.75
	CAN 0.5% 12/01/30	1,570,000.00	1,304,588.72
	CAN 1.25% 03/01/27	1,440,000.00	1,348,729.95
	CAN 1.25% 06/01/30	1,290,000.00	1,138,307.37
	CAN 1.5% 06/01/26	740,000.00	706,459.95
	CAN 1.5% 06/01/31	2,010,000.00	1,768,849.06
	CAN 1.5% 12/01/31	1,230,000.00	1,072,767.14
	CAN 1.75% 12/01/53	1,520,000.00	1,055,962.22
	CAN 1% 06/01/27	640,000.00	593,190.99
	CAN 1% 09/01/26	1,060,000.00	995,969.96
	CAN 2.25% 06/01/25	670,000.00	656,669.96
	CAN 2.25% 06/01/29	390,000.00	369,828.75
	CAN 2.25% 12/01/29	240,000.00	226,720.81
	CAN 2.5% 12/01/32	980,000.00	911,683.94
	CAN 2.75% 06/01/33	330,000.00	312,118.51
	CAN 2.75% 09/01/27	710,000.00	691,033.23
	CAN 2.75% 12/01/48	520,000.00	462,382.92
	CAN 2.75% 12/01/55	530,000.00	465,429.52
	CAN 2.75% 12/01/64	350,000.00	304,837.40
	CAN 2% 06/01/28	500,000.00	472,492.34
	CAN 2% 06/01/32	1,190,000.00	1,069,917.19
	CAN 2% 12/01/51	2,330,000.00	1,744,558.67
	CAN 3.25% 09/01/28	1,010,000.00	998,572.11
	CAN 3.5% 03/01/28	780,000.00	777,633.61

	CAN 3.5% 08/01/25	610,000.00	604,395.27
	CAN 3.5% 12/01/45	490,000.00	493,325.29
	CAN 3% 04/01/26	970,000.00	953,320.23
	CAN 3% 06/01/34	1,160,000.00	1,115,060.05
	CAN 3% 10/01/25	1,880,000.00	1,850,645.51
	CAN 4.0% 06/01/41	420,000.00	447,459.16
	CAN 4% 03/01/29	1,000,000.00	1,021,471.45
	CAN 5.75% 06/01/29	680,000.00	752,020.12
	CAN 5.75% 06/01/33	2,170,000.00	2,549,862.16
	CAN 5% 06/01/37	420,000.00	486,073.17
	カナダドル 小計	34,550,000.00	32,302,940.79 (3,684,473,426)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	5,250,000.00	5,316,885.00
	MBONO 5.5% 03/04/27	15,140,000.00	13,513,812.60
	MBONO 5.75% 03/05/26	28,180,000.00	26,087,514.95
	MBONO 7.5% 05/26/33	11,360,000.00	9,834,124.80
	MBONO 7.5% 06/03/27	21,620,000.00	20,175,135.40
	MBONO 7.75% 05/29/31	22,210,000.00	19,859,515.70
	MBONO 7.75% 11/13/42	15,680,000.00	12,888,960.00
	MBONO 7.75% 11/23/34	7,300,000.00	6,335,232.00
	MBONO 7% 09/03/26	3,040,000.00	2,838,508.80
	MBONO 8.5% 03/01/29	3,700,000.00	3,497,536.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,940,000.00	15,074,139.20
	MBONO 8.5% 11/18/38	13,720,000.00	12,304,370.40
	MBONO 8% 07/31/53	11,430,000.00	9,458,096.40
	MBONO 8% 11/07/47	14,310,000.00	11,887,603.20
	メキシコペソ 小計	188,880,000.00	169,071,434.45 (1,444,766,128)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	660,000.00	557,006.67
	BGB 0.35% 06/22/32	860,000.00	696,315.12
	BGB 0.4% 06/22/40	400,000.00	252,935.60
	BGB 0.65% 06/22/71	340,000.00	137,910.12
	BGB 0.8% 06/22/25	940,000.00	915,141.41
	BGB 0.8% 06/22/27	920,000.00	861,599.92
	BGB 0.8% 06/22/28	810,000.00	744,522.63
	BGB 0.9% 06/22/29	1,100,000.00	996,147.62
	BGB 0% 10/22/27	530,000.00	479,659.27
	BGB 0% 10/22/31	520,000.00	418,128.48
	BGB 1.25% 04/22/33	310,000.00	267,527.21
	BGB 1.4% 06/22/53	520,000.00	320,462.35
	BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	322,564.00
	BGB 1.6% 06/22/47	610,000.00	428,564.65
	BGB 1.7% 06/22/50	610,000.00	421,840.46

BGB 1.9% 06/22/38	480,000.00	403,223.40
BGB 1% 06/22/26	1,000,000.00	958,036.80
BGB 1% 06/22/31	910,000.00	795,898.96
BGB 2.15% 06/22/66	420,000.00	304,667.16
BGB 2.25% 06/22/57	330,000.00	248,154.22
BGB 2.7% 10/22/29	210,000.00	207,239.55
BGB 2.75% 04/22/39	140,000.00	130,017.33
BGB 2.85% 10/22/34	400,000.00	388,781.40
BGB 3.3% 06/22/54	580,000.00	550,330.10
BGB 3.45% 06/22/43	280,000.00	278,898.76
BGB 3.5% 06/22/55	250,000.00	245,058.87
BGB 3.75% 06/22/45	450,000.00	467,408.92
BGB 3% 06/22/33	860,000.00	853,772.74
BGB 3% 06/22/34	350,000.00	345,951.81
BGB 4.25% 03/28/41	870,000.00	960,884.55
BGB 4.5% 03/28/26	510,000.00	521,445.42
BGB 4% 03/28/32	620,000.00	660,873.50
BGB 5.5% 03/28/28	1,040,000.00	1,132,683.86
BGB 5% 03/28/35	1,110,000.00	1,290,458.25
BKO 2.5% 03/19/26	1,070,000.00	1,058,259.42
BKO 3.1% 09/18/25	1,000,000.00	997,632.25
BTPS 0.25% 03/15/28	1,250,000.00	1,110,785.93
BTPS 0.45% 02/15/29	1,710,000.00	1,488,898.71
BTPS 0.5% 02/01/26	1,250,000.00	1,190,662.50
BTPS 0.5% 07/15/28	730,000.00	648,913.42
BTPS 0.6% 08/01/31	1,300,000.00	1,053,344.50
BTPS 0.85% 01/15/27	1,000,000.00	936,552.25
BTPS 0.9% 04/01/31	1,300,000.00	1,087,947.57
BTPS 0.95% 03/01/37	600,000.00	416,965.50
BTPS 0.95% 06/01/32	1,190,000.00	966,288.80
BTPS 0.95% 08/01/30	420,000.00	359,372.58
BTPS 0.95% 09/15/27	1,000,000.00	924,346.75
BTPS 0.95% 12/01/31	1,120,000.00	922,902.40
BTPS 0% 04/01/26	2,700,000.00	2,537,260.20
BTPS 0% 08/01/26	1,330,000.00	1,235,836.66
BTPS 1.1% 04/01/27	900,000.00	844,233.30
BTPS 1.2% 08/15/25	940,000.00	914,627.52
BTPS 1.25% 12/01/26	1,170,000.00	1,110,170.29
BTPS 1.35% 04/01/30	1,510,000.00	1,336,710.89
BTPS 1.45% 03/01/36	830,000.00	633,695.45
BTPS 1.5% 04/30/45	650,000.00	406,776.50
BTPS 1.5% 06/01/25	1,500,000.00	1,470,990.00
BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,302,591.37

BTPS 1.65% 03/01/32	1,300,000.00	1,124,671.92	
BTPS 1.65% 12/01/30	820,000.00	727,550.74	
BTPS 1.7% 09/01/51	750,000.00	449,663.25	
BTPS 1.8% 03/01/41	890,000.00	634,356.62	
BTPS 1.85% 07/01/25	820,000.00	805,792.13	
BTPS 2.05% 08/01/27	1,040,000.00	997,986.60	
BTPS 2.15% 03/01/72	360,000.00	215,513.64	
BTPS 2.15% 09/01/52	510,000.00	333,922.24	
BTPS 2.2% 06/01/27	1,110,000.00	1,072,273.87	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,190,000.00	988,683.53	
BTPS 2.45% 09/01/33	1,360,000.00	1,218,951.68	
BTPS 2.45% 09/01/50	970,000.00	692,584.85	
BTPS 2.5% 11/15/25	660,000.00	651,107.32	
BTPS 2.5% 12/01/32	960,000.00	874,190.40	
BTPS 2.65% 12/01/27	770,000.00	750,449.70	
BTPS 2.7% 03/01/47	940,000.00	727,668.10	
BTPS 2.8% 03/01/67	500,000.00	360,947.72	
BTPS 2.8% 06/15/29	700,000.00	677,390.00	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,260,000.00	1,226,816.32	
BTPS 2.95% 02/15/27	220,000.00	217,117.50	
BTPS 2.95% 09/01/38	850,000.00	742,813.30	
BTPS 2% 02/01/28	750,000.00	713,695.12	
BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,027,821.15	
BTPS 3.1% 03/01/40	670,000.00	585,698.59	
BTPS 3.25% 03/01/38	270,000.00	245,211.30	
BTPS 3.25% 09/01/46	880,000.00	751,430.68	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,390,000.00	1,317,881.24	
BTPS 3.4% 04/01/28	1,050,000.00	1,048,045.95	
BTPS 3.45% 03/01/48	890,000.00	779,716.31	
BTPS 3.5% 01/15/26	1,490,000.00	1,489,255.00	
BTPS 3.5% 02/15/31	790,000.00	782,693.68	
BTPS 3.5% 03/01/30	1,870,000.00	1,867,239.88	
BTPS 3.6% 09/29/25	920,000.00	920,359.26	
BTPS 3.7% 06/15/30	500,000.00	502,595.30	
BTPS 3.85% 09/01/49	840,000.00	780,629.64	
BTPS 3.85% 12/15/29	1,250,000.00	1,268,167.50	
BTPS 3% 08/01/29	670,000.00	654,430.54	
BTPS 4.05% 10/30/37	600,000.00	598,154.85	
BTPS 4.15% 10/01/39	350,000.00	347,190.37	
BTPS 4.2% 03/01/34	900,000.00	922,806.90	
BTPS 4.35% 11/01/33	1,140,000.00	1,184,617.89	
BTPS 4.4% 05/01/33	240,000.00	250,888.32	

BTPS 4.45% 09/01/43	640,000.00	650,763.32
BTPS 4.5% 03/01/26	930,000.00	945,447.30
BTPS 4.5% 10/01/53	570,000.00	579,241.23
BTPS 4.75% 09/01/28	1,260,000.00	1,323,005.04
BTPS 4.75% 09/01/44	930,000.00	985,581.45
BTPS 4% 02/01/37	1,800,000.00	1,799,137.80
BTPS 4% 04/30/35	620,000.00	624,141.60
BTPS 4% 10/30/31	440,000.00	449,743.80
BTPS 4% 11/15/30	1,490,000.00	1,521,204.32
BTPS 5.0% 08/01/39	1,440,000.00	1,566,051.26
BTPS 5.25% 11/01/29	1,770,000.00	1,921,784.58
BTPS 5.75% 02/01/33	1,410,000.00	1,610,853.79
BTPS 5% 08/01/34	1,020,000.00	1,113,556.44
BTPS 5% 09/01/40	1,220,000.00	1,325,822.80
BTPS 6.5% 11/01/27	2,070,000.00	2,272,545.77
BTPS 6% 05/01/31	1,320,000.00	1,511,879.82
BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	380,222.85
DBR 0.25% 02/15/27	1,850,000.00	1,726,740.05
DBR 0.25% 02/15/29	1,750,000.00	1,568,212.18
DBR 0.25% 08/15/28	1,300,000.00	1,176,880.57
DBR 0.5% 02/15/26	1,990,000.00	1,905,810.56
DBR 0.5% 02/15/28	110,000.00	101,527.41
DBR 0.5% 08/15/27	580,000.00	540,151.10
DBR 0% 02/15/30	1,150,000.00	994,345.20
DBR 0% 02/15/31	1,380,000.00	1,165,052.58
DBR 0% 02/15/32	2,080,000.00	1,711,944.00
DBR 0% 05/15/35	1,280,000.00	961,135.99
DBR 0% 05/15/36	1,320,000.00	962,157.89
DBR 0% 08/15/26	1,950,000.00	1,829,504.62
DBR 0% 08/15/29	2,430,000.00	2,125,909.19
DBR 0% 08/15/30	1,880,000.00	1,607,148.53
DBR 0% 08/15/30	400,000.00	342,197.60
DBR 0% 08/15/31	1,860,000.00	1,552,073.48
DBR 0% 08/15/50	2,530,000.00	1,257,311.91
DBR 0% 08/15/52	1,560,000.00	738,178.32
DBR 0% 11/15/27	1,230,000.00	1,120,248.33
DBR 0% 11/15/28	1,250,000.00	1,112,633.75
DBR 1.25% 08/15/48	1,760,000.00	1,299,988.80
DBR 1.7% 08/15/32	1,310,000.00	1,226,494.37
DBR 1.8% 08/15/53	1,630,000.00	1,328,870.54
DBR 1% 05/15/38	970,000.00	776,383.39
DBR 1% 08/15/25	1,130,000.00	1,100,345.97
DBR 2.1% 11/15/29	450,000.00	437,614.65

DBR 2.2% 02/15/34	1,600,000.00	1,543,180.00
DBR 2.3% 02/15/33	2,120,000.00	2,072,787.81
DBR 2.4% 11/15/30	800,000.00	789,437.60
DBR 2.5% 07/04/44	1,520,000.00	1,454,594.40
DBR 2.5% 08/15/46	1,600,000.00	1,529,440.00
DBR 2.5% 08/15/54	650,000.00	619,839.18
DBR 2.6% 08/15/33	1,160,000.00	1,159,702.73
DBR 3.25% 07/04/42	930,000.00	990,962.43
DBR 4.0% 01/04/37	1,400,000.00	1,590,474.20
DBR 4.25% 07/04/39	990,000.00	1,169,680.44
DBR 4.75% 07/04/28	1,180,000.00	1,271,149.69
DBR 4.75% 07/04/34	1,160,000.00	1,374,774.81
DBR 4.75% 07/04/40	1,100,000.00	1,380,579.75
DBR 5.5% 01/04/31	1,090,000.00	1,275,438.97
DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	1,643,693.25
DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	721,871.86
DBR 6.5% 07/04/27	1,270,000.00	1,404,010.40
FRTR 0.25% 11/25/26	1,800,000.00	1,679,806.80
FRTR 0.5% 05/25/26	2,710,000.00	2,574,621.95
FRTR 0.5% 05/25/29	1,830,000.00	1,624,576.09
FRTR 0.5% 05/25/40	1,460,000.00	953,782.23
FRTR 0.5% 05/25/72	640,000.00	238,466.08
FRTR 0.5% 06/25/44	700,000.00	410,343.85
FRTR 0.75% 02/25/28	4,320,000.00	3,982,082.54
FRTR 0.75% 05/25/28	2,910,000.00	2,670,082.14
FRTR 0.75% 05/25/52	1,930,000.00	1,009,371.18
FRTR 0.75% 05/25/53	1,750,000.00	894,385.18
FRTR 0.75% 11/25/28	2,690,000.00	2,442,959.59
FRTR 0% 02/25/26	2,790,000.00	2,643,106.50
FRTR 0% 02/25/27	2,140,000.00	1,971,119.76
FRTR 0% 05/25/32	1,850,000.00	1,462,354.23
FRTR 0% 11/25/29	2,460,000.00	2,098,638.30
FRTR 0% 11/25/30	3,230,000.00	2,680,623.81
FRTR 0% 11/25/31	3,590,000.00	2,883,001.54
FRTR 1.25% 05/25/34	2,200,000.00	1,854,051.65
FRTR 1.25% 05/25/36	2,320,000.00	1,875,883.56
FRTR 1.25% 05/25/38	1,000,000.00	773,206.50
FRTR 1.5% 05/25/31	2,410,000.00	2,190,637.26
FRTR 1.5% 05/25/50	1,950,000.00	1,306,429.31
FRTR 1.75% 05/25/66	850,000.00	551,963.07
FRTR 1.75% 06/25/39	1,660,000.00	1,361,242.33
FRTR 1% 05/25/27	2,850,000.00	2,686,819.68

FRTR 1% 11/25/25	1,520,000.00	1,470,881.38
FRTR 2.5% 05/25/30	3,520,000.00	3,433,272.02
FRTR 2.5% 05/25/43	760,000.00	663,524.84
FRTR 2.5% 09/24/26	1,670,000.00	1,646,098.54
FRTR 2.75% 02/25/29	2,210,000.00	2,186,813.23
FRTR 2.75% 10/25/27	3,080,000.00	3,051,871.90
FRTR 2% 05/25/48	1,580,000.00	1,212,608.92
FRTR 2% 11/25/32	1,960,000.00	1,810,456.90
FRTR 3.25% 05/25/45	1,800,000.00	1,757,774.70
FRTR 3.25% 05/25/55	410,000.00	388,675.42
FRTR 3.5% 04/25/26	1,400,000.00	1,407,490.00
FRTR 3.5% 11/25/33	1,600,000.00	1,651,807.52
FRTR 3% 05/25/33	2,110,000.00	2,099,453.16
FRTR 3% 05/25/54	970,000.00	879,959.75
FRTR 4.5% 04/25/41	1,840,000.00	2,111,680.96
FRTR 4.75% 04/25/35	1,590,000.00	1,821,511.95
FRTR 4% 04/25/55	1,070,000.00	1,169,989.78
FRTR 4% 04/25/60	1,020,000.00	1,126,706.79
FRTR 4% 10/25/38	1,420,000.00	1,535,446.71
FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	2,781,035.50
FRTR 5.75% 10/25/32	2,150,000.00	2,571,905.25
FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	1,500,303.40
IRISH 0.2% 05/15/27	410,000.00	378,536.64
IRISH 0.2% 10/18/30	380,000.00	322,734.95
IRISH 0.35% 10/18/32	170,000.00	138,340.81
IRISH 0.4% 05/15/35	310,000.00	235,507.62
IRISH 0.55% 04/22/41	250,000.00	165,540.91
IRISH 0.9% 05/15/28	440,000.00	408,034.00
IRISH 0% 10/18/31	430,000.00	349,382.65
IRISH 1.1% 05/15/29	510,000.00	468,998.67
IRISH 1.3% 05/15/33	310,000.00	271,140.57
IRISH 1.35% 03/18/31	240,000.00	218,167.80
IRISH 1.5% 05/15/50	460,000.00	324,270.10
IRISH 1.7% 05/15/37	420,000.00	358,062.31
IRISH 1% 05/15/26	670,000.00	643,968.69
IRISH 2.4% 05/15/30	440,000.00	428,809.04
IRISH 2% 02/18/45	620,000.00	511,764.89
IRISH 3% 10/18/43	170,000.00	166,263.52
NETHER 0.25% 07/15/25	720,000.00	696,645.36
NETHER 0.25% 07/15/29	540,000.00	474,711.97
NETHER 0.5% 01/15/40	780,000.00	541,750.17
NETHER 0.5% 07/15/26	1,050,000.00	996,333.13
NETHER 0.5% 07/15/32	560,000.00	466,419.12

NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	842,666.40
NETHER 0.75% 07/15/28	450,000.00	413,693.10
NETHER 0% 01/15/26	870,000.00	827,598.37
NETHER 0% 01/15/27	750,000.00	694,616.80
NETHER 0% 01/15/29	1,040,000.00	913,459.29
NETHER 0% 01/15/38	530,000.00	354,854.34
NETHER 0% 01/15/52	970,000.00	448,132.70
NETHER 0% 07/15/30	850,000.00	717,455.25
NETHER 0% 07/15/31	800,000.00	657,377.49
NETHER 2.5% 01/15/30	420,000.00	412,425.72
NETHER 2.5% 01/15/33	820,000.00	798,775.12
NETHER 2.5% 07/15/33	590,000.00	572,355.46
NETHER 2.5% 07/15/34	270,000.00	260,326.71
NETHER 2.75% 01/15/47	1,050,000.00	1,018,112.81
NETHER 2% 01/15/54	560,000.00	459,167.38
NETHER 3.25% 01/15/44	240,000.00	249,489.27
NETHER 3.75% 01/15/42	1,010,000.00	1,113,700.43
NETHER 4% 01/15/37	950,000.00	1,051,578.75
NETHER 5.5% 01/15/28	780,000.00	848,038.38
OBL 0% 04/10/26	1,500,000.00	1,419,534.75
OBL 0% 04/16/27	1,210,000.00	1,116,644.87
OBL 0% 10/09/26	1,360,000.00	1,270,842.12
OBL 0% 10/10/25	1,970,000.00	1,889,137.41
OBL 1.3% 10/15/27	2,620,000.00	2,497,736.39
OBL 2.1% 04/12/29	200,000.00	194,752.00
OBL 2.1% 04/12/29	570,000.00	555,198.10
OBL 2.2% 04/13/28	900,000.00	882,081.90
OBL 2.4% 10/19/28	1,460,000.00	1,441,267.46
RAGB 0.25% 10/20/36	360,000.00	253,150.92
RAGB 0.5% 02/20/29	810,000.00	722,852.30
RAGB 0.5% 04/20/27	650,000.00	605,375.06
RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	121,526.69
RAGB 0.75% 02/20/28	590,000.00	544,452.44
RAGB 0.75% 03/20/51	460,000.00	259,142.15
RAGB 0.75% 10/20/26	900,000.00	852,765.75
RAGB 0.85% 06/30/20	200,000.00	87,189.00
RAGB 0.9% 02/20/32	720,000.00	615,465.00
RAGB 0% 02/20/30	930,000.00	786,285.24
RAGB 0% 02/20/31	850,000.00	696,568.20
RAGB 0% 10/20/28	420,000.00	369,504.97
RAGB 0% 10/20/40	330,000.00	195,489.85
RAGB 1.2% 10/20/25	680,000.00	660,987.54



RAGB 1.5% 02/20/47	530,000.00	381,903.42
RAGB 1.5% 11/02/86	200,000.00	116,504.45
RAGB 1.85% 05/23/49	360,000.00	274,530.42
RAGB 2.1% 09/20/17	280,000.00	203,712.60
RAGB 2.4% 05/23/34	460,000.00	432,427.48
RAGB 2.9% 02/20/33	720,000.00	710,337.60
RAGB 2.9% 02/20/34	320,000.00	314,379.27
RAGB 2% 07/15/26	260,000.00	254,199.40
RAGB 3.15% 06/20/44	420,000.00	412,836.73
RAGB 3.15% 10/20/53	190,000.00	185,192.38
RAGB 3.2% 07/15/39	130,000.00	129,051.52
RAGB 3.45% 10/20/30	150,000.00	153,784.68
RAGB 3.8% 01/26/62	210,000.00	234,953.20
RAGB 4.15% 03/15/37	770,000.00	845,552.86
RAGB 4.85% 03/15/26	470,000.00	483,159.53
RAGB 6.25% 07/15/27	540,000.00	590,388.04
RFGB 0.125% 04/15/36	270,000.00	189,510.03
RFGB 0.125% 04/15/52	240,000.00	107,922.94
RFGB 0.125% 09/15/31	290,000.00	236,283.66
RFGB 0.25% 09/15/40	210,000.00	131,571.72
RFGB 0.5% 04/15/26	500,000.00	476,356.66
RFGB 0.5% 04/15/43	180,000.00	111,146.40
RFGB 0.5% 09/15/27	380,000.00	350,620.45
RFGB 0.5% 09/15/28	290,000.00	261,443.55
RFGB 0.5% 09/15/29	290,000.00	255,462.36
RFGB 0.75% 04/15/31	320,000.00	276,292.08
RFGB 0.875% 09/15/25	380,000.00	368,777.21
RFGB 0% 09/15/30	330,000.00	274,426.47
RFGB 1.125% 04/15/34	310,000.00	258,891.85
RFGB 1.375% 04/15/27	140,000.00	133,582.97
RFGB 1.375% 04/15/47	330,000.00	233,106.39
RFGB 1.5% 09/15/32	260,000.00	231,008.73
RFGB 2.625% 07/04/42	350,000.00	320,447.75
RFGB 2.75% 04/15/38	170,000.00	160,706.95
RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	376,754.55
RFGB 2.875% 04/15/29	160,000.00	159,112.52
RFGB 2.95% 04/15/55	130,000.00	122,852.27
RFGB 3% 09/15/33	330,000.00	327,856.60
RFGB 3% 09/15/34	190,000.00	188,021.80
RFGB 4% 07/04/25	240,000.00	241,498.48
SPGB 0.1% 04/30/31	880,000.00	717,855.60
SPGB 0.5% 04/30/30	2,020,000.00	1,743,649.35
SPGB 0.5% 10/31/31	1,180,000.00	977,089.26

SPGB 0.6% 10/31/29	970,000.00	852,593.14
SPGB 0.7% 04/30/32	930,000.00	771,608.91
SPGB 0.8% 07/30/27	1,190,000.00	1,108,514.15
SPGB 0.8% 07/30/29	880,000.00	785,878.06
SPGB 0.85% 07/30/37	640,000.00	461,026.24
SPGB 0% 01/31/26	1,070,000.00	1,015,466.91
SPGB 0% 01/31/27	1,080,000.00	994,508.28
SPGB 0% 01/31/28	1,280,000.00	1,145,451.84
SPGB 0% 05/31/25	1,020,000.00	986,340.00
SPGB 1.2% 10/31/40	950,000.00	662,943.25
SPGB 1.25% 10/31/30	1,200,000.00	1,072,794.00
SPGB 1.3% 10/31/26	1,460,000.00	1,398,405.33
SPGB 1.4% 04/30/28	1,050,000.00	986,449.45
SPGB 1.4% 07/30/28	430,000.00	402,566.43
SPGB 1.45% 04/30/29	1,850,000.00	1,716,857.35
SPGB 1.45% 10/31/27	1,330,000.00	1,260,461.61
SPGB 1.45% 10/31/71	260,000.00	126,952.15
SPGB 1.5% 04/30/27	1,290,000.00	1,232,677.71
SPGB 1.85% 07/30/35	1,190,000.00	1,020,148.92
SPGB 1.9% 10/31/52	1,050,000.00	702,189.07
SPGB 1.95% 04/30/26	1,790,000.00	1,748,484.53
SPGB 1.95% 07/30/30	1,520,000.00	1,425,386.08
SPGB 1% 07/30/42	690,000.00	447,715.12
SPGB 1% 10/31/50	1,130,000.00	611,923.25
SPGB 2.15% 10/31/25	1,650,000.00	1,624,743.86
SPGB 2.35% 07/30/33	1,160,000.00	1,077,061.74
SPGB 2.55% 10/31/32	1,630,000.00	1,550,568.47
SPGB 2.7% 10/31/48	890,000.00	737,251.52
SPGB 2.8% 05/31/26	330,000.00	327,148.50
SPGB 2.9% 10/31/46	1,020,000.00	887,698.09
SPGB 3.15% 04/30/33	1,580,000.00	1,566,290.34
SPGB 3.25% 04/30/34	870,000.00	862,908.76
SPGB 3.45% 07/30/43	580,000.00	555,027.23
SPGB 3.45% 07/30/66	840,000.00	760,947.70
SPGB 3.5% 05/31/29	390,000.00	397,343.31
SPGB 3.55% 10/31/33	1,330,000.00	1,355,748.80
SPGB 3.9% 07/30/39	540,000.00	555,444.00
SPGB 4.2% 01/31/37	1,050,000.00	1,125,839.61
SPGB 4.65% 07/30/25	1,410,000.00	1,429,334.62
SPGB 4.7% 07/30/41	1,240,000.00	1,400,008.36
SPGB 4.9% 07/30/40	1,080,000.00	1,239,531.66
SPGB 4% 10/31/54	250,000.00	253,373.75

	SPGB 5.15% 10/31/28	500,000.00	542,342.75
	SPGB 5.15% 10/31/44	790,000.00	945,942.84
	SPGB 5.75% 07/30/32	950,000.00	1,122,269.39
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,360,000.00	1,433,676.23
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	2,646,822.62
	ユーロ 小計	363,910,000.00	334,936,127.10 (56,681,240,789)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	780,000.00	728,342.94
	UKT 0.125% 01/31/28	880,000.00	760,029.60
	UKT 0.25% 07/31/31	1,730,000.00	1,320,470.07
	UKT 0.375% 10/22/26	1,170,000.00	1,066,025.06
	UKT 0.375% 10/22/30	1,250,000.00	992,611.25
	UKT 0.5% 01/31/29	1,180,000.00	1,000,215.20
	UKT 0.5% 10/22/61	1,050,000.00	309,435.00
	UKT 0.625% 06/07/25	900,000.00	864,409.50
	UKT 0.625% 07/31/35	1,030,000.00	696,934.05
	UKT 0.625% 10/22/50	640,000.00	253,520.00
	UKT 0.875% 01/31/46	510,000.00	249,747.00
	UKT 0.875% 07/31/33	1,500,000.00	1,122,502.35
	UKT 0.875% 10/22/29	820,000.00	694,704.00
	UKT 1.125% 01/31/39	1,120,000.00	718,032.00
	UKT 1.125% 10/22/73	480,000.00	171,840.00
	UKT 1.25% 07/22/27	740,000.00	675,805.00
	UKT 1.25% 07/31/51	1,170,000.00	561,856.23
	UKT 1.25% 10/22/41	1,190,000.00	719,978.56
	UKT 1.5% 07/22/26	1,180,000.00	1,112,114.60
	UKT 1.5% 07/22/47	860,000.00	478,531.86
	UKT 1.5% 07/31/53	680,000.00	340,931.60
	UKT 1.625% 10/22/28	480,000.00	432,753.60
	UKT 1.625% 10/22/54	720,000.00	369,792.00
	UKT 1.625% 10/22/71	710,000.00	320,920.00
	UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	346,714.80
	UKT 1.75% 07/22/57	980,000.00	511,089.01
	UKT 1.75% 09/07/37	1,110,000.00	815,739.00
	UKT 1% 01/31/32	1,880,000.00	1,495,070.00
	UKT 2.5% 07/22/65	860,000.00	536,554.00
	UKT 2% 09/07/25	840,000.00	812,313.60
	UKT 3.25% 01/22/44	1,240,000.00	1,017,916.00
	UKT 3.25% 01/31/33	1,760,000.00	1,639,433.66
UKT 3.5% 01/22/45	1,130,000.00	957,135.99	
UKT 3.5% 07/22/68	800,000.00	644,771.20	
UKT 3.5% 10/22/25	1,330,000.00	1,307,287.59	
UKT 3.75% 01/29/38	1,060,000.00	983,150.00	

	UKT 3.75% 03/07/27	130,000.00	127,426.24
	UKT 3.75% 07/22/52	880,000.00	754,813.13
	UKT 3.75% 10/22/53	1,480,000.00	1,262,292.00
	UKT 4.125% 01/29/27	1,870,000.00	1,852,309.80
	UKT 4.125% 07/22/29	300,000.00	298,518.00
	UKT 4.25% 03/07/36	850,000.00	842,010.00
	UKT 4.25% 06/07/32	770,000.00	776,498.80
	UKT 4.25% 09/07/39	670,000.00	649,678.90
	UKT 4.25% 12/07/27	600,000.00	600,030.00
	UKT 4.25% 12/07/40	800,000.00	770,522.80
	UKT 4.25% 12/07/46	1,020,000.00	960,228.00
	UKT 4.25% 12/07/49	810,000.00	759,132.00
	UKT 4.25% 12/07/55	1,000,000.00	933,100.00
	UKT 4.375% 07/31/54	500,000.00	475,238.30
	UKT 4.5% 06/07/28	1,600,000.00	1,610,672.80
	UKT 4.5% 09/07/34	840,000.00	854,700.00
	UKT 4.5% 12/07/42	930,000.00	916,236.00
	UKT 4.625% 01/31/34	1,580,000.00	1,625,278.36
	UKT 4.75% 10/22/43	630,000.00	637,497.00
	UKT 4.75% 12/07/30	760,000.00	787,656.40
	UKT 4.75% 12/07/38	810,000.00	832,356.00
	UKT 4% 01/22/60	710,000.00	635,308.00
	UKT 4% 10/22/63	660,000.00	588,005.15
	UKT 6.0% 12/07/28	1,070,000.00	1,150,164.40
	イギリスポンド 小計	57,630,000.00	47,728,348.40 (9,532,305,742)
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	3,010,000.00	2,588,279.22
	SGB 0.75% 05/12/28	3,240,000.00	3,034,558.14
	SGB 0.75% 11/12/29	4,140,000.00	3,819,747.02
	SGB 1.75% 11/11/33	1,970,000.00	1,872,165.14
	SGB 1% 11/12/26	3,890,000.00	3,746,229.76
	SGB 2.25% 06/01/32	2,560,000.00	2,539,860.24
	SGB 3.5% 03/30/39	2,250,000.00	2,539,912.50
	スウェーデンクローナ 小計	21,060,000.00	20,140,752.02 (299,492,982)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	2,370,000.00	2,023,941.48
	NGB 1.375% 08/19/30	3,280,000.00	2,889,868.60
	NGB 1.5% 02/19/26	2,510,000.00	2,414,019.60
	NGB 1.75% 02/17/27	2,420,000.00	2,304,287.70
	NGB 1.75% 09/06/29	2,310,000.00	2,114,679.65
	NGB 2.125% 05/18/32	1,630,000.00	1,470,643.05
	NGB 2% 04/26/28	2,510,000.00	2,370,255.75

	NGB 3.5% 10/06/42	1,200,000.00	1,202,235.00
	NGB 3.625% 04/13/34	1,350,000.00	1,350,158.89
	NGB 3% 08/15/33	2,330,000.00	2,226,198.50
ノルウェークローネ 小計		21,910,000.00	20,366,288.22 (297,958,796)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	2,880,000.00	1,500,234.62
	DGB 0.5% 11/15/27	3,770,000.00	3,500,639.11
	DGB 0.5% 11/15/29	2,840,000.00	2,545,629.74
	DGB 0% 11/15/31	3,330,000.00	2,769,031.12
	DGB 1.75% 11/15/25	2,450,000.00	2,406,658.56
	DGB 2.25% 11/15/33	1,670,000.00	1,621,328.42
	DGB 4.5% 11/15/39	5,220,000.00	6,346,350.72
デンマーククローネ 小計		22,160,000.00	20,689,872.29 (469,246,303)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,080,000.00	962,260.56
	POLGB 1.25% 10/25/30	2,040,000.00	1,579,944.30
	POLGB 1.75% 04/25/32	2,940,000.00	2,228,768.43
	POLGB 2.5% 07/25/26	3,600,000.00	3,406,199.40
	POLGB 2.5% 07/25/27	2,260,000.00	2,078,811.28
	POLGB 2.75% 04/25/28	3,870,000.00	3,522,117.96
	POLGB 2.75% 10/25/29	4,370,000.00	3,822,640.02
	POLGB 3.25% 07/25/25	2,940,000.00	2,884,020.93
	POLGB 3.75% 05/25/27	300,000.00	287,479.87
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,100,000.00	1,112,216.05
	POLGB 6% 10/25/33	1,690,000.00	1,728,301.63
	POLGB 7.5% 07/25/28	1,530,000.00	1,642,243.86
	ポーランドズロチ 小計		27,720,000.00
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/25	1,000,000.00	946,112.08
	ACGB 0.5% 09/21/26	1,030,000.00	953,900.55
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,140,000.00	918,724.25
	ACGB 1.5% 06/21/31	1,190,000.00	1,004,190.42
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,060,000.00	593,730.14
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,260,000.00	1,044,346.57
	ACGB 1% 11/21/31	1,860,000.00	1,492,275.99
	ACGB 1% 12/21/30	1,480,000.00	1,224,165.29
	ACGB 2.25% 05/21/28	630,000.00	592,397.92
	ACGB 2.5% 05/21/30	620,000.00	571,251.17
	ACGB 2.75% 05/21/41	750,000.00	595,142.56
	ACGB 2.75% 06/21/35	630,000.00	547,060.32
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,080,000.00	1,040,518.08
	ACGB 2.75% 11/21/28	770,000.00	733,963.56
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,080,000.00	1,016,252.28

	ACGB 3.25% 04/21/29	1,030,000.00	999,176.92	
	ACGB 3.25% 06/21/39	480,000.00	419,292.82	
	ACGB 3.5% 12/21/34	820,000.00	768,990.91	
	ACGB 3.75% 04/21/37	780,000.00	736,743.85	
	ACGB 3.75% 05/21/34	1,050,000.00	1,010,273.61	
	ACGB 3% 03/21/47	720,000.00	557,983.26	
	ACGB 3% 11/21/33	1,120,000.00	1,015,494.40	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,200,000.00	1,205,717.88	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,340,000.00	1,371,220.39	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,080,000.00	1,104,661.69	
	ACGB 4.75% 06/21/54	330,000.00	338,881.29	
	オーストラリアドル 小計	25,530,000.00	22,802,468.20 (2,353,898,792)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	490,000.00	414,987.63	
	NZGB 0.5% 05/15/26	360,000.00	331,724.41	
	NZGB 1.5% 05/15/31	460,000.00	377,833.36	
	NZGB 1.75% 05/15/41	260,000.00	166,500.09	
	NZGB 2.75% 04/15/37	350,000.00	282,270.48	
	NZGB 2.75% 05/15/51	350,000.00	237,987.86	
	NZGB 2% 05/15/32	350,000.00	290,689.90	
	NZGB 3.5% 04/14/33	740,000.00	681,048.12	
	NZGB 3% 04/20/29	450,000.00	420,869.52	
	NZGB 4.25% 05/15/34	340,000.00	329,576.79	
	NZGB 4.5% 04/15/27	560,000.00	557,940.94	
	NZGB 4.5% 05/15/30	260,000.00	260,024.72	
	NZGB 4.5% 05/15/35	220,000.00	216,514.99	
	NZGB 5% 05/15/54	190,000.00	191,986.62	
	ニュージーランドドル 小計	5,380,000.00	4,759,955.43 (455,956,130)	
シンガポールドドル	SIGB 0.5% 11/01/25	320,000.00	307,151.22	
	SIGB 1.25% 11/01/26	90,000.00	85,745.25	
	SIGB 1.625% 07/01/31	390,000.00	350,937.78	
	SIGB 1.875% 03/01/50	330,000.00	257,150.94	
	SIGB 1.875% 10/01/51	270,000.00	209,574.00	
	SIGB 2.125% 06/01/26	770,000.00	751,540.81	
	SIGB 2.25% 08/01/36	450,000.00	406,177.02	
	SIGB 2.375% 06/01/25	430,000.00	425,133.49	
	SIGB 2.375% 07/01/39	230,000.00	207,530.15	
	SIGB 2.625% 05/01/28	280,000.00	274,111.91	
	SIGB 2.625% 08/01/32	180,000.00	172,400.16	
	SIGB 2.75% 03/01/46	410,000.00	384,483.65	
	SIGB 2.75% 04/01/42	300,000.00	282,733.26	
	SIGB 2.875% 07/01/29	530,000.00	522,208.19	

	SIGB 2.875% 08/01/28	80,000.00	79,048.32
	SIGB 2.875% 09/01/27	80,000.00	79,114.63
	SIGB 2.875% 09/01/30	460,000.00	451,151.96
	SIGB 3.375% 09/01/33	400,000.00	404,918.76
	SIGB 3.5% 03/01/27	580,000.00	583,188.08
	SIGB 3% 04/01/29	80,000.00	79,422.00
	SIGB 3% 08/01/72	270,000.00	262,883.47
	シンガポールドル 小計	6,930,000.00	6,576,605.05 (763,280,782)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	960,000.00	892,101.87
	MGS 3.502% 05/31/27	920,000.00	918,628.49
	MGS 3.519% 04/20/28	400,000.00	398,353.74
	MGS 3.582% 07/15/32	320,000.00	313,893.37
	MGS 3.733% 06/15/28	1,180,000.00	1,184,098.73
	MGS 3.757% 05/22/40	1,110,000.00	1,069,429.32
	MGS 3.828% 07/05/34	250,000.00	248,924.02
	MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	858,433.64
	MGS 3.885% 08/15/29	1,890,000.00	1,909,373.44
	MGS 3.892% 03/15/27	300,000.00	302,843.88
	MGS 3.899% 11/16/27	1,820,000.00	1,838,403.65
	MGS 3.9% 11/30/26	1,140,000.00	1,151,433.74
	MGS 3.906% 07/15/26	750,000.00	756,800.70
	MGS 3.955% 09/15/25	1,450,000.00	1,460,213.36
	MGS 4.065% 06/15/50	1,340,000.00	1,308,050.84
	MGS 4.232% 06/30/31	950,000.00	974,302.03
	MGS 4.254% 05/31/35	1,480,000.00	1,520,862.50
	MGS 4.392% 04/15/26	380,000.00	386,395.28
	MGS 4.457% 03/31/53	670,000.00	696,291.86
	MGS 4.498% 04/15/30	1,040,000.00	1,080,484.18
MGS 4.642% 11/07/33	1,160,000.00	1,229,540.95	
MGS 4.696% 10/15/42	780,000.00	836,217.01	
MGS 4.736% 03/15/46	640,000.00	689,732.35	
MGS 4.762% 04/07/37	1,160,000.00	1,247,853.18	
MGS 4.893% 06/08/38	1,490,000.00	1,629,565.76	
MGS 4.921% 07/06/48	1,170,000.00	1,295,697.78	
MGS 4.935% 09/30/43	820,000.00	903,784.23	
	マレーシアリンギット 小計	26,430,000.00	27,101,709.90 (901,394,740)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.5% 02/27/26	350,000.00	329,315.94
	ILGOV 1.3% 04/30/32	1,310,000.00	1,013,795.50
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,230,000.00	822,302.97
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,290,000.00	1,250,698.34

	ILGOV 1% 03/31/30	2,160,000.00	1,762,894.36
	ILGOV 2.25% 09/28/28	1,320,000.00	1,208,170.65
	ILGOV 2.8% 11/29/52	600,000.00	380,156.70
	ILGOV 2% 03/31/27	1,290,000.00	1,207,839.38
	ILGOV 3.75% 02/28/29	1,360,000.00	1,317,187.87
	ILGOV 3.75% 03/31/47	1,440,000.00	1,152,655.92
	ILGOV 4% 03/30/35	440,000.00	408,988.44
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,060,000.00	1,102,516.91
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,550,000.00	1,612,565.90
	イスラエルシェケル 小計	15,400,000.00	13,569,088.88 (566,619,370)
オフショア 人民元	CGB 1.85% 05/15/27	15,000,000.00	14,986,523.10
	CGB 1.99% 03/15/26	4,400,000.00	4,418,216.00
	CGB 2.18% 08/15/26	23,000,000.00	23,161,825.70
	CGB 2.18% 08/25/25	21,830,000.00	21,948,122.13
	CGB 2.22% 09/25/25	12,250,000.00	12,332,290.60
	CGB 2.27% 05/25/34	8,550,000.00	8,552,311.06
	CGB 2.28% 11/25/25	23,020,000.00	23,199,328.10
	CGB 2.3% 05/15/26	12,000,000.00	12,117,320.40
	CGB 2.33% 12/15/25	16,300,000.00	16,449,542.72
	CGB 2.35% 02/25/34	12,500,000.00	12,561,623.75
	CGB 2.37% 01/15/29	29,300,000.00	29,735,283.73
	CGB 2.37% 01/20/27	19,900,000.00	20,137,801.02
	CGB 2.39% 11/15/26	14,500,000.00	14,677,200.15
	CGB 2.4% 07/15/28	17,600,000.00	17,851,078.08
	CGB 2.44% 10/15/27	7,000,000.00	7,101,555.30
	CGB 2.46% 02/15/26	3,200,000.00	3,236,757.12
	CGB 2.48% 04/15/27	16,380,000.00	16,651,175.81
	CGB 2.48% 09/25/28	10,800,000.00	10,990,331.64
	CGB 2.49% 05/25/44	1,720,000.00	1,725,211.25
	CGB 2.5% 07/25/27	26,400,000.00	26,850,389.28
	CGB 2.52% 08/25/33	20,700,000.00	21,065,957.37
	CGB 2.54% 12/25/30	23,400,000.00	23,899,086.90
	CGB 2.55% 10/15/28	13,800,000.00	14,096,809.02
	CGB 2.6% 09/01/32	14,750,000.00	15,095,847.67
	CGB 2.6% 09/15/30	12,500,000.00	12,805,876.25
	CGB 2.62% 06/25/30	13,000,000.00	13,333,214.70
	CGB 2.62% 09/25/29	20,000,000.00	20,517,748.00
	CGB 2.67% 05/25/33	9,900,000.00	10,181,420.37
	CGB 2.67% 11/25/33	12,000,000.00	12,370,608.00
	CGB 2.68% 05/21/30	21,550,000.00	22,187,890.77
	CGB 2.69% 08/12/26	28,920,000.00	29,461,833.55
	CGB 2.69% 08/15/32	12,700,000.00	13,084,919.22



	CGB 2.75% 06/15/29	9,130,000.00	9,426,634.61	
	CGB 2.79% 12/15/29	9,740,000.00	10,071,527.19	
	CGB 2.8% 03/24/29	29,320,000.00	30,315,915.36	
	CGB 2.8% 03/25/30	19,000,000.00	19,690,676.60	
	CGB 2.8% 11/15/32	6,000,000.00	6,235,020.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	11,760,000.00	12,090,777.04	
	CGB 2.88% 02/25/33	5,100,000.00	5,337,670.20	
	CGB 2.89% 11/18/31	22,500,000.00	23,506,850.25	
	CGB 2.91% 10/14/28	20,300,000.00	21,061,792.01	
	CGB 3.01% 05/13/28	15,960,000.00	16,600,904.12	
	CGB 3.02% 05/27/31	13,850,000.00	14,595,990.08	
	CGB 3.02% 10/22/25	30,000,000.00	30,552,735.00	
	CGB 3.03% 03/11/26	22,150,000.00	22,652,867.02	
	CGB 3.12% 10/25/52	8,200,000.00	9,069,520.62	
	CGB 3.19% 04/15/53	4,600,000.00	5,184,278.66	
	CGB 3.27% 11/19/30	5,930,000.00	6,355,161.43	
	CGB 3.28% 12/03/27	11,140,000.00	11,679,587.06	
	CGB 3.32% 04/15/52	7,220,000.00	8,258,443.21	
	CGB 3.39% 03/16/50	11,760,000.00	13,512,077.71	
	CGB 3.53% 10/18/51	6,510,000.00	7,701,424.39	
	CGB 3.72% 04/12/51	6,850,000.00	8,336,523.29	
	CGB 3.81% 09/14/50	8,230,000.00	10,132,595.76	
	CGB 3.86% 07/22/49	5,810,000.00	7,165,274.29	
	CGB 3% 10/15/53	12,350,000.00	13,502,625.50	
	CGB 4.08% 10/22/48	8,080,000.00	10,278,116.32	
	オフショア人民元 小計	810,360,000.00	840,100,086.48 (18,145,993,847)	
	合計		182,419,034,990 (182,419,034,990)	

## 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 201銘柄	100.0%	47.1%
カナダドル	国債証券 35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%	31.1%
イギリスポンド	国債証券 60銘柄	100.0%	5.2%
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	7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券	12銘柄	100.0%	0.5%
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%
マレーシアリングット	国債証券	27銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券	13銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券	57銘柄	100.0%	9.9%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

**【中間財務諸表】**

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期中間計算期間(2024年6月11日から2024年12月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けておりません。

## 【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位：円 )

	第17期 ( 2024年 6月10日現在 )	第18期中間計算期間 ( 2024年12月10日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	27,408,405	33,887,387
親投資信託受益証券	4,941,296,609	4,952,662,026
未収入金	10,451,893	4,228,695
未収利息	50	200
流動資産合計	4,979,156,957	4,990,778,308
資産合計	4,979,156,957	4,990,778,308
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	453,647	2,237,833
未払受託者報酬	1,277,693	1,348,476
未払委託者報酬	14,054,551	14,833,158
その他未払費用	127,712	134,784
流動負債合計	15,913,603	18,554,251
負債合計	15,913,603	18,554,251
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,665,151,643	1,629,064,995
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	3,298,091,711	3,343,159,062
( 分配準備積立金 )	2,741,059,488	2,647,453,272
元本等合計	4,963,243,354	4,972,224,057
純資産合計	4,963,243,354	4,972,224,057
負債純資産合計	4,979,156,957	4,990,778,308

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期中間計算期間 自 2023年 6月13日 至 2023年12月12日	第18期中間計算期間 自 2024年 6月11日 至 2024年12月10日
<b>営業収益</b>		
受取利息	44	27,460
有価証券売買等損益	336,406,859	131,890,864
<b>営業収益合計</b>	<b>336,406,903</b>	<b>131,918,324</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	3,511	-
受託者報酬	1,204,981	1,348,476
委託者報酬	13,254,745	14,833,158
その他費用	120,438	134,784
<b>営業費用合計</b>	<b>14,583,675</b>	<b>16,316,418</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>321,823,228</b>	<b>115,601,906</b>
経常利益又は経常損失（ ）	321,823,228	115,601,906
<b>中間純利益又は中間純損失（ ）</b>	<b>321,823,228</b>	<b>115,601,906</b>
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	10,870,208	1,062,074
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>2,454,674,417</b>	<b>3,298,091,711</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	46,653,033	41,843,872
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	46,653,033	41,843,872
剰余金減少額又は欠損金増加額	115,763,895	113,440,501
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	115,763,895	113,440,501
分配金	-	-
<b>中間剰余金又は中間欠損金（ ）</b>	<b>2,696,516,575</b>	<b>3,343,159,062</b>

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (中間貸借対照表に関する注記)

	第17期 (2024年 6月10日現在)	第18期中間計算期間 (2024年12月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,665,151,643口	1,629,064,995口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.9807円 (29,807円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.0522円 (30,522円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	第18期中間計算期間 (2024年12月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	第17期 自 2023年 6月13日 至 2024年 6月10日	第18期中間計算期間 自 2024年 6月11日 至 2024年12月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,794,883,011円	1,665,151,643円
期中追加設定元本額	55,465,033円	21,356,956円
期中一部解約元本額	185,196,401円	57,443,604円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2024年12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,593,026,904
株式	421,499,801,922
未収入金	144,075,000
未収配当金	267,648,147
未収利息	33,161
前払金	4,925,000
差入委託証拠金	176,081,901
流動資産合計	427,685,592,035
資産合計	427,685,592,035
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,033,350
未払金	325,900
未払解約金	406,457,371
流動負債合計	411,816,621
負債合計	411,816,621
純資産の部	
元本等	
元本	127,932,502,280
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	299,341,273,134
元本等合計	427,273,775,414
純資産合計	427,273,775,414
負債純資産合計	427,685,592,035

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年12月10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12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	127,932,502,280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 3.3398円 (1万口当たり純資産額) (33,398円)

（金融商品に関する注記）  
金融商品の時価等に関する事項

2024年12月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2024年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 6月11日
期首元本額	128,699,406,748円
期中追加設定元本額	9,522,263,643円
期中一部解約元本額	10,289,168,111円
期末元本額	127,932,502,280円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	567,949,866円
D C日本株式インデックスファンド	266,775,192円
D C日本株式インデックスファンドL	52,481,243,558円
D C日本株式インデックスファンドA	628,288,318円
D Cバランスファンド3 0	1,897,299,070円
D Cバランスファンド5 0	3,308,931,173円
D Cバランスファンド7 0	2,369,663,059円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	487,914,067円
日本株式インデックスe	1,279,369,794円
インデックスコレクション(国内株式)	24,066,129,000円
インデックスコレクション(バランス株式3 0)	10,335,179,497円
インデックスコレクション(バランス株式5 0)	3,622,953,735円
インデックスコレクション(バランス株式7 0)	3,846,258,741円
私募日本株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	8,250,143,343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)	2,612,286,743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)	531,356,240円
バランスVA3 0(適格機関投資家専用)	18,079,325円
バランスVA5 0(適格機関投資家専用)	272,851,795円
VAバランスファンド(株2 5 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	37,511,206円
VAバランスファンド(株5 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	95,323,298円
VAバランスファンド(株6 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	25,492,763円
バランスVA2 5(適格機関投資家専用)	293,269,839円
バランスVA3 7. 5(適格機関投資家専用)	266,190,925円
バランスVA5 0 L(適格機関投資家専用)	4,763,536,225円
バランスVA7 5(適格機関投資家専用)	515,367,163円
VAバランスファンド(株4 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	30,654,811円
VAポートフォリオ4 0(適格機関投資家専用)	743,915,762円
VAポートフォリオ2 0(適格機関投資家専用)	11,661,187円
バランスVA4 0(適格機関投資家専用)	91,993,231円



区分	2024年12月10日現在
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,234,851,244円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	28,967,538円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	33,544,522円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	5,244,668円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	305,648,937円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	151,439,744円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	2,316,921,432円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	50,482,562円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	15,230,717円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	5,026,066円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	65,501,520円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	2,054,404円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2024年12月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,404,695,000	-	5,399,770,000	4,925,000
合計		5,404,695,000	-	5,399,770,000	4,925,000

## （注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国株式マザーファンド

## 貸借対照表

	2024年12月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	6,074,782,182
コール・ローン	1,341,801,081
株式	589,105,564,440
投資信託受益証券	98,276,348
投資証券	11,041,103,562
派生商品評価勘定	443,342,562
未収入金	1
未収配当金	695,781,700
未収利息	7,955
差入委託証拠金	5,090,747,012
流動資産合計	613,891,406,843
資産合計	613,891,406,843
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	34,624,343
前受金	427,711,400
未払解約金	251,082,406
流動負債合計	713,418,149
負債合計	713,418,149
純資産の部	

	2024年12月10日現在
項目	金額（円）
元本等	
元本	79,721,789,631
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	533,456,199,063
元本等合計	613,177,988,694
純資産合計	613,177,988,694
負債純資産合計	613,891,406,843

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p>

	2024年12月10日現在
	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12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	79,721,789,631口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 7.6915円 (76,915円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2024年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

	区分	2024年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況		
期首		2024年 6月11日
期首元本額		78,733,268,013円
期中追加設定元本額		4,401,615,993円
期中一部解約元本額		3,413,094,375円
期末元本額		79,721,789,631円
期末元本額の内訳		
外国株式インデックスファンド		1,356,820,539円
DC外国株式インデックスファンド		5,198,065,766円
DC外国株式インデックスファンドL		31,021,603,408円
DCバランスファンド30		432,915,527円
DCバランスファンド50		961,160,444円
DCバランスファンド70		797,413,375円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド		222,251,878円
外国株式インデックスe		4,065,442,957円
インデックスコレクション（外国株式）		20,249,204,395円
インデックスコレクション（バランス株式30）		2,360,262,266円
インデックスコレクション（バランス株式50）		1,087,471,878円
インデックスコレクション（バランス株式70）		1,297,649,577円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）		5,393,224,042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）		1,565,406,789円

区分	2024年12月10日現在
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	255,206,312円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	8,095,938円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	118,710,218円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	15,862,305円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	40,312,638円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	53,926,980円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	87,781,127円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	102,962,606円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	2,091,209,439円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	254,741,496円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	38,899,527円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	314,641,199円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	4,929,500円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	41,520,695円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	36,758,827円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	127,710,739円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	2,203,838円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	30,183,623円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	83,138,220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）	4,101,563円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2024年12月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	12,434,731,779	-	12,862,443,179	427,711,400
合計		12,434,731,779	-	12,862,443,179	427,711,400

## （注）1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2024年12月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,107,233,445	-	1,088,240,264	18,993,181
	アメリカドル	792,814,415	-	779,301,260	13,513,155
	ユーロ	255,433,780	-	250,999,824	4,433,956
	イギリスポンド	58,985,250	-	57,939,180	1,046,070
合計		1,107,233,445	-	1,088,240,264	18,993,181

## （注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国債券マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	405,251,838
コール・ローン	1,267,490,002
国債証券	187,026,869,236
派生商品評価勘定	6,311,996
未収利息	1,259,170,250
前払金	578,886
前払費用	130,448,358
差入委託証拠金	90,680,016
流動資産合計	190,186,800,582
資産合計	190,186,800,582
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,558,914
未払金	23,405,274
未払解約金	144,893,198
流動負債合計	180,857,386
負債合計	180,857,386
純資産の部	
元本等	
元本	60,438,169,412
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	129,567,773,784
元本等合計	190,005,943,196
純資産合計	190,005,943,196
負債純資産合計	190,186,800,582

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

2024年12月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2024年12月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	60,438,169,412口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3,1438円 (31,438円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2024年12月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2024年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 6月11日
期首元本額	58,835,582,589円
期中追加設定元本額	4,848,665,528円
期中一部解約元本額	3,246,078,705円
期末元本額	60,438,169,412円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	1,783,608,203円
DC外国債券インデックスファンド	1,753,589,371円
DC外国債券インデックスファンドL	15,048,697,996円
DCバランスファンド30	953,088,789円
DCバランスファンド50	1,163,639,021円
DCバランスファンド70	307,952,585円

区分	2024年12月10日現在
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	513,288,475円
外国債券インデックスe	916,623,627円
インデックスコレクション（外国債券）	10,162,751,602円
インデックスコレクション（バランス株式30）	5,199,786,223円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,194,058,063円
インデックスコレクション（バランス株式70）	499,537,740円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,547,013,467円
外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	3,453,702,852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）	258,561,943円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	43,955,809円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	272,010,939円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	186,465,543円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	157,959,620円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	66,026,674円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	711,847,730円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	438,208,748円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	4,818,495,457円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	310,860,110円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	111,136,724円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,155,805,968円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	48,291,884円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	143,570,789円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	60,012,680円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	34,748,216円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	21,587,533円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	152,515,670円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	52,718,121円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	882,292,812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）	13,758,428円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2024年12月10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	842,709,260	-	842,130,374	578,886
合計		842,709,260	-	842,130,374	578,886

## （注）1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2024年12月10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	1,007,329,296	-	1,001,661,264	5,668,032
	アメリカドル	487,513,838	-	484,736,000	2,777,838
	カナダドル	38,077,664	-	37,408,350	669,314
	ユーロ	301,839,576	-	300,547,140	1,292,436

	イギリスポンド	55,935,747	-	56,007,874	72,127
	オフショア人民元	123,962,471	-	122,961,900	1,000,571
	合計	1,007,329,296	-	1,001,661,264	5,668,032

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。



## 2【ファンドの現況】

## 【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

## 【純資産額計算書】

(2024年12月30日現在)

資産総額	5,031,713,648円
負債総額	2,389,120円
純資産総額( - )	5,029,324,528円
発行済口数	1,615,649,353口
1口当たり純資産額( / )	3.1129円
(1万口当たり純資産額)	(31,129円)

(参考)

## 日本株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2024年12月30日現在)

資産総額	433,809,282,826円
負債総額	391,486,008円
純資産総額( - )	433,417,796,818円
発行済口数	127,577,350,904口
1口当たり純資産額( / )	3.3973円
(1万口当たり純資産額)	(33,973円)

## 外国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2024年12月30日現在)

資産総額	627,657,264,300円
負債総額	271,166,369円
純資産総額( - )	627,386,097,931円
発行済口数	79,774,430,874口
1口当たり純資産額( / )	7.8645円
(1万口当たり純資産額)	(78,645円)

## 外国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

(2024年12月30日現在)

資産総額	194,351,967,575円
負債総額	23,134,904円
純資産総額( - )	194,328,832,671円
発行済口数	60,530,742,316口

1口当たり純資産額（ / ）	3.2104円
（1万口当たり純資産額）	（32,104円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

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

###### 受益権の譲渡

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

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

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

###### 受益権の譲渡の対抗要件

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

###### 受益権の再分割

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

###### 償還金

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

###### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2024年12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

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ DO（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

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

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

委託会社の機構は2025年 3月10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12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	525	15,838,205
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	57	202,229
単体型公社債投資信託	52	171,026
合計	634	16,211,460

## 3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は財務諸表等規則並びに同規則第2条、第282条及び第306条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第38期事業年度（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。  
また、第39期事業年度の中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	前事業年度 (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

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
<b>負債の部</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
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

当事業年度

（自 2022年4月1日  
至 2023年3月31日）（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				株主資本合計
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	941	509	431	64,219
当期変動額				
剰余金の配当				2,641
当期純利益				5,448



株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	891	0	891	891
当期変動額合計	891	0	891	1,915
当期末残高	49	510	460	66,134

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				株主資本合計
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	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 - 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。

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それら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。

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)				
其他有価証券	-	3,844	-	3,844
資産計	1,029	16,547	-	17,577
デリバティブ取引(*4)				
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)				
其他有価証券	-	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	12,195	-	9	9
	債券先物取引 売建	182	-	0	0
	合計	12,378	-	10	10

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

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	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,729	-	6
	英ポンド		3,228	-	81
	スイスフラン		20	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		21	-	0
合計			5,082	-	88

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	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		2,126	-	1
	英ポンド		4,586	-	7
	スイスフラン		28	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		63	-	0
	シンガポールドル		448	-	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		



	58	百万円	63	百万円
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（株）	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

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（株）	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,926	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

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（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

## 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第39期中間会計期間末

(2024年9月30日)

## 資産の部

## 流動資産

現金及び預金		15,957
金銭の信託		18,219
未収委託者報酬		11,990
未収運用受託報酬		6,429
短期差入証拠金		2,431
その他		4,238
流動資産合計		59,268

## 固定資産

有形固定資産	1	592
無形固定資産		
ソフトウェア		6,988
その他		59
無形固定資産合計		7,047

## 投資その他の資産

投資有価証券		6,615
関係会社株式		6,077
繰延税金資産		1,127
その他		30
投資その他の資産合計		13,850

## 固定資産合計

固定資産合計		21,491
--------	--	--------

## 資産合計

80,759

## 負債の部

## 流動負債

未払金		8,431
未払法人税等		1,202
賞与引当金		424
その他	2	2,306
流動負債合計		12,364

## 固定負債

退職給付引当金		1,035
資産除去債務		154

その他	53
固定負債合計	1,244
負債合計	13,608

(単位：百万円)

第39期中間会計期間末

(2024年9月30日)

## 純資産の部

株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	45,816
利益剰余金合計	48,416
株主資本合計	67,655
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	453
繰延ヘッジ損益	958
評価・換算差額等合計	504
純資産合計	67,150
負債・純資産合計	80,759

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

第39期中間会計期間

(自 2024年4月1日

至 2024年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		24,956
運用受託報酬		6,026
その他営業収益		187
営業収益合計		31,169
営業費用		18,985
一般管理費	1	7,504
営業利益		4,678
営業外収益	2	193
営業外費用	3	976
経常利益		3,896
特別損失		61
税引前中間純利益		3,835
法人税、住民税及び事業税		1,202
法人税等還付税額		129
法人税等調整額		22
法人税等合計		1,050
中間純利益		2,785

## 中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	45,974	48,574	67,813
当中間期変動額					
剰余金の配当			2,943	2,943	2,943
中間純利益			2,785	2,785	2,785
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	157	157	157
当中間期末残高	500	2,100	45,816	48,416	67,655

	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	360	1,071	710	67,103
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,943
中間純利益				2,785
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	92	112	205	205
当中間期変動額合計	92	112	205	47
当中間期末残高	453	958	504	67,150

## 注記事項

（重要な会計方針）

第39期中間会計期間  
（自 2024年4月1日  
至 2024年9月30日）

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## (1) 有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

## (2) デリバティブ

時価法によっております。

- (3) 金銭の信託  
時価法によっております。
2. 固定資産の減価償却の方法
- (1) 有形固定資産  
定額法によっております。
- (2) 無形固定資産  
定額法によっております。  
ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。
3. 引当金の計上基準
- (1) 賞与引当金  
従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。
- (2) 退職給付引当金  
従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。
- 過去勤務費用：発生事業年度に損益処理  
数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理
- なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間会計期間末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。
4. 収益及び費用の計上基準  
当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。
- (1) 投資信託委託業務  
当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。
- (2) 投資一任業務  
当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。
- (3) 投資助言業務  
当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。
- (4) 成功報酬  
当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準  
外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。
6. ヘッジ会計の方法
- (1) ヘッジ会計の方法  
繰延ヘッジ処理によっております。
- (2) ヘッジ手段とヘッジ対象  
ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。
- (3) ヘッジ方針  
自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。
- (4) ヘッジ有効性評価の方法  
ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。
7. グループ通算制度の適用  
グループ通算制度を適用しております。

## (中間貸借対照表関係)

第39期中間会計期間末  
(2024年9月30日)

1	有形固定資産の減価償却累計額	1,128百万円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

## (中間損益計算書関係)

第39期中間会計期間  
(自 2024年4月1日  
至 2024年9月30日)

1	減価償却実施額	
	有形固定資産	83百万円
	無形固定資産	1,211百万円

2	営業外収益の主要項目 投資有価証券売却益	149百万円
3	営業外費用の主要項目 金銭の信託運用損 投資有価証券償還損 為替差損 デリバティブ費用	263百万円 239百万円 146百万円 138百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）  
第39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

1．発行済株式に関する事項

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

2．自己株式に関する事項  
該当事項はありません。

3．配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

（リース取引関係）  
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）  
第39期中間会計期間末（2024年9月30日）  
金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

（1）時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区 分	中間貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	2,561	15,657	-	18,219
投資有価証券(*2) 其他有価証券	-	3,269	-	3,269
資産計	2,561	18,927	-	21,488
デリバティブ取引(*3) 株式関連取引 通貨関連取引 デリバティブ取引計	(281) - (281)	(230) (286) (517)	- - -	(511) (286) (798)

(\*1)負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

(\*2)投資有価証券のうち、非上場株式（中間貸借対照表計上額876百万円）、時価算定適用指針第24-3項の基準価額を時価とみなす取扱いを適用した投資信託（中間貸借対照表計上額1,991百万円）及び第24-16項を適用した組合出資金等（中間貸借対照表計上額478百万円）は上記に含めておりません。

(\*3)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

## (2) 時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

## (注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

## 金銭の信託

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

## 投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。時価算定適用指針第24-3項の取り扱いを適用し、基準価額を時価とみなした投資信託はレベルを付していません。

## デリバティブ取引

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

## (注2) 市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	876
関係会社株式	6,077

## (注3) 時価算定適用指針第24-3項の取扱いを適用した投資信託に関する情報

第24-3項の取扱いを適用した投資信託の期首残高から期末残高への調整表

(単位：百万円)

区分	期首残高	当期の損益に計上した額	その他有価証券評価差額金に計上した額	購入、売却及び償還による変動額	基準価額を時価とみなすこととした額	基準価額を時価とみなさないこととした額	期末残高	当期の損益に計上した額のうち貸借対照表日において保有する投資信託の評価損益
投資有価証券(その他有価証券)	-	-	8	2,000	1,991	-	1,991	-

(注) 決算日における解約等に関する制限の主な内容は、一定期間の解約制限があるものが1,991百万円であります。

## (有価証券関係)

第39期中間会計期間末（2024年9月30日）

## 1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

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

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
子会社株式	6,077

## 2. その他有価証券

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	3,010	2,306	704
小計	3,010	2,306	704
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,249	2,306	57
小計	2,249	2,306	57
合計	5,260	4,613	647

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額876百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額478百万円）は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## (デリバティブ取引関係)

第39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引



## (1)通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,053	-	83	83
	英ポンド	173	-	5	5
	カナダドル	130	-	2	2
	スイスフラン	74	-	1	1
	香港ドル	120	-	1	1
	ユーロ	461	-	9	9
	買建				
	米ドル	42	-	0	0
	ユーロ	11	-	0	0
合計		6,068	-	104	104

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

## (2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	10,399	-	281	281
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	5,524	-	230	230
合計		15,923	-	511	511

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,833	-	30
	英ポンド		4,463	-	137
	スイスフラン		49	-	0
	香港ドル		95	-	1
	ユーロ		31	-	0
	シンガポールドル		433	-	11
	合計			6,906	-

(資産除去債務関係)  
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

第39期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

- 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。
- 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報  
顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針4. 収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。
- 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報  
重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第39期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

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

[関連情報]

第39期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1)営業収益

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

ります。

(2)有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,620百万円

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

第39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）  
該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

第39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）  
該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

第39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）  
該当事項はありません。

( 1株当たり情報 )

第39期中間会計期間 ( 自 2024年4月1日 至 2024年9月30日 )	
1株当たり純資産額	22,383,579円15銭
1株当たり中間純利益	928,397円37銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第39期中間会計期間 ( 自 2024年4月1日 至 2024年9月30日 )	
中間純利益	2,785百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,785百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

4 【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

と。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2025年3月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2024年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2024年3月末日現在）	事業の内容
野村證券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

## (2)販売会社

該当事項はありません。

### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2024年3月末日現在）

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

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

## 第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットやSNSのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）、名称や利用上の注意事項等を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2024年8月22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」に掲げられているグローバル・インデックス・バランス・ファンドの2023年6月13日から2024年6月10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、グローバル・インデックス・バランス・ファンドの2024年6月10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드는継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の中間監査報告書**

2024年12月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

田 中 洋 一

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2024年4月1日から2025年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2024年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2025年2月18日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル・インデックス・バランス・ファンドの2024年6月11日から2024年12月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、グローバル・インデックス・バランス・ファンドの2024年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年6月11日から2024年12月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。