

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2026年5月20日

【発行者名】 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ  
株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 越前谷 道平

【本店の所在の場所】 東京都港区虎ノ門一丁目23番1号

【事務連絡者氏名】 久保 政喜

【電話番号】 03-4530-7297

【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託  
受益証券に係るファンドの名称】 AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型  
バランス・オープン（ステイブル）

【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託  
受益証券の金額】 2兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

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

（以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

委託会社の依頼により、信用格付業者から提供もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

2兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

基準価額は、販売会社（後記「(8) 申込取扱場所」をご参照ください。）でご確認いただけるほか、下記の照会先までお問い合わせください。

< 照会先 >

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

（受付時間：原則として委託会社の営業日午前9時～午後5時）

ホームページアドレス：www.ssga.com/jp

### （５）【申込手数料】

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

### （６）【申込単位】

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

**(7) 【申込期間】**

2026年5月21日から2027年5月20日まで

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

**(8) 【申込取扱場所】**

販売会社において申込みを取り扱います。

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

**(9) 【払込期日】**

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

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

**(10) 【払込取扱場所】**

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

**(11) 【振替機関に関する事項】**

ファンドの受益権の振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

**(12) 【その他】**

申込証拠金

該当事項はありません。

本邦以外の地域での発行

該当事項はありません。

振替受益権について

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

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(参考)

投資信託振替制度とは

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

#### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 当ファンドが該当する商品分類

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

#### 属性区分表

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

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

#### 当ファンドが該当する属性区分

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

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

#### ファンドの特色

**1 株式会社トータルアセットデザインが算出した資産配分に基づき、マザーファンドの配分を行います。**

- 日本および世界主要国の株式や公社債等、運用資産全体のリスク(=収益のブレ)総量をバジェット化することにより、株式会社トータルアセットデザインが決定した資産配分に基づき、資産別のインデックス型マザーファンドの配分を行います。なお、資産配分は定期的に見直しが行われます。

**<株式会社トータルアセットデザインの概要>**

1998年2月に設立され、年金基金ならびに金融機関等の資産運用について、資産配分の策定・運用機関の選択と配分構成・リスク管理に至るまで、トータルなコンサルティングサービスを提供しています。なお、2015年1月29日付にて、株式会社エー・エム・シーは、株式会社トータルアセットデザインに社名変更されました。

**2 マザーファンドは、それぞれのベンチマークに連動した投資成果の獲得を目指し、当ファンドは、「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」に連動した投資成果の獲得を目指します。**

- AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数は、株式会社トータルアセットデザインが決定した資産配分に基づき、投資対象とするマザーファンドのベンチマークのリターンを合成した指数であり、当ファンドの投資成果の比較基準となるベンチマークとします。
- 投資対象とするマザーファンドのベンチマークについては「マザーファンドの概要」をご参照ください。

**3 実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。**

- 投資対象国の通貨と円との間の為替変動により基準価額は変動します。

※資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

**投資対象とするマザーファンドの概要****■ 日本株式インデックス・マザーファンド**

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

**■ 日本債券インデックス・マザーファンド**

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

**■ 外国株式インデックス・オープン・マザーファンド**

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

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

**■ 外国債券インデックス・マザー・ファンド**

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

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

## ■ ベンチマーク(オリジナル指数)

以下に掲げるベンチマークは、マザーファンドのベンチマークです。

### TOPIX

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

### NOMURA-BPI総合

NOMURA-BPI総合は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。また、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

### MSCI コクサイ・インデックス

MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc.の登録商標です。

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

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

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

### FTSE世界国債インデックス(除く日本)

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2012年3月9日 信託契約締結、設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

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



## ファンドの関係法人

ファンドの関係法人は以下のとおりです。

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

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

- 2) 三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）

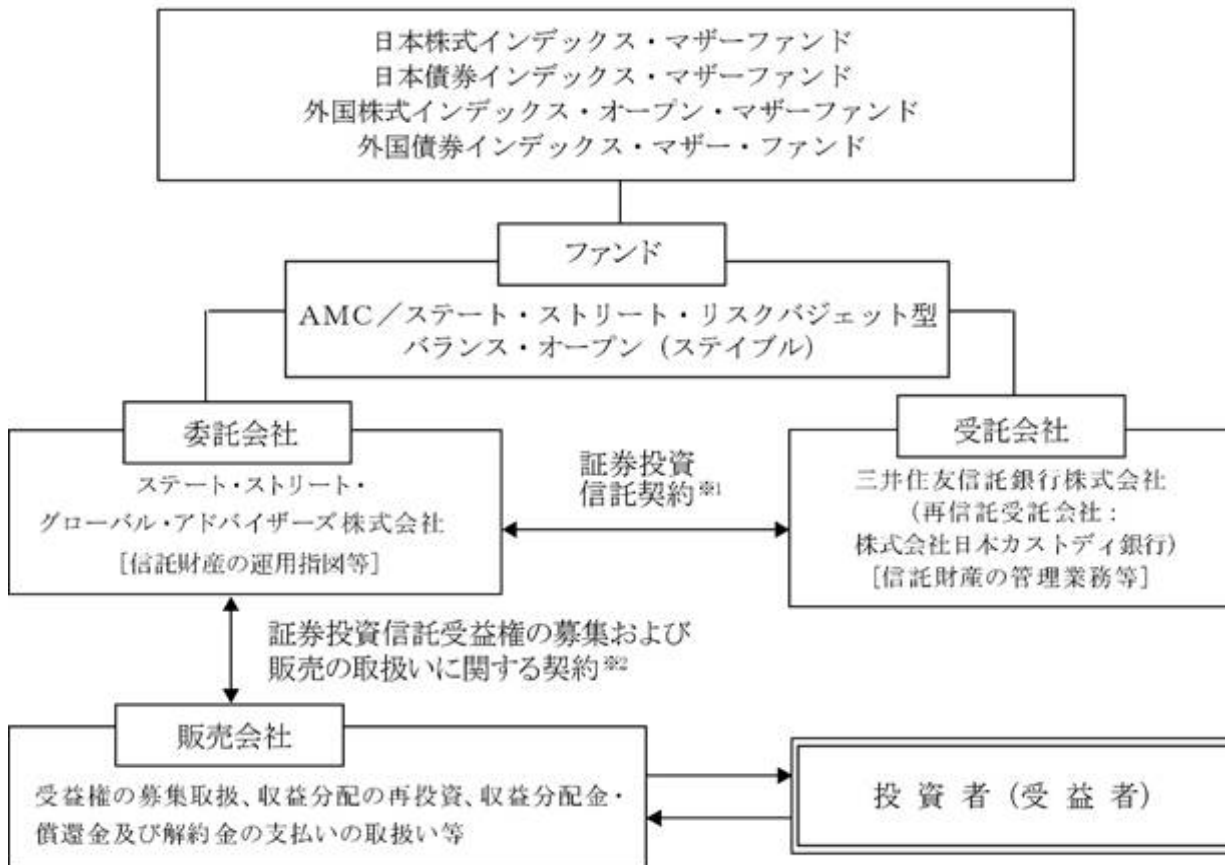
（再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行）

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

- 3) 販売会社

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

## ファンド関係法人



### 1 証券投資信託契約

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

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

### 2 証券投資信託受益権の募集および販売に関する契約

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

## 委託会社の概況（2026年2月末現在）

### 1）資本金の額

3億1千万円

### 2）沿革

1998年2月25日 ステート・ストリート投資顧問株式会社 設立

1998年3月31日 投資顧問業の登録

1998年8月28日 ステート・ストリート投信投資顧問株式会社に商号変更

1998年9月30日 投資一任契約に係る業務の認可

1998年9月30日 証券投資信託の委託会社としての認可取得

2007年9月30日 金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第345号）

2008年7月1日 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社に商号変更

### 3）大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

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

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

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

「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」をベンチマークとします。

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

日本株式インデックス・マザーファンド

[ベンチマーク：TOPIX（東証株価指数、配当込み）]

日本債券インデックス・マザーファンド

[ベンチマーク：NOMURA - BPI総合]

外国株式インデックス・オープン・マザーファンド

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

外国債券インデックス・マザー・ファンド

[ベンチマーク：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）<sup>2</sup>]

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

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

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

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

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

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

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

## (2) 【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - (a) 有価証券
  - (b) デリバティブ取引に係る権利
  - (c) 金銭債権
  - (d) 約束手形

- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産

- (a) 為替手形

### 投資の対象とする有価証券の指図範囲等

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

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

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

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

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

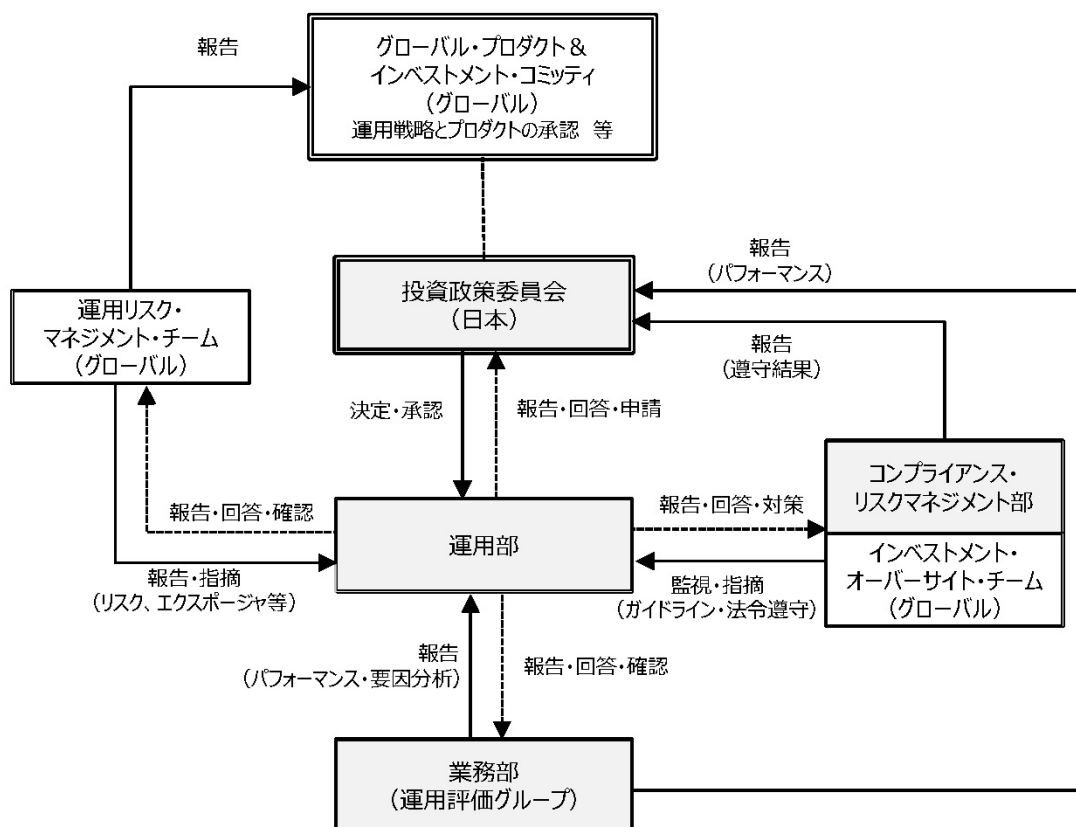
- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形

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

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

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

## (3) 【運用体制】



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

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

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

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

## (4) 【分配方針】

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

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

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

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

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

#### < 分配金に関する留意事項 >

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

#### (5) 【投資制限】

信託約款の「運用の基本方針」に定める主な投資制限

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

信託約款上のその他の投資制限

##### 1) 投資する株式等の範囲（信託約款第18条）

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

##### 2) 信用取引の指図範囲（信託約款第19条）

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

### 3) 先物取引等の運用指図（信託約款第20条）

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

### 4) スワップ取引の運用指図（信託約款第21条）

- ( a ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- ( b ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
- ( c ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち当該信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少してスワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えること

となった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部解約を指図するものとします。

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

(d) 上記(a)の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

9) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款第26条）

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

10) 外国為替予約取引の指図および範囲（信託約款第27条）

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産の額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額についての為替変動リスクを回避するため、もしくはベンチマークとの連動性を維持するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(b) 上記(a)の予約取引の指図は、原則として信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額の為替変動リスクを回避するため、もしくはベンチマークとの連動性を維持するための当該予約取引の指図については、この限りではありません。

(c) 上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内にその超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

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

11) デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第22条の2）

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

法令に基づく投資制限

1) 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

2) デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

（参考）「日本株式インデックス・マザーファンド」の概要

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

## （１）投資方針

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

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

TOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとします。

株式の組入比率は、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）の指図をすることができます。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

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

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

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

## （２）投資対象

### 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

(a) 有価証券

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

(c) 金銭債権

(d) 約束手形

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

(a) 為替手形

### 投資の対象とする有価証券の指図範囲等

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

1) 株券または新株引受権証券

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

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

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

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

### (3) 主な投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

信用取引の指図は、信託約款第15条の範囲で行います。

有価証券先物取引等は、信託約款第16条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第17条の範囲で行います。

金利先渡取引は、信託約款第18条の範囲で行います。

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

（参考）「日本債券インデックス・マザーファンド」の概要

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

## （1）投資方針

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

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

NOMURA-BPI総合をベンチマークとします。

債券組入比率は原則として高位を維持します。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

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

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

## （2）投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

（a）有価証券

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

(c) 金銭債権

(d) 約束手形

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

(a) 為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### (3) 主な投資制限

公社債の投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等は、信託約款第15条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第16条の範囲で行います。

金利先渡取引は、信託約款第17条の範囲で行います。

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

#### (参考) 「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の概要

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

#### (1) 投資方針

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

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

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

株式の組入率は、原則として高位を維持します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するために限定して、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するために限定して、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

## (2) 投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

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

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

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

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

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

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

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

### (3) 主な投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は信託約款第17条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第18条の範囲で行います。

金利先物取引及び為替先渡取引は、信託約款第19条の範囲で行います。

一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなっ

た場合には、委託会社は、一般社団法人資産運用業協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

#### （参考）「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の概要

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

##### (1) 投資方針

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

公社債への投資は原則として高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。

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

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

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

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

##### (2) 投資対象

###### 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

(a) 有価証券

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

(c) 金銭債権

(d) 約束手形

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

(a) 為替手形

###### 投資の対象とする有価証券の指図範囲等

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

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

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

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

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

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

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

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

### (3) 主な投資制限

公社債の投資割合には制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。有価証券先物取引等は、信託約款15条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款16条の範囲で行います。

金利先渡取引及び為替先渡取引は、信託約款17条の範囲で行います。

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

## 3【投資リスク】

### (1) ファンドのリスク特性

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

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

なお、投資信託は預貯金とは異なります。

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

#### 資産配分リスク

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

#### 株価変動リスク

株式の価格は、一般に個々の企業の活動および業績、経営方針、ならびに法令順守の状況等に反応して変動するほか、投資対象国の経済情勢および景気見通し、ならびに金利変動、為替相場およびそれらの

見通し等にも反応して変動します。したがって、マザーファンドに組み入れられる株式の価格は短期的または長期的に下落する可能性があります。

#### 信用リスク

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

#### 金利変動リスク

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

#### 為替変動リスク

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

#### 流動性リスク

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

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

#### 投資対象国への投資リスク

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

#### パッシブ運用のリスク

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

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

連動しない場合があります。また、インデックス採用銘柄の売買停止等の理由により当該銘柄に投資できない場合、インデックスの投資成果に連動させるため、インデックス採用銘柄以外の銘柄に投資する場合があります。

#### ファミリーファンド方式のリスク

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

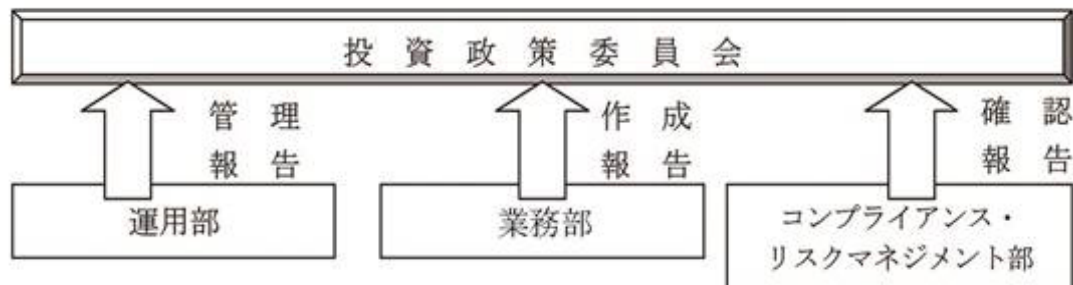
### （２）その他の留意点

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

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

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

### （３）リスク管理体制



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

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

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

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

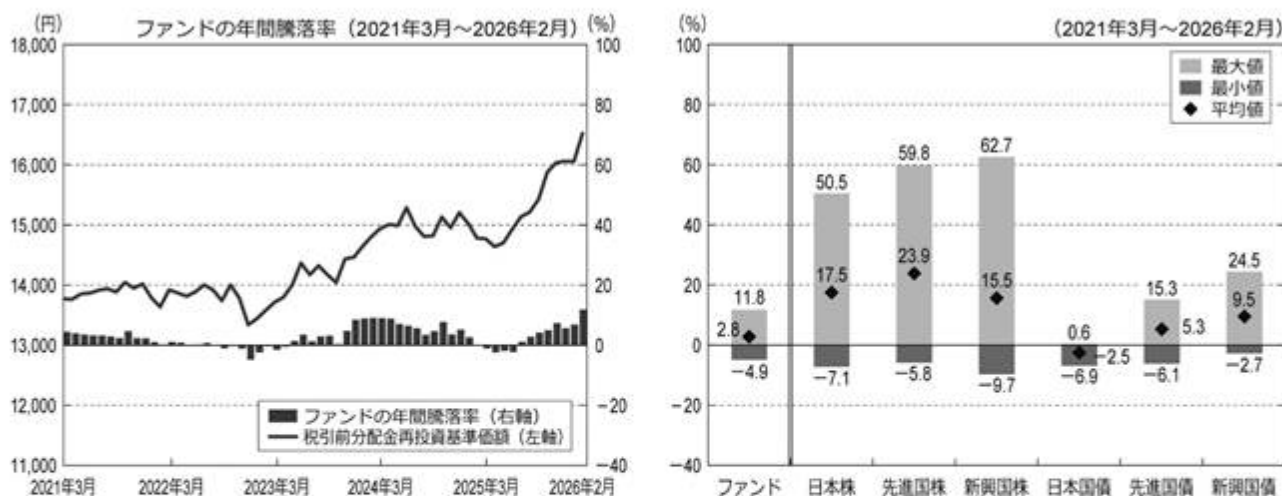
委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行います。

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

## ＜参考情報＞代表的な資産クラスと騰落率の比較等

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

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



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

### 「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

#### 日本株:TOPIX(東証株価指数、配当込み)

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

#### 先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

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

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

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

#### 日本国債:NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、同指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。

#### 先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

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

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

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

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

購入時手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の事務等の対価です。

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

### (2)【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

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

### (3)【信託報酬等】

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

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

< 信託報酬率の配分（税抜） >

支払先	信託報酬率（年率）	役務の内容
委託会社	0.60%	委託した資金の運用、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	0.10%	運用報告書等各種書類の提供等、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	0.05%	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

消費税等相当額は、消費税および地方消費税に相当する金額です。

### (4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記のほか、信託約款の規定に基づく運用指図等により生じた費用をご負担いただく場合があります。

その他の手数料等は、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することはできません。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

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

##### 個人、法人別の課税について

##### 個人の投資家に対する課税

###### < 収益分配金に対する課税 >

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

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

###### < 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

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

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

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

##### 少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」について

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

##### 法人の投資者に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

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

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

##### < 注1 > 個別元本について

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

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

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

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

#### <注2> 収益分配金の課税について

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

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

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

上記は、2026年2月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

#### （参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率（①+②）	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.86%	0.83%	0.03%

※対象期間は2025年2月21日～2026年2月20日です。

※上記は、対象期間の運用報告書に記載されている総経費率（原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含まれていません。）です。平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した値（年率）です。

※その他費用とは監査費用や有価証券の保管費用等です。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

(2026年2月27日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	5,199,691,332	85.54
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		878,941,647	14.46
純資産総額		6,078,632,979	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## &lt;参考情報&gt;

親投資信託受益証券(日本株式インデックス・マザーファンド)

(2026年2月27日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	50,002,320,950	96.39
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		1,874,259,440	3.61
純資産総額		51,876,580,390	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## &lt;参考情報&gt;

親投資信託受益証券(日本債券インデックス・マザーファンド)

(2026年2月27日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	58,758,723,280	86.23
地方債証券	日本	3,395,292,046	4.98
社債券	日本	3,299,807,900	4.84
特殊債券	日本	2,796,848,650	4.10
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		112,144,595	0.15
純資産総額		68,138,527,281	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## &lt;参考情報&gt;

親投資信託受益証券(外国株式インデックス・オープン・マザーファンド)

(2026年2月27日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	317,278,298,951	68.28
	イギリス	17,876,990,961	3.85
	カナダ	16,386,482,585	3.53
	フランス	12,394,214,788	2.67
	スイス	11,393,622,655	2.45
	ドイツ	11,160,296,754	2.40
	オーストラリア	7,630,472,631	1.64
	オランダ	6,355,556,727	1.37
	スペイン	4,626,515,377	1.00
	スウェーデン	4,477,270,176	0.96
	イタリア	3,841,570,528	0.83
	香港	2,291,737,231	0.49
	デンマーク	1,870,221,704	0.40
	シンガポール	1,845,873,028	0.40

	フィンランド	1,371,867,151	0.30
	ベルギー	1,320,625,893	0.28
	イスラエル	1,155,019,929	0.25
	ノルウェー	748,327,580	0.16
	アイルランド	528,849,257	0.11
	オーストリア	314,367,048	0.07
	ポルトガル	242,562,098	0.05
	ニュージーランド	211,855,418	0.05
	小計	425,322,598,470	91.53
投資証券	アメリカ	6,166,123,603	1.33
	オーストラリア	386,897,671	0.08
	フランス	172,676,147	0.04
	イギリス	112,034,848	0.02
	シンガポール	110,121,605	0.02
	香港	69,901,235	0.02
	小計	7,017,755,109	1.51
	コール・ローン、その他資産（負債控除後）	32,334,985,310	6.96
	純資産総額	464,675,338,889	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

（2026年2月27日現在）

種類	国/地域名	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	39,471,580,778	44.75
	中国	10,484,997,761	11.89
	フランス	6,358,049,628	7.21
	イタリア	5,878,593,569	6.66
	イギリス	5,087,918,184	5.77
	ドイツ	4,975,245,908	5.64
	スペイン	3,826,677,622	4.34
	カナダ	1,852,437,546	2.10
	ベルギー	1,326,940,407	1.50
	オーストラリア	1,143,260,188	1.30
	オランダ	1,058,407,435	1.20
	オーストリア	945,702,139	1.07
	メキシコ	815,406,756	0.92
	ポーランド	623,521,025	0.71
	ポルトガル	518,527,523	0.59
	フィンランド	451,038,751	0.51
	マレーシア	443,144,427	0.50
	アイルランド	377,482,016	0.43
	イスラエル	353,998,659	0.40
	シンガポール	330,864,290	0.38
	ニュージーランド	260,589,000	0.30
	デンマーク	182,199,897	0.21
	スウェーデン	152,469,931	0.17
ノルウェー	148,774,082	0.17	
	小計	87,067,827,522	98.71

コール・ローン、その他資産（負債控除後）	1,136,178,939	1.29
純資産総額	88,204,006,461	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## （２）【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

（2026年2月27日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	外国債券インデック ス・マザー・ファンド		711,905,094	3.3770	2,404,103,502	3.4106	2,428,023,513	39.94
2	日本	親投資信託 受益証券	日本債券インデック ス・マザーファンド		1,293,843,749	1.1201	1,449,234,383	1.1208	1,450,140,073	23.86
3	日本	親投資信託 受益証券	日本株式インデック ス・マザーファンド		132,343,996	7.4282	983,077,671	7.6846	1,017,010,671	16.73
4	日本	親投資信託 受益証券	外国株式インデック ス・オープン・マザー ファンド		32,692,097	9.1946	300,590,755	9.3147	304,517,075	5.01

（注1）投資有価証券は4銘柄です。

（注2）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（％）
親投資信託受益証券	-	85.54
合計		85.54

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

### 【投資不動産物件】

該当する事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当する事項はありません。

### <参考情報>

#### 親投資信託受益証券（日本株式インデックス・マザーファンド）

##### 投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2026年2月27日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	477,300	2,849.50	1,360,066,350	3,825.00	1,825,672,500	3.52
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	557,900	1,927.50	1,075,352,250	2,968.50	1,656,126,150	3.19
3	日本	株式	日立製作所	電気機器	230,700	3,709.00	855,666,300	5,226.00	1,205,638,200	2.32
4	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	194,300	3,788.23	736,053,089	5,997.00	1,165,217,100	2.25
5	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	309,700	2,844.90	881,065,530	3,643.00	1,128,237,100	2.17
6	日本	株式	三菱商事	卸売業	189,400	2,601.83	492,786,602	5,290.00	1,001,926,000	1.93
7	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	125,400	4,225.84	529,920,336	7,151.00	896,735,400	1.73
8	日本	株式	三菱重工	機械	169,900	2,359.15	400,819,585	5,014.00	851,878,600	1.64
9	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	19,000	22,035.00	418,665,000	44,010.00	836,190,000	1.61
10	日本	株式	三井物産	卸売業	136,600	2,780.50	379,816,300	5,872.00	802,115,200	1.55
11	日本	株式	アドバンテスト	電気機器	28,300	7,753.00	219,409,900	26,850.00	759,855,000	1.46
12	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	319,300	1,359.00	433,928,700	2,270.00	724,811,000	1.40

13	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	172,600	1,999.25	345,070,550	4,089.00	705,761,400	1.36
14	日本	株式	三菱電機	電気機器	99,300	2,583.79	256,570,347	5,991.00	594,906,300	1.15
15	日本	株式	キーエンス	電気機器	9,000	62,100.00	558,900,000	66,060.00	594,540,000	1.15
16	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	90,900	5,435.66	494,101,494	6,527.00	593,304,300	1.14
17	日本	株式	任天堂	その他製品	56,700	11,175.00	633,622,500	8,995.00	510,016,500	0.98
18	日本	株式	信越化学工業	化学	80,000	4,476.00	358,080,000	6,168.00	493,440,000	0.95
19	日本	株式	H O Y A	精密機器	17,000	17,765.00	302,005,000	28,265.00	480,505,000	0.93
20	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	68,300	9,185.00	627,335,500	6,866.00	468,947,800	0.90
21	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	80,100	4,482.00	359,008,200	5,819.00	466,101,900	0.90
22	日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	6,400	47,318.44	302,838,016	69,030.00	441,792,000	0.85
23	日本	株式	丸紅	卸売業	72,500	2,444.50	177,226,250	6,008.00	435,580,000	0.84
24	日本	株式	住友商事	卸売業	56,900	3,441.00	195,792,900	6,663.00	379,124,700	0.73
25	日本	株式	N T T	情報・通信業	2,472,300	146.90	363,180,870	153.30	379,003,590	0.73
26	日本	株式	村田製作所	電気機器	85,700	2,584.43	221,485,651	4,108.00	352,055,600	0.68
27	日本	株式	K D D I	情報・通信業	126,500	2,453.50	310,367,750	2,671.00	337,881,500	0.65
28	日本	株式	ディスコ	機械	4,400	34,180.00	150,392,000	75,500.00	332,200,000	0.64
29	日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	32,000	2,590.50	82,896,000	10,375.00	332,000,000	0.64
30	日本	株式	小松製作所	機械	43,700	4,379.00	191,362,300	7,533.00	329,192,100	0.63

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	電気機器	17.48
	銀行業	10.45
	卸売業	8.22
	機械	6.53
	輸送用機器	6.50
	情報・通信業	5.54
	化学	4.50
	小売業	3.96
	医薬品	3.61
	保険業	3.06
	サービス業	2.84
	食料品	2.61
	建設業	2.55
	非鉄金属	2.40
	不動産業	2.07
	その他製品	2.05
	陸運業	1.95
	精密機器	1.78
	電気・ガス業	1.35
	その他金融業	1.17
証券、商品先物取引業	0.94	
ガラス・土石製品	0.74	
鉄鋼	0.71	
ゴム製品	0.58	
石油・石炭製品	0.53	

海運業	0.50
金属製品	0.41
鉱業	0.37
繊維製品	0.35
空運業	0.29
パルプ・紙	0.14
倉庫・運輸関連業	0.13
水産・農林業	0.08
合計	96.39

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

#### 投資不動産物件

該当する事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	TOPIX（先物） （2026年3月限）	大阪取引所	買建	34	1,312,702,440	1,344,530,000	2.59

（注1）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

（注2）先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

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

#### <参考情報>

#### 親投資信託受益証券（日本債券インデックス・マザーファンド）

#### 投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2026年2月27日現在）

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第368回利付国債 (10年)	0.200	2032/09/20	1,920,000,000	92.12	1,768,744,400	90.51	1,737,868,800	2.55
2	日本	国債証券	第163回利付国債 (5年)	0.400	2028/09/20	1,350,000,000	98.18	1,325,533,500	97.81	1,320,462,000	1.94
3	日本	国債証券	第361回利付国債 (10年)	0.100	2030/12/20	1,350,000,000	94.45	1,275,075,000	93.24	1,258,834,500	1.85
4	日本	国債証券	第158回利付国債 (5年)	0.100	2028/03/20	1,030,000,000	97.68	1,006,169,900	97.74	1,006,732,300	1.48
5	日本	国債証券	第371回利付国債 (10年)	0.400	2033/06/20	1,100,000,000	91.09	1,002,089,500	90.38	994,202,000	1.46
6	日本	国債証券	第478回利付国債 (2年)	1.000	2027/11/01	920,000,000	100.04	920,371,600	99.69	917,212,400	1.35
7	日本	国債証券	第363回利付国債 (10年)	0.100	2031/06/20	990,000,000	93.86	929,293,200	92.33	914,076,900	1.34
8	日本	国債証券	第367回利付国債 (10年)	0.200	2032/06/20	980,000,000	93.24	913,763,100	91.02	892,015,600	1.31
9	日本	国債証券	第1回クライメー ト・トランジション 利付国債(10年)	0.700	2033/12/20	910,000,000	94.52	860,132,000	91.25	830,429,600	1.22
10	日本	国債証券	第370回利付国債 (10年)	0.500	2033/03/20	900,000,000	92.66	833,968,000	91.55	823,968,000	1.21
11	日本	国債証券	第369回利付国債 (10年)	0.500	2032/12/20	860,000,000	91.95	790,816,000	91.95	790,804,400	1.16

12	日本	国債証券	第351回利付国債 (10年)	0.100	2028/06/20	773,000,000	97.57	754,268,160	97.41	753,025,680	1.11
13	日本	国債証券	第381回利付国債 (10年)	2.100	2035/12/20	740,000,000	98.93	732,098,900	99.91	739,393,200	1.09
14	日本	国債証券	第479回利付国債 (2年)	1.000	2027/12/01	730,000,000	99.61	727,178,600	99.65	727,496,100	1.07
15	日本	国債証券	第164回利付国債 (5年)	0.200	2028/12/20	740,000,000	96.96	717,548,400	96.95	717,496,600	1.05
16	日本	国債証券	第480回利付国債 (2年)	1.100	2028/01/01	710,000,000	99.76	708,332,300	99.79	708,530,300	1.04
17	日本	国債証券	第162回利付国債 (5年)	0.300	2028/09/20	700,000,000	98.02	686,190,000	97.56	682,948,000	1.00
18	日本	国債証券	第155回利付国債 (20年)	1.000	2035/12/20	700,000,000	90.89	636,235,000	90.21	631,498,000	0.93
19	日本	国債証券	第350回利付国債 (10年)	0.100	2028/03/20	600,000,000	97.61	585,714,000	97.74	586,446,000	0.86
20	日本	国債証券	第1回クライメー ト・トランジション 利付国債(5年)	0.300	2028/12/20	600,000,000	97.40	584,442,000	97.21	583,296,000	0.86
21	日本	国債証券	第364回利付国債 (10年)	0.100	2031/09/20	620,000,000	93.55	580,034,800	91.85	569,513,400	0.84
22	日本	国債証券	第122回利付国債 (20年)	1.800	2030/09/20	500,000,000	103.84	519,230,000	101.12	505,635,000	0.74
23	日本	国債証券	第366回利付国債 (10年)	0.200	2032/03/20	550,000,000	93.55	514,533,800	91.49	503,228,000	0.74
24	日本	国債証券	第380回利付国債 (10年)	1.700	2035/09/20	520,000,000	98.34	511,382,500	96.74	503,048,000	0.74
25	日本	国債証券	第162回利付国債 (20年)	0.600	2037/09/20	600,000,000	87.99	527,946,000	82.74	496,470,000	0.73
26	日本	国債証券	第349回利付国債 (10年)	0.100	2027/12/20	500,000,000	97.87	489,370,000	98.05	490,290,000	0.72
27	日本	国債証券	第32回利付国債 (30年)	2.300	2040/03/20	500,000,000	105.91	529,585,000	97.06	485,310,000	0.71
28	日本	国債証券	第195回利付国債 (20年)	3.200	2045/12/20	460,000,000	100.73	463,396,200	103.44	475,860,800	0.70
29	日本	国債証券	第194回利付国債 (20年)	2.700	2045/09/20	490,000,000	98.96	484,936,400	96.24	471,590,700	0.69
30	日本	国債証券	第160回利付国債 (20年)	0.700	2037/03/20	550,000,000	89.91	494,538,000	84.89	466,911,500	0.69

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
国債証券	-	86.23
地方債証券	-	4.98
社債券	-	4.84
特殊債券	-	4.10
合計		100.16

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

#### 投資不動産物件

該当する事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当する事項はありません。

## &lt; 参考情報 &gt;

## 親投資信託受益証券（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

## 投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2026年2月27日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	840,100	27,598.21	23,185,260,151	28,807.71	24,201,357,927	5.21
2	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	513,068	43,421.98	22,278,433,417	42,528.33	21,819,930,091	4.70
3	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	244,142	76,629.85	18,708,565,509	62,591.99	15,281,334,404	3.29
4	アメリカ	株式	AMAZON COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	331,860	36,308.80	12,049,440,720	32,396.01	10,750,941,604	2.31
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	201,140	49,822.70	10,021,339,778	47,892.87	9,633,173,441	2.07
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	169,020	49,820.61	8,420,680,073	47,857.04	8,088,797,154	1.74
7	アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	155,120	62,475.21	9,691,156,002	50,124.07	7,775,246,824	1.67
8	アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-A	メディア・娯楽	75,022	101,010.80	7,578,032,916	102,368.72	7,679,906,720	1.65
9	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	97,730	67,277.81	6,575,061,275	63,660.84	6,221,574,851	1.34
10	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	95,080	48,801.44	4,640,041,518	47,698.11	4,535,136,803	0.98
11	アメリカ	株式	ELI LILLY AND COMPANY	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	27,819	167,549.13	4,661,049,252	159,240.93	4,429,923,604	0.95
12	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	47,674	79,961.60	3,812,089,360	78,321.01	3,733,875,959	0.80
13	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	147,438	18,065.33	2,663,516,436	23,144.01	3,412,307,637	0.73
14	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	83,266	32,237.54	2,684,291,130	37,935.06	3,158,700,764	0.68
15	オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	13,425	166,053.54	2,229,268,781	226,539.76	3,041,296,385	0.65
16	アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	151,648	17,237.56	2,614,041,896	19,385.88	2,939,829,961	0.63
17	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	58,745	52,182.17	3,065,441,628	49,345.02	2,898,773,611	0.62
18	アメリカ	株式	MICRON TECHNOLOGY	半導体・半導体製造装置	38,830	36,987.71	1,436,233,115	64,748.40	2,514,180,512	0.54
19	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	29,484	85,888.17	2,532,327,098	80,206.31	2,364,802,953	0.51
20	アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	15,327	142,069.49	2,177,499,161	153,743.95	2,356,433,666	0.51
21	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	61,057	35,473.68	2,165,916,625	35,008.94	2,137,541,393	0.46
22	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	80,939	23,066.30	1,866,963,524	25,513.88	2,065,068,540	0.44
23	アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	34,429	55,553.45	1,912,649,983	58,442.77	2,012,126,228	0.43
24	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	243,387	8,367.20	2,036,468,766	8,148.86	1,983,327,319	0.43
25	アメリカ	株式	GE AEROSPACE	資本財	36,690	46,544.65	1,707,723,564	53,106.28	1,948,469,428	0.42

26	アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	146,970	16,696.61	2,453,900,785	13,179.96	1,937,059,882	0.42
27	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	66,722	23,530.21	1,569,982,906	28,693.96	1,914,519,040	0.41
28	アメリカ	株式	CATERPILLAR	資本財	16,211	89,711.52	1,454,313,478	117,314.02	1,901,777,632	0.41
29	アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	56,142	33,872.88	1,901,691,240	31,735.38	1,781,687,749	0.38
30	スイス	株式	ROCHE HOLDING AG GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	24,305	62,044.89	1,508,001,087	73,250.85	1,780,362,055	0.38

（注1）評価金額の上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（％）
株式	半導体・半導体製造装置	10.90
	資本財	8.13
	ソフトウェア・サービス	6.97
	メディア・娯楽	6.73
	銀行	6.66
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.58
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.42
	金融サービス	6.04
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.14
	エネルギー	3.80
	素材	3.48
	ヘルスケア機器・サービス	2.79
	公益事業	2.70
	保険	2.66
	食品・飲料・タバコ	2.58
	自動車・自動車部品	1.81
	生活必需品流通・小売り	1.70
	消費者サービス	1.53
	運輸	1.38
	電気通信サービス	1.23
家庭用品・パーソナル用品	1.14	
商業・専門サービス	1.03	
耐久消費財・アパレル	0.88	
不動産管理・開発	0.24	
	小 計	91.53
投資証券	-	1.51
合 計		93.04

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

#### 投資不動産物件

該当する事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

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

株価指数 先物取引	MINI S&P 500	シカゴ商業 取引所	買建	アメリ カ・ドル	451	156,051,928.27	156,046,000.00	24,313,527,260	5.23
	EURO STOXX 50	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	買建	ユーロ	279	16,405,273.75	17,214,300.00	3,164,332,626	0.68
	FTSE100INDEX	インターコ ンチネンタ ル取引所	買建	イギリ ス・ボン ド	77	7,707,498.79	8,342,180.00	1,752,942,274	0.38
	S&P 60	モントリ オール取引 所	買建	カナダ・ ドル	30	11,273,849.81	11,910,600.00	1,356,498,218	0.29
	SPI 200	シドニー先 物取引所	買建	オースト ラリア・ ドル	37	8,060,450.00	8,454,500.00	934,983,155	0.20
	FSMI INDEX	ユーレック ス・チュー リッヒ取引 所	買建	スイス・ フラン	33	4,334,319.09	4,561,260.00	918,911,435	0.20

（注1）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

（注2）先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

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

#### < 参考情報 >

#### 親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

#### 投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2026年2月27日現在）

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリ カ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2029/02/28	4,400,000	15,908.44	699,971,551	15,930.96	700,962,411	0.79
2	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.750	2029/06/15	28,600,000	2,379.46	680,528,108	2,377.70	680,024,032	0.77
3	アメリ カ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2029/08/15	4,400,000	14,618.14	643,198,283	14,652.22	644,697,954	0.73
4	アメリ カ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2027/11/30	4,300,000	14,823.25	637,399,843	14,836.03	637,949,438	0.72
5	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.370	2029/01/15	26,600,000	2,343.13	623,274,638	2,342.33	623,061,175	0.71
6	アメリ カ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2027/05/15	4,000,000	15,365.54	614,621,762	15,369.80	614,792,175	0.70
7	アメリ カ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2029/01/31	3,800,000	14,821.42	563,214,198	14,847.59	564,208,705	0.64
8	アメリ カ	国債証券	US TREASURY N/B	0.375	2027/09/30	3,800,000	14,829.94	563,537,992	14,842.72	564,023,680	0.64
9	アメリ カ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2029/02/15	3,600,000	15,194.51	547,002,651	15,219.47	547,900,997	0.62
10	イタ リア	国債証券	ITALIAN GOVERNMENT BOND	2.000	2028/02/01	2,900,000	18,341.28	531,897,233	18,342.19	531,923,620	0.60
11	アメリ カ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2031/05/15	3,750,000	14,061.85	527,319,469	14,118.45	529,442,073	0.60
12	アメリ カ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2028/05/15	3,400,000	15,381.36	522,966,527	15,394.14	523,401,089	0.59
13	アメリ カ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2031/07/31	3,200,000	15,902.35	508,875,460	15,957.74	510,647,799	0.58

14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2031/08/15	3,700,000	13,691.19	506,574,219	13,746.58	508,623,482	0.58
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2027/02/15	3,300,000	15,386.63	507,758,891	15,388.46	507,819,481	0.58
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2027/08/31	3,200,000	15,494.57	495,826,370	15,498.83	495,962,705	0.56
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.375	2027/07/31	3,300,000	14,902.98	491,798,443	14,912.72	492,119,801	0.56
18	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	1.590	2027/03/15	21,300,000	2,283.24	486,331,547	2,282.87	486,251,344	0.55
19	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	1.910	2029/07/15	20,900,000	2,313.17	483,452,659	2,312.88	483,392,433	0.55
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2032/05/15	3,250,000	14,792.82	480,766,664	14,853.07	482,724,942	0.55
21	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.910	2028/10/14	20,300,000	2,374.81	482,087,456	2,373.95	481,911,979	0.55
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.875	2032/12/31	3,000,000	15,612.64	468,379,467	15,678.38	470,351,437	0.53
23	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.370	2027/01/20	20,400,000	2,300.07	469,214,683	2,299.66	469,130,974	0.53
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.375	2029/12/31	2,900,000	16,025.30	464,733,753	16,058.77	465,704,524	0.53
25	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	1.460	2028/05/25	20,000,000	2,283.03	456,606,214	2,283.21	456,642,448	0.52
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2029/05/15	3,000,000	15,039.31	451,179,506	15,067.31	452,019,417	0.51
27	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.020	2031/05/27	18,300,000	2,458.33	449,876,169	2,455.80	449,412,223	0.51
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2035/05/15	2,800,000	15,842.71	443,595,941	15,918.18	445,709,109	0.51
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2027/12/31	2,950,000	14,789.16	436,280,477	14,803.16	436,693,431	0.50
30	フランス	国債証券	FRENCH GOVERNMENT BOND	2.750	2027/10/25	2,350,000	18,566.86	436,321,245	18,567.10	436,327,008	0.49

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
国債証券	-	98.71
合計		98.71

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

#### 投資不動産物件

該当する事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当する事項はありません。

#### (3) 【運用実績】

##### 【純資産の推移】

2026年2月27日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

計算期間・月末		純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
第5期	(2017年 2月20日)	分配付：	3,353,263,422	分配付：	1.2368
		分配落：	3,315,305,934	分配落：	1.2228
第6期	(2018年 2月20日)	分配付：	4,218,203,352	分配付：	1.2495
		分配落：	4,167,563,611	分配落：	1.2345
第7期	(2019年 2月20日)	分配付：	4,251,424,588	分配付：	1.2434
		分配落：	4,213,813,566	分配落：	1.2324
第8期	(2020年 2月20日)	分配付：	4,636,953,719	分配付：	1.2790
		分配落：	4,582,572,120	分配落：	1.2640
第9期	(2021年 2月22日)	分配付：	4,734,124,014	分配付：	1.2791
		分配落：	4,697,113,247	分配落：	1.2691
第10期	(2022年 2月21日)	分配付：	4,854,785,226	分配付：	1.2675
		分配落：	4,835,634,300	分配落：	1.2625
第11期	(2023年 2月20日)	分配付：	4,805,659,775	分配付：	1.2509
		分配落：	4,774,926,222	分配落：	1.2429
第12期	(2024年 2月20日)	分配付：	5,134,866,475	分配付：	1.3535
		分配落：	5,096,929,136	分配落：	1.3435
第13期	(2025年 2月20日)	分配付：	5,820,783,267	分配付：	1.3514
		分配落：	5,773,404,545	分配落：	1.3404
第14期	(2026年 2月20日)	分配付：	6,028,039,287	分配付：	1.4779
		分配落：	5,970,937,995	分配落：	1.4639
2025年 2月末日			5,791,492,822		1.3357
3月末日			5,778,624,414		1.3346
4月末日			5,727,512,382		1.3230
5月末日			5,748,402,194		1.3286
6月末日			5,530,285,350		1.3489
7月末日			5,607,508,285		1.3682
8月末日			5,634,240,617		1.3751
9月末日			5,707,833,750		1.3945
10月末日			5,865,706,217		1.4352
11月末日			5,923,419,930		1.4493
12月末日			5,927,873,257		1.4513
2026年 1月末日			5,918,073,537		1.4507
2月末日			6,078,632,979		1.4790

## 【分配の推移】

計算期間		一口当たりの分配金
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	0.0140円
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	0.0150円
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	0.0110円
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	0.0150円
第9期	自2020年 2月21日 至2021年 2月22日	0.0100円

第10期	自2021年 2月23日 至2022年 2月21日	0.0050円
第11期	自2022年 2月22日 至2023年 2月20日	0.0080円
第12期	自2023年 2月21日 至2024年 2月20日	0.0100円
第13期	自2024年 2月21日 至2025年 2月20日	0.0110円
第14期	自2025年 2月21日 至2026年 2月20日	0.0140円

## 【収益率の推移】

計算期間		収益率
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	3.7%
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	2.2%
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	0.7%
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	3.8%
第9期	自2020年 2月21日 至2021年 2月22日	1.2%
第10期	自2021年 2月23日 至2022年 2月21日	0.1%
第11期	自2022年 2月22日 至2023年 2月20日	0.9%
第12期	自2023年 2月21日 至2024年 2月20日	8.9%
第13期	自2024年 2月21日 至2025年 2月20日	0.6%
第14期	自2025年 2月21日 至2026年 2月20日	10.3%

（注）各計算期間中の分配金を加味して算出しています。

## （４）【設定及び解約の実績】

計算期間		設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	468,679,521	90,490,774	2,711,249,203
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	757,459,918	92,726,355	3,375,982,766
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	128,819,369	85,618,294	3,419,183,841
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	271,844,830	65,588,688	3,625,439,983
第9期	自2020年 2月21日 至2021年 2月22日	129,832,227	54,195,439	3,701,076,771

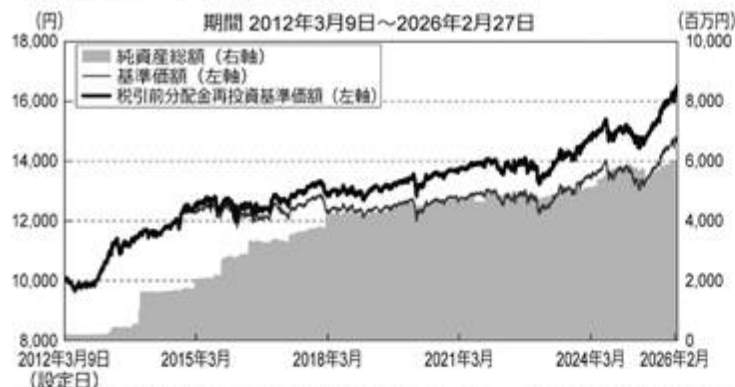
第10期	自2021年 2月23日 至2022年 2月21日	321,813,640	192,705,055	3,830,185,356
第11期	自2022年 2月22日 至2023年 2月20日	50,649,746	39,140,907	3,841,694,195
第12期	自2023年 2月21日 至2024年 2月20日	68,655,295	116,615,517	3,793,733,973
第13期	自2024年 2月21日 至2025年 2月20日	580,763,496	67,340,905	4,307,156,564
第14期	自2025年 2月21日 至2026年 2月20日	34,583,602	263,076,428	4,078,663,738

(注) 日本国外における設定、解約はありません。

## （参考情報）運用実績

（2026年2月27日現在）

## 基準価額・純資産の推移



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

## &lt;基準価額・純資産総額&gt;

基準価額	14,790円
純資産総額	6,079百万円

## 分配の推移

決算期	分配金
第10期（2022年2月21日）	50円
第11期（2023年2月20日）	80円
第12期（2024年2月20日）	100円
第13期（2025年2月20日）	110円
第14期（2026年2月20日）	140円
設定来累計	1,410円

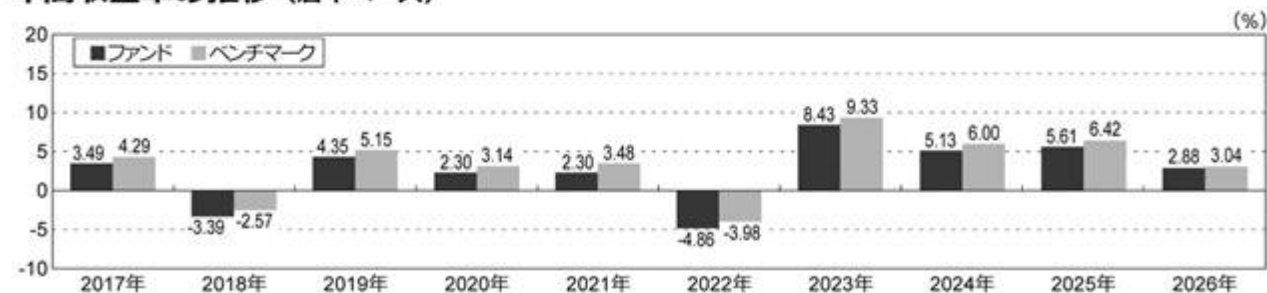
※分配金は1万口当たり、税引前です。

## 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	投資銘柄 (上位3銘柄)	国/ 地域名	種類	業種	利率	償還日	投資比率
外国債券 インデックス・マザー・ファンド	39.94%	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	4.250%	2029/02/28	0.79%
		CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	—	2.750%	2029/06/15	0.77%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	1.625%	2029/08/15	0.73%
日本債券 インデックス・マザー・ファンド	23.86%	第368回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	0.200%	2032/09/20	2.55%
		第163回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.400%	2028/09/20	1.94%
		第361回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	0.100%	2030/12/20	1.85%
外国株式 インデックス・オープン・ マザー・ファンド	5.01%	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・ 半導体製造装置	—	—	5.21%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ ハードウェアおよび機器	—	—	4.70%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・ サービス	—	—	3.29%
日本株式 インデックス・マザー・ファンド	16.73%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	3.52%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	—	—	3.19%
		日立製作所	日本	株式	電気機器	—	—	2.32%

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

## 年間収益率の推移（暦年ベース）



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

※2026年のファンドとベンチマークの年間収益率は年初から2月末までで算出しています。

※年間収益率の推移は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

### 2【換金（解約）手続等】

- 1) 受益者（当ファンドの受益権を取得した者）は、自己に帰属する受益権につき、取得申込みを行った販売会社を通じ、委託会社に一部解約の実行の請求を行うことにより、当ファンドを換金することができます。
- 2) 当ファンドの換金申込みの申込締切時間は、原則として販売会社の営業日の午後3時30分までとし、この受付時刻を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては受付時間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。
- 3) 解約単位（換金単位）は、販売会社が定める単位にて受付けます。なお、1億円または1億口を超える大口の換金申込みには、制限を設けることがあります。

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

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### 1）基準価額の算出方法

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

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

#### < 主要投資対象の評価方法 >

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

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

##### 2）基準価額の算出頻度

基準価額は原則として委託会社の営業日において日々算出されます。

### 3) 基準価額の公表

基準価額は、販売会社でご確認いただけるほか、下記の照会先までお問い合わせください。

<照会先>

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

（受付時間：原則として委託会社の営業日午前9時～午後5時）

ホームページアドレス：www.ssga.com/jp

### (2) 【保管】

該当事項はありません。

### (3) 【信託期間】

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

### (4) 【計算期間】

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

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

### (5) 【その他】

#### 1) 信託契約の解約

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

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

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

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

(e) 上記(c)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以上にあたる多数をもって行います。

- (f) 上記(c)から上記(e)までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記(c)から上記(e)までに規定するこの信託契約の解約の手続を行うことが困難な場合には適用しません。
- 2) 信託契約に関する監督官庁の命令
- (a) 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- (b) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後記6)の規定にしたがいます。
- 3) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い
- (a) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。
- (b) 上記(a)の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、後記6)の書面決議が否決となる場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- 4) 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い
- (a) 委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。
- (b) 委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。
- 5) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い
- (a) 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、後記6)の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- (b) 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- 6) 信託約款の変更等
- (a) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本6)に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- (b) 委託会社は、上記(a)の事項（信託約款の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドに係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

#### 7) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### 8) 運用報告書（運用状況に係る情報）

委託会社は、毎決算時（毎年2月20日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日。）および償還時に、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書（全体版）および運用報告書（全体版）の記載事項のうち重要なものを記載した交付運用報告書を作成します。

(a) 交付運用報告書は、知っている受益者に対して販売会社を通じて提供します。

(b) 運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページ（[www.ssga.com/jp](http://www.ssga.com/jp)）に掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の提供について、書面の交付の方法による提供の請求があった場合には、当該方法により行うものとします。

#### 9) 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 10) 関係法人との契約の更改に関する手続き等

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

### 4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

#### 分配金請求権

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

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を

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

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

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

#### 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

#### 一部解約実行請求権

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

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

#### 書面決議における議決権

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

#### 帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間（2025年2月21日から2026年2月20日まで）の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

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

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 (2025年2月20日現在)	第14期 (2026年2月20日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	2,838,644	2,528,529
コール・ローン	872,205,890	913,306,445
親投資信託受益証券	4,970,465,095	5,137,006,311
未収利息	10,183	16,959
<b>流動資産合計</b>	<b>5,845,519,812</b>	<b>6,052,858,244</b>
<b>資産合計</b>		
	<b>5,845,519,812</b>	<b>6,052,858,244</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払収益分配金	47,378,722	57,101,292
未払解約金	281,904	195,730
未払受託者報酬	1,608,863	1,619,958
未払委託者報酬	22,524,066	22,679,341
その他未払費用	321,712	323,928
<b>流動負債合計</b>	<b>72,115,267</b>	<b>81,920,249</b>
<b>負債合計</b>		
	<b>72,115,267</b>	<b>81,920,249</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	4,307,156,564	4,078,663,738
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,466,247,981	1,892,274,257
（分配準備積立金）	513,644,659	960,242,741
<b>元本等合計</b>	<b>5,773,404,545</b>	<b>5,970,937,995</b>
<b>純資産合計</b>	<b>5,773,404,545</b>	<b>5,970,937,995</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>5,845,519,812</b>	<b>6,052,858,244</b>

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期 自 2024年2月21日 至 2025年2月20日	第14期 自 2025年2月21日 至 2026年2月20日
営業収益		
受取利息	738,370	4,030,884
有価証券売買等損益	67,972,465	602,941,216
営業収益合計	68,710,835	606,972,100
営業費用		
支払利息	57,337	-
受託者報酬	3,073,408	3,165,526
委託者報酬	43,027,748	44,317,202
その他費用	615,266	632,984
営業費用合計	46,773,759	48,115,712
営業利益又は営業損失（ ）	21,937,076	558,856,388
経常利益又は経常損失（ ）	21,937,076	558,856,388
当期純利益又は当期純損失（ ）	21,937,076	558,856,388
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（ ）	1,228,927	1,636,720
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,303,195,163	1,466,247,981
剰余金増加額又は欠損金減少額	212,929,475	12,039,431
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	212,929,475	12,039,431
剰余金減少額又は欠損金増加額	23,206,084	89,404,971
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	23,206,084	89,404,971
分配金	47,378,722	57,101,292
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,466,247,981	1,892,274,257

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

第13期 (2025年2月20日現在)	第14期 (2026年2月20日現在)
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	第13期 (2025年2月20日現在)	第14期 (2026年2月20日現在)
1 期首元本額	3,793,733,973円	4,307,156,564円
期中追加設定元本額	580,763,496円	34,583,602円
期中一部解約元本額	67,340,905円	263,076,428円
2 受益権の総数	4,307,156,564口	4,078,663,738口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第13期 自 2024年2月21日 至 2025年2月20日	第14期 自 2025年2月21日 至 2026年2月20日
1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(48,166,765円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(952,603,322円)及び分配準備積立金(512,856,616円)より分配対象収益は1,513,626,703円(1万口当たり3,514円)であり、うち47,378,722円(1万口当たり110円)を分配金額としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(99,190,607円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(435,509,179円)、収益調整金(932,031,516円)及び分配準備積立金(482,644,247円)より分配対象収益は1,949,375,549円(1万口当たり4,779円)であり、うち57,101,292円(1万口当たり140円)を分配金額としております。

## (金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第13期 (2025年2月20日現在)	第14期 (2026年2月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>

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

## (有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	第13期 (2025年2月20日現在)	第14期 (2026年2月20日現在)
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額	当計算期間の損益に 含まれた評価差額
親投資信託受益証券	63,037,861	553,762,938
合計	63,037,861	553,762,938

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

該当する事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	第13期 (2025年2月20日現在)	第14期 (2026年2月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3404円 (13,404円)	1.4639円 (14,639円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・オープン・マザーファンド	32,692,097	300,590,755	
	外国債券インデックス・マザー・ファンド	711,905,094	2,404,103,502	
	日本株式インデックス・マザーファンド	132,343,996	983,077,671	
	日本債券インデックス・マザーファンド	1,293,843,749	1,449,234,383	
合 計		2,170,784,936	5,137,006,311	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額は、証券数です。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当する事項はありません。

## &lt;参考&gt;

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

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「日本株式インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2025年2月20日現在)	(2026年2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		1,941,261	1,214,550
コール・ローン		596,474,731	438,696,477
株式		46,483,053,660	49,261,862,750
派生商品評価勘定			18,055,380
未収入金			789,071,708
未収配当金		69,298,052	66,145,736
未収利息		6,964	8,146
前払金		1,775,000	
差入委託証拠金		18,006,870	16,260,128
流動資産合計		47,170,556,538	50,591,314,875
資産合計		47,170,556,538	50,591,314,875
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		5,332,920	1,125,560
前受金			21,560,000
未払金		511,320	
未払解約金		313,162,400	246,281,000
流動負債合計		319,006,640	268,966,560
負債合計		319,006,640	268,966,560
純資産の部			
元本等			
元本	1	9,003,079,654	6,774,532,506
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		37,848,470,244	43,547,815,809
元本等合計		46,851,549,898	50,322,348,315
純資産合計		46,851,549,898	50,322,348,315
負債純資産合計		47,170,556,538	50,591,314,875

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

## (2) 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

（2025年2月20日現在）	（2026年2月20日現在）
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	（2025年2月20日現在）	（2026年2月20日現在）
1 期首元本額	11,974,166,189円	9,003,079,654円
期中追加設定元本額	1,258,133,153円	991,350,834円
期中一部解約元本額	4,229,219,688円	3,219,897,982円
元本の内訳		
ファンド名		
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	56,502,671円	132,343,996円
日本株式インデックス・ファンド（年金1）＜適格機関投資家限定＞	545,513,640円	336,152,507円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	776,905円	607,464円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	10,360,724円	6,578,768円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	76,165円	61,843円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	747,633円	616,618円

バランスファンドVA50A < 適格機関投資家限定 >	2,493,969円	1,577,622円
バランスファンドVA50B < 適格機関投資家限定 >	2,783,082,675円	2,078,886,125円
日本株式インデックス・ファンドVA1 < 適格機関投資家限定 >	218,961,519円	215,393,694円
バランスファンドVA50C < 適格機関投資家限定 >	1,159,656円	5,344円
バランスファンドVA25A < 適格機関投資家限定 >	257,658,122円	158,073,152円
バランスファンドVA37.5A < 適格機関投資家限定 >	284,613,990円	209,104,507円
バランスファンドVA75A < 適格機関投資家限定 >	19,729,203円	12,850,236円
日本株式インデックス・ファンドM < 適格機関投資家限定 >	69,970,623円	円
日本株式インデックス・ファンドS < 適格機関投資家限定 >	73,382,844円	71,744,746円
4資産バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	48,785,981円	27,560,224円
4資産バランス40VA < 適格機関投資家限定 >	950,337,513円	685,081,363円
4資産バランス30VA < 適格機関投資家限定 >	96,221,656円	48,997,989円
バランスファンドVA35A < 適格機関投資家限定 >	552,457,725円	382,339,784円
バランスファンドVA40C < 適格機関投資家限定 >	20,556,463円	14,879,562円
グローバル4資産30VA < 適格機関投資家限定 >	6,609,249円	5,443,654円
グローバル4資産45VA < 適格機関投資家限定 >	9,590,379円	6,526,984円
4資産バランス30VA2 < 適格機関投資家限定 >	2,905,285円	1,781,380円
バランスファンドVA25B < 適格機関投資家限定 >	200,051,139円	130,998,447円
バランスファンドVA20A < 適格機関投資家限定 >	585,524円	338,652円
バランスファンドVA35B < 適格機関投資家限定 >	299,982円	218,952円
日本株式インデックス・ファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	35,650,598円	30,623,033円
4資産インデックスバランスVA20 < 適格機関投資家限定 >	127,711,824円	91,684,591円
世界分散ファンドVA25A < 適格機関投資家限定 >	513,795,682円	336,950,840円
T a dリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド(ステイブル)年金 < 適格機関投資家限定 >	53,008,111円	43,427,954円
フレックス資産配分戦略ファンド < 適格機関投資家限定 >	290,487,407円	242,699,359円

T a dリスクバジェット型マルチ配 分戦略ファンド（ステイブル）＜適 格機関投資家限定＞	52,386,182円	41,307,776円
ステート・ストリート日本株式イン デックス・オープン	1,524,486,041円	1,233,841,986円
ステート・ストリートTOPIXインデッ クス・オープン	10,066,100円	105,121,164円
世界バランス40VA＜適格機関投 資家限定＞	651,029円	543,540円
世界バランス60VA＜適格機関投 資家限定＞	1,467,941円	1,285,147円
グローバルバランス40VA＜適格 機関投資家限定＞	98,696円	81,610円
グローバルバランス40VA2＜適 格機関投資家限定＞	173,202,058円	115,093,836円
グローバルバランス40VA3＜適 格機関投資家限定＞	4,153,853円	2,585,932円
グローバルバランス50VA＜適格 機関投資家限定＞	2,482,897円	1,122,125円
計	9,003,079,654円	6,774,532,506円
2 受益権の総数	9,003,079,654口	6,774,532,506口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組 方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当 該金融商品に係るリス ク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「（3）附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク等の市場リスクに晒されております。</p> <p>デリバティブ取引には、ファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、ファンドの効率的な運用に資することを目的に利用している株価指数先物取引があり、株価変動リスクに晒されております。</p>

3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認を行っております。
------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	( 2025年2月20日現在 )	( 2026年2月20日現在 )
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありませ	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品</p> <p>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券            売買目的有価証券            「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引            「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品            同左</p> <p>(2)有価証券            売買目的有価証券            同左</p> <p>(3)デリバティブ取引            同左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	同左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	（2025年2月20日現在）	（2026年2月20日現在）
	当期間の損益に 含まれた評価差額	当期間の損益に 含まれた評価差額
株式	272,193,136	14,059,309,696
合計	272,193,136	14,059,309,696

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

## （デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

（単位：円）

区 分	種 類	（2025年2月20日現在）		
		契 約 額 等	時 価	評 価 損 益
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX（先物）	333,705,000	328,380,000	5,325,000
	合 計	333,705,000	328,380,000	5,325,000

（単位：円）

区 分	種 類	（2026年2月20日現在）		
		契 約 額 等	時 価	評 価 損 益
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX（先物）	858,090,000	875,035,000	16,945,000
	合 計	858,090,000	875,035,000	16,945,000

## （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、以下のように評価しております。

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

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

- 2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
- 5．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当する事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	（2025年2月20日現在）	（2026年2月20日現在）
1口当たり純資産額	5.2039円	7.4282円
（1万口当たり純資産額）	（52,039円）	（74,282円）

## （3）附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株式

銘柄	株数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
リョーサン菱洋ホールディングス	1,900	3,230.00	6,137,000	
フィットイージー	200	2,582.00	516,400	
シマダヤ	400	1,923.00	769,200	
飛島ホールディングス	900	2,511.00	2,259,900	
インターメスティック	500	1,909.00	954,500	
リガク・ホールディングス	5,500	1,783.00	9,806,500	
キオクシアホールディングス	5,600	20,560.00	115,136,000	
北里コーポレーション	800	1,453.00	1,162,400	
オリオンビール	1,600	1,334.00	2,134,400	
ブルーゾーンホールディングス	1,100	9,450.00	10,395,000	
テクセンドフォトマスク	2,600	2,946.00	7,659,600	
NE	500	656.00	328,000	
NSグループ	1,200	1,705.00	2,046,000	
極洋	500	5,240.00	2,620,000	
ニッセイ	11,700	1,471.50	17,216,550	
マルハニチロ	6,300	1,492.00	9,399,600	
ユキグニファクトリー	1,000	1,095.00	1,095,000	
カネコ種苗	300	1,512.00	453,600	
サカタのタネ	1,500	4,245.00	6,367,500	
ホクト	1,200	1,981.00	2,377,200	
ショーボンドホールディングス	7,200	1,406.00	10,123,200	
ミライト・ワン	4,400	3,888.00	17,107,200	
タマホーム	800	3,895.00	3,116,000	
robot home	3,400	201.00	683,400	
住石ホールディングス	1,200	870.00	1,044,000	
日鉄鉱業	2,500	3,665.00	9,162,500	
三井松島ホールディングス	1,500	1,487.00	2,230,500	
INPEX	43,000	3,677.00	158,111,000	
石油資源開発	7,900	2,357.00	18,620,300	
K&Oエナジーグループ	600	5,170.00	3,102,000	
第一カッター興業	300	1,584.00	475,200	
安藤・間	6,900	2,112.00	14,572,800	
東急建設	4,000	1,554.00	6,216,000	
コムシスホールディングス	4,500	5,528.00	24,876,000	
ピーアールホールディングス	1,800	528.00	950,400	
高松コンストラクショングループ	1,000	3,935.00	3,935,000	
東建コーポレーション	300	14,850.00	4,455,000	
ヤマウラ	700	1,616.00	1,131,200	
オリエンタル白石	4,900	420.00	2,058,000	
大成建設	6,700	18,795.00	125,926,500	
大林組	29,000	4,153.00	120,437,000	
清水建設	24,500	3,452.00	84,574,000	
長谷工コーポレーション	8,000	3,273.00	26,184,000	
松井建設	700	1,848.00	1,293,600	
鹿島建設	19,900	7,085.00	140,991,500	
不動産テトラ	500	3,790.00	1,895,000	

鉄建建設	600	4,710.00	2,826,000	
西松建設	1,400	6,612.00	9,256,800	
大豊建設	1,200	867.00	1,040,400	
奥村組	1,400	7,050.00	9,870,000	
東鉄工業	1,000	5,120.00	5,120,000	
浅沼組	3,600	1,135.00	4,086,000	
戸田建設	11,000	1,528.50	16,813,500	
熊谷組	5,400	1,980.00	10,692,000	
矢作建設工業	1,700	2,472.00	4,202,400	
ピーエス・コンストラクション	800	3,365.00	2,692,000	
日本ハウスホールディングス	1,800	323.00	581,400	
大東建託	15,300	3,470.00	53,091,000	
新日本建設	1,300	2,060.00	2,678,000	
東亜道路工業	1,400	1,872.00	2,620,800	
東亜建設工業	3,300	4,070.00	13,431,000	
日本国土開発	2,900	671.00	1,945,900	
若築建設	300	4,830.00	1,449,000	
五洋建設	12,700	2,042.50	25,939,750	
世紀東急工業	1,400	1,681.00	2,353,400	
福田組	300	7,360.00	2,208,000	
住友林業	23,200	1,766.50	40,982,800	
大和ハウス工業	24,800	5,515.00	136,772,000	
ライト工業	1,700	4,080.00	6,936,000	
積水ハウス	27,200	3,753.00	102,081,600	
日特建設	800	1,392.00	1,113,600	
北陸電気工事	500	1,657.00	828,500	
ユアテック	1,900	3,095.00	5,880,500	
日本リーテック	700	3,095.00	2,166,500	
四電工	1,100	2,011.00	2,212,100	
中電工	1,200	4,920.00	5,904,000	
関電工	4,900	6,688.00	32,771,200	
きんでん	6,100	8,084.00	49,312,400	
東京エネシス	900	1,921.00	1,728,900	
トーエネック	1,800	2,241.00	4,033,800	
日本電設工業	1,700	4,960.00	8,432,000	
エクシオグループ	8,500	2,876.50	24,450,250	
新日本空調	1,200	3,890.00	4,668,000	
クラフティア	1,900	9,865.00	18,743,500	
三機工業	1,800	7,520.00	13,536,000	
日揮ホールディングス	9,700	2,386.00	23,144,200	
中外炉工業	200	4,970.00	994,000	
太平電業	1,800	2,727.00	4,908,600	
高砂熱学工業	4,800	4,994.00	23,971,200	
朝日工業社	900	4,575.00	4,117,500	
明星工業	1,600	1,940.00	3,104,000	
大気社	2,300	3,770.00	8,671,000	
ダイダン	5,200	3,305.00	17,186,000	
日比谷総合設備	600	6,370.00	3,822,000	

ニッポン	3,200	2,820.00	9,024,000	
日清製粉グループ本社	8,900	2,127.50	18,934,750	
日東富士製粉	200	7,160.00	1,432,000	
昭和産業	800	3,385.00	2,708,000	
中部飼料	1,200	1,933.00	2,319,600	
フィード・ワン	1,200	1,256.00	1,507,200	
日本甜菜製糖	400	4,315.00	1,726,000	
D M三井製糖	800	3,460.00	2,768,000	
ウェルネオシュガー	500	3,005.00	1,502,500	
L I F U L L	3,100	207.00	641,700	
M I X I	1,700	2,615.00	4,445,500	
ジェイエイシーリクルートメント	3,600	876.00	3,153,600	
日本M & Aセンターホールディングス	15,100	695.60	10,503,560	
メンバーズ	400	1,160.00	464,000	
U Tグループ	19,100	202.00	3,858,200	
アイティメディア	500	1,820.00	910,000	
E・Jホールディングス	700	1,853.00	1,297,100	
オープンアップグループ	2,900	1,849.00	5,362,100	
コシダカホールディングス	2,700	1,160.00	3,132,000	
パソナグループ	1,000	1,995.00	1,995,000	
リンクアンドモチベーション	2,200	516.00	1,135,200	
エス・エム・エス	3,600	1,703.00	6,130,800	
パーソルホールディングス	85,500	240.50	20,562,750	
クックパッド	2,000	145.00	290,000	
森永製菓	3,600	2,807.50	10,107,000	
中村屋	200	3,235.00	647,000	
江崎グリコ	2,600	5,868.00	15,256,800	
me i t o	400	2,582.00	1,032,800	
井村屋グループ	500	2,508.00	1,254,000	
不二家	600	2,460.00	1,476,000	
山崎製パン	6,000	3,384.00	20,304,000	
モロゾフ	1,000	1,500.00	1,500,000	
亀田製菓	600	4,295.00	2,577,000	
寿スピリッツ	4,800	1,978.00	9,494,400	
カルビー	4,100	3,028.00	12,414,800	
森永乳業	3,300	4,628.00	15,272,400	
六甲バター	700	1,196.00	837,200	
ヤクルト本社	12,500	2,583.00	32,287,500	
明治ホールディングス	12,500	3,858.00	48,225,000	
雪印メグミルク	2,400	3,475.00	8,340,000	
プリマハム	1,200	2,829.00	3,394,800	
日本ハム	3,400	6,906.00	23,480,400	
丸大食品	900	2,364.00	2,127,600	
S F o o d s	1,000	3,180.00	3,180,000	
柿安本店	400	2,884.00	1,153,600	
伊藤ハム米久ホールディングス	1,600	6,210.00	9,936,000	
学情	400	1,853.00	741,200	
スタジオアリス	500	2,000.00	1,000,000	

クロスキャット	500	999.00	499,500	
システナ	13,200	432.00	5,702,400	
N J S	200	4,575.00	915,000	
デジタルアーツ	500	5,520.00	2,760,000	
日鉄ソリューションズ	2,500	3,660.00	9,150,000	
A L S O K	15,700	1,183.00	18,573,100	
キューブシステム	700	1,093.00	765,100	
いちご	7,600	427.00	3,245,200	
日本駐車場開発	11,200	281.00	3,147,200	
コア	400	2,207.00	882,800	
カカクコム	6,200	1,673.50	10,375,700	
セントケア・ホールディング	100	1,210.00	121,000	
ルネサンス	700	1,109.00	776,300	
ディップ	1,600	2,015.00	3,224,000	
S B Sホールディングス	800	4,155.00	3,324,000	
デジタルホールディングス	500	2,006.00	1,003,000	
新日本科学	1,000	1,708.00	1,708,000	
エムスリー	18,500	1,598.00	29,563,000	
ワールドホールディングス	400	2,808.00	1,123,200	
ディー・エヌ・エー	3,800	2,664.50	10,125,100	
博報堂D Yホールディングス	12,100	1,125.00	13,612,500	
ぐるなび	2,400	150.00	360,000	
タカミヤ	1,700	436.00	741,200	
ファンコミュニケーションズ	1,300	470.00	611,000	
ライク	500	1,573.00	786,500	
エスプール	2,800	255.00	714,000	
W D Bホールディングス	400	1,569.00	627,600	
手間いらず	100	2,870.00	287,000	
アドウェイズ	1,100	282.00	310,200	
バリューコマース	1,100	439.00	482,900	
インフォマート	8,900	369.00	3,284,100	
サッポロホールディングス	13,400	1,734.50	23,242,300	
アサヒグループホールディングス	67,600	1,708.50	115,494,600	
麒麟ホールディングス	37,500	2,638.50	98,943,750	
宝ホールディングス	7,500	1,547.50	11,606,250	
オエノンホールディングス	2,600	464.00	1,206,400	
養命酒製造	300	4,480.00	1,344,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	5,900	4,073.00	24,030,700	
ライフドリンク カンパニー	1,600	1,301.00	2,081,600	
サントリー食品インターナショナル	6,300	4,866.00	30,655,800	
ダイドーグループホールディングス	1,000	2,535.00	2,535,000	
伊藤園	2,900	2,992.00	8,676,800	
キーコーヒー	1,000	1,988.00	1,988,000	
日清オイリオグループ	1,300	5,910.00	7,683,000	
不二製油	1,800	3,919.00	7,054,200	
J - オイルミルズ	1,100	2,039.00	2,242,900	
サンエー	1,700	3,095.00	5,261,500	
カワチ薬品	800	3,130.00	2,504,000	

エービーシー・マート	5,100	2,559.00	13,050,900	
ハードオフコーポレーション	400	2,116.00	846,400	
高千穂交易	800	2,098.00	1,678,400	
アスクル	1,900	1,307.00	2,483,300	
ゲオホールディングス	1,100	1,729.00	1,901,900	
アンドエスティHD	1,400	2,963.00	4,148,200	
伊藤忠食品	200	11,920.00	2,384,000	
くら寿司	1,100	3,620.00	3,982,000	
キャンドゥ	300	3,520.00	1,056,000	
パルグループホールディングス	3,900	1,671.00	6,516,900	
エディオン	4,600	2,225.00	10,235,000	
あらた	1,500	3,005.00	4,507,500	
サーラコーポレーション	2,100	1,176.00	2,469,600	
トーメンデバイス	100	13,450.00	1,345,000	
ハローズ	400	4,740.00	1,896,000	
J Pホールディングス	2,400	748.00	1,795,200	
フジオフードグループ本社	1,500	1,058.00	1,587,000	
あみやき亭	700	1,427.00	998,900	
東京エレクトロン デバイス	1,000	3,655.00	3,655,000	
円谷フィールズホールディングス	1,700	1,526.00	2,594,200	
双日	9,300	6,766.00	62,923,800	
アルフレッサ ホールディングス	9,100	2,532.50	23,045,750	
大黒天物産	300	5,550.00	1,665,000	
ハニーズホールディングス	800	1,516.00	1,212,800	
キッコーマン	29,800	1,483.00	44,193,400	
味の素	44,700	4,602.00	205,709,400	
ブルドックソース	400	1,906.00	762,400	
キューピー	4,800	4,462.00	21,417,600	
ハウス食品グループ本社	3,400	3,055.00	10,387,000	
カゴメ	4,700	2,815.50	13,232,850	
アリアケジャパン	1,000	6,000.00	6,000,000	
エバラ食品工業	200	2,701.00	540,200	
ニチレイ	8,000	2,079.00	16,632,000	
横浜冷凍	2,400	1,418.00	3,403,200	
東洋水産	4,200	12,000.00	50,400,000	
イトアンドホールディングス	400	2,080.00	832,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	600	966.00	579,600	
日清食品ホールディングス	10,200	3,229.00	32,935,800	
フジッコ	1,100	1,623.00	1,785,300	
ロック・フィールド	1,000	1,408.00	1,408,000	
日本たばこ産業	54,700	5,893.00	322,347,100	
ケンコーマヨネーズ	500	2,245.00	1,122,500	
わらべや日洋ホールディングス	600	3,450.00	2,070,000	
なとり	500	1,934.00	967,000	
ファーマフーズ	1,200	630.00	756,000	
北の達人コーポレーション	3,500	137.00	479,500	
ユーグレナ	6,100	385.00	2,348,500	
紀文食品	800	1,085.00	868,000	

ピクルスホールディングス	500	1,277.00	638,500	
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,596.00	1,436,400	
S R Eホールディングス	400	2,789.00	1,115,600	
片倉工業	1,000	3,095.00	3,095,000	
グンゼ	1,400	4,635.00	6,489,000	
ヒューリック	26,200	2,038.50	53,408,700	
ラサ商事	500	2,336.00	1,168,000	
アルベン	1,000	2,205.00	2,205,000	
ラクーンホールディングス	900	646.00	581,400	
クオールホールディングス	1,200	1,896.00	2,275,200	
アルコニクス	1,500	3,070.00	4,605,000	
神戸物産	8,400	3,736.00	31,382,400	
ソリトンシステムズ	500	2,087.00	1,043,500	
ジズホールディングス	600	5,230.00	3,138,000	
ビクカメラ	5,200	1,780.50	9,258,600	
D C Mホールディングス	5,000	1,701.00	8,505,000	
ペッパーフードサービス	2,800	177.00	495,600	
MonotaRO	13,700	2,075.00	28,427,500	
あいホールディングス	1,900	2,813.00	5,344,700	
J.フロントリテイリング	11,100	2,609.00	28,959,900	
ドトール・日レスホールディングス	1,700	2,975.00	5,057,500	
マツキヨココカラ&カンパニー	16,800	2,595.00	43,596,000	
ブロンコビリー	600	3,940.00	2,364,000	
Z O Z O	15,200	1,080.50	16,423,600	
トレジャー・ファクトリー	600	1,796.00	1,077,600	
物語コーポレーション	1,900	5,010.00	9,519,000	
三越伊勢丹ホールディングス	15,100	2,984.50	45,065,950	
東洋紡	4,000	1,595.00	6,380,000	
ユニチカ	3,200	1,236.00	3,955,200	
富士紡ホールディングス	400	10,410.00	4,164,000	
日清紡ホールディングス	6,900	1,711.50	11,809,350	
倉敷紡績	600	9,760.00	5,856,000	
ダイワボウホールディングス	3,600	3,027.00	10,897,200	
シキボウ	700	1,112.00	778,400	
日東紡績	1,200	21,200.00	25,440,000	
トヨタ紡織	4,500	3,224.00	14,508,000	
マクニカホールディングス	6,800	2,629.00	17,877,200	
H a m e e	500	469.00	234,500	
ラクト・ジャパン	400	3,665.00	1,466,000	
クリエイトSDホールディングス	1,400	3,300.00	4,620,000	
グリムス	300	2,661.00	798,300	
パイタルケーエスケー・ホールディングス	1,400	1,398.00	1,957,200	
八洲電機	700	3,395.00	2,376,500	
メディアスホールディングス	700	814.00	569,800	
レスター	800	3,090.00	2,472,000	
T O K A Iホールディングス	5,300	1,205.00	6,386,500	
三洋貿易	1,200	1,845.00	2,214,000	
シュッピン	1,000	1,331.00	1,331,000	

ビューティガレージ	400	1,457.00	582,800
オイシックス・ラ・大地	1,500	1,385.00	2,077,500
ウイン・パートナーズ	700	1,433.00	1,003,100
ネクステージ	2,200	3,660.00	8,052,000
ジョイフル本田	2,900	2,165.00	6,278,500
エターナルホスピタリティグループ	400	3,690.00	1,476,000
ホットランドホールディングス	800	1,901.00	1,520,800
すかいらくホールディングス	13,200	3,605.00	47,586,000
SFPホールディングス	600	2,300.00	1,380,000
綿半ホールディングス	800	1,476.00	1,180,800
日本毛織	2,300	2,008.00	4,618,400
ヨシックスホールディングス	200	3,550.00	710,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	4,800	968.00	4,646,400
野村不動産ホールディングス	25,100	1,118.00	28,061,800
三重交通グループホールディングス	2,200	586.00	1,289,200
ディア・ライフ	1,600	1,100.00	1,760,000
地主	700	3,365.00	2,355,500
フィル・カンパニー	200	1,088.00	217,600
JPMC	500	1,352.00	676,000
フージャースホールディングス	1,700	1,294.00	2,199,800
オープンハウスグループ	2,800	11,640.00	32,592,000
東急不動産ホールディングス	24,600	1,554.00	38,228,400
飯田グループホールディングス	7,600	2,714.50	20,630,200
帝国繊維	1,000	2,936.00	2,936,000
日本コークス工業	9,700	124.00	1,202,800
あさひ	800	1,289.00	1,031,200
コスモス薬品	1,600	7,107.00	11,371,200
シップヘルスケアホールディングス	3,600	2,659.00	9,572,400
ソフトクリエイトホールディングス	800	2,034.00	1,627,200
セブン&アイ・ホールディングス	106,800	2,191.00	233,998,800
クリエイト・レストランツ・ホールディング	14,700	766.00	11,260,200
明治電機工業	500	2,450.00	1,225,000
ツルハホールディングス	15,100	2,656.00	40,105,600
サンマルクホールディングス	900	3,020.00	2,718,000
トリドールホールディングス	2,700	4,248.00	11,469,600
帝人	8,200	1,642.50	13,468,500
東レ	61,700	1,279.00	78,914,300
クラレ	11,600	1,792.50	20,793,000
旭化成	60,700	1,740.00	105,618,000
TOKYO BASE	1,600	383.00	612,800
稲葉製作所	600	1,665.00	999,000
宮地エンジニアリンググループ	1,200	1,880.00	2,256,000
トーカロ	2,700	2,991.00	8,075,700
SUMCO	17,900	1,614.00	28,890,600
川田テクノロジーズ	700	5,270.00	3,689,000
RS Technologies	600	3,780.00	2,268,000
And Doホールディングス	400	1,079.00	431,600
ケイアイスター不動産	400	8,140.00	3,256,000

グッドコムアセット	800	1,416.00	1,132,800	
ジェイ・エス・ビー	400	3,400.00	1,360,000	
ロードスターキャピタル	500	3,560.00	1,780,000	
アズーム	200	4,360.00	872,000	
霞ヶ関キャピタル	900	7,350.00	6,615,000	
J Mホールディングス	1,400	1,686.00	2,360,400	
コメダホールディングス	2,400	2,905.00	6,972,000	
アレンザホールディングス	700	1,461.00	1,022,700	
串カツ田中ホールディングス	300	2,019.00	605,700	
パロックジャパンリミテッド	1,000	808.00	808,000	
クスリのアオキホールディングス	2,300	4,021.00	9,248,300	
力の源ホールディングス	600	1,520.00	912,000	
FOOD & LIFE COMPANIE	5,500	9,314.00	51,227,000	
アセンテック	400	1,304.00	521,600	
セーレン	2,000	3,590.00	7,180,000	
小松マテーレ	1,400	884.00	1,237,600	
ワコールホールディングス	1,800	4,497.00	8,094,600	
ホギメディカル	1,100	6,690.00	7,359,000	
T S Iホールディングス	2,700	1,123.00	3,032,100	
ワールド	1,600	3,300.00	5,280,000	
T I S	9,700	3,109.00	30,157,300	
グリーンホールディングス	3,000	385.00	1,155,000	
G M Oペパボ	200	2,016.00	403,200	
コーエーテクモホールディングス	5,800	1,691.50	9,810,700	
三菱総合研究所	400	4,995.00	1,998,000	
ファインデックス	600	888.00	532,800	
K L a b	2,200	310.00	682,000	
ポルトゥウィンホールディングス	1,400	309.00	432,600	
ネクソン	22,600	3,216.00	72,681,600	
アイスタイル	3,400	459.00	1,560,600	
エムアップホールディングス	2,200	676.00	1,487,200	
エイチームホールディングス	700	1,009.00	706,300	
セルシス	1,200	1,284.00	1,540,800	
エニグモ	1,000	404.00	404,000	
コロプラ	3,100	425.00	1,317,500	
ブロードリーフ	3,600	680.00	2,448,000	
デジタルハーツホールディングス	800	833.00	666,400	
メディアドゥ	400	1,639.00	655,600	
じげん	2,800	427.00	1,195,600	
ブイキューブ	1,500	138.00	207,000	
フィックスターズ	1,200	1,440.00	1,728,000	
オブティム	1,300	458.00	595,400	
セレス	500	1,594.00	797,000	
S H I F T	8,200	657.10	5,388,220	
特種東海製紙	1,500	1,668.00	2,502,000	
セック	300	3,975.00	1,192,500	
テクマトリックス	1,800	1,889.00	3,400,200	
プロシップ	800	1,428.00	1,142,400	

ガンホー・オンライン・エンターテイメント	2,100	2,483.00	5,214,300	
GMOペイメントゲートウェイ	1,800	7,444.00	13,399,200	
システムリサーチ	700	1,798.00	1,258,600	
インターネットイニシアティブ	5,100	2,238.00	11,413,800	
さくらインターネット	1,300	2,887.00	3,753,100	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	300	2,058.00	617,400	
SRAホールディングス	500	4,975.00	2,487,500	
朝日ネット	900	677.00	609,300	
eBASE	1,100	414.00	455,400	
アバントグループ	1,100	1,384.00	1,522,400	
アドソル日進	800	1,811.00	1,448,800	
フリービット	500	1,548.00	774,000	
コムチュア	1,300	1,447.00	1,881,100	
アステリア	700	1,245.00	871,500	
アイル	500	2,336.00	1,168,000	
王子ホールディングス	34,600	971.60	33,617,360	
日本製紙	5,200	1,246.00	6,479,200	
北越コーポレーション	5,300	913.00	4,838,900	
大王製紙	4,600	1,119.00	5,147,400	
マークライNZ	500	1,542.00	771,000	
gumi	2,000	329.00	658,000	
テラスカイ	300	1,892.00	567,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,000	1,012.00	1,012,000	
ネオジャパン	300	1,700.00	510,000	
PR TIMES	200	2,379.00	475,800	
ラクス	8,700	766.10	6,665,070	
ダブルスタンダード	400	1,442.00	576,800	
オーブンドア	600	358.00	214,800	
アカツキ	500	3,055.00	1,527,500	
Ubicomホールディングス	400	958.00	383,200	
カナミックネットワーク	1,200	526.00	631,200	
レンゴー	9,200	1,526.50	14,043,800	
トーモク	500	3,625.00	1,812,500	
ザ・バック	1,800	1,292.00	2,325,600	
チェンジホールディングス	1,900	939.00	1,784,100	
オークネット	800	2,223.00	1,778,400	
オロ	400	1,955.00	782,000	
ユーザーローカル	500	1,591.00	795,500	
PKSHA Technology	1,100	2,758.00	3,033,800	
マネーフォワード	2,100	3,052.00	6,409,200	
レゾナック・ホールディングス	8,800	11,220.00	98,736,000	
住友化学	73,600	568.00	41,804,800	
住友精化	400	6,870.00	2,748,000	
日産化学	4,600	6,597.00	30,346,200	
ラサ工業	300	9,850.00	2,955,000	
クレハ	1,400	4,765.00	6,671,000	
多木化学	400	3,830.00	1,532,000	
テイカ	600	1,704.00	1,022,400	

石原産業	1,500	3,950.00	5,925,000	
日本曹達	1,900	4,115.00	7,818,500	
東ソー	13,300	2,640.00	35,112,000	
トクヤマ	3,200	4,169.00	13,340,800	
セントラル硝子	1,200	4,215.00	5,058,000	
東亜合成	3,800	1,831.50	6,959,700	
大阪ソーダ	3,200	2,385.00	7,632,000	
関東電化工業	1,700	1,658.00	2,818,600	
GMOフィナンシャルゲート	100	5,000.00	500,000	
Sun Asterisk	900	414.00	372,600	
デンカ	3,600	3,264.00	11,750,400	
イビデン	11,600	9,157.00	106,221,200	
信越化学工業	81,400	5,750.00	468,050,000	
日本カーバイド工業	500	3,000.00	1,500,000	
プラスアルファ・コンサルティング	1,200	2,038.00	2,445,600	
電算システムホールディングス	400	3,050.00	1,220,000	
堺化学工業	800	3,735.00	2,988,000	
第一稀元素化学工業	900	2,500.00	2,250,000	
エア・ウォーター	8,600	2,101.50	18,072,900	
日本酸素ホールディングス	10,400	5,818.00	60,507,200	
日本化学工業	400	3,405.00	1,362,000	
日本パーカライズニング	4,600	1,561.00	7,180,600	
高压ガス工業	1,300	1,110.00	1,443,000	
四国化成ホールディングス	1,000	5,160.00	5,160,000	
戸田工業	300	1,400.00	420,000	
ステラ ケミファ	500	5,290.00	2,645,000	
保土谷化学工業	600	2,315.00	1,389,000	
日本触媒	5,700	2,451.50	13,973,550	
大日精化工業	600	4,885.00	2,931,000	
カネカ	2,200	5,102.00	11,224,400	
協和キリン	10,800	2,778.50	30,007,800	
Appier Group	3,600	700.00	2,520,000	
三菱瓦斯化学	6,500	4,405.00	28,632,500	
三井化学	16,500	2,313.50	38,172,750	
東京応化工業	4,400	9,237.00	40,642,800	
大阪有機化学工業	800	4,525.00	3,620,000	
三菱ケミカルグループ	64,000	1,117.50	71,520,000	
KHネオケム	1,500	2,987.00	4,480,500	
ビジョナル	1,100	6,878.00	7,565,800	
ダイセル	10,000	1,629.00	16,290,000	
住友ベークライト	3,200	5,787.00	18,518,400	
積水化学工業	19,100	2,985.00	57,013,500	
日本ゼオン	6,700	2,032.00	13,614,400	
アイカ工業	2,300	3,833.00	8,815,900	
UBE	4,700	2,802.00	13,169,400	
積水樹脂	1,100	2,258.00	2,483,800	
旭有機材	600	4,995.00	2,997,000	
ニチバン	600	1,946.00	1,167,600	

リケンテクノス	1,500	1,731.00	2,596,500	
大倉工業	500	4,985.00	2,492,500	
積水化成品工業	1,700	497.00	844,900	
群栄化学工業	200	5,100.00	1,020,000	
ダイキョーニシカワ	1,900	910.00	1,729,000	
森六	500	2,527.00	1,263,500	
恵和	700	1,323.00	926,100	
日本化薬	6,600	1,925.00	12,705,000	
カーリット	800	2,669.00	2,135,200	
CLホールディングス	300	1,153.00	345,900	
プレステージ・インターナショナル	3,400	670.00	2,278,000	
ハイマックス	400	1,268.00	507,200	
アミューズ	600	2,020.00	1,212,000	
野村総合研究所	17,900	3,833.00	68,610,700	
ドリームインキュベータ	300	2,803.00	840,900	
クイック	2,400	856.00	2,054,400	
日本システム技術	900	2,000.00	1,800,000	
電通グループ	9,100	2,831.00	25,762,100	
インテージホールディングス	600	1,650.00	990,000	
テイクアンドグヴ・ニーズ	500	713.00	356,500	
東邦システムサイエンス	400	1,151.00	460,400	
ぴあ	400	2,864.00	1,145,600	
イオンファンタジー	400	2,781.00	1,112,400	
ソースネクスト	6,100	131.00	799,100	
シーティーエス	1,200	977.00	1,172,400	
メディカルシステムネットワーク	900	515.00	463,500	
日本精化	600	2,698.00	1,618,800	
扶桑化学工業	1,000	9,200.00	9,200,000	
トリケミカル研究所	1,100	3,470.00	3,817,000	
シンプレクス・ホールディングス	7,300	834.00	6,088,200	
HEROZ	500	785.00	392,500	
ラクスル	1,900	1,899.00	3,608,100	
メルカリ	4,000	3,585.00	14,340,000	
I P S	300	3,145.00	943,500	
システムサポートホールディングス	800	1,211.00	968,800	
A D E K A	3,500	4,542.00	15,897,000	
日油	10,500	2,970.00	31,185,000	
ハリマ化成グループ	900	1,018.00	916,200	
ボードルア	500	1,712.00	856,000	
イーソル	900	545.00	490,500	
ウイングアーク1st	1,000	2,697.00	2,697,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン	400	942.00	376,800	
サーバーワークス	200	1,852.00	370,400	
S a n s a n	2,900	1,105.00	3,204,500	
ギフトィ	800	982.00	785,600	
花王	21,700	6,524.00	141,570,800	
第一工業製薬	400	11,310.00	4,524,000	
石原ケミカル	400	2,771.00	1,108,400	

三洋化成工業	600	5,880.00	3,528,000	
メドレー	1,200	2,045.00	2,454,000	
ベース	400	3,210.00	1,284,000	
J M D C	1,300	3,960.00	5,148,000	
武田薬品工業	81,600	5,790.00	472,464,000	
アステラス製薬	80,400	2,476.50	199,110,600	
住友ファーマ	8,100	2,475.50	20,051,550	
塩野義製薬	33,400	3,645.00	121,743,000	
日本新薬	2,400	5,015.00	12,036,000	
中外製薬	28,700	9,930.00	284,991,000	
科研製薬	1,400	4,270.00	5,978,000	
エーザイ	12,000	5,114.00	61,368,000	
理研ビタミン	800	3,000.00	2,400,000	
ロート製薬	9,700	2,377.00	23,056,900	
小野薬品工業	20,400	2,617.50	53,397,000	
久光製薬	2,000	6,031.00	12,062,000	
持田製薬	1,100	3,780.00	4,158,000	
参天製薬	15,400	1,716.00	26,426,400	
扶桑薬品工業	400	2,387.00	954,800	
ツムラ	3,100	4,051.00	12,558,100	
テルモ	60,700	1,962.00	119,093,400	
H . U . グループホールディングス	3,000	3,190.00	9,570,000	
キッセイ薬品工業	1,400	4,750.00	6,650,000	
生化学工業	1,600	723.00	1,156,800	
栄研化学	1,300	3,050.00	3,965,000	
J C R ファーマ	3,700	678.00	2,508,600	
東和薬品	1,200	4,310.00	5,172,000	
富士製薬工業	700	2,400.00	1,680,000	
ゼリア新薬工業	1,300	2,208.00	2,870,400	
ネクセラファーマ	4,200	897.00	3,767,400	
第一三共	84,200	2,918.50	245,737,700	
杏林製薬	1,800	1,687.00	3,036,600	
大幸薬品	1,700	300.00	510,000	
ダイト	1,100	1,410.00	1,551,000	
大塚ホールディングス	20,400	10,620.00	216,648,000	
ペプチドリーム	4,400	1,358.50	5,977,400	
大日本塗料	1,000	1,461.00	1,461,000	
日本ペイントホールディングス	48,600	1,158.00	56,278,800	
関西ペイント	7,300	2,728.50	19,918,050	
中国塗料	1,900	4,595.00	8,730,500	
藤倉化成	1,000	1,047.00	1,047,000	
太陽ホールディングス	4,400	5,990.00	26,356,000	
D I C	3,200	4,314.00	13,804,800	
サカタインクス	2,000	2,701.00	5,402,000	
a r t i e n c e	1,700	4,160.00	7,072,000	
アルプス技研	800	2,618.00	2,094,400	
サニックスホールディングス	1,000	205.00	205,000	
日本空調サービス	1,000	1,554.00	1,554,000	

オリエンタルランド	55,400	2,710.50	150,161,700
フォーカスシステムズ	600	1,673.00	1,003,800
ダスキン	2,100	4,227.00	8,876,700
パーク24	6,500	2,145.00	13,942,500
明光ネットワークジャパン	1,500	718.00	1,077,000
ファルコホールディングス	400	2,680.00	1,072,000
クレスコ	1,700	1,535.00	2,609,500
フジ・メディア・ホールディングス	7,200	3,374.00	24,292,800
ラウンドワン	9,000	988.30	8,894,700
リゾートトラスト	9,000	1,880.00	16,920,000
オービック	17,000	3,883.00	66,011,000
ジャストシステム	1,300	4,000.00	5,200,000
TDCソフト	1,800	1,038.00	1,868,400
LINEヤフー	141,000	374.30	52,776,300
ビー・エム・エル	1,300	4,145.00	5,388,500
トレンドマイクロ	5,300	5,688.00	30,146,400
IDホールディングス	600	1,948.00	1,168,800
リソー教育グループ	3,000	208.00	624,000
日本オラクル	1,700	9,411.00	15,998,700
早稲田アカデミー	500	2,011.00	1,005,500
アルファシステムズ	300	3,660.00	1,098,000
フューチャー	2,000	1,796.00	3,592,000
CAC Holdings	500	1,906.00	953,000
ユー・エス・エス	17,800	1,849.00	32,912,200
オービックビジネスコンサルタント	1,500	5,837.00	8,755,500
アイティフォー	1,000	1,691.00	1,691,000
東計電算	300	4,250.00	1,275,000
サイバーエージェント	19,000	1,309.00	24,871,000
楽天グループ	74,100	822.40	60,939,840
クリーク・アンド・リバー社	600	1,456.00	873,600
SBIグローバルアセットマネジメント	1,700	608.00	1,033,600
テー・オー・ダブリュー	1,700	377.00	640,900
大塚商会	10,400	3,040.00	31,616,000
サイボウズ	1,300	2,164.00	2,813,200
GMOインターネット	200	724.00	144,800
山田コンサルティンググループ	400	1,674.00	669,600
セントラルスポーツ	400	2,480.00	992,000
パラカ	200	2,007.00	401,400
電通総研	3,400	1,814.00	6,167,600
デジタルガレージ	1,400	2,042.00	2,858,800
EMシステムズ	1,400	697.00	975,800
ウェザーニューズ	600	4,145.00	2,487,000
CIJ	2,100	503.00	1,056,300
ビジネスエンジニアリング	1,000	1,407.00	1,407,000
WOWOW	700	1,311.00	917,700
スカラ	1,200	368.00	441,600
フルキャストホールディングス	700	1,635.00	1,144,500
エン	1,500	1,205.00	1,807,500

セルソース	400	402.00	160,800	
あすか製薬ホールディングス	900	2,487.00	2,238,300	
サワイグループホールディングス	4,800	2,365.50	11,354,400	
富士フィルムホールディングス	55,300	3,000.00	165,900,000	
コニカミノルタ	20,900	591.50	12,362,350	
資生堂	17,800	3,074.00	54,717,200	
ライオン	10,500	1,744.00	18,312,000	
高砂香料工業	3,500	1,385.00	4,847,500	
マンダム	2,000	3,095.00	6,190,000	
ミルボン	1,500	2,716.00	4,074,000	
コーセーホールディングス	2,100	6,064.00	12,734,400	
コタ	1,100	1,287.00	1,415,700	
ポーラ・オルビスホールディングス	4,700	1,357.50	6,380,250	
ノエビアホールディングス	800	4,610.00	3,688,000	
新日本製薬	600	2,088.00	1,252,800	
I - n e	300	1,101.00	330,300	
アクシージア	700	373.00	261,100	
エステー	700	1,540.00	1,078,000	
コニシ	2,900	1,343.00	3,894,700	
長谷川香料	1,800	2,850.00	5,130,000	
小林製薬	2,400	5,635.00	13,524,000	
荒川化学工業	800	1,468.00	1,174,400	
メック	700	6,980.00	4,886,000	
日本高純度化学	200	5,280.00	1,056,000	
タカラバイオ	2,400	1,148.00	2,755,200	
J C U	1,000	6,660.00	6,660,000	
O A T アグリオ	300	2,389.00	716,700	
デクセリアルズ	7,900	2,372.50	18,742,750	
アース製薬	800	4,920.00	3,936,000	
北興化学工業	600	1,823.00	1,093,800	
大成ラミックグループ	300	2,677.00	803,100	
クミアイ化学工業	4,100	711.00	2,915,100	
日本農薬	1,400	1,017.00	1,423,800	
ニチレキグループ	1,000	2,414.00	2,414,000	
ユシロ	500	3,095.00	1,547,500	
J X 金属	26,200	3,389.00	88,791,800	
出光興産	39,600	1,416.50	56,093,400	
E N E O S ホールディングス	129,500	1,456.00	188,552,000	
コスモエネルギーホールディングス	5,100	4,793.00	24,444,300	
ANYCOLOR	1,400	4,020.00	5,628,000	
日本ビジネスシステムズ	500	1,548.00	774,000	
テスホールディングス	2,700	532.00	1,436,400	
インフロニア・ホールディングス	9,400	2,566.50	24,125,100	
横浜ゴム	5,100	7,982.00	40,708,200	
TOYO TIRE	5,800	4,735.00	27,463,000	
ブリヂストン	53,700	3,620.00	194,394,000	
住友ゴム工業	9,900	2,715.00	26,878,500	
藤倉コンポジット	800	2,605.00	2,084,000	

オカモト	500	5,580.00	2,790,000
アキレス	600	1,655.00	993,000
フコク	500	2,005.00	1,002,500
ニッタ	900	4,440.00	3,996,000
三ツ星ベルト	1,200	4,180.00	5,016,000
バンドー化学	1,400	2,328.00	3,259,200
A G C	8,900	6,294.00	56,016,600
日本板硝子	5,300	599.00	3,174,700
有沢製作所	1,600	2,550.00	4,080,000
日本電気硝子	3,100	6,180.00	19,158,000
オハラ	400	1,154.00	461,600
住友大阪セメント	1,500	4,409.00	6,613,500
太平洋セメント	5,600	4,647.00	26,023,200
日本ヒューム	1,600	1,587.00	2,539,200
日本コンクリート工業	1,600	349.00	558,400
三谷セキサン	400	7,270.00	2,908,000
アジアパイルホールディングス	1,500	1,508.00	2,262,000
東海カーボン	9,300	1,042.00	9,690,600
日本カーボン	500	4,870.00	2,435,000
東洋炭素	800	5,980.00	4,784,000
ノリタケ	1,000	6,920.00	6,920,000
T O T O	5,700	6,195.00	35,311,500
日本碍子	10,200	4,321.00	44,074,200
日本特殊陶業	7,500	7,793.00	58,447,500
M A R U W A	400	55,080.00	22,032,000
品川リフラ	1,200	2,388.00	2,865,600
黒崎播磨	700	4,205.00	2,943,500
ヨータイ	600	1,966.00	1,179,600
フジインコーポレーテッド	2,800	3,200.00	8,960,000
ニチアス	2,500	8,689.00	21,722,500
日本製鉄	257,100	673.90	173,259,690
神戸製鋼所	18,900	2,287.00	43,224,300
中山製鋼所	1,900	620.00	1,178,000
合同製鐵	500	4,025.00	2,012,500
J F E ホールディングス	30,600	2,249.50	68,834,700
東京製鐵	2,600	1,581.00	4,110,600
共英製鋼	1,100	2,565.00	2,821,500
大和工業	1,700	12,755.00	21,683,500
東京鐵鋼	400	6,270.00	2,508,000
大阪製鐵	500	2,546.00	1,273,000
ヨドコウ	5,500	1,406.00	7,733,000
中部鋼鉄	800	2,574.00	2,059,200
丸一鋼管	9,400	1,587.00	14,917,800
モリ工業	1,100	1,003.00	1,103,300
大同特殊鋼	6,700	2,160.00	14,472,000
日本冶金工業	600	5,060.00	3,036,000
愛知製鋼	1,800	3,300.00	5,940,000
大平洋金属	800	3,090.00	2,472,000

新日本電工	5,600	427.00	2,391,200	
栗本鐵工所	2,300	1,711.00	3,935,300	
日本製鋼所	2,800	10,020.00	28,056,000	
三菱製鋼	600	2,024.00	1,214,400	
日本精線	700	1,315.00	920,500	
エンビプロ・ホールディングス	800	940.00	752,000	
大紀アルミニウム工業所	1,400	1,423.00	1,992,200	
日本軽金属ホールディングス	2,800	2,968.00	8,310,400	
三井金属	2,400	31,290.00	75,096,000	
東邦亜鉛	800	1,547.00	1,237,600	
三菱マテリアル	6,300	5,237.00	32,993,100	
住友金属鉱山	12,900	10,010.00	129,129,000	
DOWAホールディングス	2,500	10,140.00	25,350,000	
古河機械金属	1,100	5,750.00	6,325,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,600	2,686.00	4,297,600	
東邦チタニウム	1,700	1,895.00	3,221,500	
UACJ	5,700	2,480.00	14,136,000	
CKサンエツ	200	4,330.00	866,000	
古河電気工業	3,100	23,335.00	72,338,500	
住友電気工業	32,600	9,748.00	317,784,800	
フジクラ	12,100	22,900.00	277,090,000	
SWCC	1,400	14,310.00	20,034,000	
平河ヒューテック	500	4,255.00	2,127,500	
いよぎんホールディングス	11,800	3,492.00	41,205,600	
しずおかフィナンシャルグループ	19,800	3,119.00	61,756,200	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	7,600	3,348.00	25,444,800	
楽天銀行	4,800	8,962.00	43,017,600	
京都フィナンシャルグループ	12,300	3,698.00	45,485,400	
リョービ	1,100	2,960.00	3,256,000	
AREホールディングス	3,800	4,245.00	16,131,000	
Japan Eyewear Holdin	300	1,916.00	574,800	
東洋製罐グループホールディングス	4,700	3,915.00	18,400,500	
ホッカンホールディングス	500	2,363.00	1,181,500	
コロナ	700	1,041.00	728,700	
横河ブリッジホールディングス	1,600	3,200.00	5,120,000	
三和ホールディングス	9,100	3,969.00	36,117,900	
文化シヤッター	2,900	2,056.00	5,962,400	
三協立山	1,100	687.00	755,700	
アルインコ	700	1,150.00	805,000	
LIXIL	14,700	1,825.00	26,827,500	
ノーリツ	1,700	2,345.00	3,986,500	
長府製作所	1,000	2,069.00	2,069,000	
リンナイ	4,800	4,037.00	19,377,600	
ユニプレス	1,700	1,471.00	2,500,700	
日東精工	1,400	767.00	1,073,800	
岡部	1,800	1,000.00	1,800,000	
ジーテクト	1,200	2,020.00	2,424,000	
東プレ	1,700	2,829.00	4,809,300	

高周波熱錬	1,400	1,450.00	2,030,000	
東京製綱	600	1,910.00	1,146,000	
サンコール	1,000	1,142.00	1,142,000	
パイオラックス	1,100	1,780.00	1,958,000	
エイチワン	1,100	1,428.00	1,570,800	
日本発條	7,100	3,019.00	21,434,900	
中央発條	600	3,365.00	2,019,000	
三浦工業	4,300	2,940.50	12,644,150	
タクマ	2,800	2,897.00	8,111,600	
弁護士ドットコム	300	2,307.00	692,100	
アイ・アールジャパンホールディングス	700	803.00	562,100	
K e e P e r 技研	600	3,380.00	2,028,000	
G u n o s y	700	548.00	383,600	
イー・ガーディアン	300	1,643.00	492,900	
ジャパンマテリアル	2,900	2,039.00	5,913,100	
ベクトル	1,300	1,354.00	1,760,200	
チャーム・ケア・コーポレーション	900	1,401.00	1,260,900	
キャリアリンク	400	2,764.00	1,105,600	
I B J	700	737.00	515,900	
アサンテ	400	1,610.00	644,000	
バリューHR	900	1,407.00	1,266,300	
M & Aキャピタルパートナーズ	800	3,495.00	2,796,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	1,032.00	516,000	
シグマクシス・ホールディングス	2,600	679.00	1,765,400	
ウィルグループ	800	1,281.00	1,024,800	
リクルートホールディングス	69,500	6,284.00	436,738,000	
エラン	900	742.00	667,800	
ツガミ	2,000	3,875.00	7,750,000	
オークマ	1,600	4,515.00	7,224,000	
芝浦機械	1,100	4,510.00	4,961,000	
アマダ	13,400	2,514.00	33,687,600	
アイダエンジニアリング	1,900	1,159.00	2,202,100	
F U J I	3,700	5,601.00	20,723,700	
牧野フライス製作所	900	11,680.00	10,512,000	
オーエスジー	3,300	2,828.50	9,334,050	
旭ダイヤモンド工業	2,200	1,147.00	2,523,400	
D M G 森精機	6,300	2,967.50	18,695,250	
ソディック	2,300	1,348.00	3,100,400	
ディスコ	4,400	74,060.00	325,864,000	
日東工器	400	1,852.00	740,800	
日進工具	900	911.00	819,900	
富士ダイス	600	1,242.00	745,200	
日本郵政	84,600	2,012.00	170,215,200	
ベルシステム24ホールディングス	1,200	1,464.00	1,756,800	
鎌倉新書	1,100	556.00	611,600	
エアトリ	900	721.00	648,900	
アトラエ	900	696.00	626,400	
ストライク	500	4,360.00	2,180,000	

ソラスト	2,400	920.00	2,208,000	
セラク	400	1,588.00	635,200	
インソース	2,000	708.00	1,416,000	
豊田自動織機	7,800	20,200.00	157,560,000	
リケンNPR	1,100	4,120.00	4,532,000	
島精機製作所	1,400	967.00	1,353,800	
オプトラン	1,500	2,820.00	4,230,000	
イワキポンプ	600	2,841.00	1,704,600	
フリュー	900	1,180.00	1,062,000	
ヤマシンフィルタ	1,900	595.00	1,130,500	
日阪製作所	1,100	1,652.00	1,817,200	
やまびこ	1,500	3,760.00	5,640,000	
野村マイクロ・サイエンス	1,700	3,465.00	5,890,500	
平田機工	1,300	2,848.00	3,702,400	
PEGASUS	1,000	780.00	780,000	
マルマエ	300	3,905.00	1,171,500	
タツモ	600	2,550.00	1,530,000	
ナプテスコ	5,200	4,718.00	24,533,600	
三井海洋開発	2,300	14,710.00	33,833,000	
レオン自動機	1,000	1,592.00	1,592,000	
SMC	2,600	72,880.00	189,488,000	
ホソカワミクロン	700	6,640.00	4,648,000	
ユニオンツール	400	14,000.00	5,600,000	
瑞光	700	985.00	689,500	
オイレス工業	1,200	2,595.00	3,114,000	
日精エー・エス・ビー機械	400	8,560.00	3,424,000	
サトー	1,300	2,425.00	3,152,500	
技研製作所	800	2,387.00	1,909,600	
日本エアーテック	400	1,266.00	506,400	
日精樹脂工業	700	895.00	626,500	
ワイエイシーホールディングス	800	1,149.00	919,200	
小松製作所	44,500	7,541.00	335,574,500	
住友重機械工業	5,500	5,754.00	31,647,000	
日立建機	3,700	6,549.00	24,231,300	
日工	1,500	856.00	1,284,000	
巴工業	1,000	2,146.00	2,146,000	
井関農機	900	1,906.00	1,715,400	
TOWA	3,400	2,909.00	9,890,600	
北川鉄工所	300	1,791.00	537,300	
ローツェ	5,400	3,464.00	18,705,600	
クボタ	46,700	3,046.00	142,248,200	
荏原実業	1,000	2,892.00	2,892,000	
東洋エンジニアリング	1,300	3,060.00	3,978,000	
三菱化工機	1,000	3,920.00	3,920,000	
月島ホールディングス	1,200	3,330.00	3,996,000	
帝国電機製作所	600	3,160.00	1,896,000	
新東工業	2,000	1,168.00	2,336,000	
澁谷工業	900	3,540.00	3,186,000	

アイチ コーポレーション	1,500	1,404.00	2,106,000	
小森コーポレーション	2,200	1,735.00	3,817,000	
鶴見製作所	1,300	2,203.00	2,863,900	
酒井重工業	400	2,227.00	890,800	
荏原製作所	19,000	5,638.00	107,122,000	
西島製作所	700	2,553.00	1,787,100	
A I R M A N	900	2,114.00	1,902,600	
ダイキン工業	12,000	19,730.00	236,760,000	
オルガノ	1,300	16,620.00	21,606,000	
トーヨーカネツ	800	3,090.00	2,472,000	
栗田工業	5,600	8,307.00	46,519,200	
椿本チエイン	4,000	2,610.00	10,440,000	
日機装	2,100	2,350.00	4,935,000	
木村化工機	700	1,508.00	1,055,600	
レイズネクスト	1,300	2,578.00	3,351,400	
アネスト岩田	1,800	1,754.00	3,157,200	
ダイフク	15,600	6,325.00	98,670,000	
サムコ	200	6,310.00	1,262,000	
タダノ	4,900	1,395.00	6,835,500	
C K D	2,800	5,400.00	15,120,000	
平和	2,800	1,993.00	5,580,400	
理想科学工業	1,500	1,252.00	1,878,000	
S A N K Y O	9,800	2,172.50	21,290,500	
日本金銭機械	1,200	1,207.00	1,448,400	
マースグループホールディングス	600	3,160.00	1,896,000	
ガリレイ	1,400	3,720.00	5,208,000	
ダイコク電機	500	2,634.00	1,317,000	
竹内製作所	1,700	7,560.00	12,852,000	
アマノ	2,400	4,031.00	9,674,400	
J U K I	1,400	650.00	910,000	
ジャノメ	700	1,426.00	998,200	
ブラザー工業	11,400	3,098.00	35,317,200	
マックス	1,300	6,700.00	8,710,000	
モリタホールディングス	1,500	2,929.00	4,393,500	
グローリー	2,400	3,980.00	9,552,000	
新晃工業	2,600	1,437.00	3,736,200	
大和冷機工業	1,500	1,686.00	2,529,000	
セガサミーホールディングス	7,500	2,441.00	18,307,500	
T P R	2,100	1,374.00	2,885,400	
ツバキ・ナカシマ	2,600	352.00	915,200	
ホシザキ	5,900	5,290.00	31,211,000	
大豊工業	800	985.00	788,000	
日本精工	17,100	1,322.50	22,614,750	
N T N	23,600	411.80	9,718,480	
ジェイテクト	8,800	2,046.00	18,004,800	
不二越	700	5,180.00	3,626,000	
ミネベアミツミ	16,000	3,310.00	52,960,000	
日本トムソン	2,600	1,056.00	2,745,600	

THK	4,900	5,055.00	24,769,500	
YUSHIN	900	718.00	646,200	
前澤給装工業	700	1,653.00	1,157,100	
イーグル工業	1,000	3,420.00	3,420,000	
PILLAR	800	8,110.00	6,488,000	
キッツ	3,300	2,201.00	7,263,300	
日立製作所	234,900	4,930.00	1,158,057,000	
三菱電機	101,100	5,850.00	591,435,000	
富士電機	6,600	12,575.00	82,995,000	
安川電機	10,000	5,198.00	51,980,000	
シンフォニアテクノロジー	1,000	12,020.00	12,020,000	
明電舎	1,700	7,660.00	13,022,000	
山洋電気	1,100	4,910.00	5,401,000	
デンヨー	700	3,840.00	2,688,000	
PHCホールディングス	1,800	1,044.00	1,879,200	
KOKUSAI ELECTRIC	10,600	6,371.00	67,532,600	
ソシオネクスト	8,000	1,946.50	15,572,000	
ペイカレント	6,900	4,480.00	30,912,000	
Orchestra Holdings	300	1,101.00	330,300	
アイモバイル	1,600	523.00	836,800	
MS-Japan	500	1,050.00	525,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディング	8,000	1,630.50	13,044,000	
エル・ティー・エス	100	1,662.00	166,200	
ミダックホールディングス	500	1,998.00	999,000	
キュービーネットホールディングス	400	1,345.00	538,000	
オープングループ	1,700	242.00	411,400	
三櫻工業	1,500	838.00	1,257,000	
マキタ	11,500	5,961.00	68,551,500	
東芝テック	1,200	3,165.00	3,798,000	
芝浦メカトロニクス	600	27,930.00	16,758,000	
マブチモーター	9,000	1,765.00	15,885,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	600	336.00	201,600	
トレックス・セミコンダクター	400	1,740.00	696,000	
東光高岳	500	5,430.00	2,715,000	
ダブル・スコープ	3,700	171.00	632,700	
宮越ホールディングス	500	808.00	404,000	
ダイヘン	900	14,450.00	13,005,000	
ヤーマン	1,700	705.00	1,198,500	
JVCケンウッド	7,400	1,334.50	9,875,300	
ミマキエンジニアリング	800	1,839.00	1,471,200	
大崎電気工業	1,700	1,692.00	2,876,400	
オムロン	7,700	5,169.00	39,801,300	
日東工業	1,100	4,550.00	5,005,000	
IDEC	1,200	3,245.00	3,894,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	3,800	5,208.00	19,790,400	
BUFFALO	200	5,020.00	1,004,000	
テクノメディカ	200	2,456.00	491,200	
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	500	654.00	327,000	

日本電気	60,600	3,916.00	237,309,600
富士通	84,900	3,630.00	308,187,000
沖電気工業	4,500	3,070.00	13,815,000
電気興業	400	3,040.00	1,216,000
サンケン電気	900	7,765.00	6,988,500
アイホン	500	2,877.00	1,438,500
ルネサスエレクトロニクス	89,500	2,908.00	260,266,000
セイコーエプソン	11,500	2,073.50	23,845,250
ワコム	5,600	849.00	4,754,400
アルバック	2,400	10,410.00	24,984,000
アクセル	400	1,240.00	496,000
E I Z O	1,300	2,263.00	2,941,900
ジャパンディスプレイ	41,600	23.00	956,800
日本信号	2,300	1,691.00	3,889,300
京三製作所	2,200	783.00	1,722,600
能美防災	1,200	4,280.00	5,136,000
ホーチキ	600	5,920.00	3,552,000
エレコム	2,300	1,784.00	4,103,200
パナソニック ホールディングス	109,100	2,510.50	273,895,550
シャープ	11,200	651.00	7,291,200
アンリツ	6,100	2,611.00	15,927,100
ソニーグループ	315,300	3,336.00	1,051,840,800
T D K	79,700	2,380.00	189,686,000
帝国通信工業	400	2,725.00	1,090,000
タムラ製作所	3,800	686.00	2,606,800
アルプスアルパイン	7,200	2,330.50	16,779,600
日本電波工業	1,000	1,182.00	1,182,000
鈴木	600	2,986.00	1,791,600
メイコー	800	21,510.00	17,208,000
日本トリム	200	5,090.00	1,018,000
フォスター電機	900	2,993.00	2,693,700
S M K	200	3,325.00	665,000
ヨコオ	800	3,005.00	2,404,000
ホシデン	1,900	2,795.00	5,310,500
ヒロセ電機	1,300	21,400.00	27,820,000
日本航空電子工業	2,200	2,619.00	5,761,800
T O A	900	1,786.00	1,607,400
マクセル	1,900	2,226.00	4,229,400
古野電気	1,200	8,280.00	9,936,000
スミダコーポレーション	1,700	1,213.00	2,062,100
アイコム	400	3,145.00	1,258,000
リオン	400	2,999.00	1,199,600
横河電機	10,100	5,398.00	54,519,800
新電元工業	400	3,915.00	1,566,000
アズビル	22,200	1,347.00	29,903,400
日本光電工業	7,700	1,646.50	12,678,050
チノー	800	1,641.00	1,312,800
日本電子材料	600	8,330.00	4,998,000

堀場製作所	1,700	19,250.00	32,725,000	
アドバンテスト	28,800	25,475.00	733,680,000	
エスベック	900	3,905.00	3,514,500	
キーエンス	9,100	61,430.00	559,013,000	
日置電機	500	7,160.00	3,580,000	
シスメックス	23,600	1,338.50	31,588,600	
日本マイクロニクス	1,500	11,900.00	17,850,000	
メガチップス	600	9,050.00	5,430,000	
O B A R A G R O U P	500	5,200.00	2,600,000	
デンソー	89,500	2,215.00	198,242,500	
コーセル	1,100	1,266.00	1,392,600	
イリソ電子工業	800	3,645.00	2,916,000	
オプテックスグループ	1,600	2,904.00	4,646,400	
千代田インテグレ	200	3,315.00	663,000	
レーザーテック	3,900	30,640.00	119,496,000	
スタンレー電気	4,700	3,186.00	14,974,200	
ウシオ電機	3,800	3,084.00	11,719,200	
日本セラミック	700	3,740.00	2,618,000	
山一電機	900	8,380.00	7,542,000	
図研	800	4,560.00	3,648,000	
日本電子	2,100	6,493.00	13,635,300	
カシオ計算機	7,400	1,604.50	11,873,300	
ファナック	43,600	6,421.00	279,955,600	
日本シイエムケイ	2,900	597.00	1,731,300	
エンプラス	300	14,390.00	4,317,000	
大真空	1,300	655.00	851,500	
ローム	17,900	2,650.00	47,435,000	
浜松ホトニクス	15,200	1,864.00	28,332,800	
三井ハイテック	4,500	801.00	3,604,500	
京セラ	56,800	2,656.50	150,889,200	
太陽誘電	4,900	4,634.00	22,706,600	
村田製作所	87,200	3,675.00	320,460,000	
双葉電子工業	2,000	718.00	1,436,000	
日東電工	27,800	3,624.00	100,747,200	
東海理化電機製作所	2,400	3,265.00	7,836,000	
ニチコン	2,400	2,088.00	5,011,200	
日本ケミコン	1,300	1,675.00	2,177,500	
K O A	1,600	1,663.00	2,660,800	
三井E & S	4,600	8,090.00	37,214,000	
カナデビア	7,600	1,080.00	8,208,000	
三菱重工業	173,000	4,965.00	858,945,000	
川崎重工業	6,900	17,915.00	123,613,500	
I H I	48,100	4,384.00	210,870,400	
名村造船所	2,800	5,630.00	15,764,000	
マネジメントソリューションズ	500	1,382.00	691,000	
プロレド・パートナーズ	300	492.00	147,600	
フロンティア・マネジメント	300	550.00	165,000	
アンビスホールディングス	2,100	506.00	1,062,600	

カーブスホールディングス	2,700	769.00	2,076,300	
Macbee Planet	300	1,461.00	438,300	
日本車輛製造	300	4,275.00	1,282,500	
三菱ロジスネクスト	1,400	1,531.00	2,143,400	
ユニソルホールディングス	900	2,281.00	2,052,900	
ヤマエグループホールディングス	1,000	3,045.00	3,045,000	
FPG	2,900	2,043.00	5,924,700	
ライフネット生命保険	1,400	2,091.00	2,927,400	
全国保証	5,200	3,166.00	16,463,200	
めぶきフィナンシャルグループ	42,000	1,320.00	55,440,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,500	1,963.00	2,944,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,100	11,390.00	12,529,000	
九州フィナンシャルグループ	17,400	1,318.00	22,933,200	
かんぽ生命保険	10,200	4,959.00	50,581,800	
ゆうちょ銀行	97,800	3,054.00	298,681,200	
富山第一銀行	2,900	2,591.00	7,513,900	
横浜フィナンシャルグループ	46,900	1,698.50	79,659,650	
ジェイリース	600	1,420.00	852,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	5,500	4,419.00	24,304,500	
SBIアルヒ	900	926.00	833,400	
プレミアグループ	1,600	1,814.00	2,902,400	
日産自動車	139,500	445.00	62,077,500	
いすゞ自動車	24,400	2,755.00	67,222,000	
トヨタ自動車	485,900	3,635.00	1,766,246,500	
日野自動車	13,900	444.00	6,171,600	
三菱自動車工業	34,800	434.70	15,127,560	
武蔵精密工業	2,100	2,370.00	4,977,000	
日産車体	1,300	1,046.00	1,359,800	
新明和工業	2,700	2,663.00	7,190,100	
極東開発工業	1,400	3,470.00	4,858,000	
トピー工業	700	3,535.00	2,474,500	
ティラド	200	10,940.00	2,188,000	
曙ブレーキ工業	5,300	142.00	752,600	
タチエス	1,700	2,287.00	3,887,900	
NOK	3,400	3,237.00	11,005,800	
フタバ産業	2,400	1,120.00	2,688,000	
カヤバ	1,500	5,140.00	7,710,000	
市光工業	2,200	563.00	1,238,600	
大同メタル工業	1,800	1,119.00	2,014,200	
プレス工業	3,700	965.00	3,570,500	
太平洋工業	2,100	3,010.00	6,321,000	
アイシン	23,300	2,682.00	62,490,600	
マツダ	30,200	1,342.00	40,528,400	
本田技研工業	198,500	1,543.00	306,285,500	
スズキ	67,100	2,294.00	153,927,400	
SUBARU	27,500	3,021.00	83,077,500	
ヤマハ発動機	45,200	1,233.00	55,731,600	
小糸製作所	9,500	2,725.00	25,887,500	

エクセディ	1,500	6,020.00	9,030,000	
ミツバ	1,800	1,390.00	2,502,000	
豊田合成	3,000	4,884.00	14,652,000	
愛三工業	1,600	2,230.00	3,568,000	
ヨロズ	900	1,053.00	947,700	
エフ・シー・シー	1,800	3,760.00	6,768,000	
シマノ	3,800	16,880.00	64,144,000	
テイ・エス テック	3,400	1,984.50	6,747,300	
三十三フィナンシャルグループ	900	6,120.00	5,508,000	
第四北越フィナンシャルグループ	8,500	1,998.00	16,983,000	
ひろぎんホールディングス	12,500	1,924.50	24,056,250	
おきなわフィナンシャルグループ	800	5,900.00	4,720,000	
ダイレクトマーケティングミックス	1,300	345.00	448,500	
ポピンズ	200	1,406.00	281,200	
LITALICO	1,000	1,343.00	1,343,000	
十六フィナンシャルグループ	1,300	9,880.00	12,844,000	
CCIグループ	9,500	1,013.00	9,623,500	
ネットプロテクションズホールディングス	2,900	511.00	1,481,900	
プロクレアホールディングス	1,100	2,860.00	3,146,000	
FPパートナー	300	2,281.00	684,300	
あいちフィナンシャルグループ	1,800	6,250.00	11,250,000	
小野建	1,100	1,480.00	1,628,000	
ノジマ	9,600	1,145.00	10,992,000	
佐島電機	600	1,966.00	1,179,600	
カッパ・クリエイト	1,500	1,544.00	2,316,000	
伯東	600	4,320.00	2,592,000	
コンドーテック	800	1,511.00	1,208,800	
ナガイレーベン	1,100	1,754.00	1,929,400	
良品計画	21,100	3,620.00	76,382,000	
松田産業	700	7,330.00	5,131,000	
第一興商	3,300	1,666.50	5,499,450	
メディカルホールディングス	10,300	2,920.00	30,076,000	
アドヴァングループ	600	1,000.00	600,000	
SPK	400	2,654.00	1,061,600	
萩原電気ホールディングス	400	3,870.00	1,548,000	
アルビス	300	2,710.00	813,000	
アズワン	3,100	2,190.00	6,789,000	
スズデン	500	1,750.00	875,000	
シモジマ	700	1,447.00	1,012,900	
ドウシシャ	1,000	3,565.00	3,565,000	
高速	700	3,280.00	2,296,000	
G-7ホールディングス	1,000	1,495.00	1,495,000	
たけびし	400	2,477.00	990,800	
イオン北海道	2,600	935.00	2,431,000	
コジマ	1,600	1,338.00	2,140,800	
コーナン商事	1,100	4,190.00	4,609,000	
エコス	400	3,200.00	1,280,000	
ワタミ	1,100	968.00	1,064,800	

リックス	200	3,810.00	762,000	
システムソフト	4,300	61.00	262,300	
パン・パシフィック・インターナショナルホ	97,700	1,005.00	98,188,500	
丸文	900	1,243.00	1,118,700	
西松屋チェーン	2,200	2,153.00	4,736,600	
ゼンショーホールディングス	4,900	9,862.00	48,323,800	
ハピネット	1,300	2,880.00	3,744,000	
幸楽苑	1,000	1,208.00	1,208,000	
橋本総業ホールディングス	300	1,395.00	418,500	
日本ライフライン	2,400	1,450.00	3,480,000	
サイゼリヤ	1,200	6,930.00	8,316,000	
タカショー	1,100	397.00	436,700	
V Tホールディングス	3,900	558.00	2,176,200	
アルゴグラフィックス	3,200	1,527.00	4,886,400	
魚力	400	2,326.00	930,400	
I D O M	2,900	1,490.00	4,321,000	
日本エム・ディ・エム	1,000	569.00	569,000	
ユナイテッドアローズ	1,100	2,511.00	2,762,100	
進和	600	3,305.00	1,983,000	
ダイトロン	800	2,880.00	2,304,000	
ハイデイ日高	1,600	3,210.00	5,136,000	
シークス	1,600	1,385.00	2,216,000	
コロワイド	5,500	1,824.00	10,032,000	
オーハシテクニカ	1,000	1,243.00	1,243,000	
壱番屋	3,900	922.00	3,595,800	
白銅	300	2,664.00	799,200	
スギホールディングス	5,200	3,493.00	18,163,600	
薬王堂ホールディングス	600	2,079.00	1,247,400	
ダブルエー	200	1,327.00	265,400	
島津製作所	12,100	4,177.00	50,541,700	
J M S	1,100	440.00	484,000	
長野計器	600	2,992.00	1,795,200	
ブイ・テクノロジー	400	4,150.00	1,660,000	
東京計器	700	8,780.00	6,146,000	
愛知時計電機	400	3,145.00	1,258,000	
インターアクション	600	1,455.00	873,000	
東京精密	1,700	16,895.00	28,721,500	
マニー	3,600	1,607.00	5,785,200	
ニコン	11,400	1,964.00	22,389,600	
オリンパス	49,500	1,480.00	73,260,000	
理研計器	1,300	3,390.00	4,407,000	
S C R E E Nホールディングス	3,300	21,980.00	72,534,000	
タムロン	4,600	1,025.00	4,715,000	
H O Y A	17,600	27,545.00	484,792,000	
ノーリツ鋼機	2,600	2,183.00	5,675,800	
A & Dホロンホールディングス	1,300	2,792.00	3,629,600	
朝日インテック	10,900	2,980.50	32,487,450	
キャノン	41,000	4,685.00	192,085,000	

リコー	21,400	1,449.00	31,008,600	
シチズン時計	7,500	1,727.00	12,952,500	
メニコン	3,500	1,819.00	6,366,500	
トランザクション	1,000	1,295.00	1,295,000	
ニホンフラッシュ	900	845.00	760,500	
前田工織	1,800	2,118.00	3,812,400	
アートネイチャー	800	810.00	648,000	
フルヤ金属	900	7,390.00	6,651,000	
バンダイナムコホールディングス	24,400	4,030.00	98,332,000	
SHOEI	2,400	1,704.00	4,089,600	
フランスベッドホールディングス	1,400	1,333.00	1,866,200	
マーベラス	1,600	499.00	798,400	
パイロットコーポレーション	1,400	4,845.00	6,783,000	
萩原工業	600	1,780.00	1,068,000	
エイベックス	1,700	1,222.00	2,077,400	
フジシールインターナショナル	1,900	2,785.00	5,291,500	
タカラトミー	4,500	2,722.50	12,251,250	
広済堂ホールディングス	2,900	478.00	1,386,200	
レック	1,000	1,125.00	1,125,000	
三光合成	1,200	1,018.00	1,221,600	
プロネクス	1,000	1,159.00	1,159,000	
TOPPANホールディングス	11,100	4,606.00	51,126,600	
大日本印刷	19,700	3,092.00	60,912,400	
共同印刷	900	1,668.00	1,501,200	
NISSHA	1,600	1,315.00	2,104,000	
ZACROS	2,900	1,403.00	4,068,700	
TAKARA & COMPANY	500	3,950.00	1,975,000	
前澤化成工業	600	2,320.00	1,392,000	
未来工業	400	3,415.00	1,366,000	
アシックス	35,100	4,810.00	168,831,000	
ツツミ	200	2,963.00	592,600	
JSP	700	2,784.00	1,948,800	
ニチハ	1,100	3,650.00	4,015,000	
ローランド	700	3,980.00	2,786,000	
エフピコ	1,700	2,774.00	4,715,800	
小松ウオール工業	700	2,901.00	2,030,700	
ヤマハ	15,400	1,195.50	18,410,700	
河合楽器製作所	300	2,952.00	885,600	
クリナップ	900	1,021.00	918,900	
ビジョン	5,500	1,644.00	9,042,000	
キングジム	900	814.00	732,600	
象印マホービン	2,600	1,588.00	4,128,800	
リンテック	2,000	5,160.00	10,320,000	
信越ポリマー	2,000	2,147.00	4,294,000	
イトーキ	2,000	3,205.00	6,410,000	
任天堂	57,700	8,587.00	495,469,900	
三菱鉛筆	1,300	2,277.00	2,960,100	
松風	900	1,802.00	1,621,800	

タカラスタANDARD	2,100	3,000.00	6,300,000	
コクヨ	18,300	895.50	16,387,650	
ナカバヤシ	900	614.00	552,600	
ニフコ	3,400	5,193.00	17,656,200	
立川ブラインド工業	500	2,545.00	1,272,500	
グロープライド	800	2,310.00	1,848,000	
オカムラ	2,800	2,590.00	7,252,000	
バルカー	800	5,000.00	4,000,000	
伊藤忠商事	325,000	2,192.50	712,562,500	
丸紅	73,800	5,710.00	421,398,000	
スクロール	1,700	1,348.00	2,291,600	
ヨンドシーホールディングス	900	1,883.00	1,694,700	
三陽商会	400	4,400.00	1,760,000	
長瀬産業	4,100	4,701.00	19,274,100	
蝶理	500	4,500.00	2,250,000	
豊田通商	29,000	6,735.00	195,315,000	
オンワードホールディングス	5,300	801.00	4,245,300	
三共生興	1,300	883.00	1,147,900	
兼松	8,100	2,315.50	18,755,550	
美津濃	2,500	3,985.00	9,962,500	
ルックホールディングス	300	2,489.00	746,700	
三井物産	139,100	5,505.00	765,745,500	
日本紙パルプ商事	5,100	1,088.00	5,548,800	
東京エレクトロン	19,300	43,960.00	848,428,000	
カメイ	900	3,275.00	2,947,500	
スターゼン	2,200	1,343.00	2,954,600	
セイコーグループ	1,300	11,470.00	14,911,000	
山善	2,900	1,508.00	4,373,200	
椿本興業	600	3,000.00	1,800,000	
住友商事	58,000	6,382.00	370,156,000	
B I P R O G Y	3,100	4,658.00	14,439,800	
内田洋行	1,800	2,063.00	3,713,400	
三菱商事	192,800	4,991.00	962,264,800	
第一実業	900	3,475.00	3,127,500	
キャノンマーケティングジャパン	2,300	6,853.00	15,761,900	
西華産業	1,400	2,862.00	4,006,800	
佐藤商事	700	2,432.00	1,702,400	
東京産業	900	999.00	899,100	
ユアサ商事	800	6,220.00	4,976,000	
神鋼商事	700	2,713.00	1,899,100	
阪和興業	1,600	8,800.00	14,080,000	
正栄食品工業	600	4,045.00	2,427,000	
カナデン	800	2,264.00	1,811,200	
R Y O D E N	700	3,550.00	2,485,000	
ニプロ	7,700	1,536.50	11,831,050	
岩谷産業	9,700	1,931.00	18,730,700	
極東貿易	600	2,131.00	1,278,600	
アステナホールディングス	1,900	499.00	948,100	

三愛オブリ	2,300	2,419.00	5,563,700	
稲畑産業	2,200	4,210.00	9,262,000	
G S Iクレオス	600	2,719.00	1,631,400	
明和産業	1,500	943.00	1,414,500	
ゴールドウイン	5,400	2,420.00	13,068,000	
ユニ・チャーム	57,300	1,065.00	61,024,500	
ワキタ	1,600	2,112.00	3,379,200	
東邦ホールディングス	2,700	4,644.00	12,538,800	
サンゲツ	2,400	3,275.00	7,860,000	
ミツウロコグループホールディングス	1,200	2,295.00	2,754,000	
シナネンホールディングス	200	6,890.00	1,378,000	
伊藤忠エネクス	2,400	1,963.00	4,711,200	
サンリオ	9,600	5,295.00	50,832,000	
サンワテクノス	500	3,310.00	1,655,000	
新光商事	1,200	1,065.00	1,278,000	
トーホー	1,200	1,314.00	1,576,800	
三信電気	500	3,130.00	1,565,000	
東陽テクニカ	900	1,850.00	1,665,000	
モスフードサービス	1,400	4,235.00	5,929,000	
加賀電子	1,800	4,180.00	7,524,000	
都築電気	600	3,985.00	2,391,000	
ソーダニッカ	1,100	1,184.00	1,302,400	
立花エレテック	600	3,385.00	2,031,000	
木曽路	1,500	2,568.00	3,852,000	
S R Sホールディングス	1,700	1,251.00	2,126,700	
千趣会	2,400	141.00	338,400	
リテールパートナーズ	1,400	1,398.00	1,957,200	
上新電機	1,100	2,800.00	3,080,000	
日本瓦斯	4,600	3,028.00	13,928,800	
ロイヤルホールディングス	3,700	1,514.00	5,601,800	
チヨダ	1,100	1,115.00	1,226,500	
ライフコーポレーション	1,900	2,713.00	5,154,700	
リンガーハット	1,300	2,272.00	2,953,600	
M r M a x H D	800	813.00	650,400	
A O K Iホールディングス	2,000	1,778.00	3,556,000	
オークワ	1,300	885.00	1,150,500	
コメリ	1,300	3,605.00	4,686,500	
青山商事	2,100	2,587.00	5,432,700	
しまむら	6,900	3,537.00	24,405,300	
高島屋	14,000	2,297.00	32,158,000	
松屋	1,800	2,645.00	4,761,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	4,700	2,488.00	11,693,600	
近鉄百貨店	600	1,815.00	1,089,000	
丸井グループ	5,700	3,130.00	17,841,000	
クレディセゾン	5,100	4,643.00	23,679,300	
アクシアル リテイリング	2,600	1,275.00	3,315,000	
イオン	114,200	2,295.00	262,089,000	
イズミ	1,700	3,110.00	5,287,000	

フォーバル	500	1,116.00	558,000	
平和堂	1,600	3,000.00	4,800,000	
フジ	1,500	2,146.00	3,219,000	
ゼビオホールディングス	1,200	1,111.00	1,333,200	
ケーズホールディングス	6,600	1,675.50	11,058,300	
PALTAC	1,500	4,915.00	7,372,500	
三谷産業	1,700	705.00	1,198,500	
SBI新生銀行	11,500	1,919.50	22,074,250	
あおぞら銀行	5,800	2,877.50	16,689,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	567,900	2,942.00	1,670,761,800	
りそなホールディングス	110,400	1,980.50	218,647,200	
三井住友トラストグループ	31,300	5,484.00	171,649,200	
三井住友フィナンシャルグループ	197,800	5,963.00	1,179,481,400	
千葉銀行	27,500	2,383.50	65,546,250	
群馬銀行	16,200	2,205.50	35,729,100	
武蔵野銀行	1,200	6,340.00	7,608,000	
千葉興業銀行	1,700	2,386.00	4,056,200	
筑波銀行	3,900	715.00	2,788,500	
七十七銀行	2,900	9,828.00	28,501,200	
秋田銀行	600	5,550.00	3,330,000	
山形銀行	1,200	2,688.00	3,225,600	
岩手銀行	600	6,860.00	4,116,000	
東邦銀行	10,400	714.00	7,425,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	7,200	6,807.00	49,010,400	
スルガ銀行	6,100	2,148.00	13,102,800	
八十二長野銀行	18,500	2,091.50	38,692,750	
山梨中央銀行	1,100	5,420.00	5,962,000	
大垣共立銀行	1,900	6,490.00	12,331,000	
福井銀行	900	3,420.00	3,078,000	
清水銀行	300	2,850.00	855,000	
滋賀銀行	1,400	8,790.00	12,306,000	
南都銀行	1,300	7,490.00	9,737,000	
百五銀行	8,400	1,557.00	13,078,800	
紀陽銀行	3,000	4,270.00	12,810,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	5,400	6,231.00	33,647,400	
山陰合同銀行	5,700	1,764.00	10,054,800	
百十四銀行	900	9,500.00	8,550,000	
四国銀行	1,400	2,408.00	3,371,200	
阿波銀行	1,300	5,810.00	7,553,000	
大分銀行	600	9,670.00	5,802,000	
宮崎銀行	500	9,480.00	4,740,000	
佐賀銀行	600	5,080.00	3,048,000	
琉球銀行	1,900	2,462.00	4,677,800	
セブン銀行	28,500	295.70	8,427,450	
みずほフィナンシャルグループ	127,700	7,175.00	916,247,500	
山口フィナンシャルグループ	8,800	2,730.00	24,024,000	
芙蓉総合リース	2,500	4,583.00	11,457,500	
みずほリース	6,800	1,509.00	10,261,200	

東京センチュリー	6,800	2,237.50	15,215,000	
SBIホールディングス	31,600	3,355.00	106,018,000	
日本証券金融	3,300	2,269.00	7,487,700	
アイフル	14,800	503.00	7,444,400	
名古屋銀行	1,700	5,510.00	9,367,000	
北洋銀行	11,800	1,048.00	12,366,400	
愛媛銀行	1,400	1,908.00	2,671,200	
京葉銀行	3,900	2,151.00	8,388,900	
栃木銀行	5,000	1,002.00	5,010,000	
北日本銀行	300	5,210.00	1,563,000	
東和銀行	1,900	1,234.00	2,344,600	
リコーリース	800	6,160.00	4,928,000	
イオンフィナンシャルサービス	5,200	1,785.00	9,282,000	
アコム	16,000	508.00	8,128,000	
ジャックス	1,100	4,290.00	4,719,000	
オリエントコーポレーション	3,300	1,135.00	3,745,500	
オリックス	55,600	5,410.00	300,796,000	
三菱HCキャピタル	45,100	1,503.50	67,807,850	
ジャフコ グループ	2,400	2,435.00	5,844,000	
トモニホールディングス	8,700	976.00	8,491,200	
大和証券グループ本社	64,300	1,592.50	102,397,750	
野村ホールディングス	151,400	1,404.50	212,641,300	
岡三証券グループ	7,200	956.00	6,883,200	
丸三証券	3,000	1,081.00	3,243,000	
東洋証券	2,700	767.00	2,070,900	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	10,800	773.00	8,348,400	
水戸証券	2,500	630.00	1,575,000	
いちよし証券	1,800	1,317.00	2,370,600	
松井証券	6,300	936.00	5,896,800	
SOMPOホールディングス	44,700	5,904.00	263,908,800	
日本取引所グループ	49,400	1,877.00	92,723,800	
マネックスグループ	9,800	718.00	7,036,400	
極東証券	1,200	1,797.00	2,156,400	
岩井コスモホールディングス	900	3,945.00	3,550,500	
アイザワ証券グループ	1,000	1,479.00	1,479,000	
フィデアホールディングス	1,000	2,184.00	2,184,000	
池田泉州ホールディングス	12,600	937.00	11,806,200	
アニコム ホールディングス	2,800	1,178.00	3,298,400	
MS&ADインシュアランスグループホール	56,100	4,320.00	242,352,000	
ソニーフィナンシャルグループ	315,000	159.30	50,179,500	
スパークス・グループ	1,000	2,062.00	2,062,000	
第一生命ホールディングス	177,100	1,562.00	276,630,200	
東京海上ホールディングス	92,500	6,475.00	598,937,500	
イー・ギャランティ	1,400	1,740.00	2,436,000	
NECキャピタルソリューション	400	4,250.00	1,700,000	
T&Dホールディングス	22,300	4,012.00	89,467,600	
アドバンスクリエイト	900	211.00	189,900	
三井不動産	133,100	2,086.00	277,646,600	

三菱地所	54,100	5,089.00	275,314,900	
平和不動産	1,900	2,506.00	4,761,400	
東京建物	8,500	4,145.00	35,232,500	
京阪神ビルディング	1,400	2,014.00	2,819,600	
住友不動産	25,600	5,044.00	129,126,400	
テオーシー	1,800	888.00	1,598,400	
レオパレス21	7,900	720.00	5,688,000	
スターツコーポレーション	1,700	5,120.00	8,704,000	
フジ住宅	1,100	881.00	969,100	
空港施設	1,400	1,032.00	1,444,800	
明和地所	700	1,154.00	807,800	
ゴールドクレスト	500	3,260.00	1,630,000	
リログループ	4,200	1,850.50	7,772,100	
エスリード	400	7,220.00	2,888,000	
日神グループホールディングス	1,500	798.00	1,197,000	
エスコン	2,000	1,127.00	2,254,000	
MIRARTHホールディングス	5,800	411.00	2,383,800	
ランド	65,600	9.00	590,400	
カチタス	2,400	3,515.00	8,436,000	
東祥	900	936.00	842,400	
トーセイ	2,600	1,632.00	4,243,200	
サンフロンティア不動産	1,400	2,553.00	3,574,200	
FJネクストホールディングス	900	1,873.00	1,685,700	
グランディハウス	700	649.00	454,300	
東武鉄道	9,400	3,058.00	28,745,200	
相鉄ホールディングス	3,500	2,909.50	10,183,250	
東急	23,500	1,930.50	45,366,750	
京浜急行電鉄	10,300	1,540.00	15,862,000	
小田急電鉄	13,800	1,744.00	24,067,200	
京王電鉄	4,100	4,122.00	16,900,200	
京成電鉄	15,900	1,331.00	21,162,900	
富士急行	1,200	2,258.00	2,709,600	
東日本旅客鉄道	50,400	3,814.00	192,225,600	
西日本旅客鉄道	21,800	3,279.00	71,482,200	
東海旅客鉄道	38,700	4,623.00	178,910,100	
東京地下鉄	14,500	1,660.00	24,070,000	
西武ホールディングス	10,100	4,629.00	46,752,900	
鴻池運輸	1,600	3,535.00	5,656,000	
西日本鉄道	2,700	3,134.00	8,461,800	
ハマキョウレックス	2,900	1,911.00	5,541,900	
サカイ引越センター	1,200	2,895.00	3,474,000	
近鉄グループホールディングス	9,800	3,300.00	32,340,000	
阪急阪神ホールディングス	12,000	4,557.00	54,684,000	
南海電気鉄道	4,400	3,025.00	13,310,000	
京阪ホールディングス	4,800	3,468.00	16,646,400	
神戸電鉄	300	2,555.00	766,500	
名古屋鉄道	10,100	1,804.50	18,225,450	
山陽電気鉄道	700	2,018.00	1,412,600	

ヤマトホールディングス	11,100	1,853.00	20,568,300	
山九	2,100	9,783.00	20,544,300	
丸全昭和運輸	600	9,370.00	5,622,000	
センコーグループホールディングス	6,700	1,926.50	12,907,550	
ニッコンホールディングス	3,900	3,885.00	15,151,500	
福山通運	1,000	5,450.00	5,450,000	
セイノーホールディングス	4,500	2,606.50	11,729,250	
神奈川中央交通	300	3,645.00	1,093,500	
A Z - C O M丸和ホールディングス	2,800	942.00	2,637,600	
日本郵船	19,300	5,215.00	100,649,500	
商船三井	17,400	5,441.00	94,673,400	
川崎汽船	19,600	2,405.50	47,147,800	
N Sユナイテッド海運	600	7,650.00	4,590,000	
飯野海運	3,300	1,602.00	5,286,600	
九州旅客鉄道	6,900	3,893.00	26,861,700	
S Gホールディングス	15,300	1,518.00	23,225,400	
N I P P O N E X P R E S Sホールディン	9,100	3,670.00	33,397,000	
日本航空	20,900	3,053.00	63,807,700	
A N Aホールディングス	24,800	3,304.00	81,939,200	
ビーウィズ	300	1,750.00	525,000	
サンウェルズ	500	274.00	137,000	
T R Eホールディングス	2,100	1,805.00	3,790,500	
人・夢・技術グループ	500	1,615.00	807,500	
シルバーライフ	400	811.00	324,400	
G e n k y D r u g S t o r e s	800	4,385.00	3,508,000	
コア商事ホールディングス	800	847.00	677,600	
K P Pグループホールディングス	2,100	907.00	1,904,700	
ブックオフグループホールディングス	700	1,878.00	1,314,600	
ギフトホールディングス	500	3,920.00	1,960,000	
三菱倉庫	10,500	1,370.00	14,385,000	
三井倉庫ホールディングス	2,800	3,464.00	9,699,200	
住友倉庫	2,700	3,850.00	10,395,000	
澁澤倉庫	1,400	1,389.00	1,944,600	
ヤマタネ	800	2,279.00	1,823,200	
乾汽船	1,200	1,546.00	1,855,200	
日本トランスシティ	2,200	1,324.00	2,912,800	
中央倉庫	500	1,675.00	837,500	
安田倉庫	600	2,537.00	1,522,200	
N I S S Oホールディングス	1,100	670.00	737,000	
大栄環境	2,000	3,850.00	7,700,000	
G E N O V A	400	600.00	240,000	
日本管財ホールディングス	1,000	2,834.00	2,834,000	
上組	4,000	5,601.00	22,404,000	
キューソー流通システム	500	3,155.00	1,577,500	
エーアイティー	600	2,281.00	1,368,600	
T B Sホールディングス	4,500	5,714.00	25,713,000	
日本テレビホールディングス	8,100	3,248.00	26,308,800	
朝日放送グループホールディングス	1,200	826.00	991,200	

テレビ朝日ホールディングス	2,200	3,210.00	7,062,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	6,100	2,800.00	17,080,000	
テレビ東京ホールディングス	600	4,375.00	2,625,000	
ビジョン	1,600	1,291.00	2,065,600	
U - N E X T H O L D I N G S	3,100	1,839.00	5,700,900	
日本通信	8,600	136.00	1,169,600	
N T T	2,517,000	151.00	380,067,000	
K D D I	128,800	2,616.00	336,940,800	
ソフトバンク	1,474,500	210.00	309,645,000	
光通信	900	41,910.00	37,719,000	
エムティーアイ	900	701.00	630,900	
G M O インターネットグループ	3,000	2,930.00	8,790,000	
ファイバーゲート	400	685.00	274,000	
K A D O K A W A	5,100	2,788.50	14,221,350	
学研ホールディングス	1,700	1,039.00	1,766,300	
ゼンリン	1,500	1,014.00	1,521,000	
東京電力ホールディングス	82,300	703.30	57,881,590	
中部電力	33,700	2,573.50	86,726,950	
関西電力	49,500	2,682.00	132,759,000	
中国電力	15,800	1,078.00	17,032,400	
北陸電力	9,300	1,076.50	10,011,450	
東北電力	24,000	1,301.00	31,224,000	
四国電力	8,600	1,758.50	15,123,100	
九州電力	21,000	1,945.00	40,845,000	
北海道電力	10,400	1,191.00	12,386,400	
沖縄電力	2,300	1,186.00	2,727,800	
電源開発	6,900	3,572.00	24,646,800	
エフオン	900	342.00	307,800	
イーレックス	1,800	673.00	1,211,400	
レノバ	2,500	721.00	1,802,500	
東京瓦斯	16,500	7,575.00	124,987,500	
大阪瓦斯	16,300	6,388.00	104,124,400	
東邦瓦斯	3,300	5,450.00	17,985,000	
北海道瓦斯	2,700	870.00	2,349,000	
広島ガス	1,800	384.00	691,200	
西部ガスホールディングス	1,100	2,517.00	2,768,700	
静岡ガス	2,200	1,459.00	3,209,800	
メタウォーター	1,200	4,025.00	4,830,000	
クオオンツ総研ホールディングス	1,300	783.00	1,017,900	
松竹	500	11,590.00	5,795,000	
東宝	4,800	7,745.00	37,176,000	
エイチ・アイ・エス	2,700	1,262.00	3,407,400	
東映	1,500	5,400.00	8,100,000	
ラックランド	400	1,745.00	698,000	
共立メンテナンス	3,600	2,614.50	9,412,200	
イチネンホールディングス	900	2,159.00	1,943,100	
建設技術研究所	1,000	3,425.00	3,425,000	
スペース	700	1,648.00	1,153,600	

アインホールディングス	1,100	6,223.00	6,845,300	
燦ホールディングス	900	1,484.00	1,335,600	
ピー・シー・エー	700	1,939.00	1,357,300	
スバル興業	300	3,525.00	1,057,500	
タナベコンサルティンググループ	600	718.00	430,800	
ビジネスブレイン太田昭和	300	3,050.00	915,000	
ナガワ	200	5,990.00	1,198,000	
東京都競馬	700	5,600.00	3,920,000	
カナモト	1,300	4,145.00	5,388,500	
D T S	7,400	1,119.00	8,280,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	15,100	2,514.00	37,961,400	
シーイーシー	1,100	1,956.00	2,151,600	
カブコン	18,200	3,148.00	57,293,600	
ニシオホールディングス	800	4,515.00	3,612,000	
アイ・エス・ビー	400	1,854.00	741,600	
日本空港ビルデング	3,200	5,334.00	17,068,800	
トランス・コスモス	1,200	4,005.00	4,806,000	
乃村工芸社	4,100	1,433.00	5,875,300	
藤田観光	1,900	2,321.00	4,409,900	
K N T - C Tホールディングス	400	1,649.00	659,600	
トーカイ	700	2,583.00	1,808,100	
セコム	17,500	5,985.00	104,737,500	
N S W	400	2,381.00	952,400	
セントラル警備保障	500	2,919.00	1,459,500	
アイネス	800	2,012.00	1,609,600	
丹青社	2,000	1,561.00	3,122,000	
メイテックグループホールディングス	3,500	3,370.00	11,795,000	
T K C	1,400	4,000.00	5,600,000	
応用地質	800	2,913.00	2,330,400	
船井総研ホールディングス	3,700	1,134.00	4,195,800	
N S D	3,300	2,840.00	9,372,000	
コナミグループ	3,900	18,795.00	73,300,500	
学究社	400	2,440.00	976,000	
ナック	1,000	536.00	536,000	
福井コンピュータホールディングス	500	3,330.00	1,665,000	
ダイセキ	1,800	3,700.00	6,660,000	
ステップ	400	2,487.00	994,800	
泉州電業	600	6,460.00	3,876,000	
Genki Global Dining	600	2,904.00	1,742,400	
トラスコ中山	2,000	2,451.00	4,902,000	
ヤマダホールディングス	29,700	569.90	16,926,030	
オートバックスセブン	3,400	1,745.00	5,933,000	
モリト	700	2,025.00	1,417,500	
アー克蘭ズ	2,900	2,013.00	5,837,700	
ニトリホールディングス	15,600	3,237.00	50,497,200	
グルメ杵屋	800	992.00	793,600	
ケーユーホールディングス	600	1,294.00	776,400	
吉野家ホールディングス	3,600	3,138.00	11,296,800	

加藤産業	1,200	6,790.00	8,148,000	
イノテック	600	2,722.00	1,633,200	
イエローハット	2,500	1,717.00	4,292,500	
松屋フーズホールディングス	400	6,110.00	2,444,000	
J B C Cホールディングス	2,400	1,343.00	3,223,200	
J Kホールディングス	700	1,537.00	1,075,900	
サガミホールディングス	1,600	1,881.00	3,009,600	
日伝	600	2,495.00	1,497,000	
ミロク情報サービス	800	1,744.00	1,395,200	
杉本商事	800	1,413.00	1,130,400	
因幡電機産業	5,100	2,787.00	14,213,700	
王将フードサービス	2,000	3,190.00	6,380,000	
ミニストップ	800	2,016.00	1,612,800	
アークス	1,600	3,890.00	6,224,000	
パローホールディングス	1,800	3,710.00	6,678,000	
東テク	1,100	4,330.00	4,763,000	
ミスミグループ本社	13,600	3,047.00	41,439,200	
ベルク	400	7,730.00	3,092,000	
大庄	700	1,206.00	844,200	
ファーストリテイリング	6,500	66,960.00	435,240,000	
ソフトバンクグループ	175,700	4,329.00	760,605,300	
スズケン	3,200	6,278.00	20,089,600	
サンドラッグ	2,900	4,160.00	12,064,000	
サックスパー ホールディングス	800	820.00	656,000	
ジェコス	800	1,833.00	1,466,400	
ベルーナ	2,300	975.00	2,242,500	
合 計	18,800,200		49,261,862,750	

株式以外の有価証券

該当する事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

「日本債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

### (1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2025年2月20日現在)	(2026年2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		399,300	596,987
コール・ローン		86,065,428	93,453,024
国債証券		54,907,278,050	58,374,266,230
地方債証券		3,916,387,145	3,392,533,609

特殊債券		3,702,298,440	2,796,270,119
社債券		3,601,302,900	3,298,840,800
未収利息		214,780,702	221,287,829
前払費用		3,605,608	28,920,977
流動資産合計		66,432,117,573	68,206,169,575
資産合計		66,432,117,573	68,206,169,575
負債の部			
流動負債			
未払解約金		24,173,885	83,515,729
流動負債合計		24,173,885	83,515,729
負債合計		24,173,885	83,515,729
純資産の部			
元本等			
元本	1	56,731,588,821	60,820,572,524
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		9,676,354,867	7,302,081,322
元本等合計		66,407,943,688	68,122,653,846
純資産合計		66,407,943,688	68,122,653,846
負債純資産合計		66,432,117,573	68,206,169,575

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

## （2）注記表

### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

### （重要な会計上の見積りに関する注記）

（2025年2月20日現在）	（2026年2月20日現在）
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

### （貸借対照表に関する注記）

区 分	（2025年2月20日現在）	（2026年2月20日現在）
1 期首元本額	86,862,860,040円	56,731,588,821円
期中追加設定元本額	4,567,003,672円	9,912,946,234円
期中一部解約元本額	34,698,274,891円	5,823,962,531円
元本の内訳 ファンド名		

AMC / ステート・ストリート・リ スクバジェット型バランス・オーブ ン(ステイブル)	1,507,738,719円	1,293,843,749円
日本債券インデックス・ファンド (年金1) < 適格機関投資家限定 >	4,498,208,005円	8,257,710,247円
バランスファンドVA30A < 適格機関投 資家限定 >	8,574,105円	9,474,766円
バランスファンドVA30B < 適格機関投 資家限定 >	105,116,970円	99,967,926円
バランスファンドVA40A < 適格機関投 資家限定 >	599,461円	676,299円
バランスファンドVA40B < 適格機関投 資家限定 >	4,906,282円	5,587,333円
バランスファンドVA50A < 適格機関投 資家限定 >	14,733,909円	13,854,268円
バランスファンドVA50B < 適格機関投 資家限定 >	12,386,909,260円	12,854,897,919円
バランスファンドVA50C < 適格機関投 資家限定 >	5,066,246円	32,442円
バランスファンドVA25A < 適格機関投 資家限定 >	3,094,183,704円	2,765,502,884円
バランスファンドVA37.5A < 適格機関 投資家限定 >	1,904,317,718円	1,973,978,377円
バランスファンドVA75A < 適格機関投 資家限定 >	11,987,467円	10,814,090円
4資産バランス20VA < 適格機関投資家 限定 >	872,427,991円	722,580,507円
4資産バランス40VA < 適格機関投資家 限定 >	6,291,581,398円	6,273,499,679円
4資産バランス30VA < 適格機関投資家 限定 >	1,003,766,478円	755,982,849円
バランスファンドVA35A < 適格機関投 資家限定 >	4,358,326,141円	4,238,249,855円
バランスファンドVA40C < 適格機関投 資家限定 >	136,576,439円	140,404,996円
日本債券インデックス・ファンドV A1 < 適格機関投資家限定 >	46,457,531円	6,471,664円
グローバル4資産30VA < 適格機 関投資家限定 >	57,949,883円	63,845,810円
グローバル4資産45VA < 適格機 関投資家限定 >	42,356,711円	40,830,216円
4資産バランス30VA2 < 適格機関 投資家限定 >	39,014,561円	35,847,378円
バランスファンドVA25B < 適格 機関投資家限定 >	2,927,292,134円	2,800,410,823円
バランスファンドVA20A < 適格 機関投資家限定 >	10,959,024円	8,875,776円
バランスファンドVA35B < 適格 機関投資家限定 >	2,632,853円	2,667,362円
日本債券インデックス・ファンドV A3 < 適格機関投資家限定 >	325,071,229円	376,745,836円

日本債券インデックス・ファンド<適格機関投資家限定>	1,332,418,908円	767,396,754円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	2,290,714,069円	2,326,419,812円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	7,577,346,808円	7,305,337,854円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	27,825,765円	40,480,723円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）年金<適格機関投資家限定>	376,650,517円	466,127,177円
債券マルチ・ファクター戦略ファンド（年金）<適格機関投資家限定>	745,218,563円	791,837,601円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）<適格機関投資家限定>	389,984,706円	457,047,157円
ステート・ストリート日本債券インデックス・オープン	1,133,116,081円	2,813,594,883円
ステート・ストリート国内債券インデックス・オープン（隔月分配型）	3,352,126円	15,185,160円
世界バランス40VA<適格機関投資家限定>	7,187,617円	8,059,349円
世界バランス60VA<適格機関投資家限定>	9,776,286円	11,445,974円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	1,087,338円	1,212,495円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	3,101,474,557円	3,002,128,128円
グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	45,812,067円	40,269,212円
グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	32,869,194円	21,277,194円
計	56,731,588,821円	60,820,572,524円
2 受益権の総数	56,731,588,821口	60,820,572,524口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「（3）附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク等の市場リスクに晒されております。

3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。
------------------	---

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2025年2月20日現在)	(2026年2月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券関係に関する注記)

## 売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(2025年2月20日現在)	(2026年2月20日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	3,181,973,100	2,799,207,830
地方債証券	162,342,311	119,168,251
特殊債券	172,936,657	199,396,384

社債券	142,368,800	100,721,600
合計	3,659,620,868	3,218,494,065

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

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

該当する事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(2025年2月20日現在)	(2026年2月20日現在)
1口当たり純資産額	1.1706円	1.1201円
(1万口当たり純資産額)	(11,706円)	(11,201円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

国債証券	第100回利付国債(20年)	200,000,000	203,928,000	
	第101回利付国債(20年)	100,000,000	102,367,000	
	第102回利付国債(20年)	200,000,000	205,180,000	
	第103回利付国債(20年)	200,000,000	204,730,000	
	第104回利付国債(20年)	150,000,000	152,854,500	
	第105回利付国債(20年)	100,000,000	102,027,000	
	第106回利付国債(20年)	200,000,000	204,552,000	
	第107回利付国債(20年)	100,000,000	102,120,000	
	第108回利付国債(20年)	100,000,000	101,576,000	
	第109回利付国債(20年)	200,000,000	203,178,000	
	第10回利付国債(40年)	150,000,000	80,775,000	
	第110回利付国債(20年)	200,000,000	204,384,000	
	第111回利付国債(20年)	200,000,000	205,136,000	
	第112回利付国債(20年)	200,000,000	204,502,000	
	第113回利付国債(20年)	200,000,000	204,550,000	
	第114回利付国債(20年)	300,000,000	306,945,000	
	第115回利付国債(20年)	400,000,000	410,704,000	
	第116回利付国債(20年)	200,000,000	205,404,000	
	第118回利付国債(20年)	300,000,000	305,709,000	
	第11回利付国債(40年)	90,000,000	45,928,800	
	第122回利付国債(20年)	500,000,000	505,010,000	
	第123回利付国債(20年)	300,000,000	306,846,000	
	第126回利付国債(20年)	300,000,000	305,550,000	
	第127回利付国債(20年)	200,000,000	202,716,000	
	第128回利付国債(20年)	300,000,000	303,963,000	
	第12回利付国債(30年)	100,000,000	101,727,000	
	第12回利付国債(40年)	300,000,000	132,087,000	
	第130回利付国債(20年)	400,000,000	402,956,000	
	第132回利付国債(20年)	400,000,000	400,424,000	
	第133回利付国債(20年)	300,000,000	301,986,000	
	第135回利付国債(20年)	300,000,000	299,916,000	
	第136回利付国債(20年)	250,000,000	248,487,500	
	第137回利付国債(20年)	200,000,000	199,658,000	
	第139回利付国債(20年)	200,000,000	198,462,000	
	第13回利付国債(30年)	100,000,000	100,818,000	
	第13回利付国債(40年)	460,000,000	200,790,000	
	第140回利付国債(20年)	300,000,000	299,028,000	
	第141回利付国債(20年)	100,000,000	99,513,000	
	第142回利付国債(20年)	100,000,000	100,152,000	
	第143回利付国債(20年)	100,000,000	98,715,000	
	第144回利付国債(20年)	100,000,000	98,057,000	
第146回利付国債(20年)	220,000,000	217,591,000		
第147回利付国債(20年)	100,000,000	97,924,000		
第149回利付国債(20年)	130,000,000	125,587,800		
第14回利付国債(30年)	100,000,000	103,605,000		
第14回利付国債(40年)	290,000,000	135,050,100		
第151回利付国債(20年)	100,000,000	93,546,000		
第153回利付国債(5年)	440,000,000	433,655,200		

第154回利付国債(20年)	340,000,000	314,238,200	
第155回利付国債(20年)	100,000,000	90,237,000	
第155回利付国債(5年)	100,000,000	98,371,000	
第156回利付国債(5年)	160,000,000	157,108,800	
第157回利付国債(20年)	400,000,000	327,764,000	
第157回利付国債(5年)	450,000,000	440,527,500	
第158回利付国債(20年)	370,000,000	311,251,400	
第158回利付国債(5年)	1,030,000,000	1,006,248,200	
第159回利付国債(20年)	100,000,000	84,503,000	
第15回利付国債(30年)	200,000,000	208,544,000	
第15回利付国債(40年)	110,000,000	56,672,000	
第160回利付国債(20年)	550,000,000	467,021,500	
第160回利付国債(5年)	100,000,000	97,579,000	
第161回利付国債(20年)	100,000,000	83,348,000	
第161回利付国債(5年)	200,000,000	195,610,000	
第162回利付国債(20年)	600,000,000	496,356,000	
第162回利付国債(5年)	700,000,000	682,416,000	
第163回利付国債(20年)	100,000,000	82,140,000	
第163回利付国債(5年)	1,350,000,000	1,319,449,500	
第164回利付国債(20年)	400,000,000	321,960,000	
第164回利付国債(5年)	20,000,000	19,377,800	
第165回利付国債(20年)	450,000,000	359,316,000	
第165回利付国債(5年)	100,000,000	97,161,000	
第166回利付国債(20年)	410,000,000	333,670,300	
第166回利付国債(5年)	100,000,000	97,433,000	
第167回利付国債(20年)	100,000,000	78,600,000	
第168回利付国債(20年)	400,000,000	307,576,000	
第168回利付国債(5年)	450,000,000	439,672,500	
第169回利付国債(20年)	370,000,000	278,110,500	
第169回利付国債(5年)	180,000,000	175,339,800	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	208,306,000	
第16回利付国債(40年)	305,000,000	171,306,300	
第170回利付国債(20年)	420,000,000	313,202,400	
第171回利付国債(20年)	300,000,000	221,844,000	
第171回利付国債(5年)	20,000,000	19,350,400	
第172回利付国債(20年)	500,000,000	372,510,000	
第172回利付国債(5年)	20,000,000	19,413,800	
第173回利付国債(20年)	400,000,000	295,688,000	
第174回利付国債(20年)	320,000,000	234,576,000	
第174回利付国債(5年)	170,000,000	165,615,700	
第175回利付国債(20年)	420,000,000	310,371,600	
第176回利付国債(20年)	240,000,000	175,917,600	
第177回利付国債(20年)	120,000,000	85,725,600	
第178回利付国債(20年)	250,000,000	180,320,000	
第179回利付国債(20年)	120,000,000	85,926,000	
第17回利付国債(30年)	200,000,000	206,460,000	
第17回利付国債(40年)	510,000,000	374,870,400	
第181回利付国債(20年)	120,000,000	90,997,200	

第181回利付国債(5年)	350,000,000	345,821,000	
第182回利付国債(20年)	70,000,000	54,614,000	
第182回利付国債(5年)	400,000,000	397,012,000	
第183回利付国債(20年)	80,000,000	65,289,600	
第183回利付国債(5年)	100,000,000	99,977,000	
第186回利付国債(20年)	10,000,000	8,170,700	
第187回利付国債(20年)	30,000,000	23,544,600	
第188回利付国債(20年)	20,000,000	16,440,200	
第189回利付国債(20年)	10,000,000	8,608,000	
第18回利付国債(30年)	200,000,000	204,526,000	
第18回利付国債(40年)	340,000,000	314,955,600	
第190回利付国債(20年)	30,000,000	25,299,300	
第191回利付国債(20年)	410,000,000	356,396,600	
第192回利付国債(20年)	110,000,000	101,686,200	
第193回利付国債(20年)	380,000,000	355,889,000	
第194回利付国債(20年)	490,000,000	472,164,000	
第195回利付国債(20年)	460,000,000	476,767,000	
第19回利付国債(30年)	200,000,000	204,230,000	
第1回クライメート・トランジション利付 国債(10年)	910,000,000	829,719,800	
第1回クライメート・トランジション利付 国債(5年)	600,000,000	582,888,000	
第1回利付国債(30年)	300,000,000	314,118,000	
第1回利付国債(40年)	160,000,000	142,614,400	
第20回利付国債(30年)	100,000,000	103,641,000	
第21回利付国債(30年)	200,000,000	203,420,000	
第22回利付国債(30年)	200,000,000	206,646,000	
第23回利付国債(30年)	100,000,000	103,129,000	
第24回利付国債(30年)	120,000,000	123,510,000	
第25回利付国債(30年)	100,000,000	100,785,000	
第26回利付国債(30年)	150,000,000	152,262,000	
第27回利付国債(30年)	320,000,000	326,294,400	
第28回利付国債(30年)	300,000,000	304,086,000	
第29回利付国債(30年)	200,000,000	199,518,000	
第2回クライメート・トランジション利付 国債(10年)	50,000,000	46,511,000	
第2回メキシコ合衆国円貨債券(202 2)(SDG債)	100,000,000	98,969,000	
第2回利付国債(30年)	380,000,000	393,239,200	
第2回利付国債(40年)	300,000,000	253,953,000	
第30回利付国債(30年)	350,000,000	342,937,000	
第31回利付国債(30年)	100,000,000	96,325,000	
第32回利付国債(30年)	500,000,000	484,050,000	
第33回利付国債(30年)	400,000,000	370,332,000	
第346回利付国債(10年)	100,000,000	98,998,000	
第347回利付国債(10年)	550,000,000	542,745,500	
第348回利付国債(10年)	400,000,000	393,340,000	
第349回利付国債(10年)	500,000,000	490,075,000	
第34回利付国債(30年)	350,000,000	330,018,500	

第350回利付国債(10年)	600,000,000	586,164,000	
第351回利付国債(10年)	773,000,000	752,546,420	
第353回利付国債(10年)	100,000,000	96,605,000	
第354回利付国債(10年)	250,000,000	240,515,000	
第355回利付国債(10年)	100,000,000	95,787,000	
第356回利付国債(10年)	50,000,000	47,676,500	
第358回利付国債(10年)	100,000,000	94,454,000	
第35回利付国債(30年)	220,000,000	200,371,600	
第360回利付国債(10年)	120,000,000	112,286,400	
第361回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,256,580,000	
第362回利付国債(10年)	450,000,000	416,902,500	
第363回利付国債(10年)	990,000,000	912,522,600	
第364回利付国債(10年)	620,000,000	568,657,800	
第365回利付国債(10年)	440,000,000	401,548,400	
第366回利付国債(10年)	550,000,000	502,425,000	
第367回利付国債(10年)	980,000,000	890,545,600	
第368回利付国債(10年)	1,480,000,000	1,337,727,600	
第369回利付国債(10年)	860,000,000	789,695,000	
第36回利付国債(30年)	180,000,000	162,959,400	
第370回利付国債(10年)	900,000,000	823,041,000	
第371回利付国債(10年)	1,100,000,000	993,036,000	
第372回利付国債(10年)	250,000,000	231,417,500	
第373回利付国債(10年)	70,000,000	63,480,200	
第374回利付国債(10年)	10,000,000	9,169,700	
第375回利付国債(10年)	10,000,000	9,354,800	
第376回利付国債(10年)	10,000,000	9,158,300	
第377回利付国債(10年)	10,000,000	9,354,600	
第378回利付国債(10年)	360,000,000	341,456,400	
第379回利付国債(10年)	480,000,000	457,732,800	
第37回利付国債(30年)	100,000,000	88,609,000	
第380回利付国債(10年)	520,000,000	503,022,000	
第381回利付国債(10年)	790,000,000	789,676,100	
第38回利付国債(30年)	100,000,000	86,651,000	
第39回利付国債(30年)	180,000,000	157,703,400	
第3回利付国債(30年)	100,000,000	103,122,000	
第3回利付国債(40年)	250,000,000	208,087,500	
第40回利付国債(30年)	150,000,000	128,770,500	
第41回利付国債(30年)	100,000,000	84,074,000	
第42回利付国債(30年)	80,000,000	66,913,600	
第43回利付国債(30年)	140,000,000	116,555,600	
第44回利付国債(30年)	50,000,000	41,457,000	
第45回利付国債(30年)	120,000,000	95,644,800	
第474回利付国債(2年)	130,000,000	129,248,600	
第475回利付国債(2年)	10,000,000	9,964,700	
第477回利付国債(2年)	419,000,000	417,780,710	
第478回利付国債(2年)	920,000,000	916,954,800	
第479回利付国債(2年)	730,000,000	727,284,400	
第480回利付国債(2年)	710,000,000	708,324,400	

第48回利付国債(30年)	300,000,000	231,258,000	
第49回利付国債(30年)	120,000,000	92,127,600	
第4回利付国債(40年)	250,000,000	204,827,500	
第50回利付国債(30年)	350,000,000	235,826,500	
第51回利付国債(30年)	250,000,000	148,315,000	
第52回利付国債(30年)	100,000,000	61,864,000	
第53回利付国債(30年)	100,000,000	62,914,000	
第54回利付国債(30年)	100,000,000	65,513,000	
第55回利付国債(30年)	100,000,000	65,051,000	
第56回利付国債(30年)	150,000,000	96,886,500	
第57回利付国債(30年)	100,000,000	64,137,000	
第58回利付国債(30年)	480,000,000	305,520,000	
第59回利付国債(30年)	300,000,000	184,680,000	
第5回利付国債(30年)	100,000,000	102,822,000	
第5回利付国債(40年)	130,000,000	99,945,300	
第60回利付国債(30年)	100,000,000	64,336,000	
第61回利付国債(30年)	120,000,000	72,757,200	
第62回利付国債(30年)	250,000,000	142,210,000	
第63回利付国債(30年)	250,000,000	136,795,000	
第64回利付国債(30年)	210,000,000	113,794,800	
第65回利付国債(30年)	310,000,000	166,364,600	
第66回利付国債(30年)	290,000,000	154,230,700	
第67回利付国債(30年)	200,000,000	112,032,000	
第68回利付国債(30年)	200,000,000	111,058,000	
第69回利付国債(30年)	200,000,000	113,488,000	
第6回利付国債(30年)	180,000,000	187,122,600	
第6回利付国債(40年)	150,000,000	111,748,500	
第70回利付国債(30年)	360,000,000	202,435,200	
第71回利付国債(30年)	200,000,000	111,374,000	
第72回利付国債(30年)	280,000,000	154,506,800	
第73回利付国債(30年)	220,000,000	120,298,200	
第74回利付国債(30年)	175,000,000	104,214,250	
第75回利付国債(30年)	100,000,000	64,514,000	
第76回利付国債(30年)	100,000,000	66,042,000	
第77回利付国債(30年)	120,000,000	83,220,000	
第78回利付国債(30年)	160,000,000	104,980,800	
第79回利付国債(30年)	50,000,000	30,917,500	
第7回利付国債(30年)	300,000,000	310,143,000	
第80回利付国債(30年)	100,000,000	72,389,000	
第81回利付国債(30年)	90,000,000	61,721,100	
第82回利付国債(30年)	50,000,000	36,003,000	
第83回利付国債(30年)	45,000,000	35,616,150	
第84回利付国債(30年)	20,000,000	15,437,600	
第85回利付国債(30年)	50,000,000	40,406,000	
第86回利付国債(30年)	130,000,000	107,383,900	
第87回利付国債(30年)	30,000,000	27,000,300	
第88回利付国債(30年)	210,000,000	204,863,400	
第89回利付国債(30年)	300,000,000	304,050,000	

	第8回利付国債(30年)	100,000,000	100,180,000	
	第8回利付国債(40年)	100,000,000	64,321,000	
	第94回利付国債(20年)	200,000,000	202,222,000	
	第95回利付国債(20年)	150,000,000	152,328,000	
	第96回利付国債(20年)	100,000,000	101,292,000	
	第97回利付国債(20年)	150,000,000	152,392,500	
	第98回利付国債(20年)	100,000,000	101,441,000	
	第99回利付国債(20年)	200,000,000	203,204,000	
	第9回利付国債(30年)	100,000,000	97,600,000	
	第9回利付国債(40年)	100,000,000	45,240,000	
	国債証券 小計		58,374,266,230	
地方債証券	第10回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	100,020,000	
	第11回静岡県公募公債(20年)	50,000,000	50,281,500	
	第12回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	51,940,000	
	第12回東京都公募公債(20年)	100,000,000	101,564,000	
	第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	98,671,000	
	第13回大阪市公募公債(20年)	50,000,000	50,831,000	
	第14回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	99,636,000	
	第15回千葉県公募公債(20年・定時償還)	80,000,000	66,650,400	
	第160回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	71,561,000	
	第181回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,447,000	
	第184回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,082,000	
	第188回共同発行市場公募地方債	30,000,000	29,040,600	
	第18回神奈川県公募公債(20年)	50,000,000	50,023,500	
	第209回共同発行市場公募地方債	100,000,000	93,230,000	
	第211回共同発行市場公募地方債	100,000,000	92,876,000	
	第24回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	91,066,000	
	第24回千葉県公募公債	100,000,000	79,359,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	99,144,000	
	第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	94,274,000	
	第2回横浜市公募公債(30年)	100,000,000	102,498,000	
	第2回兵庫県公募公債(30年)	100,000,000	95,398,000	
	第2回名古屋市中公募公債(15年)	100,000,000	97,494,000	
	第3回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	102,019,000	
	第3回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	100,127,000	
	第469回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	91,598,000	
	第479回大阪府公募公債(10年)	4,000,000	3,626,120	
	第5回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	102,655,000	
	第6回京都市公募公債(20年)	100,000,000	101,664,000	
	第6回札幌市公募公債(20年)	100,000,000	102,246,000	
	第800回東京都公募公債	100,000,000	94,323,000	
	平成24年度第12回愛知県公募公債(30年)	10,000,000	8,941,400	
	平成25年度第10回京都府公募公債(15年)	100,000,000	99,248,000	
	平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	92,439,000	

平成27年度第12回愛知県公募公債(15年)	100,000,000	95,725,000	
平成28年度第6回福岡県公募公債	100,000,000	99,225,000	
平成29年度第1回秋田県公募公債	45,900,000	44,804,367	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	98,607,000	
平成30年度第18回北海道公募公債	20,000,000	19,208,400	
平成30年度第1回熊本市公募公債	100,000,000	96,784,000	
平成30年度第6回広島市公募公債	45,000,000	43,233,750	
令和2年度第3回長崎県公募公債(10年)	12,400,000	11,600,572	
令和2年度第9回静岡県公募公債	100,000,000	93,051,000	
令和6年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	81,321,000	
地方債証券 小計		3,392,533,609	

特殊債券	第106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,303,000	40,912,435	
	第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,280,000	45,033,004	
	第114回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,727,000	
	第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,842,000	46,975,922	
	第118回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	78,987,000	
	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,801,000	47,792,626	
	第12回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,513,000	
	第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,307,000	48,432,477	
	第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,817,000	49,640,691	
	第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,014,000	49,445,053	
	第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,328,000	50,094,786	
	第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,570,000	56,902,995	
	第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,018,000	
	第172回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	87,425,000	
	第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,293,000	58,250,223	
	第191回都市再生債券	100,000,000	62,471,000	
	第192回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,707,000	65,050,383	
	第22回公営企業債券（20年）	100,000,000	101,358,000	
	第237回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	90,443,000	
	第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券	20,000,000	20,302,800	
	第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,815,000	11,920,035	
	第26回日本高速道路保有・債務返済機構債券	10,000,000	10,135,300	
	第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,119,000	14,168,134	
	第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,987,000	15,033,010	
	第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,694,000	14,746,604	
	第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,420,000	14,422,451	

第331回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	80,755,000	
第342回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	13,000,000	12,675,000	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,916,000	13,979,456	
第378回信金中金債(5年)	100,000,000	99,785,000	
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,066,000	15,983,420	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,506,000	15,412,808	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	18,791,000	18,435,474	
第404回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	48,784,000	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,741,000	18,431,398	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,431,000	18,251,666	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,627,000	14,674,684	
第4回公営企業債券(30年)	100,000,000	106,193,000	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	62,000,000	60,132,560	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,147,000	19,742,649	
第5回国際協力機構債券	100,000,000	100,685,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,872,000	20,324,527	
第64回西日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	100,000,000	99,422,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,416,000	25,104,445	
第68回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	77,882,000	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,053,000	27,683,151	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,734,000	23,782,730	
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,398,000	22,272,790	
第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債(社債間限定同順位)	100,000,000	98,846,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,005,000	23,629,224	
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,480,000	25,826,528	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	83,889,000	
第8回公営企業債券(30年)	10,000,000	10,192,700	

第90回政府保証日本高速道路保有・債務 返済機構債券	100,000,000	101,891,000	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債 券	42,635,000	37,346,980	
第9回新関西国際空港株式会社社債(一般 担保付)	100,000,000	99,055,000	
特殊債券 小計		2,796,270,119	

社債券	第11回東急株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	90,567,000	
	第122回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同)	100,000,000	51,889,000	
	第13回東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	98,089,000	
	第14回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債(2017)	100,000,000	98,702,000	
	第14回ソフトバンク株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	99,275,000	
	第15回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債(社債間)	100,000,000	90,580,000	
	第18回イオンモール株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	76,451,000	
	第21回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定)	100,000,000	98,632,000	
	第21回三井住友信託銀行株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	100,000,000	99,230,000	
	第26回東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	89,205,000	
	第298回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	69,887,000	
	第30回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(201)	100,000,000	99,313,000	
	第30回大和ハウス工業株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位)	100,000,000	98,401,000	
	第31回株式会社光通信無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	79,166,000	
	第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	96,504,000	
	第32回ANAホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定)	100,000,000	80,277,000	
	第350回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	77,632,000	
	第36回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(202)	100,000,000	95,946,000	
	第3回NTTファイナンス株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	100,000,000	91,136,000	
	第426回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	93,086,000	
	第44回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債(相模鉄道株式)	100,000,000	98,617,000	
	第45回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位)	100,000,000	102,048,000	
	第45回東邦瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	89,987,000	
	第4回東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	10,000,000	10,044,800	
	第510回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	98,668,000	

第519回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	75,171,000	
第52回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特	100,000,000	51,685,000	
第540回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	98,984,000	
第545回中部電力株式会社社債（一般担保付）（グリーンボンド	100,000,000	91,058,000	
第58回電源開発株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	76,408,000	
第59回日本電気株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	98,622,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債（担保提供制限等財務上特約	100,000,000	99,213,000	
第67回三菱UFJリース株式会社無担保社債（社債間限定同順位	100,000,000	95,830,000	
第67回東京瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	52,680,000	
第6回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	98,823,000	
第73回株式会社ホンダファイナンス無担保社債（社債間限定同順	100,000,000	99,062,000	
第83回三井不動産株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付	100,000,000	90,299,000	
第8回ピー・エヌ・ビー・バリバ円貨社債（2023）	100,000,000	97,673,000	
社債券 小計		3,298,840,800	
合 計	75,945,415,000	67,861,910,758	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当する事項はありません。

「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2025年2月20日現在)	(2026年2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		5,338,860,471	15,495,963,698
金銭信託		14,036,911	35,017,229
コール・ローン		4,313,000,957	12,648,248,647
株式		310,749,633,353	419,964,440,309
投資証券		5,595,221,897	6,906,632,246
派生商品評価勘定		225,785,668	337,490,567
未収入金		84,968,988	88,758,453

未収配当金		256,346,942	342,059,810
未収利息		50,355	234,872
差入委託証拠金		1,568,221,530	2,340,382,669
流動資産合計		328,146,127,072	458,159,228,500
資産合計		328,146,127,072	458,159,228,500
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		13,764,581	297,787,653
未払金			3,160,825
未払解約金		33,589,100	18,653,000
流動負債合計		47,353,681	319,601,478
負債合計		47,353,681	319,601,478
純資産の部			
元本等			
元本	1	42,690,497,118	49,794,164,924
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		285,408,276,273	408,045,462,098
元本等合計		328,098,773,391	457,839,627,022
純資産合計		328,098,773,391	457,839,627,022
負債純資産合計		328,146,127,072	458,159,228,500

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

## （2）注記表

### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>外国先物の評価においては、個別法に基づき、原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>

3 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。</p>
4 その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

（2025年2月20日現在）	（2026年2月20日現在）
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	（2025年2月20日現在）	（2026年2月20日現在）
1 期首元本額	43,017,386,757円	42,690,497,118円
期中追加設定元本額	3,270,926,198円	9,743,656,150円
期中一部解約元本額	3,597,815,837円	2,639,988,344円
元本の内訳		
ファンド名		
ステート・ストリート外国株式イン	4,597,093,504円	4,322,123,103円
デックス・オープン		
ステート・ストリートDC外国株式イン	5,936,290,999円	5,647,098,176円
デックス・オープン		
ステート・ストリートDCグローバル株式インデックス・オープン	85,777,817円	87,242,560円
AMC / ステート・ストリート・リス	41,989,511円	32,692,097円
クバジェット型バランス・オープン（ステイブル）		
外国株式インデックス・ファンドVA	53,947,604円	50,163,436円
1（適格機関投資家専用）		
外国株式インデックス・ファンドVA2	13,896,586円	9,802,964円
（適格機関投資家専用）		
バランスファンドVA30A < 適格機関投	266,548円	235,141円
資家限定 >		

バランスファンドVA30B<適格機関投資家限定>	6,989,062円	5,181,739円
バランスファンドVA40A<適格機関投資家限定>	31,514円	27,754円
バランスファンドVA40B<適格機関投資家限定>	512,753円	465,038円
バランスファンドVA50A<適格機関投資家限定>	1,116,636円	854,077円
バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	1,904,838,916円	1,595,122,423円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	343,596円	1,717円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	117,471,970円	83,897,676円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	170,188,872円	143,173,441円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	15,477,889円	10,843,265円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	33,041,514円	22,034,300円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	642,464,541円	516,115,820円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	65,166,647円	39,192,582円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	284,194,333円	225,508,876円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	14,059,658円	11,606,765円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	8,845,183円	7,887,901円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	13,179,640円	9,983,647円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	3,947,752円	2,946,395円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	58,476,012円	45,586,787円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	133,332円	86,513円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	83,229円	66,043円
外国株式インデックス・ファンドVA3<適格機関投資家限定>	131,959,865円	132,393,806円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	58,532,279円	48,692,671円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	21,773,927円	22,698,863円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド(ステイブル)年金<適格機関投資家限定>	13,409,659円	10,765,174円

T a dリスクバジェット型マルチ配 分戦略ファンド（ステイブル）＜適 格機関投資家限定＞	12,033,654円	10,409,560円
ステート・ストリート先進国株式イ ンデックス・オープン	237,120,437円	251,880,041円
ステート・ストリート先進国株式イ ンデックス・オープン（為替ヘッジ あり）	1,005,938,891円	897,384,727円
全世界株式インデックス・ファンド	3,095,905,845円	3,566,992,384円
ステート・ストリート・グローバル 株式インデックス・オープン	2,818,056円	10,569,168円
ステート・ストリート全世界株式イ ンデックス・オープン	2,268,847円	18,426,589円
世界バランス40VA＜適格機関投 資家限定＞	1,336,804円	1,186,236円
世界バランス60VA＜適格機関投 資家限定＞	4,990,883円	4,632,441円
グローバルバランス40VA＜適格 機関投資家限定＞	202,263円	178,307円
グローバルバランス40VA2＜適 格機関投資家限定＞	354,962,066円	271,300,671円
グローバルバランス40VA3＜適 格機関投資家限定＞	8,516,683円	5,790,670円
グローバルバランス50VA＜適格 機関投資家限定＞	6,816,365円	3,409,760円
ワールドエクイティ・ファンドVL ＜適格機関投資家限定＞	23,662,084,976円	31,667,513,620円
計	42,690,497,118円	49,794,164,924円
2 受益権の総数	42,690,497,118口	49,794,164,924口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組 方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資 並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基 づき行っております。
--------------------	---

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	( 2025年2月20日現在 )	( 2026年2月20日現在 )
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	同左
---------------------------	---	----

## (有価証券関係に関する注記)

## 売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(2025年2月20日現在)	(2026年2月20日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	9,001,534,725	6,879,393,887
投資証券	312,931,337	348,227,828
合計	8,688,603,388	7,227,621,715

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

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## 株式関連

(単位：円)

区 分	種 類	(2025年2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MINI S&P 500	8,954,979,037		9,034,717,633	79,738,596
	S&P 60	418,786,829		425,249,645	6,462,816
	SPI 200	359,166,713		362,161,988	2,995,275
	FTSE100INDEX	507,472,058		528,272,800	20,800,742
	FSMI INDEX	253,790,941		277,187,783	23,396,842
	EURO STOXX 50	938,257,416		1,025,303,048	87,045,632
	合 計	11,432,452,994		11,652,892,897	220,439,903

(単位：円)

区 分	種 類	(2026年2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			

市場取引	株価指数先物取引 買建			
	MINI S&P 500	23,298,738,263		23,153,174,108
	S&P 60	1,233,131,236		1,278,654,262
	SPI 200	857,742,237		891,256,149
	FTSE100INDEX	1,542,614,040		1,639,768,550
	FSMI INDEX	811,963,328		850,088,946
	EURO STOXX 50	2,871,503,887		2,964,266,618
	合計	30,615,692,991		30,777,208,633
				161,515,642

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

## 通貨関連

(単位：円)

区分	種類	(2025年2月20日現在)			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	3,663,236,664		3,649,490,451	13,746,213
	カナダ・ドル	132,155,625		132,547,375	391,750
	オーストラリア・ドル	73,909,836		74,673,144	763,308
	イギリス・ポンド	129,376,104		130,956,273	1,580,169
	ユーロ	358,612,569		361,100,119	2,487,550
	売建				
	アメリカ・ドル	36,241,200		36,250,104	8,904
	オーストラリア・ドル	18,323,324		18,202,338	120,986
	ユーロ	20,472,920		20,480,382	7,462
	合計	4,432,328,242		4,423,700,186	8,418,816

(単位：円)

区分	種類	(2026年2月20日現在)			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		

市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	10,214,112,752		10,127,515,577	86,597,175
	カナダ・ドル	487,940,700		482,395,584	5,545,116
	オーストラリア・ドル	218,971,635		217,393,968	1,577,667
	イギリス・ポンド	526,495,270		516,461,272	10,033,998
	スイス・フラン	20,023,000		20,007,680	15,320
	スウェーデン・クロー ナ	13,692,000		13,685,920	6,080
	ユーロ	1,246,744,597		1,228,708,965	18,035,632
	売建				
	アメリカ・ドル	30,972,720		30,974,460	1,740
合 計	12,758,952,674		12,637,143,426	121,812,728	

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
4. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	(2025年2月20日現在)	(2026年2月20日現在)
1口当たり純資産額	7.6855円	9.1946円
(1万口当たり純資産額)	(76,855円)	(91,946円)

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	

アメリカ・ドル	BAKER HUGHES COMPANY	34,249	62.56	2,142,617.44	
	CHENIERE ENERGY INC	7,611	226.19	1,721,532.09	
	CHEVRON CORPORATION	66,722	184.78	12,328,891.16	
	CONOCOPHILLIPS	43,252	111.59	4,826,490.68	
	COTERRA ENERGY INC	25,800	31.71	818,118.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	21,000	44.66	937,860.00	
	DIAMONDBACK ENERGY	6,500	174.72	1,135,680.00	
	EOG RESOURCES INC	18,906	123.87	2,341,886.22	
	EQT CORP	21,700	59.77	1,297,009.00	
	EXPAND ENERGY CORPORATION	8,000	103.85	830,800.00	
	EXXON MOBIL CORPORATION	147,438	150.97	22,258,714.86	
	HALLIBURTON CO	29,714	35.37	1,050,984.18	
	KINDER MORGAN INC	69,372	32.54	2,257,364.88	
	MARATHON PETROLEUM CORP	10,530	196.47	2,068,829.10	
	OCCIDENTAL PETROLEUM	24,924	51.53	1,284,333.72	
	ONEOK INC NEW	21,900	86.88	1,902,672.00	
	PHILLIPS 66	13,983	155.41	2,173,098.03	
	SLB LTD	51,762	51.54	2,667,813.48	
	TARGA RESOURCES CORP	7,500	224.16	1,681,200.00	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,950	486.56	948,792.00	
	VALERO ENERGY CORP	10,803	199.24	2,152,389.72	
	WILLIAMS COS	42,341	72.17	3,055,749.97	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	7,707	280.72	2,163,509.04	
	AMCOR PLC	11,280	49.53	558,698.40	
	AMRIZE LTD	900	63.92	57,528.00	
	AVERY DENNISON CORP	2,757	193.60	533,755.20	
	BALL CORPORATION	9,104	66.03	601,137.12	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,700	99.46	566,922.00	
	CORTEVA INC	23,568	77.02	1,815,207.36	
	CRH PLC	2,700	125.49	338,823.00	
	DOW INC	23,735	31.39	745,041.65	
	DUPONT DE NEMOURS INC	14,669	50.24	736,970.56	
	ECOLAB INC	8,866	301.00	2,668,666.00	
	FREEMPORT MCMORAN INC	49,766	62.57	3,113,858.62	
	INT'L FLAVORS FRAGRANCES	8,539	81.62	696,953.18	
	INT'L PAPER CO	17,490	46.86	819,581.40	
	LINDE PLC	16,224	490.11	7,951,544.64	
	LYONDELLBASELL INDU CL A	8,345	55.33	461,728.85	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,100	675.40	1,418,340.00	
	NEWMONT CORPORATION	27,735	125.40	3,477,969.00	
NUCOR CORP	7,971	180.04	1,435,098.84		
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,000	238.95	716,850.00		
PPG INDUSTRIES	7,847	124.25	974,989.75		
RELIANCE INC	1,860	327.28	608,740.80		
RPM INTERNATIONAL INC	4,200	114.46	480,732.00		
SHERWIN-WILLIAMS CO	8,209	357.61	2,935,620.49		
SMURFIT WESTROCK PLC	10,325	49.78	513,978.50		

STEEL DYNAMICS INC	4,700	190.58	895,726.00	
VULCAN MATERIALS CO	4,576	302.85	1,385,841.60	
3M CO	18,482	165.05	3,050,454.10	
AECOM	4,300	96.58	415,294.00	
AERCAP HOLDINGS NV	6,000	151.32	907,920.00	
ALLEGION PLC W/I	2,800	161.23	451,444.00	
AMETEK INC	8,000	232.75	1,862,000.00	
AXON ENTERPRISE INC	2,590	441.12	1,142,500.80	
BLOOM ENERGY CORP- A	7,500	159.00	1,192,500.00	
BOEING CO	26,970	233.71	6,303,158.70	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	3,900	111.42	434,538.00	
CARLISLE COS INC	1,400	407.65	570,710.00	
CARRIER GLOBAL CORP	26,556	62.92	1,670,903.52	
CATERPILLAR	16,211	760.53	12,328,951.83	
CNH INDUSTRIAL NV	28,516	12.98	370,137.68	
COMFORT SYSTEMS USA INC	1,200	1,373.52	1,648,224.00	
CUMMINS ENGINE CO	4,772	596.91	2,848,454.52	
DEERE & CO	8,895	662.00	5,888,490.00	
DOVER CORP	4,614	232.52	1,072,847.28	
EATON CORP PLC	13,481	377.32	5,086,650.92	
EMCOR GROUP INC	1,520	803.55	1,221,396.00	
EMERSON ELECTRIC CO	19,549	151.30	2,957,763.70	
FASTENAL CO	39,800	46.21	1,839,158.00	
FERGUSON ENTERPRISES INC	700	257.84	180,488.00	
FORTIVE CORPORATION	11,834	57.86	684,715.24	
GE AEROSPACE	36,690	334.74	12,281,610.60	
GE VERNOVA INC	9,425	834.61	7,866,199.25	
GENERAL DYNAMICS CORP	7,920	354.34	2,806,372.80	
GRACO INC	5,400	93.02	502,308.00	
GRAINGER (WW)	1,547	1,127.73	1,744,598.31	
HEICO CORP	1,540	345.99	532,824.60	
HEICO CORP-CLASS A	2,520	260.20	655,704.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	22,017	240.77	5,301,033.09	
HOWMET AEROSPACE INC	13,229	251.30	3,324,447.70	
HUBBELL INC	1,780	526.56	937,276.80	
IDEX CORP	2,500	207.86	519,650.00	
ILLINOIS TOOL WORKS	9,598	293.82	2,820,084.36	
INGERSOLL-RAND INC	13,827	96.20	1,330,157.40	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5,700	78.21	445,797.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	22,724	142.70	3,242,714.80	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	6,510	358.70	2,335,137.00	
LENNOX INTERNATIONAL	1,110	550.32	610,855.20	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	7,278	666.51	4,850,859.78	
MASCO CORP	7,390	75.07	554,767.30	
NORDSON CORP	1,900	293.93	558,467.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,710	736.87	3,470,657.70	

OTIS WORLDWIDE CORP	13,678	93.04	1,272,601.12	
PACCAR INC	18,259	124.90	2,280,549.10	
PARKER HANNIFIN CORP	4,378	1,012.44	4,432,462.32	
PENTAIR PLC	5,734	100.48	576,152.32	
QUANTA SERVICES INC	5,170	554.00	2,864,180.00	
ROCKET LAB CORP	14,600	76.58	1,118,068.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,902	395.38	1,542,772.76	
RTX CORP	46,263	205.41	9,502,882.83	
SNAP-ON	1,824	383.87	700,178.88	
TEXTRON	6,252	99.03	619,135.56	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	7,711	463.69	3,575,513.59	
TRANSDIGM GROUP INC	1,950	1,330.13	2,593,753.50	
UNITED RENTALS INC	2,236	888.98	1,987,759.28	
VERTIV HOLDINGS CO	12,600	243.06	3,062,556.00	
WABTEC CORPORATION	5,806	261.88	1,520,475.28	
WATSCO INC	1,130	409.56	462,802.80	
XYLEM INC	8,454	129.21	1,092,341.34	
AUTOMATIC DATA PROCESS	14,033	215.97	3,030,707.01	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	4,300	79.94	343,742.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	4,100	176.21	722,461.00	
CINTAS CORP	12,496	197.97	2,473,833.12	
COPART INC	32,000	37.65	1,204,800.00	
EQUIFAX INC	4,323	195.30	844,281.90	
JACOBS SOLUTIONS INC	4,200	139.31	585,102.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	4,100	176.27	722,707.00	
PAYCHEX INC	10,951	92.34	1,011,215.34	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,600	120.72	193,152.00	
REPUBLIC SERVICES INC	7,602	221.63	1,684,831.26	
ROLLINS	10,125	60.92	616,815.00	
SS&C TECHNOLOGIES HLDGS	7,700	71.37	549,549.00	
TRANSUNION	6,500	76.12	494,780.00	
VERALTO CORP	8,689	93.98	816,592.22	
VERISK ANALYTICS INC	4,700	183.89	864,283.00	
WASTE CONNECTIONS INC	8,963	166.06	1,488,395.78	
WASTE MANAGEMENT (NEW)	13,920	233.42	3,249,206.40	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,000	185.19	740,760.00	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	6,616	84.70	560,375.20	
CSX CORP	64,615	41.68	2,693,153.20	
DELTA AIR LINES INC	5,300	67.44	357,432.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,584	150.70	690,808.80	
FEDEX CORP	7,740	383.14	2,965,503.60	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	83,400	4.40	366,960.00	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,757	225.72	622,310.04	
NORFOLK SOUTHERN CORP	7,789	314.05	2,446,135.45	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	6,600	195.17	1,288,122.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	68,600	72.94	5,003,684.00	

UNION PACIFIC CORP	20,566	262.97	5,408,241.02	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	2,900	110.05	319,145.00	
UNITED PARCEL SERVICE -CL B	25,497	115.54	2,945,923.38	
APTIV PLC	7,412	80.46	596,369.52	
FORD MOTOR COMPANY	135,625	13.78	1,868,912.50	
GENERAL MOTORS CO	32,999	81.47	2,688,428.53	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	27,600	15.59	430,284.00	
TESLA INC	97,730	411.71	40,236,418.30	
DECKERS OUTDOOR CORP	5,220	118.07	616,325.40	
DR HORTON INC	9,366	163.78	1,533,963.48	
GARMIN LTD	5,700	239.80	1,366,860.00	
LENNAR CORP-CL A	7,212	116.12	837,457.44	
LULULEMON ATHLETICA INC	3,600	182.88	658,368.00	
NIKE B	41,204	65.61	2,703,394.44	
NVR INC	92	7,526.14	692,404.88	
PULTE GROUP INC	6,863	139.61	958,143.43	
TAPESTRY INC	7,000	152.30	1,066,100.00	
AIRBNB INC-CLASS A	14,900	125.81	1,874,569.00	
BOOKING HOLDINGS INC	1,123	4,007.45	4,500,366.35	
CARNIVAL CORP	36,566	31.55	1,153,657.30	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	46,550	37.97	1,767,503.50	
DARDEN RESTAURANTS	4,019	212.98	855,966.62	
DOMINO'S PIZZA INC	1,050	385.13	404,386.50	
DOORDASH INC - A	13,260	176.19	2,336,279.40	
DRAFTKINGS INC-CL A	15,600	22.49	350,844.00	
EXPEDIA GROUP INC	4,127	199.76	824,409.52	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	400	122.16	48,864.00	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	8,137	312.73	2,544,684.01	
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,400	167.96	235,144.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	5,052	142.30	718,899.60	
LAS VEGAS SANDS CORP	10,500	58.09	609,945.00	
MARRIOTT INT'L A	7,994	349.89	2,797,020.66	
MCDONALD'S CORP	24,688	327.11	8,075,691.68	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,940	310.35	2,774,529.00	
STARBUCKS CORP	39,352	95.80	3,769,921.60	
YUM! BRANDS INC	9,658	163.48	1,578,889.84	
ALPHABET INC-CL A	201,140	302.85	60,915,249.00	
ALPHABET INC-CL C	169,020	303.56	51,307,711.20	
CHARTER COMMUNICATION-A	2,985	231.54	691,146.90	
DISCOVERY INC-W/T	81,553	28.53	2,326,707.09	
DISNEY (WALT) CO NEW	62,264	106.00	6,599,984.00	
EHOSTAR CORP-A	4,800	114.84	551,232.00	
ELECTRONIC ARTS	8,224	199.88	1,643,813.12	
FOX CORP	5,038	51.47	259,305.86	
FOX CORPORATION-CLASS A	7,369	56.16	413,843.04	
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	7,100	90.11	639,781.00	

LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	5,400	157.46	850,284.00	
META PLATFORMS INC-A	75,022	644.78	48,372,685.16	
NETFLIX INC	146,970	77.00	11,316,690.00	
NEWS CORP - CLASS A	12,256	23.36	286,300.16	
OMNICOM GROUP	11,088	80.94	897,462.72	
PINTEREST INC- CLASS A	20,400	16.77	342,108.00	
REDDIT INC-CL A	3,400	146.13	496,842.00	
ROBLOX CORP -CLASS A	20,200	64.44	1,301,688.00	
SNAP INC - A	36,000	5.00	180,000.00	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	5,420	485.29	2,630,271.80	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	6,400	201.37	1,288,768.00	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	15,100	25.24	381,124.00	
AMAZON COM INC	331,860	204.86	67,984,839.60	
AUTOZONE INC	581	3,745.49	2,176,129.69	
BEST BUY COMPANY INC	6,986	66.30	463,171.80	
BURLINGTON STORES INC	2,120	312.80	663,136.00	
CARVANA CO	4,550	332.79	1,514,194.50	
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,300	202.74	466,302.00	
EBAY INC	15,922	84.75	1,349,389.50	
GENUINE PARTS CO	4,900	119.37	584,913.00	
HOME DEPOT	34,429	378.58	13,034,130.82	
LOWE'S COMPANIES	19,406	278.18	5,398,361.08	
MERCADOLIBRE	1,580	1,996.55	3,154,549.00	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	29,420	94.17	2,770,481.40	
ROSS STORES INC	11,312	200.38	2,266,698.56	
SEA LTD-ADR	13,300	114.60	1,524,180.00	
TJX COMPANIES INC	38,522	156.51	6,029,078.22	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	18,420	51.96	957,103.20	
ULTA BEAUTY INC	1,566	692.79	1,084,909.14	
WILLIAMS-SONOMA INC	4,200	210.82	885,444.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	15,327	987.82	15,140,317.14	
DOLLAR GENERAL CORP	7,609	151.79	1,154,970.11	
DOLLAR TREE INC	6,703	133.57	895,319.71	
KROGER CO	21,892	67.63	1,480,555.96	
SYSCO CORP	16,603	89.67	1,488,791.01	
TARGET CORP	15,805	115.66	1,828,006.30	
WALMART INC	151,648	124.87	18,936,285.76	
ALTRIA GROUP INC	58,232	67.99	3,959,193.68	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND	16,184	68.86	1,114,430.24	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,480	29.42	161,221.60	
BUNGE GLOBAL SA	4,675	123.49	577,315.75	
COCA-COLA CO	141,407	78.91	11,158,426.37	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	2,700	104.70	282,690.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	5,016	154.64	775,674.24	
GENERAL MILLS	18,561	44.80	831,532.80	
HORMEL FOODS CORP	10,700	24.55	262,685.00	

JM SMUCKER CO	3,788	109.57	415,051.16	
KEURIG DR PEPPER INC	44,900	29.10	1,306,590.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,598	68.49	588,877.02	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	44,861	58.64	2,630,649.04	
MONSTER BEVERAGE CORP	25,380	81.99	2,080,906.20	
PEPSICO INC	47,336	164.59	7,791,032.24	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	53,851	183.50	9,881,658.50	
THE HERSHEY COMPANY	5,200	219.91	1,143,532.00	
THE KRAFT HEINZ CO/THE	30,955	23.99	742,610.45	
TYSON FOODS INC-CL A	9,526	64.33	612,807.58	
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,200	103.25	846,650.00	
CLOROX CO	4,283	122.22	523,468.26	
COLGATE-PALMOLIVE CO	26,662	93.98	2,505,694.76	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,213	111.74	917,720.62	
KENVUE INC	66,748	18.66	1,245,517.68	
KIMBERLY-CLARK CORP	11,557	108.68	1,256,014.76	
PROCTER & GAMBLE CO	80,939	158.56	12,833,687.84	
ABBOTT LABORATORIES	60,177	112.19	6,751,257.63	
BAXTER INTERNATIONAL	18,143	21.34	387,171.62	
BECTON DICKINSON	9,909	182.47	1,808,095.23	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	51,248	75.72	3,880,498.56	
CARDINAL HEALTH INC	8,271	222.76	1,842,447.96	
CENCORA INC	6,382	359.11	2,291,840.02	
CENTENE CORP	17,122	43.68	747,888.96	
COOPER COS INC/THE	6,924	83.68	579,400.32	
CVS HEALTH CORPORATION	43,921	77.32	3,395,971.72	
DEXCOM INC	13,700	72.27	990,099.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	20,400	78.92	1,609,968.00	
ELEVANCE HEALTH INC	7,805	348.18	2,717,544.90	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	15,866	83.01	1,317,036.66	
HCA HEALTHCARE INC	5,673	528.66	2,999,088.18	
HOLOGIC INC	7,416	75.14	557,238.24	
HUMANA	4,049	190.50	771,334.50	
IDEXX LABORATORIES	2,780	630.73	1,753,429.40	
INSULET CORP	2,360	249.10	587,876.00	
INTUITIVE SURGICAL INC COM NEW	12,404	499.53	6,196,170.12	
LABCORP HOLDINGS INC	2,804	282.48	792,073.92	
MCKESSON CORP	4,308	937.14	4,037,199.12	
MEDTRONIC PLC	44,405	97.58	4,333,039.90	
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,946	202.44	798,828.24	
RESMED INC	4,933	256.29	1,264,278.57	
SOLVENTUM CORP	5,495	73.61	404,486.95	
STERIS PLC	3,300	251.18	828,894.00	
STRYKER CORP	11,917	372.66	4,440,989.22	
THE CIGNA GROUP	9,238	285.92	2,641,328.96	

UNITED HEALTH GROUP INC	31,331	289.93	9,083,796.83	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,020	230.00	464,600.00	
VEEVA SYSTEMS A	5,400	182.57	985,878.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	6,631	99.25	658,126.75	
ABBVIE INC	61,057	224.35	13,698,137.95	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,820	126.34	1,240,658.80	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,550	339.37	1,544,133.50	
AMGEN INC	18,634	375.50	6,997,067.00	
BIOGEN INC	5,001	192.08	960,592.08	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	70,476	60.30	4,249,702.80	
DANAHER CORP	22,269	211.25	4,704,326.25	
ELI LILLY AND COMPANY	27,819	1,023.22	28,464,957.18	
GILEAD SCIENCES INC	42,910	151.12	6,484,559.20	
ILLUMINA INC	5,400	120.00	648,000.00	
INCYTE CORP	5,808	101.73	590,847.84	
INSMED INC	7,300	161.00	1,175,300.00	
IQVIA HOLDINGS INC	5,932	169.36	1,004,643.52	
JOHNSON & JOHNSON	83,266	246.91	20,559,208.06	
MERCK & CO	86,460	121.86	10,536,015.60	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	717	1,376.53	986,972.01	
NATERA INC	4,400	216.36	951,984.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,500	130.10	455,350.00	
PFIZER	196,788	26.86	5,285,725.68	
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,607	782.38	2,822,044.66	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	13,900	45.11	627,029.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	17,000	34.33	583,610.00	
THERMO ELECTRON CORP	13,071	515.12	6,733,133.52	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,500	480.52	720,780.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	8,880	469.27	4,167,117.60	
WATERS CORPORATION	3,338	328.66	1,097,067.08	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,450	243.83	597,383.50	
ZOETIS INC	15,395	127.28	1,959,475.60	
BANK OF AMERICA CORP	243,387	52.77	12,843,531.99	
CITIGROUP INC	63,751	115.55	7,366,428.05	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	15,000	64.59	968,850.00	
FIFTH THIRD BANCORP	31,120	52.90	1,646,248.00	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	310	2,045.30	634,043.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	69,915	17.85	1,247,982.75	
JPMORGAN CHASE & CO	95,080	308.05	29,289,394.00	
KEYCORP	31,191	21.79	679,651.89	
M & T BANK CORP	5,391	229.11	1,235,132.01	
PINNACLE FINANCIAL PARTNERS	5,200	99.13	515,476.00	
PNC BANK CORP	13,687	230.30	3,152,116.10	
REGIONS FINANCIAL CORP	31,045	29.72	922,657.40	
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	44,738	51.78	2,316,533.64	
US BANCORP	53,935	57.89	3,122,297.15	
WELLS FARGO COMPANY	110,797	87.57	9,702,493.29	

AFFIRM HOLDINGS INC	9,200	51.82	476,744.00	
AMERICAN EXPRESS	19,265	342.65	6,601,152.25	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,276	472.43	1,547,680.68	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,166	118.34	1,794,744.44	
ARES MANAGEMENT CORP - A	7,500	129.85	973,875.00	
BANK NEW YORK MELLO CORP	24,457	118.16	2,889,839.12	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	47,674	496.94	23,691,117.56	
BLACKROCK FUNDING INC/DE	5,090	1,081.28	5,503,715.20	
BLACKSTONE INC	25,500	125.76	3,206,880.00	
BLOCK INC-A	16,600	52.89	877,974.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	22,175	205.06	4,547,205.50	
CARLYLE GROUP INC/THE	8,200	52.98	434,436.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,600	286.17	1,030,212.00	
CME GROUP INC	12,469	303.91	3,789,453.79	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	7,110	165.94	1,179,833.40	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	9,900	30.07	297,693.00	
CORPAY INC	2,341	347.20	812,795.20	
EQUITABLE HOLDINGS INC	10,500	44.35	465,675.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	18,196	49.00	891,604.00	
FISERV INC	18,902	61.53	1,163,040.06	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,000	153.50	307,000.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	8,078	80.25	648,259.50	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	10,474	916.65	9,600,992.10	
INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A	15,000	73.99	1,109,850.00	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	19,825	154.11	3,055,230.75	
JACK HENRY & ASSOCIATES, INC.	2,400	161.14	386,736.00	
KKR & CO INC	21,600	101.64	2,195,424.00	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	2,780	327.92	911,617.60	
MASTERCARD INC-CLASS A	29,484	520.26	15,339,345.84	
MOODY'S CORPORATION	5,599	449.29	2,515,574.71	
MORGAN STANLEY	41,399	174.37	7,218,743.63	
MSCI INC	2,690	541.12	1,455,612.80	
NASDAQ INC	15,920	81.41	1,296,047.20	
NORTHERN TRUST CORP	6,505	145.02	943,355.10	
PAYPAL HOLDINGS INC	31,522	41.73	1,315,413.06	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,572	158.03	1,038,573.16	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	25,500	75.65	1,929,075.00	
ROCKET COS INC-CLASS A	31,200	18.35	572,520.00	
S&P GLOBAL INC	10,812	416.67	4,505,036.04	
SCHWAB (CHARLES) CORP	59,735	93.87	5,607,324.45	
SOFI TECHNOLOGIES INC	40,400	19.30	779,720.00	
STATE STREET CORP	9,831	127.87	1,257,089.97	
SYNCHRONY FINANCIAL	12,915	72.26	933,237.90	
T ROWE PRICE GROUP INC	7,693	94.36	725,911.48	

TOAST INC-CLASS A	16,100	27.64	445,004.00	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	3,900	118.95	463,905.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	58,745	318.93	18,735,542.85	
AFLAC	17,610	112.76	1,985,703.60	
ALLSTATE CORP	9,128	203.22	1,854,992.16	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,100	130.37	273,777.00	
AMERICAN INT'L GROUP	19,217	79.54	1,528,520.18	
AON PLC	7,104	324.30	2,303,827.20	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	12,950	98.34	1,273,503.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,880	218.37	1,939,125.60	
BROWN & BROWN INC	10,100	69.42	701,142.00	
CHUBB LTD	13,114	329.16	4,316,604.24	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,237	162.40	850,488.80	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	800	274.63	219,704.00	
EVEREST GROUP LTD	1,380	342.93	473,243.40	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC	9,002	54.21	487,998.42	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	9,809	140.31	1,376,300.79	
LOEWS CORP	6,205	108.35	672,311.75	
MARKEL GROUP INC	425	2,067.69	878,768.25	
MARSH AND MCLENNAN	17,075	178.87	3,054,205.25	
METLIFE INC	19,671	78.10	1,536,305.10	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7,586	92.15	699,049.90	
PROGRESSIVE CORP	20,289	201.77	4,093,711.53	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	12,235	102.71	1,256,656.85	
TRAVELERS COS INC/THE ST.PAUL TRAVELERS	7,814	299.90	2,343,418.60	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,388	301.01	1,019,821.88	
WR BERKLEY CORP	10,633	70.34	747,925.22	
ACCENTURE PLC-CL A	21,437	214.95	4,607,883.15	
ADOBE INC	14,488	259.21	3,755,434.48	
APPROVIN CORP-CLASS A	7,990	412.00	3,291,880.00	
ATLASSIAN CORP-CL A	5,800	80.26	465,508.00	
AUTODESK INC	7,367	229.10	1,687,779.70	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	5,100	34.17	174,267.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	9,440	296.59	2,799,809.60	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	3,003	159.05	477,627.15	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	10,900	192.64	2,099,776.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	16,955	64.99	1,101,905.45	
COREWEAVE INC-CL A	5,900	97.14	573,126.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	8,690	422.14	3,668,396.60	
DATADOG INC - CLASS A	10,700	120.60	1,290,420.00	
DOCUSIGN INC	7,100	44.12	313,252.00	
DYNATRACE INC	10,600	36.28	384,568.00	
FAIR ISAAC CORP	830	1,352.73	1,122,765.90	
FORTINET INC	22,600	81.67	1,845,742.00	

GARTNER INC	2,520	156.94	395,488.80	
GEN DIGITAL INC	18,300	22.34	408,822.00	
GODADDY INC-CLASS A	4,600	88.67	407,882.00	
HUBSPOT INC	1,750	239.37	418,897.50	
IBM CORP	32,221	256.28	8,257,597.88	
INTUIT CORP	9,646	381.54	3,680,334.84	
MICROSOFT CORP	244,142	398.46	97,280,821.32	
MONDAY.COM LTD	1,477	76.00	112,252.00	
MONGODB INC	2,830	355.89	1,007,168.70	
NEBIUS GROUP NV	7,200	107.61	774,792.00	
NUTANIX INC - A	8,500	41.32	351,220.00	
OKTA INC	5,900	81.80	482,620.00	
ORACLE CORP	59,179	156.54	9,263,880.66	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	78,700	134.89	10,615,843.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	27,912	150.99	4,214,432.88	
PTC INC	4,200	154.40	648,459.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,740	332.00	1,241,680.00	
SALESFORCE INC	32,927	185.29	6,101,043.83	
SAMSARA INC-CL A	11,800	26.80	316,240.00	
SERVICENOW INC	36,000	107.37	3,865,320.00	
SNOWFLAKE INC	11,200	179.20	2,007,040.00	
STRATEGY INC-CL A	9,080	129.45	1,175,406.00	
SYNOPSYS INC	6,432	442.44	2,845,774.08	
TRIMBLE INC	8,043	67.39	542,017.77	
TWILIO INC - A	5,200	110.96	576,992.00	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,470	319.55	469,738.50	
VERISIGN INC	2,939	216.62	636,646.18	
WIX.COM LTD	1,800	66.72	120,096.00	
WORKDAY INC CLASS A	7,572	140.02	1,060,231.44	
ZOOM COMMUNICATIONS INC	8,600	90.96	782,256.00	
ZSCALER INC	3,460	168.99	584,705.40	
AMPHENOL CORP-CL A	42,300	151.20	6,395,760.00	
APPLE INC	513,068	260.58	133,695,259.44	
ARISTA NETWORKS INC	37,000	137.23	5,077,510.00	
CDW CORP/DE	4,600	124.17	571,182.00	
CIENA CORP	4,800	318.41	1,528,368.00	
CISCO SYSTEMS	136,782	78.56	10,745,593.92	
CORNING	28,228	129.99	3,669,357.72	
DELL TECHNOLOGIES INC-C	11,277	119.06	1,342,639.62	
F5 INC	2,000	279.19	558,380.00	
FLEX LTD	12,600	65.11	820,386.00	
HEWLETT-PACKARD CO	32,603	18.34	597,939.02	
HP ENTERPRISE CO	44,476	21.39	951,341.64	
IONQ INC	10,000	33.43	334,300.00	
JABIL INC	3,600	262.44	944,784.00	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,000	239.54	1,437,240.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,773	453.68	2,619,094.64	

NETAPP INC	6,948	101.60	705,916.80	
PURE STORAGE INC - CLASS A	10,500	73.59	772,695.00	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,378	408.97	3,017,380.66	
SUPER MICRO COMPUTER INC	18,100	32.16	582,096.00	
TE CONNECTIVITY PLC	10,262	232.40	2,384,888.80	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,580	666.35	1,052,833.00	
WESTERN DIGITAL CORP	11,992	284.67	3,413,762.64	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,800	251.74	453,132.00	
AT & T INC	247,483	27.88	6,899,826.04	
COMCAST CORP-CL A	127,512	31.38	4,001,326.56	
T MOBILE US INC	17,590	215.30	3,787,127.00	
VERIZON COMMUNICATIONS	145,884	48.64	7,095,797.76	
ALLIANT ENERGY CORP	8,690	70.01	608,386.90	
AMEREN CORPORATION	9,377	109.80	1,029,594.60	
AMERICAN ELECTRIC POWER	18,585	128.42	2,386,685.70	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,800	131.36	893,248.00	
ATMOS ENERGY CORP	5,458	178.97	976,818.26	
CENTERPOINT ENERGY INC	21,856	42.64	931,939.84	
CMS ENERGY CORP	10,400	75.85	788,840.00	
CONSOLIDATED EDISON	12,559	111.92	1,405,603.28	
CONSTELLATION ENERGY	10,816	291.66	3,154,594.56	
DOMINION ENERGY INC	29,560	65.46	1,934,997.60	
DTE ENERGY	6,966	145.03	1,010,278.98	
DUKE ENERGY CORP	26,965	126.37	3,407,567.05	
EDISON INTERNATIONAL	13,416	72.66	974,806.56	
ENERGY CORP	15,540	103.33	1,605,748.20	
ESSENTIAL UTILITIES INC	9,900	39.09	386,991.00	
EVERGY INC	7,800	79.53	620,334.00	
EVERSOURCE ENERGY	12,571	73.67	926,105.57	
EXELON CORP	35,109	47.36	1,662,762.24	
FIRSTENERGY CORP	18,316	49.57	907,924.12	
NEXTERA ENERGY INC	71,260	91.64	6,530,266.40	
NISOURCE INC	15,900	45.82	728,538.00	
NRG ENERGY INC	6,500	175.01	1,137,565.00	
OKLO INC	3,800	67.64	257,032.00	
P G & E CORP	76,400	18.10	1,382,840.00	
PPL CORPORATION	24,766	36.97	915,599.02	
PUBLIC SV ENTERPRISE CO	17,302	85.68	1,482,435.36	
SEMPRA	22,682	92.97	2,108,745.54	
SOUTHERN CO	38,139	95.05	3,625,111.95	
VISTRA CORP	11,800	172.50	2,035,500.00	
WEC ENERGY GROUP INC	10,886	114.22	1,243,398.92	
XCEL ENERGY INC	20,544	80.82	1,660,366.08	
ADVANCED MICRO DEVICES	56,142	203.37	11,417,598.54	
ANALOG DEVICES	17,066	345.30	5,892,889.80	
APPLIED MATERIALS	27,541	369.83	10,185,488.03	
ASTERA LABS INC	4,500	132.62	596,790.00	

BROADCOM INC	155,120	333.99	51,808,528.80	
CREDO TECHNOLOGY GROUP HOLDI	5,300	130.66	692,498.00	
ENTEGRIS INC	5,300	132.67	703,151.00	
FIRST SOLAR INC	3,500	233.30	816,550.00	
INTEL CORP	156,428	44.62	6,979,817.36	
KLA CORPORATION	4,568	1,469.90	6,714,503.20	
LAM RESEARCH CORP	43,600	237.39	10,350,204.00	
MARVELL TECHNOLOGY INC	29,900	79.61	2,380,339.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,720	77.16	1,444,435.20	
MICRON TECHNOLOGY	38,830	417.35	16,205,700.50	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,660	1,175.22	1,950,865.20	
NVIDIA CORP	840,100	187.90	157,854,790.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	8,791	232.11	2,040,479.01	
ON SEMICONDUCTOR CORP	14,300	68.09	973,687.00	
QNITY ELECTRONICS INC	7,334	112.86	827,715.24	
QUALCOMM	37,118	141.27	5,243,659.86	
TERADYNE INC	5,500	315.90	1,737,450.00	
TEXAS INSTRUMENTS	31,486	218.05	6,865,522.30	
CBRE GROUP INC-A	10,284	149.19	1,534,269.96	
COSTAR GROUP	14,300	49.07	701,701.00	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	38,500	8.55	329,175.00	
ZILLOW GROUP INC-C	5,900	45.55	268,745.00	
アメリカ・ドル小計	12,661,401		2,026,491,336.79 (314,410,130,903)	

カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	19,000	24.95	474,050.00	
	CAMECO CORP	15,122	163.11	2,466,549.42	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	72,380	58.23	4,214,687.40	
	CENOVUS ENERGY INC	47,848	31.68	1,515,824.64	
	ENBRIDGE INC	75,571	70.65	5,339,091.15	
	IMPERIAL OIL LTD	5,785	167.97	971,706.45	
	KEYERA CORP	7,442	51.57	383,783.94	
	PEMBINA PIPELINE CORP	19,649	59.51	1,169,311.99	
	SUNCOR ENERGY INC	41,930	77.77	3,260,896.10	
	TC ENERGY CORP	36,028	85.63	3,085,077.64	
	TOURMALINE OIL CORP	12,500	63.09	788,625.00	
	WHITECAP RESOURCES INC	40,100	13.77	552,177.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	17,397	307.51	5,349,751.47	
	ALAMOS GOLD INC-CLASS A	14,700	62.80	923,160.00	
	BARRICK MINING CORP	58,980	66.56	3,925,708.80	
	CCL INDUSTRIES INC	4,800	87.89	421,872.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	24,128	36.41	878,500.48	
	FRANCO NEV CORP	6,662	349.38	2,327,569.56	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	27,700	15.60	432,120.00	
	KINROSS GOLD CORP	42,163	45.82	1,931,908.66	
	LUNDIN GOLD INC	3,800	109.00	414,200.00	
	LUNDIN MINING CORP	24,000	35.66	855,840.00	
	NUTRIEN LTD	16,853	98.29	1,656,481.37	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	14,700	83.85	1,232,595.00	
	TECK RESOURCES LTD	15,908	81.28	1,293,002.24	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	15,747	199.10	3,135,227.70	
	ATKINSREALIS GROUP INC	5,800	95.45	553,610.00	
	BOMBARDIER INC-B	3,000	275.84	827,520.00	
	CAE Inc.	10,750	40.67	437,202.50	
	STANTEC INC	4,000	122.45	489,800.00	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	2,800	204.54	572,712.00	
	WSP GLOBAL INC	4,400	227.02	998,888.00	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	14,100	33.76	476,016.00	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	8,300	59.56	494,348.00	
	RB GLOBAL INC	6,500	142.01	923,065.00	
	THOMSON REUTERS CORP	5,279	116.67	615,900.93	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	18,225	149.93	2,732,474.25	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	24,865	116.00	2,884,340.00	
	TFI INTERNATIONAL INC	2,800	162.43	454,804.00	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	9,138	91.39	835,121.82	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,915	97.33	575,706.95	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	10,533	93.86	988,627.38	
	CANADIAN TIRE CORP.	1,831	182.53	334,212.43	
	DOLLARAMA INC	9,485	193.44	1,834,778.40	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	26,000	84.14	2,187,640.00	
	EMPIRE CO LTD 'A'	4,266	49.57	211,465.62	
	LOBLAW COMPANIES LTD	20,188	68.58	1,384,493.04	

METRO INC	7,118	98.43	700,624.74	
WESTON (GEORGE)	5,970	102.05	609,238.50	
SAPUTO INC	8,107	42.13	341,547.91	
BANK OF MONTREAL	24,794	196.75	4,878,219.50	
BANK OF NOVA SCOTIA	42,951	104.34	4,481,507.34	
CANADIAN IMPERIAL BANK	32,228	134.47	4,333,699.16	
NATIONAL BANK OF CANADA	13,646	176.53	2,408,928.38	
ROYAL BANK OF CANADA	48,642	233.96	11,380,282.32	
TRONTO-DOMINION BANK	58,862	131.27	7,726,814.74	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	13,836	68.57	948,734.52	
BROOKFIELD CORP	71,417	63.25	4,517,125.25	
IGM FINANCIAL INC	2,433	65.80	160,091.40	
TMX GROUP LTD	9,800	46.33	454,034.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	742	2,325.98	1,725,877.16	
GREAT-WEST LIFECO INC	9,446	63.76	602,276.96	
IA FINANCIAL CORP INC	3,293	149.85	493,456.05	
INTACT FINANCIAL CORP	6,200	263.30	1,632,460.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	58,720	49.57	2,910,750.40	
POWER CORP OF CANADA	19,333	65.92	1,274,431.36	
SUN LIFE FINANCIAL INC	19,491	89.47	1,743,859.77	
CGI INC	6,884	101.01	695,352.84	
CONSTELLATION SOFTWARE	695	2,415.33	1,678,654.35	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,000	90.44	271,320.00	
OPEN TEXT CORP	8,984	33.89	304,467.76	
SHOPIFY INC - CLASS A	42,300	169.61	7,174,503.00	
CELESTICA INC	4,000	399.59	1,598,360.00	
BCE INC	2,115	35.01	74,046.15	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	12,432	52.32	650,442.24	
TELUS CORP	18,108	18.54	335,722.32	
ALTAGAS LTD	10,613	45.10	478,646.30	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	4,550	58.17	264,673.50	
CANADIAN UTILITIES LTD A	4,400	46.84	206,096.00	
EMERA	10,500	70.14	736,470.00	
FORTIS INC	17,557	77.38	1,358,560.66	
HYDRO ONE	11,200	56.84	636,608.00	
FIRSTSERVICE CORP	1,300	213.72	277,836.00	
カナダ・ドル小計	1,494,735		139,878,162.91 (15,853,790,984)	

オーストラリア・ドル	SANTOS	113,944	7.00	797,608.00	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	66,152	27.10	1,792,719.20	
	AMCOR PLC-CDI	4,350	70.85	308,197.50	
	BHP GROUP LIMITED	119,206	53.23	6,345,335.38	
	EVOLUTION MINING LTD	69,038	14.94	1,031,427.72	
	FORTESCUE LTD	58,992	20.31	1,198,127.52	
	LYNAS RARE EARTHS LTD	31,116	15.61	485,720.76	
	NEWMONT CORP-CDI	10,339	176.25	1,822,248.75	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	45,960	28.36	1,303,425.60	
	RIO TINTO LTD	12,904	168.55	2,174,969.20	
	SOUTH32 LTD	158,503	4.41	698,998.23	
	SGH LTD	6,659	47.81	318,366.79	
	BRAMBLES LTD	46,100	24.38	1,123,918.00	
	COMPUTERSHARE LIMITED	18,293	31.22	571,107.46	
	QANTAS AIRWAYS LTD	23,007	10.74	247,095.18	
	TRANSURBAN GROUP	108,357	13.88	1,503,995.16	
	ARISTOCRAT LEISURE LIMITED	18,788	50.33	945,600.04	
	LOTTERY CORP LTD/THE	78,892	5.58	440,217.36	
	CAR GROUP LTD	13,024	25.66	334,195.84	
	REA GROUP LTD	1,882	163.02	306,803.64	
	WESFARMERS LIMITED	39,356	84.24	3,315,349.44	
	COLES GROUP LTD	45,441	21.87	993,794.67	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	41,303	31.96	1,320,043.88	
	COCHLEAR LIMITED	2,232	199.94	446,266.08	
	PRO MEDICUS LTD	1,970	129.16	254,445.20	
	SIGMA HEALTHCARE LTD	177,855	2.98	530,007.90	
	SONIC HEALTHCARE LIMITED	16,679	23.34	389,287.86	
	CSL LIMITED	16,830	154.19	2,595,017.70	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	103,422	40.07	4,144,119.54	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	57,919	178.19	10,320,586.61	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	106,132	48.28	5,124,052.96	
	WESTPAC BANKING	118,507	41.89	4,964,258.23	
	AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	6,343	54.92	348,357.56	
	BLOCK INC - CDI	2,469	75.99	187,619.31	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	12,568	223.00	2,802,664.00	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON	11,768	38.01	447,301.68	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	80,675	6.96	561,498.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD.	94,599	4.52	427,587.48	
	QBE INSURANCE GROUP	51,127	20.06	1,025,607.62	
	SUNCORP GROUP LTD	38,011	15.25	579,667.75	
WISETECH GLOBAL LTD	6,934	48.96	339,488.64		
XERO LTD	5,811	80.55	468,076.05		
TELSTRA GROUP LTD	139,430	5.14	716,670.20		
APA GROUP	45,272	9.01	407,900.72		
ORIGIN ENERGY LIMITED	60,445	12.14	733,802.30		
オーストラリア・ドル小計	2,288,604		67,193,548.71		

				(7,355,005,842)	
イギリス・ポ ンド	BP PLC	545,082	4.79	2,610,942.78	
	SHELL PLC	200,435	29.44	5,900,806.40	
	ANGLO AMERICAN PLC	38,862	35.78	1,390,482.36	
	ANTOFAGASTA PLC	13,417	38.75	519,908.75	
	BHP GROUP LTD	56,604	27.48	1,555,477.92	
	CRH PLC	20,580	93.08	1,915,586.40	
	ENDEAVOUR MINING PLC	6,646	47.14	313,292.44	
	FRESNILLO PLC	7,811	38.66	301,973.26	
	GLENCORE PLC	348,822	5.05	1,761,551.10	
	RIO TINTO PLC REG	39,108	71.18	2,783,707.44	
	SMURFIT WESTROCK PLC	7,863	37.87	297,771.81	
	ASHTREAD GROUP PLC	14,668	51.06	748,948.08	
	BAE SYSTEMS PLC	104,179	21.63	2,253,391.77	
	BUNZL PLC	10,646	21.18	225,482.28	
	DCC (GB)	3,104	52.00	161,408.00	
	FERGUSON ENTERPRISES INC/DE	6,083	191.90	1,167,327.70	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	41,320	6.65	274,943.28	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	291,414	13.24	3,858,321.36	
	SMITHS GROUP PLC	11,159	26.56	296,383.04	
	SPIRAX GROUP PLC	2,407	78.05	187,866.35	
	EXPERIAN PLC	31,868	25.76	820,919.68	
	INTERTEK GROUP PLC	5,447	44.90	244,570.30	
	RELX PLC	56,167	22.93	1,287,909.31	
	RENTOKIL INITIAL PLC	88,475	4.62	409,108.40	
	BARRATT REDROW PLC	44,673	3.77	168,417.21	
	COMPASS GROUP PLC	58,892	21.95	1,292,679.40	
	ENTAIN PLC	19,856	5.82	115,641.34	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	5,304	90.40	479,481.60	
	PEARSON	20,402	9.23	188,392.06	
	WHITBREAD PLC	6,183	27.37	169,228.71	
	AUTOTRADER GROUP PLC	30,719	4.73	145,393.02	
	INFORMA PLC	45,317	8.22	372,687.00	
	JD SPORTS FASHION PLC	78,700	0.78	61,716.54	
	KINGFISHER PLC	55,838	3.57	199,397.49	
	NEXT PLC	3,935	129.90	511,156.50	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	72,628	3.97	288,187.90	
	SAINSBURY (J) PLC	55,267	3.55	195,976.78	
	TESCO PLC	225,849	4.97	1,122,017.83	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	11,371	19.76	224,747.81	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO	75,692	44.73	3,385,703.16	
	COCA COLA HBC AG CDI	7,461	47.22	352,308.42	
DIAGEO	77,264	17.82	1,376,458.16		
IMPERIAL BRANDS PLC	26,614	32.00	851,648.00		
MAGNUM ICE CREAM CO BV/THE	9,870	11.97	118,094.55		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	22,486	64.56	1,451,696.16		
UNILEVER PLC	46,258	53.20	2,460,925.60		

SMITH&NEOHEW PLC	26,957	13.17	355,158.47	
ASTRAZENECA PLC	53,646	152.90	8,202,473.40	
GSK PLC	140,792	22.26	3,134,029.92	
HALEON PLC	309,247	4.07	1,258,944.53	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,103	16.40	83,689.20	
BARCLAYS PLC	483,795	4.68	2,263,918.70	
HSBC HOLDINGS PLC	595,564	12.82	7,632,748.22	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,051,876	1.02	2,092,913.52	
NATWEST GROUP PLC	278,562	6.17	1,719,284.66	
STANDARD CHARTERED PLC	67,560	17.84	1,205,270.40	
3I GROUP PLC	34,495	33.88	1,168,690.60	
LONDON STOCK EXCAHNGE GROUP	16,208	77.78	1,260,658.24	
M&G PLC	80,769	3.19	257,410.80	
SCHRODERS PLC	22,611	5.86	132,500.46	
WISE PLC - A	21,694	8.57	185,809.11	
ADMIRAL GROUP PLC	9,160	28.30	259,228.00	
AVIVA PLC	106,428	6.43	684,119.18	
LEGAL & GENERAL GROUP	193,141	2.72	526,116.08	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	22,489	7.61	171,141.29	
PRUDENTIAL PLC	89,030	11.14	991,794.20	
THE SAGE GROUP PLC	32,780	8.07	264,403.48	
HALMA PLC	12,879	39.24	505,371.96	
BT GROUP PLC	203,415	2.03	413,135.86	
VODAFONE GROUP PLC	667,269	1.15	770,362.06	
CENTRICA PLC	154,834	1.86	287,836.40	
NATIONAL GRID PLC	171,956	13.43	2,308,509.30	
SEVERN TRENT PLC	9,546	31.29	298,694.34	
SSE PLC	41,918	25.50	1,068,909.00	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	23,311	13.35	311,318.40	
イギリス・ポンド小計	8,879,781		86,634,475.23 (18,096,209,186)	

スイス・フラン	AMRIZE LTD	16,474	49.15	809,697.10	
	EMS CHEMIE HOLDING AG RE	231	625.00	144,375.00	
	GIVAUDAN-REG	321	2,990.00	959,790.00	
	HOLCIM LTD	17,708	73.22	1,296,579.76	
	SIKA AG-BEARER	5,303	152.75	810,033.25	
	ABB LTD	54,276	69.92	3,794,977.92	
	BELIMO HOLDING AG-REG	347	894.50	310,391.50	
	GEBERIT AG-REG	1,145	639.00	731,655.00	
	SCHINDLER HLDG AG	739	281.50	208,028.50	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,426	293.00	417,818.00	
	VAT GROUP AG	948	526.20	498,837.60	
	SGS SA-REG	5,783	93.78	542,329.74	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,700	176.30	299,710.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON REG	18,616	158.70	2,954,359.20	
	THE SWATCH GROUP AG-B	948	195.60	185,428.80	
	AVOLTA AG(REGD)	2,750	52.00	143,000.00	
	BARRY CALLEBAUT AG REG	117	1,460.00	170,820.00	
	LINDT SPRUENGLI PTG CERT CHF10	32	12,780.00	408,960.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	128,000.00	512,000.00	
	NESTLE SA-REG	89,140	81.43	7,258,670.20	
	ALCON INC	17,359	63.92	1,109,587.28	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,778	196.20	348,843.60	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	3,914	94.88	371,360.32	
	GALDERMA GROUP AG	5,378	154.60	831,438.80	
	LOMZA AG-REG	2,438	538.20	1,312,131.60	
	NOVARTIS AG-REG SHS	65,775	126.48	8,319,222.00	
	ROCHE HOLDING AG GENUSS	24,305	368.20	8,949,101.00	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,090	374.80	408,532.00	
	SANDOZ GROUP AG	14,102	67.22	947,936.44	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	903	112.10	101,226.30	
	JULIUS BAER GROUP LTD	7,209	65.46	471,901.14	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	766	910.80	697,672.80	
	UBS GROUP AG	109,894	32.71	3,594,632.74	
HELVETIA BALOISE HOLDING AG- REG	2,774	193.90	537,878.60		
SWISS LIFE HOLDING AG	992	855.00	848,160.00		
SWISS RE LTD	10,369	127.80	1,325,158.20		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,069	558.80	2,832,557.20		
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	5,179	69.52	360,044.08		
SWISSCOM	877	706.50	619,600.50		
BKW AG	695	146.50	101,817.50		
SWISS PRIME SITE REG	2,818	137.80	388,320.40		
スイス・フラン小計	501,692		56,934,584.07 (11,390,332,889)		

香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED	93,623	63.60	5,954,422.80	
	SWIRE PACIFIC A	12,500	79.70	996,250.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	51,000	122.80	6,262,800.00	
	MTR CORP	54,246	36.66	1,988,658.36	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	44,000	30.24	1,330,560.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	68,000	43.08	2,929,440.00	
	SANDS CHINA LTD	79,744	19.00	1,515,136.00	
	WH GROUP LIMITED	286,000	9.90	2,831,400.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	125,489	43.40	5,446,222.60	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	41,741	408.80	17,063,720.80	
	AIA GROUP LTD	363,884	82.35	29,965,847.40	
	HKT TRUST AND HKT LTD	124,000	12.15	1,506,600.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	22,000	65.00	1,430,000.00	
	CLP HOLDINGS	57,317	76.50	4,384,750.50	
	HONGKONG CHINA GAS	383,197	7.75	2,969,776.75	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	47,500	62.25	2,956,875.00	
	CK ASSET HOLDINGS LIMITED	67,633	47.24	3,194,982.92	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	50,308	32.70	1,645,071.60	
	SINO LAND	116,997	12.59	1,472,992.23	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	49,108	134.70	6,614,847.60	
WHARF HOLDINGS LTD	39,000	25.84	1,007,760.00		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	55,125	28.76	1,585,395.00		
香港・ドル小計		2,232,412		105,053,509.56 (2,085,312,165)	
シンガポール・ドル	KEPPEL LTD	49,700	12.86	639,142.00	
	SINGAPORE TECH ENGR.	55,000	10.22	562,100.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	84,500	3.64	307,580.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	6.98	376,222.00	
	WILMAR INTERL LTD SGD0.5	61,200	3.57	218,484.00	
	DBS GROUP HOLDING	73,721	57.62	4,247,804.02	
	OVERSEA-CHINESE BANKING	117,524	21.59	2,537,343.16	
	UNITED OVERSEAS BANK	43,543	38.66	1,683,372.38	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	29,300	18.12	530,916.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	258,774	4.98	1,288,694.52	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	27,100	6.34	171,814.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	77,075	3.15	242,786.25	
シンガポール・ドル小計		931,337		12,806,258.33 (1,566,461,519)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	60,011	8.73	523,896.03	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	20,020	37.60	752,752.00	
	INFRATIL LTD	33,227	11.08	368,155.16	
	CONTACT ENERGY LTD	30,577	9.39	287,118.03	
	MERIDIAN ENERGY LTD	46,460	5.76	267,609.60	
ニュージーランド・ドル小計		190,295		2,199,530.82 (203,522,587)	

スウェーデン・クローナ	BOLIDEN AB	9,687	650.40	6,300,424.80	
	HOLMEN AB-B SHARES	2,240	357.20	800,128.00	
	SVENSKA CELLULOOSA AB SCA-B	21,516	121.00	2,603,436.00	
	ADDTECH AB-B SHARES	8,472	324.80	2,751,705.60	
	ALFA LAVAL AB	10,140	521.00	5,282,940.00	
	ASSA ABLOY AB-B	34,827	377.50	13,147,192.50	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	93,246	194.85	18,168,983.10	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	52,771	168.25	8,878,720.75	
	BEIJER REF AB	14,563	135.25	1,969,645.75	
	EPIROC AB-A	23,084	258.70	5,971,830.80	
	EPIROC AB-B	13,820	223.60	3,090,152.00	
	INDUTRADE AB	9,710	228.20	2,215,822.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	4,596	225.20	1,035,019.20	
	LIFCO AB-B SHS	8,238	321.60	2,649,340.80	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	49,693	39.38	1,956,910.34	
	SAAB AB-B	10,860	672.90	7,307,694.00	
	SANDVIK AB	37,078	377.50	13,996,945.00	
	SKANSKA AB-B	12,014	270.50	3,249,787.00	
	SKF AB-B SHARES	12,054	254.70	3,070,153.80	
	TRELLEBORG AB-B SHS	7,175	395.90	2,840,582.50	
	VOLVO AB-B SHS	55,144	347.20	19,145,996.80	
	SECURITAS B	17,431	156.70	2,731,437.70	
	EVOLUTION AB	4,633	538.20	2,493,480.60	
	HENNES & MAURITZ B	18,333	184.50	3,382,438.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	21,072	282.10	5,944,411.20	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	6,985	401.60	2,805,176.00	
	NORDEA BANK ABP	94,926	176.45	16,749,692.70	
	SKAND. ENSKILDA BANKEN A	52,664	193.00	10,164,152.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	49,397	141.45	6,987,205.65	
	SWEDBANK AB	29,550	347.30	10,262,715.00	
	EQT AB	16,755	294.00	4,925,970.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	3,703	485.00	1,795,955.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,550	484.20	2,687,310.00	
INVESTOR AB-B SHS	63,180	365.55	23,095,449.00		
LUNDBERGFÖRETAGEN B	2,513	550.50	1,383,406.50		
"ERICSSON (LM) TEL, SEK1 SER B"	97,441	101.65	9,904,877.65		
HEXAGON AB-B SHS	70,150	98.80	6,930,820.00		
TELE2 AB-B SHS	19,332	189.10	3,655,681.20		
TELIA COMPANY AB	80,917	44.70	3,616,989.90		
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	22,743	63.60	1,446,454.80		
SAGAX AB-B	6,690	174.80	1,169,412.00		
スウェーデン・クローナ小計	1,174,893		248,566,446.14 (4,252,971,892)		

ノルウェー・ クローネ	AKER BP ASA	10,306	286.20	2,949,577.20	
	EQUINOR ASA	25,989	279.20	7,256,128.80	
	NORSK HYDRO	48,752	83.70	4,080,542.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,752	460.00	2,645,920.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	15,473	392.95	6,080,115.35	
	MOWI ASA	16,372	229.60	3,759,011.20	
	ORKLA ASA	24,198	127.30	3,080,405.40	
	SALMAR ASA	2,402	580.00	1,393,160.00	
	DNB BANK ASA	30,896	298.60	9,225,545.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,147	266.40	1,903,960.80	
	TELENOR ASA	20,012	176.00	3,522,112.00	
ノルウェー・クローネ小計		207,299		45,896,478.75 (746,276,743)	
デンマーク・ クローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	11,915	386.00	4,599,190.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	2,850	221.25	630,562.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	35,161	159.75	5,616,969.75	
	A P MOLLER MAERSK A/S	134	15,800.00	2,117,200.00	
	A.P. MOLLER-MAERSK A DKK1000	102	15,720.00	1,603,440.00	
	DSV A/S	7,093	1,669.50	11,841,763.50	
	PANDORA A/S	2,792	526.00	1,468,592.00	
	CARLSBERG B	3,211	995.40	3,196,229.40	
	COLOPLAST B	4,437	479.70	2,128,428.90	
	DEMANT A/S	2,833	181.00	512,773.00	
	GENMAB A/S	2,130	1,791.50	3,815,895.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	111,478	307.40	34,268,337.20	
	DANSKE BANK A/S	23,230	336.00	7,805,280.00	
	TRYG A/S	11,562	154.60	1,787,485.20	
ORSTED A/S	18,582	152.40	2,831,896.80		
デンマーク・クローネ小計		237,510		84,224,043.25 (2,058,435,617)	
イスラエル・ シェケル	ICL GROUP LIMITED	25,457	16.92	430,732.44	
	ELBIT SYSTEMS LTD	974	2,251.00	2,192,474.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	22,893	106.40	2,435,815.20	
	BANK HAPUALIM BM	43,519	81.16	3,532,002.04	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	51,776	77.49	4,012,122.24	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	41,666	39.43	1,642,890.38	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,483	248.90	1,364,718.70	
	PHOENIX FINANCIAL LTD	7,838	167.00	1,308,946.00	
	NICE LTD	1,976	342.00	675,792.00	
	NOVA LTD	1,012	1,403.00	1,419,836.00	
AZRIELI GROUP	1,492	461.30	688,259.60		
イスラエル・シェケル小計		204,086		19,703,588.60 (974,117,834)	

ユーロ	BOLLORE SE	21,754	4.85	105,463.39	
	ENI SPA	71,073	18.64	1,324,658.57	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	13,982	18.70	261,393.49	
	NESTE OYJ	14,934	21.45	320,334.30	
	OMV AG	5,065	55.85	282,880.25	
	REPSOL SA	39,375	18.14	714,262.50	
	TENARIS SA	12,212	23.10	282,097.20	
	TOTAL SE	68,758	66.53	4,574,469.74	
	AIR LIQUIDE	20,036	167.52	3,356,430.72	
	AKZO NOBEL	5,843	60.50	353,501.50	
	BASF SE	30,983	48.69	1,508,562.27	
	BUZZI SPA	2,709	48.74	132,036.66	
	DSM-FIRMENICH AG	6,021	60.68	365,354.28	
	EVONIK INDUSTRIES AG	7,711	15.29	117,901.19	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	4,653	205.50	956,191.50	
	NLG) ARCELORMITTAL	15,891	54.48	865,741.68	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	19,082	11.29	215,340.37	
	SYENSQO SA	2,386	78.32	186,871.52	
	SYMRISE AG	4,537	74.94	340,002.78	
	UPM-KYMMENE	17,949	26.89	482,648.61	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	6,203	104.60	648,833.80	
	AIRBUS SE	20,572	187.10	3,849,021.20	
	ALSTOM	12,215	29.56	361,075.40	
	BOUYGUES SA	6,759	50.94	344,303.46	
	BRENTAG SE	4,356	54.14	235,833.84	
	CIE DE SAINT-GOBAIN	15,593	87.54	1,365,011.22	
	CSG NV	6,900	30.04	207,276.00	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	16,090	42.04	676,423.60	
	DASSAULT AVIATION SA	679	349.80	237,514.20	
	EIFFAGE EUR4 (POST SUBDIV ISIO	2,418	141.40	341,905.20	
	FERROVIAL SE	17,856	60.90	1,087,430.40	
	GEA GROUP AG NPV	5,166	65.15	336,564.90	
	HENSOLDT AG	2,011	83.60	168,119.60	
	HOCHTIEF AG	543	393.00	213,399.00	
	IMCD NV	2,117	84.78	179,479.26	
	KINGSPAN GROUP PLC	5,244	79.65	417,684.60	
	KNORR-BREMSE AG	2,371	111.00	263,181.00	
	KONE OYJ	11,491	62.78	721,404.98	
	LEGRAND PROMESSES EUR4	9,112	151.35	1,379,101.20	
	LEONARDO SPA	14,113	59.20	835,489.60	
METSO CORPORATION	22,678	16.80	380,877.01		
MTU AERO ENGINES AG	1,820	398.60	725,452.00		
PRYSMIAN SPA EURO.10	9,802	98.08	961,380.16		
RATIONAL AG	186	734.50	136,617.00		
REXEL SA	7,320	36.62	268,058.40		
RHEINMETALL AG	1,594	1,743.50	2,779,139.00		

SAFRAN SA	12,468	342.10	4,265,302.80	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	18,979	259.35	4,922,203.65	
SIEMENS AG	26,298	240.55	6,325,983.90	
SIEMENS ENERGY AG	26,841	164.20	4,407,292.20	
THALES SA	3,229	263.30	850,195.70	
VINCI SA	17,295	139.45	2,411,787.75	
WARTSILA OYJ	17,089	36.45	622,894.05	
BUREAU VERITAS	11,981	27.54	329,956.74	
RANDSTAD NV	3,928	27.98	109,905.44	
RELX PLC	7,093	26.38	187,113.34	
WOLTERS KLUWER CVA	8,101	62.32	504,854.32	
ADP	1,241	120.40	149,416.40	
AENA SME SA	25,393	27.06	687,134.58	
DHL GROUP-REG	33,311	49.92	1,662,885.12	
GETLINK SE	9,927	17.81	176,799.87	
INPOST SA	7,995	15.23	121,763.85	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	39,280	4.97	195,103.76	
LUFTHANSA	21,408	9.10	194,855.61	
RYANAIR HOLDINGS PLC	29,361	26.61	781,296.21	
BAYER MOTOREN WERKEUR1	9,760	90.08	879,180.80	
BAYER MOTOREN WERKNON-VTG PRF EUR1	1,799	90.00	161,910.00	
CONTINENTAL	3,889	73.08	284,208.12	
DR ING HC F PORSCHE AG	3,738	41.70	155,874.60	
FERRARI NV	4,376	311.10	1,361,373.60	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	25,061	58.75	1,472,333.75	
MICHELIN (CGDE)	22,677	33.50	759,679.50	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE (PREF)	5,305	35.97	190,820.85	
RENAULT SA	6,801	32.16	218,720.16	
STELLANTIS NV	55,414	6.42	355,813.29	
STELLANTIS NV	14,857	6.42	95,352.22	
VOLKSWAGEN VORZUG	7,183	102.60	736,975.80	
ADIDAS AG	5,946	155.25	923,116.50	
HERMES INTERNATIONAL	1,098	2,039.00	2,238,822.00	
KERING	2,592	275.50	714,096.00	
LVMH	8,654	531.50	4,599,601.00	
MONCLER SPA	7,936	50.26	398,863.36	
ACCOR SA	6,705	48.33	324,052.65	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	15,666	47.94	751,028.04	
DELIVERY HERO SE	6,308	20.53	129,503.24	
FDJ UNITED	3,559	24.72	87,978.48	
SODEXO	2,903	47.52	137,950.56	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	2,045	65.45	133,845.25	
PUBLICIS GROUPE	7,738	72.88	563,945.44	
SCOUT24 SE	2,658	69.60	184,996.80	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	38,307	19.42	743,921.94	

D' IETEREN GROUP	633	188.10	119,067.30	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	37,814	57.92	2,190,186.88	
PROSUS NV	45,343	43.82	1,986,930.26	
ZALANDO SE	7,334	21.03	154,234.02	
CARREFOUR	20,758	15.17	314,795.07	
JERONIMO MARTINS	9,784	21.10	206,442.40	
KESKO OYJ-B SHS	9,743	21.04	204,992.72	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	31,171	40.00	1,246,840.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	34,274	66.66	2,284,704.84	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	4,300	88.60	380,980.00	
DANONE	22,452	74.12	1,664,142.24	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	22,264	6.51	144,938.64	
HEINEKEN HOLDING EUR1.6	4,572	70.90	324,154.80	
HEINEKEN NV	10,038	76.90	771,922.20	
JDE PEET'S BV	6,085	31.70	192,894.50	
KERRY GROUP A	5,681	73.70	418,689.70	
LOTUS BAKERIES	15	10,380.00	155,700.00	
MAGNUM ICE CREAM CO NV/THE	6,567	13.69	89,875.96	
PERNOD RICARD	6,838	83.94	573,981.72	
BEIERSDORF	3,321	106.55	353,852.55	
HENKEL AG & CO KGAA (PREF)	5,461	82.18	448,784.98	
HENKEL KGAA	3,679	76.15	280,155.85	
L'OREAL	8,319	395.00	3,286,005.00	
UNILEVER PLC	29,190	61.02	1,781,173.80	
BIOMERIEUX	1,361	94.30	128,342.30	
ESSILORLUXOTTICA	10,428	233.00	2,429,724.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	7,530	40.69	306,395.70	
FRESENIUS SE & CO KGaA	14,276	52.08	743,494.08	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	26,059	26.25	684,048.75	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,826	41.45	490,187.70	
ARGENX SE	2,136	717.60	1,532,793.60	
BAYER AG	34,125	45.57	1,555,246.87	
EUROFINS SCIENTIFIC	3,948	67.42	266,174.16	
FINANCIERE DE TUBIZE	703	247.50	173,992.50	
GRIFOLS SA	9,432	11.16	105,213.96	
IPSEN	1,351	158.20	213,728.20	
MERCK KGAA	4,515	127.90	577,468.50	
ORION OYJ	3,544	69.55	246,485.20	
QIAGEN N.V.	7,252	41.33	299,688.90	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,976	47.62	189,337.12	
SANOFI	38,260	79.00	3,022,540.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	857	231.50	198,395.50	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	956	175.95	168,208.20	
UCB SA	4,395	283.20	1,244,664.00	

ABN AMRO BANK NV-CVA	20,353	28.82	586,573.46	
AIB GROUP PLC	72,319	8.84	639,661.55	
BANCA INTESA SPA	493,364	5.75	2,835,856.27	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	68,940	8.52	587,644.56	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT	199,538	19.81	3,952,847.78	
BANCO BPM SPA	39,730	12.40	492,652.00	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	262,146	0.90	235,511.96	
BANCO DE SABADELL SA	175,360	3.22	564,834.56	
BANCO SANTANDER SA	515,175	10.58	5,452,612.20	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	33,335	16.25	541,693.75	
BANKINTER SA	23,061	14.00	322,969.30	
BNP PARIBAS	34,818	93.84	3,267,321.12	
BPER BANCA SPA	49,957	11.92	595,737.22	
CAIXABANK	135,274	10.70	1,447,431.80	
COMMERZBANK AG	25,498	34.11	869,736.78	
CREDIT AGRICOLE SA	36,126	18.26	659,480.13	
ERSTE GROUP BANK AG	10,701	106.90	1,143,936.90	
FINECOBANK SPA	21,405	19.61	419,859.07	
ING GROUP N.V.	104,700	24.60	2,575,620.00	
KBC BANCASSURANCE HOLDING NV	7,990	116.50	930,835.00	
NORDEA BANK ABP	12,800	16.54	211,712.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	4,614	42.72	197,110.08	
SOCIETE GENERALE-A	24,515	72.34	1,773,415.10	
UNICREDIT SPA	48,546	72.85	3,536,576.10	
ADYEN NV	876	997.70	873,985.20	
AMUNDI SA	2,213	77.75	172,060.75	
BANCA MEDIOLANUM SPA	7,142	17.71	126,484.82	
CVC CAPITAL PARTNERS PLC	6,379	12.45	79,418.55	
DEUTSCHE BANK AG-REG	64,164	30.41	1,951,227.24	
DEUTSCHE BOERSE AG	6,536	216.40	1,414,390.40	
EDENRED	7,473	17.81	133,094.13	
EURONEXT NV	2,678	122.50	328,055.00	
EXOR NV	3,311	72.70	240,709.70	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	2,600	83.80	217,880.00	
NEXI SPA	15,458	3.17	49,032.77	
POSTE ITALIANE	16,073	22.96	369,036.08	
SOFINA	580	246.00	142,680.00	
AEGON LTD	46,596	6.24	290,572.65	
AGEAS	5,254	62.60	328,900.40	
ALLIANZ	13,365	373.40	4,990,491.00	
ASR NEDERLAND NV	5,364	61.64	330,636.96	
AXA SA	60,105	39.12	2,351,307.60	
GENERALI	29,628	35.46	1,050,608.88	
HANNOVER RUECK SE	2,106	249.00	524,394.00	
MAPFRE SA	32,564	3.90	127,129.85	
MUENCHENER RUECK AG-REG	4,527	535.80	2,425,566.60	
NN GROUP NV	9,112	69.00	628,728.00	

SAMPO OYJ-A SHS	84,262	9.16	771,671.39	
TALANX AG	2,282	107.10	244,402.20	
UNIPOL ASSICURAZIONI SPA	11,841	19.44	230,248.24	
CAPGEMINI SA	5,259	103.95	546,673.05	
DASSAULT SYSTEMES SE	23,427	17.54	410,909.58	
NEMETSCHKE SE	2,058	65.90	135,622.20	
SAP SE	36,127	170.74	6,168,323.98	
NOKIA OYJ	184,190	6.35	1,169,606.50	
CELLNEX TELECOM SA	17,313	30.00	519,390.00	
DEUTSCHE TELEKOM	127,392	32.63	4,156,800.96	
ELISA CORP-A SHARES	5,069	42.40	214,925.60	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	9,879	8.77	86,688.22	
KPN (KON. PTT NEDERLAND	135,871	4.64	631,120.79	
ORANGE S.A.	64,782	18.14	1,175,145.48	
TELECOM ITALIA SPA	376,164	0.65	243,378.10	
TELEFONICA S.A.	129,036	3.59	463,755.38	
ACCIONA SA	730	196.80	143,664.00	
E.ON SE	77,977	18.60	1,450,372.20	
EDP RENOVAVEIS SA	10,379	13.16	136,587.64	
ELIA GROUP SA/NV	1,552	134.90	209,364.80	
ENDESA SA	10,835	31.43	340,544.05	
ENEL SPA	281,835	8.96	2,524,396.09	
ENGIE	63,402	26.42	1,675,080.84	
FORTUM OYJ	15,830	19.65	311,059.50	
IBERDROLA SA	222,754	19.52	4,348,158.08	
NATURGY ENERGY GROUP SA	8,609	25.62	220,562.58	
PTE) EDP SA	106,749	4.29	457,526.21	
REDEIA CORPORACION SA	13,233	15.91	210,537.03	
RWE AG	21,987	51.46	1,131,451.02	
SNAM SPA	68,639	6.31	433,386.64	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	47,811	9.80	468,739.04	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	21,330	34.17	728,846.10	
VERBUND AG	2,100	59.20	124,320.00	
ASM INTERNATIONAL NV	1,631	701.80	1,144,635.80	
ASML HOLDING NV	13,425	1,238.20	16,622,835.00	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	2,444	173.00	422,812.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	45,308	45.84	2,076,692.18	
STMICROELECTRONICS NV	23,667	28.30	669,776.10	
LEG IMMOBILIEN SE	2,475	68.05	168,423.75	
VONOVIA SE	25,579	27.35	699,585.65	
ユーロ小計	6,776,524		224,405,039.70 (40,971,872,147)	
合計	37,780,569		419,964,440,309 (419,964,440,309)	

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

## 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE	5,100.00	272,340.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	11,700.00	361,179.00	
		AMERICAN TOWER CORP	16,192.00	2,992,119.68	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	21,850.00	502,113.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,915.00	872,756.55	
		BXP INC	4,850.00	301,767.00	
		CROWN CASTLE INC	15,166.00	1,311,404.02	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,800.00	2,087,420.00	
		EQUINIX INC	3,397.00	3,118,547.91	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,500.00	436,475.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	12,143.00	765,616.15	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,157.00	548,805.51	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	7,200.00	1,051,848.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	9,600.00	454,560.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	22,500.00	383,850.00	
		INVITATION HOMES INC	19,500.00	500,760.00	
		IRON MOUNTAIN INC	9,857.00	1,066,034.55	
		KIMCO REALTY CORP	22,700.00	512,339.00	
		MID AMERICA APARTMENT COMM	3,937.00	531,770.59	
		PROLOGIS INC	32,128.00	4,467,077.12	
		PUBLIC STORAGE	5,490.00	1,638,765.00	
		REALTY INCOME CORP	31,738.00	2,078,839.00	
		REGENCY CENTERS CORP	5,800.00	439,698.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,700.00	733,673.00	
		SIMON PPTY (SIMON DEBART	11,280.00	2,252,841.60	
		SUN COMMUNITIES INC	4,400.00	568,832.00	
		UDR INC	11,100.00	418,803.00	
		VENTAS INC COM	15,800.00	1,350,584.00	
	VICI PROPERTIES INC	35,900.00	1,072,333.00		
	WELLTOWER INC	23,191.00	4,823,959.91		
	WEYERHAEUSER CO	24,160.00	617,288.00		
	WP CAREY INC	7,700.00	552,860.00		
		アメリカ・ドル小計	423,451.00	39,087,259.59 (6,064,388,324)	
オーストラリア・ドル	GOODMAN GROUP	71,041.00	2,118,442.62		
	SCENTRE GROUP	182,754.00	692,637.66		
	STOCKLAND	82,953.00	417,253.59		
	VINCINITY CENTERS	135,558.00	348,384.06		
	オーストラリア・ドル小計	472,306.00	3,576,717.93 (391,507,545)		
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	25,300.00	167,106.50		
	SEGRO PLC	43,856.00	350,058.59		

イギリス・ポンド小計		69,156.00	517,165.09 (108,025,444)	
香港・ドル	LINK REIT	91,524.00	3,397,370.88	
香港・ドル小計		91,524.00	3,397,370.88 (67,437,812)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,585.00	372,793.65	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	207,982.00	503,316.44	
シンガポール・ドル小計		346,567.00	876,110.09 (107,165,786)	
ユーロ	COVIVIO	1,785.00	104,868.75	
	GECINA SA	1,664.00	125,132.80	
	KLEPIERRE	7,607.00	264,419.32	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,147.00	426,311.60	
ユーロ小計		15,203.00	920,732.47 (168,107,334)	
投資証券合計			6,906,632,246 (6,906,632,246)	
合 計			6,906,632,246 (6,906,632,246)	

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

3. 投資証券における券面総額は、証券数です。

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の合計 額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 527銘柄	98.1%		73.8%
	投資証券 32銘柄		1.9%	1.4%
カナダ・ドル	株式 83銘柄	100.0%		3.7%
オーストラリア・ドル	株式 45銘柄	94.9%		1.7%
	投資証券 4銘柄		5.1%	0.1%
イギリス・ポンド	株式 75銘柄	99.4%		4.2%
	投資証券 2銘柄		0.6%	0.0%
スイス・フラン	株式 41銘柄	100.0%		2.7%
香港・ドル	株式 22銘柄	96.9%		0.5%
	投資証券 1銘柄		3.1%	0.0%
シンガポール・ドル	株式 12銘柄	93.6%		0.4%
	投資証券 2銘柄		6.4%	0.0%
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	100.0%		0.0%
スウェーデン・クローナ	株式 41銘柄	100.0%		1.0%
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%		0.5%
イスラエル・シェケル	株式 11銘柄	100.0%		0.2%
ユーロ	株式 222銘柄	99.6%		9.6%
	投資証券 4銘柄		0.4%	0.0%

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

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### (1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2025年2月20日現在)	(2026年2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		336,844,128	366,410,165
金銭信託		32,537	336,645
コール・ローン		9,997,224	121,596,597
国債証券		84,627,332,672	86,253,508,534
派生商品評価勘定		98,760	1,081,875
未収利息		633,812,922	694,322,324
前払費用		47,001,990	31,802,215
流動資産合計		85,655,120,233	87,469,058,355
資産合計		85,655,120,233	87,469,058,355
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,870	18,026
未払金		7,099,323	78,533,893
未払解約金		13,631,485	34,670,045
流動負債合計		20,733,678	113,221,964
負債合計		20,733,678	113,221,964
純資産の部			
元本等			
元本	1	28,704,560,795	25,867,682,996
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		56,929,825,760	61,488,153,395
元本等合計		85,634,386,555	87,355,836,391
純資産合計		85,634,386,555	87,355,836,391
負債純資産合計		85,655,120,233	87,469,058,355

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

#### (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

（2025年2月20日現在）	（2026年2月20日現在）
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	（2025年2月20日現在）	（2026年2月20日現在）
1 期首元本額	32,087,499,983円	28,704,560,795円
期中追加設定元本額	4,703,861,796円	4,256,669,089円
期中一部解約元本額	8,086,800,984円	7,093,546,888円
元本の内訳 ファンド名		
ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン	6,274,107,523円	6,034,771,137円
ステート・ストリートDCグローバル債券インデックス・オープン	31,298,065円	28,122,944円
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	867,750,986円	711,905,094円
外国債券インデックス・ファンド / 為替ヘッジ付き（年金1）＜適格機関投資家限定＞	1,412,131,120円	1,576,372,505円
外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	400,186,300円	320,123,668円

バランスファンドVA30A<適格機関投資家限定>	1,337,953円	1,277,503円
バランスファンドVA30B<適格機関投資家限定>	40,536,967円	32,690,979円
バランスファンドVA40A<適格機関投資家限定>	77,986円	76,139円
バランスファンドVA40B<適格機関投資家限定>	1,912,039円	1,891,366円
バランスファンドVA50A<適格機関投資家限定>	1,426,151円	1,153,677円
バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	4,813,619,474円	4,381,282,415円
外国債券インデックス・ファンドVA1<適格機関投資家限定>	53,284,689円	46,842,057円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	850,933円	4,598円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	1,052,443,546円	801,740,996円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	804,372,828円	727,316,639円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	19,133,965円	14,851,020円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	338,322,539円	240,262,394円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	2,429,196,220円	2,117,297,187円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	389,251,122円	250,932,276円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	1,454,582,343円	1,229,041,857円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	53,146,648円	47,533,555円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	56,274,450円	53,589,791円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	44,337,599円	36,449,941円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	20,127,578円	15,933,740円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	345,886,044円	287,107,006円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	980,231円	686,788円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	310,462円	269,989円
外国債券インデックス・ファンドVA3<適格機関投資家限定>	530,821,556円	564,363,165円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	593,682,305円	520,876,953円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	896,046,559円	739,612,608円

外国債券インデックス・ファンドA / 為替ヘッジ付き＜適格機関投資家限定＞	164,446,229円	151,212,781円
4資産インデックスバランスVA50 ＜適格機関投資家限定＞	45,688,841円	52,989,153円
Tadリスクバジェット型マルチ配分 戦略ファンド（ステイブル）年金＜適 格機関投資家限定＞	182,418,457円	166,349,449円
債券マルチ・ファクター戦略ファンド （年金）＜適格機関投資家限定＞	286,731,255円	260,164,626円
フレックス資産配分戦略ファンド＜適 格機関投資家限定＞	376,515,782円	325,223,938円
Tadリスクバジェット型マルチ配分 戦略ファンド（ステイブル）＜適格機 関投資家限定＞	179,819,666円	163,149,453円
ステート・ストリート先進国債券イン デックス・オープン	207,304,041円	170,857,966円
ステート・ストリート先進国債券イン デックス・オープン（為替ヘッジあ り）	2,177,406,453円	2,074,341,602円
世界国債タームスプレッド・プレミア 戦略ファンド/為替ヘッジ付＜適格機 関投資家限定＞	1,499,001,652円	1,054,116,618円
ステート・ストリート・グローバル債 券インデックス・オープン（隔月分配 型）	9,696,520円	133,221,111円
世界バランス40VA＜適格機関投資 家限定＞	3,921,897円	3,777,754円
世界バランス60VA＜適格機関投資 家限定＞	6,344,125円	6,355,612円
グローバルバランス40VA＜適格機 関投資家限定＞	593,350円	567,859円
グローバルバランス40VA2＜適格 機関投資家限定＞	603,659,197円	497,690,960円
グローバルバランス40VA3＜適格 機関投資家限定＞	24,996,942円	18,553,521円
グローバルバランス50VA＜適格機 関投資家限定＞	8,580,207円	4,730,606円
計	28,704,560,795円	25,867,682,996円
2 受益権の総数	28,704,560,795口	25,867,682,996口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組 方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
--------------------	---

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	(2025年2月20日現在)	(2026年2月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	同左
---------------------------	---	----

## (有価証券関係に関する注記)

## 売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(2025年2月20日現在)	(2026年2月20日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	520,628,655	1,389,513,278
合計	520,628,655	1,389,513,278

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

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## 通貨関連

(単位：円)

区 分	種 類	(2025年2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	15,210,000		15,111,240	98,760
	ユーロ	7,874,200		7,877,070	2,870
合 計		23,084,200		22,988,310	95,890

(単位：円)

区 分	種 類	(2026年2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	中国・オフショア人民元	83,196,900		84,278,775	1,081,875
	売建				
	アメリカ・ドル	32,568,501		32,570,391	1,890
	イギリス・ポンド	10,435,889		10,440,325	4,436
	ユーロ	32,847,588		32,859,288	11,700
合 計		159,048,878		160,148,779	1,063,849

(注) 1 . 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

- 2．換算において円未満の端数は切り捨てております。
- 3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
- 4．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当する事項はありません。

( 1口当たり情報に関する注記 )

	( 2025年2月20日現在 )	( 2026年2月20日現在 )
1口当たり純資産額	2.9833円	3.3770円
( 1万口当たり純資産額 )	( 29,833円 )	( 33,770円 )

( 3 ) 附属明細表

第 1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

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

国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY N/B 0.38% 27/07/31	3,300,000.00	3,156,398.45	
		US TREASURY N/B 0.38% 27/09/30	3,800,000.00	3,616,828.14	
		US TREASURY N/B 0.5% 27/06/30	2,000,000.00	1,920,937.50	
		US TREASURY N/B 0.5% 27/10/31	1,650,000.00	1,569,755.86	
		US TREASURY N/B 0.63% 27/11/30	4,300,000.00	4,090,878.91	
		US TREASURY N/B 0.63% 27/12/31	2,950,000.00	2,800,080.08	
		US TREASURY N/B 0.63% 30/05/15	1,850,000.00	1,635,226.56	
		US TREASURY N/B 0.63% 30/08/15	2,700,000.00	2,367,773.42	
		US TREASURY N/B 0.88% 30/11/15	2,600,000.00	2,290,234.38	
		US TREASURY N/B 1.13% 27/02/28	2,600,000.00	2,537,335.94	
		US TREASURY N/B 1.13% 31/02/15	2,750,000.00	2,437,832.04	
		US TREASURY N/B 1.13% 40/05/15	250,000.00	162,187.50	
		US TREASURY N/B 1.13% 40/08/15	900,000.00	578,003.90	
		US TREASURY N/B 1.25% 28/03/31	1,700,000.00	1,623,699.22	
		US TREASURY N/B 1.25% 28/05/31	2,800,000.00	2,664,703.13	
		US TREASURY N/B 1.25% 28/06/30	2,600,000.00	2,470,000.00	
		US TREASURY N/B 1.25% 28/09/30	600,000.00	566,742.18	
		US TREASURY N/B 1.25% 31/08/15	3,700,000.00	3,251,230.47	
		US TREASURY N/B 1.25% 50/05/15	1,100,000.00	543,769.53	
		US TREASURY N/B 1.38% 28/10/31	1,400,000.00	1,324,367.18	
		US TREASURY N/B 1.38% 31/11/15	1,200,000.00	1,054,265.62	
		US TREASURY N/B 1.38% 40/11/15	800,000.00	530,937.50	
		US TREASURY N/B 1.38% 50/08/15	1,200,000.00	609,515.62	
		US TREASURY N/B 1.5% 27/01/31	2,500,000.00	2,452,539.05	
		US TREASURY N/B 1.5% 28/11/30	2,400,000.00	2,274,468.74	
		US TREASURY N/B 1.63% 29/08/15	4,400,000.00	4,128,093.72	
		US TREASURY N/B 1.63% 31/05/15	3,750,000.00	3,384,375.00	
		US TREASURY N/B 1.63% 50/11/15	600,000.00	324,890.62	
		US TREASURY N/B 1.75% 29/01/31	3,800,000.00	3,614,750.00	
		US TREASURY N/B 1.75% 29/11/15	2,150,000.00	2,016,044.91	
		US TREASURY N/B 1.88% 32/02/15	2,750,000.00	2,472,851.56	
		US TREASURY N/B 1.88% 41/02/15	950,000.00	678,062.50	
		US TREASURY N/B 1.88% 51/02/15	1,850,000.00	1,065,339.85	
		US TREASURY N/B 1.88% 51/11/15	2,400,000.00	1,367,250.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 41/11/15	600,000.00	428,062.50	
		US TREASURY N/B 2.0% 50/02/15	1,000,000.00	603,750.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 51/08/15	1,600,000.00	944,500.00	
		US TREASURY N/B 2.25% 27/02/15	3,300,000.00	3,258,833.78	
		US TREASURY N/B 2.25% 27/08/15	2,000,000.00	1,964,218.76	
		US TREASURY N/B 2.25% 27/11/15	2,600,000.00	2,546,273.44	
		US TREASURY N/B 2.25% 41/05/15	650,000.00	488,210.93	
US TREASURY N/B 2.25% 46/08/15	400,000.00	270,265.62			
US TREASURY N/B 2.25% 49/08/15	1,000,000.00	644,414.06			
US TREASURY N/B 2.25% 52/02/15	1,900,000.00	1,186,535.16			
US TREASURY N/B 2.38% 27/05/15	4,000,000.00	3,944,687.52			
US TREASURY N/B 2.38% 29/05/15	3,000,000.00	2,895,703.14			
US TREASURY N/B 2.38% 49/11/15	1,700,000.00	1,122,000.00			

US TREASURY N/B 2.38% 51/05/15	2,600,000.00	1,685,023.44	
US TREASURY N/B 2.5% 45/02/15	750,000.00	544,423.83	
US TREASURY N/B 2.5% 46/05/15	500,000.00	355,976.56	
US TREASURY N/B 2.63% 27/05/31	1,800,000.00	1,779,960.94	
US TREASURY N/B 2.63% 29/02/15	3,600,000.00	3,510,703.11	
US TREASURY N/B 2.75% 28/02/15	2,300,000.00	2,268,195.32	
US TREASURY N/B 2.75% 32/08/15	1,400,000.00	1,315,015.63	
US TREASURY N/B 2.75% 42/08/15	800,000.00	631,468.75	
US TREASURY N/B 2.75% 42/11/15	500,000.00	392,617.19	
US TREASURY N/B 2.75% 47/08/15	500,000.00	366,503.90	
US TREASURY N/B 2.75% 47/11/15	1,000,000.00	730,625.00	
US TREASURY N/B 2.88% 28/05/15	3,400,000.00	3,356,437.50	
US TREASURY N/B 2.88% 28/08/15	1,500,000.00	1,478,554.68	
US TREASURY N/B 2.88% 32/05/15	3,250,000.00	3,085,595.69	
US TREASURY N/B 2.88% 43/05/15	300,000.00	238,089.84	
US TREASURY N/B 2.88% 45/08/15	900,000.00	691,769.52	
US TREASURY N/B 2.88% 46/11/15	800,000.00	605,875.00	
US TREASURY N/B 2.88% 49/05/15	500,000.00	367,890.62	
US TREASURY N/B 2.88% 52/05/15	1,500,000.00	1,076,601.57	
US TREASURY N/B 3.0% 42/05/15	500,000.00	411,015.62	
US TREASURY N/B 3.0% 45/05/15	400,000.00	315,062.50	
US TREASURY N/B 3.0% 45/11/15	600,000.00	469,664.06	
US TREASURY N/B 3.0% 47/02/15	900,000.00	694,828.12	
US TREASURY N/B 3.0% 47/05/15	500,000.00	384,765.62	
US TREASURY N/B 3.0% 48/02/15	550,000.00	419,697.26	
US TREASURY N/B 3.0% 48/08/15	800,000.00	607,500.00	
US TREASURY N/B 3.0% 49/02/15	1,200,000.00	906,609.37	
US TREASURY N/B 3.0% 52/08/15	1,800,000.00	1,324,265.61	
US TREASURY N/B 3.13% 27/08/31	3,200,000.00	3,182,249.98	
US TREASURY N/B 3.13% 28/11/15	1,700,000.00	1,683,796.87	
US TREASURY N/B 3.13% 41/11/15	950,000.00	801,339.83	
US TREASURY N/B 3.13% 42/02/15	900,000.00	755,824.22	
US TREASURY N/B 3.13% 43/02/15	700,000.00	578,839.84	
US TREASURY N/B 3.13% 44/08/15	400,000.00	324,218.75	
US TREASURY N/B 3.13% 48/05/15	1,350,000.00	1,051,154.29	
US TREASURY N/B 3.25% 29/06/30	2,200,000.00	2,180,234.36	
US TREASURY N/B 3.38% 27/12/31	1,400,000.00	1,397,375.00	
US TREASURY N/B 3.38% 33/05/15	1,900,000.00	1,840,328.12	
US TREASURY N/B 3.38% 42/08/15	700,000.00	603,941.40	
US TREASURY N/B 3.38% 48/11/15	1,470,000.00	1,191,274.21	
US TREASURY N/B 3.5% 27/10/31	1,500,000.00	1,500,175.78	
US TREASURY N/B 3.5% 28/01/31	1,900,000.00	1,900,964.83	
US TREASURY N/B 3.5% 29/01/15	1,500,000.00	1,500,000.00	
US TREASURY N/B 3.5% 29/09/30	2,300,000.00	2,295,597.66	
US TREASURY N/B 3.5% 33/02/15	1,800,000.00	1,761,539.05	
US TREASURY N/B 3.5% 39/02/15	1,000,000.00	924,414.06	
US TREASURY N/B 3.63% 27/08/31	600,000.00	601,101.56	

US TREASURY N/B 3.63% 28/03/31	2,500,000.00	2,507,812.50	
US TREASURY N/B 3.63% 30/09/30	2,300,000.00	2,299,371.08	
US TREASURY N/B 3.63% 43/08/15	300,000.00	264,574.21	
US TREASURY N/B 3.63% 44/02/15	400,000.00	351,062.50	
US TREASURY N/B 3.63% 53/02/15	1,100,000.00	912,957.03	
US TREASURY N/B 3.75% 27/04/30	2,000,000.00	2,005,078.12	
US TREASURY N/B 3.75% 28/04/15	600,000.00	603,351.56	
US TREASURY N/B 3.75% 31/08/31	2,500,000.00	2,504,296.87	
US TREASURY N/B 3.75% 32/10/31	1,450,000.00	1,443,089.85	
US TREASURY N/B 3.75% 41/08/15	800,000.00	734,781.24	
US TREASURY N/B 3.75% 43/11/15	700,000.00	626,500.00	
US TREASURY N/B 3.88% 27/07/31	2,100,000.00	2,110,910.15	
US TREASURY N/B 3.88% 27/10/15	1,600,000.00	1,609,687.50	
US TREASURY N/B 3.88% 30/04/30	1,800,000.00	1,819,054.69	
US TREASURY N/B 3.88% 30/06/30	2,500,000.00	2,526,464.85	
US TREASURY N/B 3.88% 30/07/31	500,000.00	505,292.97	
US TREASURY N/B 3.88% 32/09/30	500,000.00	501,562.50	
US TREASURY N/B 3.88% 32/12/31	3,000,000.00	3,006,093.75	
US TREASURY N/B 3.88% 33/08/15	1,800,000.00	1,798,031.25	
US TREASURY N/B 3.88% 34/08/15	2,100,000.00	2,084,988.27	
US TREASURY N/B 3.88% 40/08/15	900,000.00	848,039.05	
US TREASURY N/B 3.88% 43/05/15	800,000.00	732,375.00	
US TREASURY N/B 4.0% 28/06/30	2,300,000.00	2,327,671.87	
US TREASURY N/B 4.0% 29/07/31	1,000,000.00	1,014,843.75	
US TREASURY N/B 4.0% 30/03/31	2,000,000.00	2,030,546.88	
US TREASURY N/B 4.0% 30/05/31	1,600,000.00	1,624,812.49	
US TREASURY N/B 4.0% 34/02/15	2,150,000.00	2,159,826.16	
US TREASURY N/B 4.0% 35/11/15	1,050,000.00	1,044,421.86	
US TREASURY N/B 4.0% 42/11/15	300,000.00	280,218.75	
US TREASURY N/B 4.0% 52/11/15	1,800,000.00	1,599,609.38	
US TREASURY N/B 4.13% 27/01/31	1,000,000.00	1,005,156.25	
US TREASURY N/B 4.13% 31/07/31	3,200,000.00	3,266,000.00	
US TREASURY N/B 4.13% 31/10/31	2,000,000.00	2,039,921.88	
US TREASURY N/B 4.13% 31/11/30	1,300,000.00	1,325,847.65	
US TREASURY N/B 4.13% 32/02/29	1,600,000.00	1,631,000.00	
US TREASURY N/B 4.13% 32/05/31	1,000,000.00	1,018,750.00	
US TREASURY N/B 4.13% 32/11/15	2,000,000.00	2,034,687.50	
US TREASURY N/B 4.13% 44/08/15	200,000.00	187,515.62	
US TREASURY N/B 4.13% 53/08/15	1,050,000.00	952,218.75	
US TREASURY N/B 4.25% 28/01/15	600,000.00	608,414.06	
US TREASURY N/B 4.25% 28/02/15	2,100,000.00	2,130,843.75	
US TREASURY N/B 4.25% 29/02/28	4,400,000.00	4,492,468.72	
US TREASURY N/B 4.25% 29/06/30	1,500,000.00	1,533,808.59	
US TREASURY N/B 4.25% 30/01/31	1,900,000.00	1,946,312.50	
US TREASURY N/B 4.25% 34/11/15	2,200,000.00	2,240,820.31	
US TREASURY N/B 4.25% 35/05/15	2,800,000.00	2,847,031.26	
US TREASURY N/B 4.25% 35/08/15	2,550,000.00	2,590,640.62	

US TREASURY N/B 4.25% 39/05/15	500,000.00	497,265.62	
US TREASURY N/B 4.25% 40/11/15	1,000,000.00	980,898.44	
US TREASURY N/B 4.25% 54/08/15	850,000.00	787,179.68	
US TREASURY N/B 4.38% 27/07/15	1,200,000.00	1,214,156.25	
US TREASURY N/B 4.38% 28/11/30	350,000.00	358,052.73	
US TREASURY N/B 4.38% 29/12/31	2,900,000.00	2,982,695.29	
US TREASURY N/B 4.38% 30/11/30	1,200,000.00	1,237,968.74	
US TREASURY N/B 4.38% 34/05/15	1,000,000.00	1,029,570.31	
US TREASURY N/B 4.38% 38/02/15	400,000.00	408,359.37	
US TREASURY N/B 4.38% 39/11/15	750,000.00	751,230.46	
US TREASURY N/B 4.38% 40/05/15	500,000.00	499,238.28	
US TREASURY N/B 4.38% 43/08/15	600,000.00	584,460.93	
US TREASURY N/B 4.5% 29/05/31	600,000.00	617,835.93	
US TREASURY N/B 4.5% 31/12/31	900,000.00	935,472.65	
US TREASURY N/B 4.5% 33/11/15	2,150,000.00	2,234,236.33	
US TREASURY N/B 4.5% 36/02/15	520,000.00	540,860.93	
US TREASURY N/B 4.5% 38/05/15	300,000.00	309,105.46	
US TREASURY N/B 4.5% 54/11/15	700,000.00	675,910.15	
US TREASURY N/B 4.63% 28/09/30	1,800,000.00	1,850,765.61	
US TREASURY N/B 4.63% 31/04/30	1,500,000.00	1,566,621.09	
US TREASURY N/B 4.63% 35/02/15	2,000,000.00	2,092,109.38	
US TREASURY N/B 4.63% 45/11/15	500,000.00	498,203.12	
US TREASURY N/B 4.63% 54/05/15	400,000.00	394,187.50	
US TREASURY N/B 4.63% 55/02/15	1,100,000.00	1,084,445.31	
US TREASURY N/B 4.63% 55/11/15	1,250,000.00	1,233,398.42	
US TREASURY N/B 4.75% 41/02/15	700,000.00	724,117.18	
US TREASURY N/B 4.75% 43/11/15	250,000.00	254,882.81	
US TREASURY N/B 4.75% 45/02/15	400,000.00	405,859.37	
US TREASURY N/B 4.75% 53/11/15	1,050,000.00	1,055,291.01	
US TREASURY N/B 4.75% 55/05/15	1,020,000.00	1,026,175.78	
US TREASURY N/B 4.75% 55/08/15	900,000.00	906,046.87	
US TREASURY N/B 4.88% 45/08/15	250,000.00	257,460.93	
US TREASURY N/B 5.0% 37/05/15	300,000.00	324,269.53	
US TREASURY N/B 5.0% 45/05/15	150,000.00	156,966.79	
US TREASURY N/B 5.38% 31/02/15	500,000.00	538,769.53	
US TREASURY N/B 6.13% 27/11/15	300,000.00	313,289.06	
US TREASURY N/B 6.25% 30/05/15	1,400,000.00	1,543,882.81	
アメリカ・ドル小計	270,710,000.00	252,567,933.24	(39,185,914,841)

カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.0% 27/06/01	1,200,000.00	1,179,936.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 30/06/01	1,440,000.00	1,354,824.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 31/06/01	1,500,000.00	1,402,065.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 53/12/01	570,000.00	376,804.20	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 28/06/01	550,000.00	544,225.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 32/06/01	1,010,000.00	955,641.80	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 51/12/01	670,000.00	480,731.70	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 28/02/01	280,000.00	278,986.40	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 27/05/01	1,400,000.00	1,406,790.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 33/06/01	750,000.00	736,410.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 48/12/01	430,000.00	369,881.70	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 55/12/01	600,000.00	496,314.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 64/12/01	530,000.00	425,992.80	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 27/02/01	1,400,000.00	1,409,170.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 34/06/01	870,000.00	863,379.30	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 35/06/01	980,000.00	985,037.20	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 35/12/01	350,000.00	350,672.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 29/09/01	300,000.00	308,571.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 45/12/01	230,000.00	227,021.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 29/03/01	200,000.00	208,136.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 37/06/01	500,000.00	578,735.00		
CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 29/06/01	410,000.00	449,954.50		
CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/06/01	700,000.00	823,235.00		
カナダ・ドル小計	16,870,000.00	16,212,514.10 (1,837,526,347)		

オーストラ リア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.0% 30/12/21	730,000.00	622,901.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.0% 31/11/21	410,000.00	338,475.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 32/05/21	2,000,000.00	1,648,120.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 51/06/21	350,000.00	178,122.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 28/05/21	800,000.00	765,528.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.5% 30/05/21	250,000.00	232,042.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 27/11/21	820,000.00	799,344.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 35/06/21	640,000.00	544,076.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 41/05/21	280,000.00	212,889.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 47/03/21	170,000.00	122,282.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 29/04/21	370,000.00	358,359.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 39/06/21	350,000.00	292,649.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 34/05/21	200,000.00	187,412.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 37/04/21	350,000.00	317,446.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 34/06/21	450,000.00	436,779.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 36/03/21	470,000.00	450,208.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 36/10/21	300,000.00	286,080.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 33/04/21	1,780,000.00	1,770,441.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 27/04/21	260,000.00	261,541.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 37/10/21	180,000.00	178,290.00	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 54/06/21	300,000.00	277,455.00		
オーストラリア・ドル小計	11,460,000.00	10,280,445.80 (1,125,297,596)		

イギリス・ bond	UK GILT BOND 0.25% 31/07/31	1,610,000.00	1,330,395.49	
	UK GILT BOND 0.38% 30/10/22	450,000.00	386,046.84	
	UK GILT BOND 0.88% 29/10/22	770,000.00	698,117.72	
	UK GILT BOND 0.88% 33/07/31	1,200,000.00	949,778.71	
	UK GILT BOND 1.13% 39/01/31	1,150,000.00	754,796.57	
	UK GILT BOND 1.25% 27/07/22	1,100,000.00	1,066,366.45	
	UK GILT BOND 1.25% 41/10/22	100,000.00	60,630.92	
	UK GILT BOND 1.63% 28/10/22	930,000.00	885,732.94	
	UK GILT BOND 1.63% 71/10/22	950,000.00	385,412.95	
	UK GILT BOND 1.75% 37/09/07	1,050,000.00	785,105.85	
	UK GILT BOND 1.75% 49/01/22	700,000.00	383,460.18	
	UK GILT BOND 1.75% 57/07/22	570,000.00	269,628.95	
	UK GILT BOND 2.5% 65/07/22	690,000.00	386,193.91	
	UK GILT BOND 3.25% 33/01/31	1,160,000.00	1,099,425.83	
	UK GILT BOND 3.25% 44/01/22	450,000.00	355,927.86	
	UK GILT BOND 3.5% 45/01/22	620,000.00	503,529.63	
	UK GILT BOND 3.5% 68/07/22	650,000.00	471,185.00	
	UK GILT BOND 3.75% 27/03/07	990,000.00	992,021.55	
	UK GILT BOND 3.75% 52/07/22	470,000.00	375,573.55	
	UK GILT BOND 4.0% 29/05/22	550,000.00	554,938.27	
	UK GILT BOND 4.0% 31/10/22	150,000.00	150,327.78	
	UK GILT BOND 4.0% 60/01/22	700,000.00	572,888.40	
	UK GILT BOND 4.25% 27/12/07	600,000.00	607,917.60	
	UK GILT BOND 4.25% 32/06/07	1,000,000.00	1,016,285.17	
	UK GILT BOND 4.25% 34/07/31	180,000.00	179,380.43	
	UK GILT BOND 4.25% 36/03/07	350,000.00	343,716.04	
	UK GILT BOND 4.25% 39/09/07	780,000.00	741,428.68	
	UK GILT BOND 4.25% 40/12/07	550,000.00	516,341.49	
	UK GILT BOND 4.25% 46/12/07	730,000.00	652,317.23	
	UK GILT BOND 4.25% 49/12/07	650,000.00	572,698.58	
	UK GILT BOND 4.25% 55/12/07	730,000.00	630,317.30	
	UK GILT BOND 4.38% 28/03/07	150,000.00	152,308.62	
	UK GILT BOND 4.38% 30/03/07	220,000.00	224,846.42	
	UK GILT BOND 4.38% 54/07/31	290,000.00	255,673.76	
	UK GILT BOND 4.5% 34/09/07	950,000.00	964,719.04	
UK GILT BOND 4.5% 35/03/07	510,000.00	515,023.96		
UK GILT BOND 4.5% 42/12/07	510,000.00	484,164.45		
UK GILT BOND 4.75% 30/12/07	800,000.00	834,476.59		
UK GILT BOND 4.75% 35/10/22	200,000.00	204,856.18		
UK GILT BOND 4.75% 38/12/07	600,000.00	603,917.74		
UK GILT BOND 4.75% 43/10/22	260,000.00	252,029.93		
UK GILT BOND 5.25% 41/01/31	70,000.00	72,912.39		
UK GILT BOND 6.0% 28/12/07	750,000.00	799,154.66		
イギリス・bond小計	27,890,000.00	24,041,971.61 (5,021,887,030)		

シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 1.88% 51/10/01	150,000.00	143,685.13	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.38% 39/07/01	180,000.00	188,116.10	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 42/04/01	175,000.00	192,140.39	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 46/03/01	150,000.00	166,521.75	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.88% 30/09/01	525,000.00	555,754.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.0% 29/04/01	160,000.00	167,399.46	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.0% 72/08/01	160,000.00	196,131.41	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.25% 54/06/01	50,000.00	61,728.25	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.38% 33/09/01	300,000.00	333,847.27	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.38% 34/05/01	290,000.00	324,618.61	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.5% 27/03/01	365,000.00	373,132.01	
シンガポール・ドル小計		2,505,000.00	2,703,074.88 (330,640,118)	

マレーシア・リングット	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.48% 35/07/02	500,000.00	498,043.70	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 27/05/31	1,000,000.00	1,007,014.46	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.58% 32/07/15	300,000.00	302,422.08	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.73% 28/06/15	650,000.00	659,494.11	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.76% 40/05/22	200,000.00	198,046.21	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.77% 41/01/15	130,000.00	129,423.94	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.92% 55/07/15	150,000.00	146,963.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.07% 50/06/15	950,000.00	957,694.14	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 30/04/15	1,500,000.00	1,569,572.04	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.64% 33/11/07	3,350,000.00	3,602,880.07	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.74% 46/03/15	1,100,000.00	1,213,897.08	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.92% 48/07/06	450,000.00	511,039.65	
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.94% 43/09/30	230,000.00	258,842.40		
マレーシア・リングット小計		10,510,000.00	11,055,333.68 (438,835,943)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	400,000.00	408,210.91	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	250,000.00	234,738.78	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	60,000.00	59,323.48	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	103,440.63	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1,250,000.00	1,114,252.30	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	530,000.00	537,844.59	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	290,000.00	195,616.84	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	105,000.00	71,131.90	
NEW ZEALAND GOVERNMENT	70,000.00	69,772.17		
ニュージーランド・ドル小計		3,055,000.00	2,794,331.60 (258,559,503)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT BOND 0.13% 31/05/12	1,550,000.00	1,392,687.40	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/05/12	3,050,000.00	2,976,516.89	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 0.75% 29/11/12	1,000,000.00	954,376.25	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 2.25% 35/05/11	320,000.00	311,004.73	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.5% 39/03/30	2,980,000.00	3,203,663.90	

スウェーデン・クローナ小計		8,900,000.00	8,838,249.17 (151,222,442)	
ノル ウェー・ク ローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.38% 30/08/19	750,000.00	669,385.12	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 27/02/17	1,360,000.00	1,331,023.16	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 29/09/06	1,700,000.00	1,574,001.28	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 28/04/26	600,000.00	575,664.76	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 2.13% 32/05/18	1,470,000.00	1,314,179.97	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 33/08/15	1,050,000.00	975,237.37	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 42/10/06	990,000.00	903,741.30	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.63% 34/04/13	1,270,000.00	1,223,702.15	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 35/06/12	550,000.00	531,217.38	
ノルウェー・クローネ小計		9,740,000.00	9,098,152.49 (147,935,958)	
デンマー ク・クロ ーネ	DANISH GOVERNMENT BOND 0.0% 31/11/15	280,000.00	246,831.20	
	DANISH GOVERNMENT BOND 0.25% 52/11/15	1,580,000.00	771,752.58	
	DANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 27/11/15	1,540,000.00	1,507,649.99	
	DANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/11/15	1,700,000.00	1,606,830.37	
	DANISH GOVERNMENT BOND 2.25% 35/11/15	450,000.00	436,695.18	
	DANISH GOVERNMENT BOND 4.5% 39/11/15	2,360,000.00	2,809,525.72	
デンマーク・クローネ小計		7,910,000.00	7,379,285.04 (180,349,725)	

メキシコ・ペソ	MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 36/11/20	7,200,000.00	7,838,285.76	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.5% 27/06/03	18,400,000.00	18,516,023.59	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.5% 33/05/26	3,500,000.00	3,325,091.42	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 31/05/29	11,500,000.00	11,302,460.59	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 34/11/23	3,500,000.00	3,323,757.78	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 42/11/13	6,300,000.00	5,511,644.39	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 36/02/21	1,500,000.00	1,425,000.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 47/11/07	8,100,000.00	7,157,254.36	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 53/07/31	7,800,000.00	6,845,440.29	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 29/05/31	17,200,000.00	17,565,200.20	
MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 38/11/18	7,000,000.00	6,719,118.00		
メキシコ・ペソ小計		92,000,000.00	89,529,276.38 (804,948,771)	
イスラエル・シェケル	ISRAEL FIXED BOND	1,000,000.00	1,003,106.99	
	ISRAEL FIXED BOND	1,540,000.00	1,510,942.18	
	ISRAEL FIXED BOND	940,000.00	862,795.87	
	ISRAEL FIXED BOND	700,000.00	824,936.93	
	ISRAEL FIXED BOND	545,000.00	533,722.08	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3	470,000.00	417,431.73	
	ISRAEL FIXED BOND 2.8	600,000.00	460,514.88	
	ISRAEL FIXED BOND 4	1,160,000.00	1,229,232.04	
ISRAEL FIXED BOND 4.6	250,000.00	265,126.61		
イスラエル・シェケル小計		7,205,000.00	7,107,809.31 (351,400,140)	

ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 1.25% 30/10/25	2,080,000.00	1,828,988.84	
	POLAND GOVERNMENT BOND 1.75% 32/04/25	500,000.00	429,127.65	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5% 27/07/25	2,110,000.00	2,087,671.59	
	POLAND GOVERNMENT BOND 4.5% 30/07/25	750,000.00	761,644.10	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.0% 30/01/25	1,030,000.00	1,067,085.64	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.0% 34/10/25	1,840,000.00	1,863,633.70	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.0% 35/10/25	580,000.00	583,556.95	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 29/04/25	4,520,000.00	4,779,472.18	
	POLAND GOVERNMENT BOND 6.0% 33/10/25	840,000.00	910,926.43	
ポーランド・ズロチ小計		14,250,000.00	14,312,107.08 (618,745,307)	

中国・人民 元	CHINA GOVERNMENT BOND	20,400,000.00	20,615,849.95	
	CHINA GOVERNMENT BOND	21,300,000.00	21,367,912.27	
	CHINA GOVERNMENT BOND	18,000,000.00	18,265,523.58	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,021,519.70	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,000,000.00	12,320,024.64	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,100,000.00	7,118,057.43	
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	20,061,872.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,300,000.00	21,181,440.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,700,000.00	11,042,547.87	
	CHINA GOVERNMENT BOND	26,600,000.00	27,384,770.49	
	CHINA GOVERNMENT BOND	28,600,000.00	29,900,311.87	
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,900,000.00	21,241,422.81	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,700,000.00	6,690,110.46	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,000,000.00	8,393,710.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,300,000.00	5,313,937.45	
	CHINA GOVERNMENT BOND	13,000,000.00	13,633,266.40	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,500,000.00	2,498,911.30	
	CHINA GOVERNMENT BOND	18,300,000.00	19,766,175.13	
	CHINA GOVERNMENT BOND	13,500,000.00	13,891,349.74	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,484,164.83	
	CHINA GOVERNMENT BOND	17,300,000.00	18,613,851.96	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,074,975.46	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,000,868.76	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,500,000.00	10,305,727.01	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,628,362.63	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,500,000.00	9,009,075.62	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,437,932.98	
	CHINA GOVERNMENT BOND	14,350,000.00	14,791,131.34	
	CHINA GOVERNMENT BOND	13,800,000.00	13,640,279.49	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,700,000.00	12,586,240.51	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,400,000.00	10,337,984.48	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	4,996,014.35	
CHINA GOVERNMENT BOND	10,730,000.00	13,743,117.37		
CHINA GOVERNMENT BOND	11,200,000.00	13,878,178.83		
CHINA GOVERNMENT BOND	8,700,000.00	10,428,706.18		
CHINA GOVERNMENT BOND	3,700,000.00	4,240,487.97		
CHINA GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,242,935.15		
中国・人民元小計		441,980,000.00	461,148,749.41	(10,351,129,289)

ユーロ	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.0% 30/02/20	350,000.00	318,764.25	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.0% 31/02/20	730,000.00	645,512.58	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.0% 40/10/20	300,000.00	184,010.40	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.5% 29/02/20	370,000.00	351,639.54	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 28/02/20	630,000.00	613,855.62	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 51/03/20	440,000.00	231,343.39	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.85% 20/06/30	190,000.00	58,974.57	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.5% 47/02/20	265,000.00	183,933.35	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.5% 86/11/02	120,000.00	57,715.20	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.1% 17/09/20	130,000.00	77,263.55	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.4% 34/05/23	530,000.00	513,072.06	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.9% 33/02/20	550,000.00	556,002.15	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.95% 35/02/20	250,000.00	250,310.77	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.15% 44/06/20	160,000.00	152,349.37	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.2% 39/07/15	160,000.00	158,611.50	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.8% 62/01/26	115,000.00	116,701.13	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.15% 37/03/15	210,000.00	230,670.30	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 6.25% 27/07/15	400,000.00	422,914.00	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.1% 30/06/22	400,000.00	362,197.34	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.35% 32/06/22	250,000.00	215,927.98	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.4% 40/06/22	180,000.00	115,224.75	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.65% 71/06/22	130,000.00	40,009.74	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 28/06/22	350,000.00	339,638.97	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.9% 29/06/22	470,000.00	449,518.67	

BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.0% 31/06/22	350,000.00	322,970.87	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.25% 33/04/22	350,000.00	315,333.90	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.45% 37/06/22	360,000.00	295,758.50	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.6% 47/06/22	300,000.00	198,385.50	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.7% 50/06/22	200,000.00	127,476.07	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.9% 38/06/22	200,000.00	169,032.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.15% 66/06/22	280,000.00	168,474.60	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.25% 57/06/22	440,000.00	290,694.46	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.7% 29/10/22	240,000.00	242,943.06	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.0% 34/06/22	550,000.00	550,823.38	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.1% 35/06/22	200,000.00	199,449.78	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.4% 36/06/22	150,000.00	151,943.74	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.5% 55/06/22	50,000.00	44,318.75	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.75% 45/06/22	250,000.00	245,900.29	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 32/03/28	700,000.00	752,392.11	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 41/03/28	370,000.00	395,299.45	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.0% 35/03/28	550,000.00	632,716.15	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.5% 28/03/28	520,000.00	555,697.97	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.0% 30/09/15	30,000.00	26,874.21	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.13% 31/09/15	130,000.00	113,697.15	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.13% 36/04/15	260,000.00	193,451.57	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.13% 52/04/15	110,000.00	44,488.40	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.25% 40/09/15	80,000.00	51,208.10	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 28/09/15	300,000.00	287,654.31	

FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/09/15	170,000.00	159,612.99	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.75% 31/04/15	180,000.00	164,848.51	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.13% 34/04/15	170,000.00	148,798.74	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.38% 27/04/15	50,000.00	49,643.42	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.38% 47/04/15	150,000.00	100,125.18	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.63% 32/04/15	100,000.00	99,938.70	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.63% 42/07/04	195,000.00	174,719.02	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.75% 28/07/04	250,000.00	253,889.15	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.95% 55/04/15	75,000.00	64,114.58	
FINNISH GOVERNMENT BOND 3.0% 33/09/15	350,000.00	355,094.25	
FINNISH GOVERNMENT BOND 3.0% 35/09/15	100,000.00	99,996.25	
FINNISH GOVERNMENT BOND 3.2% 45/04/15	60,000.00	56,941.38	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 29/11/25	1,760,000.00	1,608,524.72	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 30/11/25	1,490,000.00	1,320,126.96	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 31/11/25	1,300,000.00	1,112,943.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 32/05/25	1,380,000.00	1,159,565.70	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/05/25	1,600,000.00	1,508,192.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 40/05/25	1,340,000.00	863,909.39	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 44/06/25	300,000.00	166,650.82	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 72/05/25	480,000.00	127,137.36	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/05/25	2,130,000.00	2,062,633.42	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/11/25	1,300,000.00	1,247,571.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 53/05/25	680,000.00	300,234.70	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 27/05/25	1,550,000.00	1,529,274.55	

FRENCH GOVERNMENT BOND 1.25% 34/05/25	1,200,000.00	1,037,624.70	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.25% 36/05/25	950,000.00	776,034.57	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.5% 31/05/25	1,450,000.00	1,368,840.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.5% 50/05/25	770,000.00	459,977.21	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 39/06/25	750,000.00	601,127.74	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 66/05/25	550,000.00	284,673.21	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.0% 32/11/25	1,070,000.00	1,011,627.22	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.0% 48/05/25	730,000.00	508,422.31	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.4% 28/09/24	200,000.00	200,703.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.5% 30/05/25	1,200,000.00	1,200,190.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.75% 27/10/25	2,350,000.00	2,373,633.15	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.0% 34/11/25	910,000.00	897,044.33	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.0% 54/05/25	630,000.00	501,057.90	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.2% 35/05/25	980,000.00	975,888.90	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.25% 45/05/25	830,000.00	751,427.01	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.6% 42/05/25	390,000.00	378,505.53	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.75% 56/05/25	190,000.00	172,622.41	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 38/10/25	900,000.00	938,037.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 55/04/25	730,000.00	700,070.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 60/04/25	470,000.00	443,903.25	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.1% 46/05/25	150,000.00	151,900.95	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.5% 41/04/25	800,000.00	868,813.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.75% 35/04/25	1,500,000.00	1,679,257.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.5% 29/04/25	1,480,000.00	1,621,505.76	

FRENCH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/10/25	1,300,000.00	1,525,544.15	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 29/08/15	1,230,000.00	1,142,448.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 30/02/15	750,000.00	687,606.75	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 30/08/15	600,000.00	543,516.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 31/02/15	800,000.00	714,668.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 31/08/15	800,000.00	704,762.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 31/08/15	820,000.00	722,614.75	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 35/05/15	620,000.00	484,252.70	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 50/08/15	450,000.00	198,100.12	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 52/08/15	630,000.00	258,754.86	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 27/02/15	700,000.00	688,274.30	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 28/08/15	1,350,000.00	1,292,128.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 29/02/15	1,300,000.00	1,231,415.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 27/08/15	800,000.00	782,725.88	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.25% 48/08/15	670,000.00	449,180.06	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.7% 32/08/15	1,180,000.00	1,128,404.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.8% 53/08/15	680,000.00	487,399.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.2% 27/03/11	400,000.00	400,767.92	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.2% 34/02/15	950,000.00	923,106.45	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 31/04/16	100,000.00	100,777.95	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 35/02/15	700,000.00	690,662.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 35/02/15	100,000.00	98,748.30	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 44/07/04	560,000.00	503,410.32	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 46/08/15	700,000.00	618,359.35	

GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 54/08/15	500,000.00	418,441.75	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.6% 33/08/15	1,100,000.00	1,103,608.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.6% 35/08/15	450,000.00	446,064.72	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.6% 41/05/15	550,000.00	515,330.47	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.9% 56/08/15	600,000.00	542,329.48	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 42/07/04	500,000.00	505,642.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/04	980,000.00	1,087,254.95	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.25% 39/07/04	600,000.00	682,217.25	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/07/04	900,000.00	955,602.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 34/07/04	820,000.00	951,646.08	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 40/07/04	610,000.00	729,509.98	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.5% 31/01/04	750,000.00	858,840.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.63% 28/01/04	1,300,000.00	1,384,799.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.25% 30/01/04	450,000.00	516,825.11	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.5% 27/07/04	1,350,000.00	1,430,804.25	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.0% 31/10/18	100,000.00	87,023.45	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.35% 32/10/18	250,000.00	215,816.25	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.4% 35/05/15	190,000.00	151,786.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.55% 41/04/22	40,000.00	26,968.38	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.9% 28/05/15	360,000.00	350,977.50	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.1% 29/05/15	140,000.00	135,237.62	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.3% 33/05/15	140,000.00	127,723.57	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.35% 31/03/18	160,000.00	152,323.60	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.5% 50/05/15	275,000.00	184,286.09	

IRISH GOVERNMENT BOND 1.7% 37/05/15	60,000.00	52,306.57	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.0% 45/02/18	220,000.00	176,992.14	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.4% 30/05/15	270,000.00	270,711.31	
IRISH GOVERNMENT BOND 3.1% 36/06/18	50,000.00	50,425.56	
IRISH GOVERNMENT BOND 3.15% 55/10/18	70,000.00	63,594.03	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.6% 31/08/01	1,080,000.00	966,107.52	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.9% 31/04/01	700,000.00	641,913.65	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.35% 30/04/01	1,000,000.00	956,461.25	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.65% 30/12/01	1,000,000.00	957,819.86	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.65% 32/03/01	650,000.00	609,253.45	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.7% 51/09/01	450,000.00	277,768.45	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.8% 41/03/01	470,000.00	364,837.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 28/02/01	2,900,000.00	2,893,576.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.05% 27/08/01	900,000.00	899,843.85	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.15% 72/03/01	80,000.00	48,545.70	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.2% 27/06/01	1,020,000.00	1,022,258.72	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 36/09/01	720,000.00	650,052.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.45% 33/09/01	880,000.00	848,044.85	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.45% 50/09/01	350,000.00	260,706.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.65% 28/06/15	100,000.00	100,967.12	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.7% 30/10/01	350,000.00	351,676.93	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.7% 47/03/01	400,000.00	325,688.38	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.8% 28/12/01	890,000.00	903,554.08	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.8% 67/03/01	510,000.00	372,539.06	

ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.95% 30/07/01	950,000.00	965,748.46	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.95% 38/09/01	800,000.00	752,147.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 29/08/01	1,150,000.00	1,174,294.32	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.15% 31/11/15	200,000.00	204,075.70	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 32/11/15	100,000.00	101,995.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 46/09/01	450,000.00	403,011.27	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.35% 35/03/01	600,000.00	607,857.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.45% 48/03/01	470,000.00	429,885.97	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 30/03/01	1,000,000.00	1,039,909.33	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.65% 35/08/01	830,000.00	855,829.31	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.85% 35/02/01	500,000.00	524,900.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.85% 40/10/01	110,000.00	111,495.94	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.85% 49/09/01	410,000.00	396,877.74	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/02/01	670,000.00	708,072.08	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.1% 46/04/30	80,000.00	81,328.04	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.2% 34/03/01	850,000.00	916,670.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.3% 54/10/01	100,000.00	101,408.72	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.4% 33/05/01	990,000.00	1,081,540.84	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 53/10/01	250,000.00	262,156.75	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/09/01	1,190,000.00	1,262,852.39	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 44/09/01	550,000.00	611,599.17	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 34/08/01	850,000.00	967,571.57	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 39/08/01	800,000.00	918,157.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 40/09/01	700,000.00	803,084.33	

ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.25% 29/11/01	1,120,000.00	1,232,281.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/02/01	850,000.00	999,684.57	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 6.0% 31/05/01	800,000.00	929,470.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 30/07/15	470,000.00	424,853.21	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 31/07/15	100,000.00	87,777.65	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 38/01/15	300,000.00	209,622.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 52/01/15	510,000.00	212,699.45	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.25% 29/07/15	450,000.00	421,419.93	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.5% 40/01/15	300,000.00	211,511.36	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.75% 27/07/15	300,000.00	294,880.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.75% 28/07/15	190,000.00	184,132.61	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.0% 54/01/15	230,000.00	170,937.72	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.5% 33/01/15	600,000.00	597,264.07	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.5% 34/07/15	990,000.00	973,362.06	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.75% 47/01/15	540,000.00	492,275.61	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.25% 44/01/15	60,000.00	59,819.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.5% 56/01/15	90,000.00	90,696.44	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.75% 42/01/15	300,000.00	319,898.62	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/15	250,000.00	274,859.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 5.5% 28/01/15	670,000.00	712,776.15	
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 0.3% 31/10/17	560,000.00	495,638.21	
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 0.7% 27/10/15	370,000.00	362,424.62	
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 1.0% 52/04/12	70,000.00	38,052.52	
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 1.15% 42/04/11	200,000.00	142,020.60	

PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 1.65% 32/07/16	400,000.00	377,438.30	
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 1.95% 29/06/15	340,000.00	337,637.05	
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 2.88% 34/10/20	420,000.00	419,361.18	
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 3.0% 35/06/15	120,000.00	120,238.44	
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 3.25% 36/06/13	50,000.00	50,665.00	
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 3.38% 40/06/15	120,000.00	119,281.68	
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 3.5% 38/06/18	240,000.00	245,404.56	
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 3.63% 54/06/12	105,000.00	100,863.43	
SPANISH GOVERNMENT BOND 0.1% 31/04/30	820,000.00	724,020.23	
SPANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 30/04/30	1,270,000.00	1,175,225.28	
SPANISH GOVERNMENT BOND 0.6% 29/10/31	700,000.00	657,653.15	
SPANISH GOVERNMENT BOND 0.7% 32/04/30	980,000.00	870,849.07	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.0% 42/07/30	740,000.00	501,532.70	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.0% 50/10/31	400,000.00	218,373.86	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.4% 28/04/30	950,000.00	935,609.78	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.4% 28/07/30	960,000.00	942,868.56	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 27/10/31	1,150,000.00	1,138,375.98	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 29/04/30	730,000.00	712,218.47	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 71/10/31	430,000.00	203,828.17	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.5% 27/04/30	900,000.00	894,401.10	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.85% 35/07/30	770,000.00	693,844.69	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.9% 52/10/31	230,000.00	153,457.15	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.95% 30/07/30	610,000.00	598,016.36	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.35% 29/03/31	100,000.00	100,180.40	

SPANISH GOVERNMENT BOND 2.35%	1,350,000.00	1,306,173.93	
33/07/30			
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.7%	400,000.00	332,351.00	
48/10/31			
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.9%	340,000.00	297,592.82	
46/10/31			
SPANISH GOVERNMENT BOND 3.15%	100,000.00	100,704.85	
35/04/30			
SPANISH GOVERNMENT BOND 3.2%	500,000.00	503,533.75	
35/10/31			
SPANISH GOVERNMENT BOND 3.3%	500,000.00	505,873.08	
36/04/30			
SPANISH GOVERNMENT BOND 3.45%	250,000.00	258,375.12	
34/10/31			
SPANISH GOVERNMENT BOND 3.45%	410,000.00	361,726.52	
66/07/30			
SPANISH GOVERNMENT BOND 3.5%	150,000.00	148,711.50	
41/01/31			
SPANISH GOVERNMENT BOND 3.55%	300,000.00	313,542.45	
33/10/31			
SPANISH GOVERNMENT BOND 3.9%	550,000.00	575,723.22	
39/07/30			
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.2%	500,000.00	543,821.75	
37/01/31			
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.7%	640,000.00	725,263.68	
41/07/30			
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.9%	550,000.00	635,707.87	
40/07/30			
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15%	750,000.00	807,143.47	
28/10/31			
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15%	400,000.00	477,625.20	
44/10/31			
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.75%	1,250,000.00	1,473,984.06	
32/07/30			
SPANISH GOVERNMENT BOND 6.0%	760,000.00	841,229.11	
29/01/31			
ユーロ小計	147,570,000.00	139,386,107.58 (25,449,115,522)	
国債証券合計		86,253,508,534 (86,253,508,534)	
合計		86,253,508,534 (86,253,508,534)	

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	有価証券の合計額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 178銘柄	100.0%	45.4%

カナダ・ドル	国債証券	23銘柄	100.0%	2.1%
オーストラリア・ドル	国債証券	21銘柄	100.0%	1.3%
イギリス・ポンド	国債証券	43銘柄	100.0%	5.8%
シンガポール・ドル	国債証券	11銘柄	100.0%	0.4%
マレーシア・リンギット	国債証券	13銘柄	100.0%	0.5%
ニュージーランド・ドル	国債証券	9銘柄	100.0%	0.3%
スウェーデン・クローナ	国債証券	5銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	100.0%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	100.0%	0.2%
メキシコ・ペソ	国債証券	11銘柄	100.0%	0.9%
イスラエル・シェケル	国債証券	9銘柄	100.0%	0.4%
ポーランド・ズロチ	国債証券	9銘柄	100.0%	0.7%
中国・人民元	国債証券	37銘柄	100.0%	12.0%
ユーロ	国債証券	258銘柄	100.0%	29.5%

（注）組入債券時価比率は時価の合計額に対する通貨毎の比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

(2026年2月27日現在)

資産総額	6,079,615,736円
負債総額	982,757円
純資産総額( - )	6,078,632,979円
発行済口数	4,109,988,274口
1口当たり純資産額( / )	1.4790円

## &lt;参考情報&gt;

親投資信託受益証券（日本株式インデックス・マザーファンド）

(2026年2月27日現在)

資産総額	52,110,625,520円
負債総額	234,045,130円
純資産総額( - )	51,876,580,390円
発行済口数	6,750,728,094口
1口当たり純資産額( / )	7.6846円

## &lt;参考情報&gt;

親投資信託受益証券（日本債券インデックス・マザーファンド）

(2026年2月27日現在)

資産総額	70,314,276,163円
負債総額	2,175,748,882円
純資産総額( - )	68,138,527,281円
発行済口数	60,796,548,167口
1口当たり純資産額( / )	1.1208円

## &lt;参考情報&gt;

親投資信託受益証券（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

(2026年2月27日現在)

資産総額	464,956,760,511円
負債総額	281,421,622円
純資産総額( - )	464,675,338,889円
発行済口数	49,886,114,458口
1口当たり純資産額( / )	9.3147円

## &lt;参考情報&gt;

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

(2026年2月27日現在)

資産総額	88,264,704,000円
負債総額	60,697,539円
純資産総額( - )	88,204,006,461円
発行済口数	25,861,381,251口
1口当たり純資産額( / )	3.4106円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

### (1) 受益証券の名義書換等

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

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

### (2) 受益者等名簿の閉鎖の時期

該当事項はありません。

### (3) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

### (4) 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容

#### < 受益権の譲渡 >

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

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

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

#### < 受益権の譲渡の対抗要件 >

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

### (5) その他内国投資信託受益証券事務に関し投資者に示すことが必要な事項

#### < 受益権の再分割 >

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

#### < 償還金 >

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

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

< 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて >

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額（2026年2月末現在）

###### 資本金の額

委託会社の資本金の額は金3億1千万円です。

###### 発行する株式の総数

委託会社の発行する株式の総数は6,200株です。

###### 発行済株式の総数

委託会社の発行済株式総数は6,200株です。

最近5年間ににおける主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

##### (2) 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1) 運用基本方針の決定

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

###### 2) 運用実施計画の作成

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

###### 3) 運用の実行

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2026年2月末現在、委託会社の運用する証券投資信託は、129本であり、その純資産総額は4,645,774百万円です（親投資信託を除く、公募投資信託および私募投資信託の合計値です。）。

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。  
また、委託会社の中間財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）、ならびに同規則第282条第1項及び第306条第1項の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第28期事業年度（2024年4月1日から2025年3月31日まで）の財務諸表ならびに第29期事業年度の中間会計期間（2025年4月1日から2025年9月30日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人により監査および中間監査を受けております。

## 1. 財務諸表

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2024年3月31日現在)		当事業年度 (2025年3月31日現在)	
	金 額	構成比	金 額	構成比
(資産の部)		%		%
流動資産				
預金	4,234,566		5,255,086	
前払金	102,444		192,385	
前払費用	41,233		41,160	
未収入金	1,032,848		651,420	
未収委託者報酬	749,873		828,796	
未収収益	27,066		1,301	
流動資産計	6,188,032	81.2	6,970,151	85.3
固定資産				
有形固定資産	0		10,584	
建物附属設備	1	0	-	
器具備品	1	0	10,584	
無形固定資産	0		0	
ソフトウェア	0		0	
投資その他の資産	1,432,737		1,189,419	
投資有価証券	39,012		40,048	
長期差入保証金	48,833		43,216	
繰延税金資産	1,338,616		1,099,879	
その他投資	6,275		6,275	
固定資産計	1,432,737	18.8	1,200,003	14.7
資産合計	7,620,770	100.0	8,170,154	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2024年3月31日現在)		当事業年度 (2025年3月31日現在)	
	金 額	構成比	金 額	構成比
(負債の部)		%		%
流動負債				
預り金	188,612		207,627	
未払金	339,082		404,642	
未払手数料	221,226		254,991	
その他未払金	117,856		149,650	
未払費用	13,751		15,158	
未払法人税等	45,960		193,713	
未払消費税等	59,410		55,908	
賞与引当金	125,008		103,473	
流動負債計	771,826	10.1	980,524	12.0
固定負債				
退職給付引当金	62,307		79,516	
固定負債計	62,307	0.8	79,516	1.0
負債合計	834,133	10.9	1,060,041	13.0
(純資産の部)		%		%
株主資本	6,778,287	88.9	7,101,046	86.9

資本金	310,000			310,000		
利益剰余金						
利益準備金	77,500			77,500		
その他利益剰余金						
別途積立金	31,620			31,620		
繰越利益剰余金	6,359,167			6,681,926		
評価・換算差額等		8,348	0.1		9,066	0.1
その他有価証券評価差額金	8,348			9,066		
純資産合計		6,786,636	89.1		7,110,113	87.0
負債・純資産合計		7,620,770	100.0		8,170,154	100.0

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日		当事業年度 自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日	
	金 額	構成比	金 額	構成比
営業収益		%		%
委託者報酬	2,891,198		3,159,384	
投資顧問収入	2,862,987		2,869,671	
その他営業収益	102,972		74,525	
営業収益計	5,857,158	100.0	6,103,581	100.0
営業費用				
支払手数料	906,480		1,024,590	
広告宣伝費	21,264		84,625	
公告費	-		1,140	
調査費	720,300		723,759	
調査費	396,650		389,188	
委託調査費	323,202		334,212	
図書費	446		358	
委託計算費	207,395		232,269	
営業雑経費	55,720		50,286	
通信費	8,017		7,612	
印刷費	26,511		15,708	
協会費	15,992		21,171	
諸会費	83		1	
その他	5,114		5,792	
営業費用計	1,911,160	32.6	2,116,670	34.7
一般管理費				
給料	1,332,279		1,418,542	
役員報酬	154,418		130,477	
給料・手当	805,664		905,955	
賞与	289,236		298,672	
賞与引当金繰入額	82,960		83,436	
交際費	2,358		2,917	
旅費交通費	11,678		13,965	
租税公課	29,533		43,879	
不動産賃借料	72,193		69,771	
退職給付費用	61,309		96,268	
固定資産減価償却費	428		932	

福利厚生費		144,113			148,872	
諸経費		161,722			206,939	
一般管理費計		1,815,616	31.0		2,002,089	32.8
営業利益		2,130,381	36.4		1,984,820	32.5
営業外収益						
為替差益		1,186			-	
有価証券運用益		1,258			-	
有価証券分配金		-			40	
雑収入		61			115	
営業外収益計		2,505	0.0		155	0.0
営業外費用						
移転価格調整金	1、2	996,646			416,568	
為替差損		2,193			839	
雑損失		3,349			20	
営業外費用計		1,002,189	17.1		417,428	6.8
経常利益		1,130,697	19.3		1,567,547	25.7
特別損失						
事務処理損失		814			654	
特別損失計		814	0.0		654	0.0
税引前当期純利益		1,129,883	19.3		1,566,893	25.7
法人税,住民税及び事業税		189,140	3.2		260,714	4.3
法人税等調整額		195,041	3.3		238,420	3.9
当期純利益		745,701	12.7		1,067,758	17.5

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本					株主資本 合計	評価・換算差額等		純資産 合計
	資本金	利益 準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計		その他 有価証券 評価差額金	評価・ 換算差額等 合計	
			その他利益 剰余金	繰越利益 剰余金					
当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,784,466	6,893,586	7,203,586	-	-	7,203,586
当期変動額									
剰余金の配当	-	-	-	(1,171,000)	(1,171,000)	(1,171,000)	-	-	(1,171,000)
当期純利益	-	-	-	745,701	745,701	745,701	-	-	745,701
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	8,348	8,348	8,348
当期変動額合計	-	-	-	(425,298)	(425,298)	(425,298)	8,348	8,348	(416,950)
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,359,167	6,468,287	6,778,287	8,348	8,348	6,786,636

当事業年度（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本					株主資本 合計	評価・換算差額等		純資産 合計
	資本金	利益 準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計		その他 有価証券 評価差額金	評価・ 換算差額等 合計	
			その他利益 剰余金	繰越利益 剰余金					
当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,359,167	6,468,287	6,778,287	8,348	8,348	6,786,636
当期変動額									
剰余金の配当	-	-	-	(745,000)	(745,000)	(745,000)	-	-	(745,000)
当期純利益	-	-	-	1,067,758	1,067,758	1,067,758	-	-	1,067,758
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	718	718	718

当期変動額合計	-	-	-	322,758	322,758	322,758	718	718	323,477
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,681,926	6,791,046	7,101,046	9,066	9,066	7,110,113

## [ 重要な会計方針 ]

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

## 会計上の見積りに関する注記

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

繰延税金資産 1,099,879千円

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

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

（未適用の会計基準等）

- ・「リースに関する会計基準」（企業会計基準第34号 2024年9月13日）
- ・「リースに関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第33号 2024年9月13日）

ほか、関連する企業会計基準、企業会計基準適用指針、実務対応報告及び移管指針の改正

(1) 概要

国際的な会計基準と同様に、借手のすべてのリースについて資産・負債を計上する等の取扱いを定めるものであります。

(2) 適用予定日

2028年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「リースに関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 (2024年3月31日現在)	当事業年度 (2025年3月31日現在)
1. 有形固定資産の減価償却累計額 器具備品 29,386千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 器具備品 28,435千円
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左

（損益計算書関係）

前事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日	当事業年度 自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日
1. 移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた事務手数料調整額102,739千円は、損益計算書のその他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額996,646千円は、損益計算書の営業外費用である移転価格調整金に含まれております。	1. 移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた事務手数料調整額74,278千円は、損益計算書のその他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額416,568千円は、損益計算書の営業外費用である移転価格調整金に含まれております。
2. 関係会社に係る注記 関係会社との取引高 営業外費用 996,646千円	2. 関係会社に係る注記 関係会社との取引高 営業費用および一般管理費 880,997千円 営業外費用 416,568千円

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

## 1. 発行済株式の総数に関する事項

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

## 2. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

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

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

（決議）	株式の種類	配当金の総額	配当の原資	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2024年6月27日 定時株主総会	普通株式	745,000千円	利益剰余金	120,161.29円	2024年3月31日	2024年6月28日

当事業年度（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

## 1. 発行済株式の総数に関する事項

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

## 2. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

（決議）	株式の種類	配当金の総額	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2024年6月27日 定時株主総会	普通株式	745,000千円	120,161.29円	2024年3月31日	2024年6月28日

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

（決議）	株式の種類	配当金の総額	配当の原資	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2025年6月26日 定時株主総会	普通株式	1,067,000千円	利益剰余金	172,096.77円	2025年3月31日	2025年6月27日

## （金融商品関係）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## （1）金融商品に対する取組方針

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

## （2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2024年3月31日現在

	貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
投資有価証券	39,012	39,012	-
資産計	39,012	39,012	-

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

2025年3月31日現在

	貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
投資有価証券	40,048	40,048	-
資産計	40,048	40,048	-

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

### 3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

2024年3月31日現在

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券	-	39,012	-	39,012
その他有価証券		39,012		39,012
資産計	-	39,012	-	39,012

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

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

2025年3月31日現在

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計

投資有価証券	-	40,048	-	40,048
その他有価証券		40,048		40,048
資産計	-	40,048	-	40,048

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

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

（有価証券関係）

2024年3月31日現在

その他有価証券

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 投資信託	39,012千円	26,980千円	12,032千円
小計	39,012千円	26,980千円	12,032千円
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託			
小計			
合計	39,012千円	26,980千円	12,032千円

2025年3月31日現在

その他有価証券

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 投資信託	39,113千円	25,980千円	13,133千円
小計	39,113千円	25,980千円	13,133千円
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託	934千円	1,000千円	65千円
小計	934千円	1,000千円	65千円
合計	40,048千円	26,980千円	13,068千円

（デリバティブ取引関係）

前事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日	当事業年度 自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日
該当事項はありません。	同左

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

前事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日	当事業年度 自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日

2011年4月1日に複数事業主制度の確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）、確定拠出年金制度を導入いたしました。 また、2000年9月29日より退職給付信託を設定しております。 なお、複数事業主制度の確定給付企業年金制度は自社の拠出に対応する年金資産の額を合理的に算定できることから、確定給付制度の注記に含めて記載しております。	同左
---	----

## 2．退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日
退職給付債務の期首残高	483,396
勤務費用	51,371
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	20,319
退職給付の支払額	<u>66,566</u>
退職給付債務の期末残高	488,520

(単位：千円)

	当事業年度 自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日
退職給付債務の期首残高	488,520
勤務費用	54,894
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	15,628
退職給付の支払額	<u>62,700</u>
退職給付債務の期末残高	496,343

## 3．年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日
年金資産の期首残高	416,191
期待運用収益	3,083
数理計算上の差異の発生額	3,224
事業主からの拠出額	53,186
退職給付の支払額	<u>66,566</u>
年金資産の期末残高	402,670

(単位：千円)

	当事業年度 自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日
年金資産の期首残高	402,670
期待運用収益	2,981
数理計算上の差異の発生額	5,196
事業主からの拠出額	58,246
退職給付の支払額	62,700
年金資産の期末残高	406,394

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

(単位：千円)

	前事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日
積立型制度の退職給付債務	488,520
年金資産	402,670
	85,850
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	85,850
未認識数理計算上の差異	23,543
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	62,307

(単位：千円)

	当事業年度 自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日
積立型制度の退職給付債務	496,343
年金資産	406,394
	89,948
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	89,948
未認識数理計算上の差異	10,431
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	79,516

## 5. 退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	39,232
(1)勤務費用	51,371
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益	3,083

(4) 数理計算上の差異の費用処理額	9,055
--------------------	-------

(単位：千円)

	当事業年度 自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	75,456
(1) 勤務費用	54,894
(2) 利息費用	-
(3) 期待運用収益	2,981
(4) 数理計算上の差異の費用処理額	23,543

## 6．年金資産に関する事項

前事業年度（2024年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定）	98.1%
その他	1.9%
合計	100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

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

当事業年度（2025年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定）	98.1%
その他	1.9%
合計	100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

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

## 7．退職給付債務等の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (2024年3月31日現在)
(1) 割引率	0.00%
(2) 長期期待運用収益率	0.75%
(3) 予想昇給率	5.80%
(4) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(5) 過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(6) 数理計算上の差異の処理年数	1年

	当事業年度 (2025年3月31日現在)
(1) 割引率	0.00%
(2) 長期期待運用収益率	0.75%
(3) 予想昇給率	5.80%
(4) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準

(5)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(6)数理計算上の差異の処理年数	1年

## 8. 確定拠出制度

前事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は22,077千円であります。

当事業年度（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は20,811千円であります。

### （税効果会計関係）

前事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日	当事業年度 自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日
繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円)	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金繰入超過額 27,942	賞与引当金繰入超過額 24,152
退職給付引当金 20,778	退職給付引当金 26,815
(注)繰越欠損金 1,267,265	(注)税務上の繰越欠損金 1,039,855
その他 26,314	その他 46,429
繰延税金資産 合計 1,342,300	繰延税金資産 小計 1,137,251
繰延税金負債	税務上の繰越欠損金に係る評価性引当額 -
その他有価証券評価差額金 3,684	将来減算一時差異の合計に係る評価性引当額 33,371
繰延税金資産の純額 1,338,616	評価性引当額 小計 33,371
	繰延税金資産 合計 1,103,881
	繰延税金負債
	その他有価証券評価差額金 4,001
	繰延税金資産の純額 1,099,879

（注）税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

前事業年度（2024年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超 2年以内 (千円)	2年超 3年以内 (千円)	3年超 4年以内 (千円)	4年超 5年以内 (千円)	5年超 (千円)	合計 (千円)
税務上の繰越欠損金 (*1)	-	137,227	157,331	-	366,561	606,144	1,267,265
繰延税金資産	-	137,227	157,331	-	366,561	606,144	(*2)1,267,265

(\*1) 税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額であります。

(\*2) 税務上の繰越欠損金1,267,265千円（法定実効税率を乗じた金額）について、繰延税金資産1,267,265千円を計上しております。当該税務上の繰越欠損金に係る繰延税金資産については、将来の課税所得の見込等により回収可能と判断しております。

当事業年度（2025年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超 2年以内 (千円)	2年超 3年以内 (千円)	3年超 4年以内 (千円)	4年超 5年以内 (千円)	5年超 (千円)	合計 (千円)
税務上の繰越欠損金 (*1)	-	43,867	-	372,027	287,713	336,248	1,039,855
繰延税金資産	-	43,867	-	372,027	287,713	336,248	(*2)1,039,855

(\*1) 税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額であります。

(\*2) 税務上の繰越欠損金1,039,855千円（法定実効税率を乗じた金額、1年以内のものは30.62%、1年を超えるものは31.52%）について、繰延税金資産1,039,855千円を計上しております。当該税務上の繰越欠損金に係る繰延税金資産については、将来の課税所得の見込等により回収可能と判断しております。

前事業年度（2024年3月31日現在）	当事業年度（2025年3月31日現在）
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳	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。
法定実効税率	30.6%
交際費等永久に損金に 算入されない項目	2.8%
その他	0.6%
税効果会計適用後の 法人税等の負担率	34.0%
	=====

法人税等の税率の変更により繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律（令和7年法律第13号）」が2025年3月31日に国会で成立したことに伴い、2026年4月1日以後開始する事業年度より防衛特別法人税が新設されることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債を計算する法定実効税率は30.62%から31.52%に変更されます。この変更により、当事業年度の繰延税金資産（繰延税金負債の金額を控除した金額）が23,465千円、法人税等調整額が23,465千円それぞれ増加しております。

（資産除去債務関係）

前事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

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

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

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

## (3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は15,059千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、変動は有りません。

当事業年度（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

## (1) 資産除去債務の概要

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

## (2) 資産除去債務の金額の算定方法

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

## (3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は19,219千円であります。当事業年度において、原状回復費用の見直しが行われたことから、資産除去債務の総額は、4,160千円増加しました。

## (収益認識関係)

前事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

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

## (1) 収益の分解情報

当会計期間の収益の構成は次のとおりです。

委託者報酬	2,891,198千円
投資顧問収入	2,862,987千円
その他営業収益	102,972千円
合計	5,857,158千円

## (2) 収益を理解するための基礎となる情報

重要な会計方針「5.収益の計上方法」に記載のとおりです。

## (3) 当期及び翌期以降の収益の金額を理解するための情報

重要性が乏しいため、注記を省略しております。

当事業年度（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

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

## (1) 収益の分解情報

当会計期間の収益の構成は次のとおりです。

委託者報酬	3,159,384千円
投資顧問収入	2,869,671千円
その他営業収益	74,525千円
合計	6,103,581千円

## (2) 収益を理解するための基礎となる情報

重要な会計方針「5.収益の計上方法」に記載のとおりです。

- (3) 当期及び翌期以降の収益の金額を理解するための情報  
重要性が乏しいため、注記を省略しております。

(セグメント情報)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

2. セグメント関連情報

1. 商品及びサービスに関する情報

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

2. 地域に関する情報

営業収益

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

有形固定資産

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

3. 主要な顧客に関する情報

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

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

該当事項はありません。

(2) 同一の親会社を持つ会社

前事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

前事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日											
種 類	会社等 の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権 の所有 (被所 有)割合	関連当事者との 関係		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員 の 兼任等	事業上 の 関係				

同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー	米国 マサチューセッツ州ボストン市	29百万 米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ  ソフトウェアの使用契約  人件費等及び事務手数料の支払	ソフトウェア使用料の支払  投資顧問料の支払  人件費等の支払  事務手数料の受取  移転価格調整金の支払	349,158  233,443  112,526  102,739  996,646	前払金   未払金	3,388   33,312
	ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ  兼職社員の人件費支払等	投資信託計理業務委託  人件費等の支払	39,191  45,719	前払金	99,056
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ユナイテッド・キングダム	英国 ロンドン	62百万 ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ	投資顧問料の支払	23,532	-	-
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール シンガポール市	136万 シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ及びETF商品の紹介	紹介料の受取  投資顧問料の支払	233  22,463	-	-

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

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 5. ETF商品の紹介料については、当社との間で締結された役務提供契約に基づいて計算されております。

当事業年度（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

当事業年度 自 2024年4月1日 至 2025年3月31日													
種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権 の所有 (被所有)割合	関連当事者との 関係		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)		
						役員の 兼任等	事業上の 関係						
同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・アソシエーツ・ラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ	ソフトウェア使用料の支払	334,750	前払金	170,340		
								投資顧問料の支払	230,948				
								人件費等の支払	95,312			未払金	33,242
								事務手数料の受取	74,278				
								移転価格調整金の支払	416,568				
ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ	投資信託計理業務委託	39,783	前払金	22,044			
							人件費等の支払	126,028					
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・リミテッド・カンパニー	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ	投資顧問料の支払	31,542	-	-			
							紹介料の受取	247	-	-			
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ及びETF商品の紹介	投資顧問料の支払	22,631	-	-			
							紹介料の受取	247	-	-			

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

ステート・ストリート・コーポレーション（ニューヨーク証券取引所に上場）

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インク（非上場）

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インターナショナル・ホールディングス（非上場）

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社（非上場）

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

前事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日	当事業年度 自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日
1株当たり純資産 1,094,618円75銭	1株当たり純資産 1,146,792円47銭
1株当たり当期純利益 120,274円44銭	1株当たり当期純利益 172,219円14銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。	なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

(注) 1株当たり当期純利益の算定基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日	当事業年度 自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日
当期純利益（千円）	745,701	1,067,758
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式にかかる当期純利益（千円）	745,701	1,067,758
期中平均株式数（株）	6,200	6,200

## (重要な後発事象)

前事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度

自 2024年4月 1日

至 2025年3月31日

該当事項はありません。

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

科 目	期 別	第29期中間会計期間末 (2025年9月30日現在)	
		金 額	構成比
(資産の部)			%
流動資産			
預金			5,028,355
前払金			106,761
前払費用			37,329
未収入金			718,540
未収委託者報酬			869,678
未収収益			299,582
流動資産計			7,060,247
固定資産			
有形固定資産			9,699
器具備品	1	9,699	
無形固定資産			0
ソフトウェア		0	
投資その他の資産			1,047,046
投資有価証券		49,708	
長期差入保証金		43,265	
繰延税金資産		947,798	
その他投資		6,275	
固定資産計			1,056,746
資産合計			8,116,993
(負債の部)			%
流動負債			
預り金			39,426
未払金			444,602
未払手数料		271,551	
その他未払金		173,050	
未払費用			15,433
未払法人税等			253,991
未払消費税等	2		80,002
賞与引当金			336,954
流動負債計			1,170,411
固定負債			
退職給付引当金			84,992
固定負債計			84,992
負債合計			1,255,404
(純資産の部)			%
株主資本			6,848,596
資本金		310,000	
利益剰余金		6,538,596	
利益準備金		77,500	

その他利益剰余金			
別途積立金	31,620		
繰越利益剰余金	6,429,476		
評価・換算差額等		12,993	0.2
その他有価証券評価差額金	12,993		
純資産合計		6,861,589	84.5
負債・純資産合計		8,116,993	100

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

期 別	第29期中間会計期間		
	自 2025年4月 1日 至 2025年9月30日		
科 目	金 額		構成比
			%
営業収益			
委託者報酬		1,653,634	
投資顧問収入		1,437,595	
その他営業収益	1	33,042	
営業収益計		3,124,271	100
営業費用・一般管理費			
営業費用		1,130,909	
支払手数料	561,962		
その他営業費用	1	568,946	
一般管理費	2	1,085,183	
営業費用・一般管理費計		2,216,092	70.9
営業利益		908,179	29.1
営業外収益	1	301,002	9.6
営業外費用		6,051	0.2
経常利益		1,203,130	38.5
特別損失		86	0.0
税引前中間純利益		1,203,043	38.5
法人税,住民税及び事業税		238,146	7.6
法人税等調整額		150,347	4.8
中間純利益		814,549	26.1

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）

(単位：千円)

	株 主 資 本					評価・換算差額等			純資産 合計
	資本金	利益剰余金				株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・ 換算差額等 合計	
		利益 準備金	その他利益 剰余金		利益剰余金 合計				
		別途 積立金	繰越利益 剰余金						
当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,681,926	6,791,046	7,101,046	9,066	9,066	7,110,113
当中間期変動額	-	-	-	-	-	-	-	-	-
剰余金の配当	-	-	-	1,067,000	1,067,000	1,067,000	-	-	1,067,000
中間純利益	-	-	-	814,549	814,549	814,549	-	-	814,549
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	3,926	3,926	3,926
当中間期変動額合計	-	-	-	252,450	252,450	252,450	3,926	3,926	248,524
当中間期末残高	310,000	77,500	31,620	6,429,476	6,538,596	6,848,596	12,993	12,993	6,861,589

[ 重要な会計方針 ]

	<p>第29期中間会計期間 自 2025年4月 1日 至 2025年9月30日</p>
1. 資産の評価基準及び評価方法	<p>有価証券          其他有価証券          市場価格のない株式等以外のもの          時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。          市場価格のない株式等          移動平均法による原価法を採用しております。</p>
2. 固定資産の減価償却方法	<p>有形固定資産          定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。          器具備品 3～7年</p>
3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金          従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当中間会計期間に負担すべき金額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金          退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。          退職給付見込額の期間帰属方法          退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。          数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法          過去勤務費用          その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。          数理計算上の差異          発生の翌事業年度に一括費用処理しております。</p>
5. 収益の計上方法	<p>(1) 委託者報酬          委託者報酬は、投資信託約款に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資信託約款毎に、日々の純資産総額に信託報酬率を乗じた金額で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問収入          投資顧問収入は、投資顧問契約に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資顧問契約毎に、計算基礎額に投資顧問料率を乗じた金額で収益を認識しております。</p>

## 注 記 事 項

( 中間貸借対照表関係 )

第29期中間会計期間末  
(2025年9月30日現在)

1. 有形固定資産の減価償却累計額 器具備品	29,320千円
2. 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。	

## (中間損益計算書関係)

第29期中間会計期間 自 2025年4月 1日 至 2025年9月30日	
1. 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当中間会計期間に、ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額32,921千円は中間損益計算書のその他営業収益、300,961千円は営業外収益にそれぞれ含まれております。 また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額199,655千円は中間損益計算書のその他営業費用に含まれております。	
2. 減価償却実施額 有形固定資産	1,186千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第29期中間会計期間 自 2025年4月 1日 至 2025年9月30日					
1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項					
株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)	
普通株式	6,200			6,200	
2. 当中間会計期間中に行った剰余金の配当に関する事項					
決議	株式の種類	配当金の総額	1株あたりの 配当額	基準日	効力発生日
2025年6月26日 定時株主総会	普通株式	1,067,000千円	172,096.77円	2025年3月31日	2025年6月27日

## (金融商品関係)

第29期中間会計期間末 (2025年9月30日現在)			
1. 金融商品の時価等に関する事項			
	中間貸借対照表計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
投資有価証券	49,708	49,708	-
資産計	49,708	49,708	-

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

## 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券	-	49,708	-	49,708
その他有価証券	-	49,708	-	49,708
資産計	-	49,708	-	49,708

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

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

### （有価証券関係）

第29期中間会計期間末

（2025年9月30日現在）

#### その他有価証券

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
投資信託	48,791千円	29,980千円	18,811千円
小計	48,791千円	29,980千円	18,811千円
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
投資信託	916千円	1,000千円	83千円
小計	916千円	1,000千円	83千円
合計	49,708千円	30,980千円	18,728千円

### （資産除去債務関係）

第29期中間会計期間末

（2025年9月30日現在）

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

### （デリバティブ取引関係）

第29期中間会計期間末  
(2025年9月30日現在)

当社はデリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第29期中間会計期間末  
(2025年9月30日現在)

(セグメント情報)

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

(セグメント関連情報)

1. 商品およびサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

該当事項はありません。

(収益認識関係)

第29期中間会計期間

自 2025年4月 1日

至 2025年9月30日

(1) 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次のとおりです。

委託者報酬	1,653,634千円
投資顧問収入	1,437,595千円
その他営業収益	33,042千円
合計	3,124,271千円

## (2) 収益を理解するための基礎となる情報

委託者報酬および投資顧問収入は、重要な会計方針「5.収益の計上方法」に記載のとおりです。  
その他営業収益は重要性が乏しいため、省略いたします。

## (3) 当期及び翌期以降の収益の金額を理解するための情報

重要性が乏しいため、注記を省略しております。

## ( 1株当たり情報 )

第29期中間会計期間	
自 2025年4月 1日	
至 2025年9月30日	
1株当たり純資産額	1,106,707円99銭
1株当たり中間純利益	131,378円95銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。	
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29期中間会計期間	
自 2025年4月 1日	
至 2025年9月30日	
中間純利益(千円)	814,549
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式にかかる中間純利益(千円)	814,549
期中平均株式数(株)	6,200

## ( 重要な後発事象 )

第29期中間会計期間	
自 2025年4月 1日	
至 2025年9月30日	
該当事項はありません。	

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更

委託会社の定款変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

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

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名 称

三井住友信託銀行株式会社

資本金の額

342,037百万円（2025年3月末現在）

事業の内容

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

#### （参考）再信託受託会社

名 称：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2025年3月末現在）

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

#### (2) 販売会社

名 称	資本金の額 （2025年3月末現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	54,323百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	19,495百万円	

2025年12月末現在です。

### 2【関係業務の概要】

#### (1) 受託会社

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

#### (2) 販売会社

当ファンドの販売会社として受益権の募集の取扱い等を行います。

### 3【資本関係】

#### (1) 受託会社

該当事項はありません。

#### (2) 販売会社

該当事項はありません。

### 第3【その他】

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

# 独立監査人の監査報告書

2025年6月10日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

公認会計士 稲葉 宏和

業務執行社員

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2024年4月1日から2025年3月31日までの第28期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2025年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### その他の記載内容

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

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

### 財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2026年4月24日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社  
取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太  
業務執行社員**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているAMC/ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）の2025年2月21日から2026年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、AMC/ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）の2026年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2025年12月10日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 稲葉 宏 和

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2025年4月1日から2026年3月31日までの第29期事業年度の中間会計期間（2025年4月1日から2025年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2025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（2025年4月1日から2025年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。