

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年9月9日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	グローバル・インデックス・バランス・ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

グローバル・インデックス・バランス・ファンド

ただし、愛称として“投資生活”という名称を用いることがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

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

### （７）【申込期間】

2022年 9月10日から2023年 3月10日までとします。

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

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

**( 9 ) 【払込期日】**

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

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

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

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**( 12 ) 【その他】**

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

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

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所）で、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場で、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受け付けを中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取り消すことができます。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。  
属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

#### [ 投資対象地域による区分 ]

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

#### [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

#### [ 独立した区分 ]

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

#### [ 補足分類 ]

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

#### < 属性区分表定義 >

#### [ 投資対象資産による属性区分 ]

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

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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



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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

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

#### [ 特殊型 ]

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

#### < ファンドの特色 >

## ● 国内外の株式及び外国の公社債に分散投資します。

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

各マザーファンドは、それぞれの資産の市場全体の動きと連動することを目指すインデックス運用を行います。

実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

### <投資対象とするマザーファンド>

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

## ● 3つの資産への均等配分を基本配分比率とします。

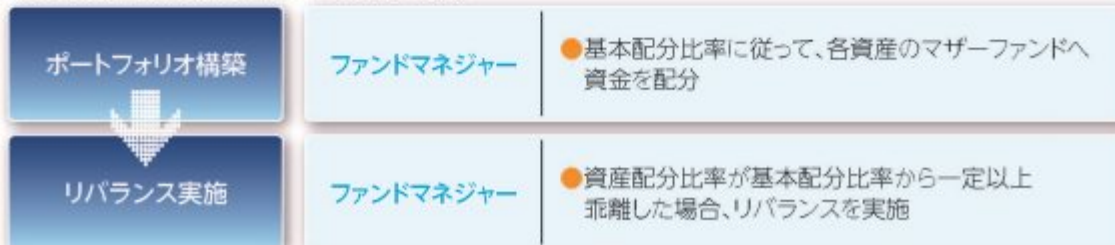
### 基本配分比率



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

### ポートフォリオ構築プロセス

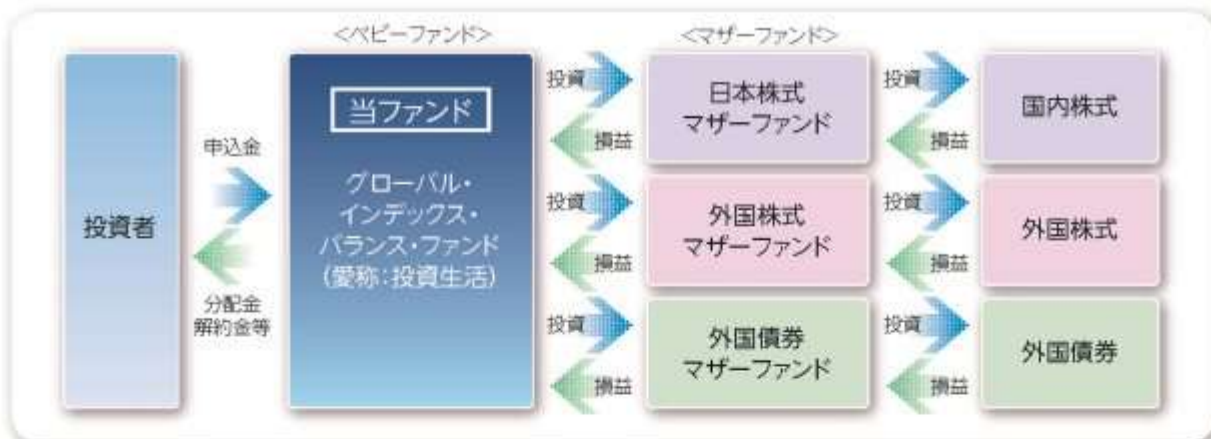
ファンドマネジャーは基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

## ● ファンドの仕組み

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



## ● 主な投資制限

- 株式への投資割合 …………… 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。
- 外貨建資産への投資割合 …… 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

## ● 分配方針

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

ただし、分配を行わないことがあります。

分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

### ◆各マザーファンドが対象とする指数は次のとおりです。

#### 日本株式マザーファンド: [TOPIX(東証株価指数、配当込み)]

[TOPIX(東証株価指数)]とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。

[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

同指数の指数値及び同指数に係る商標又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る商標又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

#### 外国株式マザーファンド: [MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)]

[MSCIコクサイ・インデックス]とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

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

[FTSE世界国債インデックス]は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

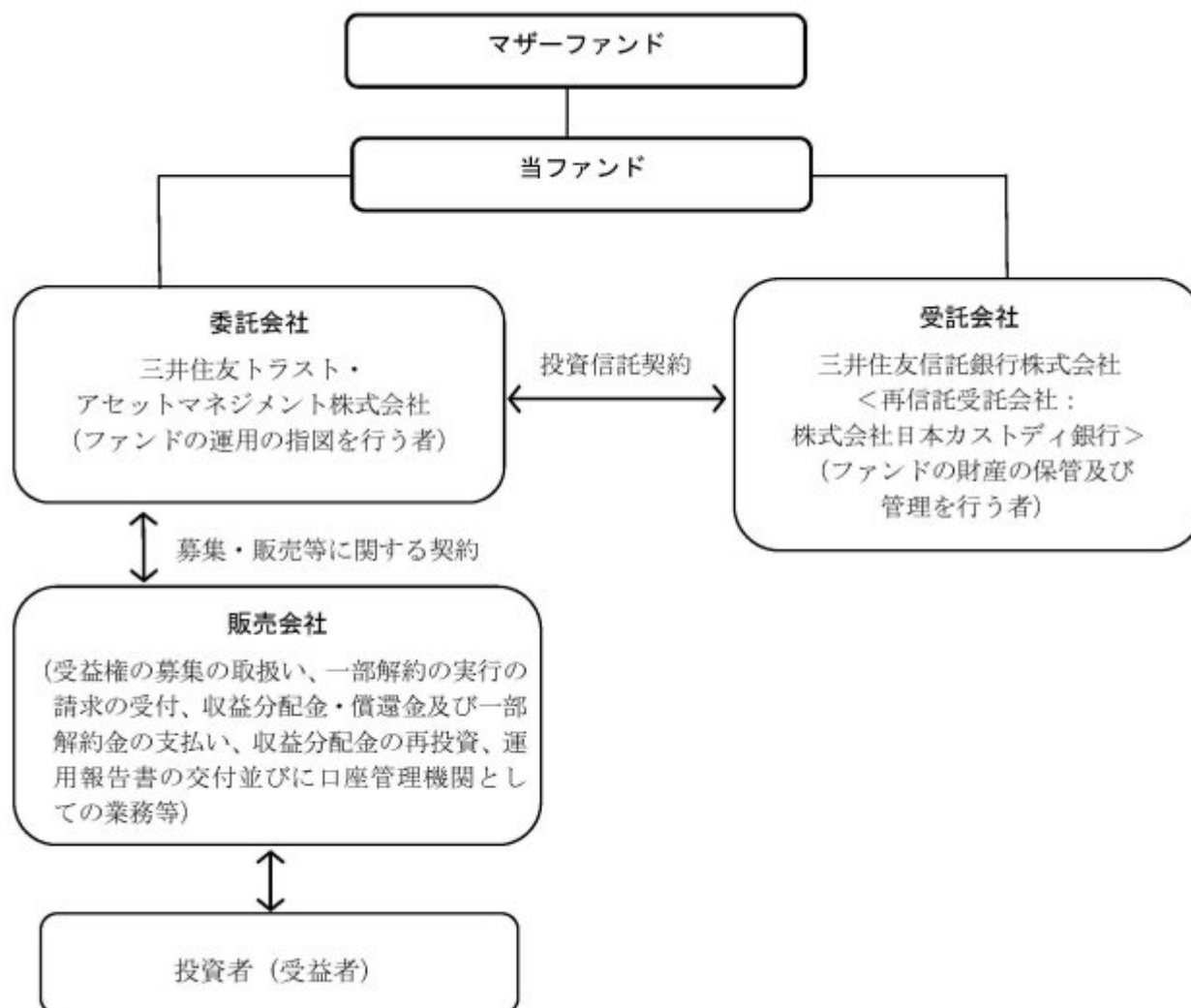
## (2) 【ファンドの沿革】

2008年3月3日	信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始
2010年9月11日	ファンドの名称を「ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド」から、「グローバル・インデックス・バランス・ファンド」に変更

2012年4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継  
当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンドの名称を外国株式マザーファンド、中央三井外国債券マザーファンドの名称を外国債券マザーファンドに変更

### （3）【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2022年6月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

1986年11月1日：	住信キャピタルマネジメント株式会社設立
1987年2月20日：	投資顧問業の登録
1987年9月9日：	投資一任契約に係る業務の認可
1990年10月1日：	住信投資顧問株式会社に商号変更
1999年2月15日：	住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
1999年3月25日：	証券投資信託委託業の認可
2007年9月30日：	金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）

2012年4月1日： 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更

2018年10月1日： 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

## 八．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 運用方針

当ファンドは、日本株式マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンドの各受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

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

#### 投資態度

- A．主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- B．各資産への配分は、3つの資産への均等配分を基本とします。
- C．上記の基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設け、一定以上乖離した場合にはリバランスを行います。また、市況動向等の変化に応じて、当該基本配分比率の見直しを行う場合があります。
- D．実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、為替予約取引等を活用する場合があります。
- E．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引及び債券先物取引等を活用することがあります。このため、株式及び債券の組入総額と株価指数先物取引及び債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- F．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- G．ただし、資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
- H．国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- I．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- J．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

B．次に掲げる特定資産以外の資産

- １．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

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

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

19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で上記21.の有価証券の性質を有するもの

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

#### 運用指図できる金融商品

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

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

B. 金融商品による運用の特例

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

#### (参考)マザーファンドの概要

##### 「日本株式マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の

金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

### 3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「外国株式マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

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

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金



利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

### 3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

## 「外国債券マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

### 3. 投資制限

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

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

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

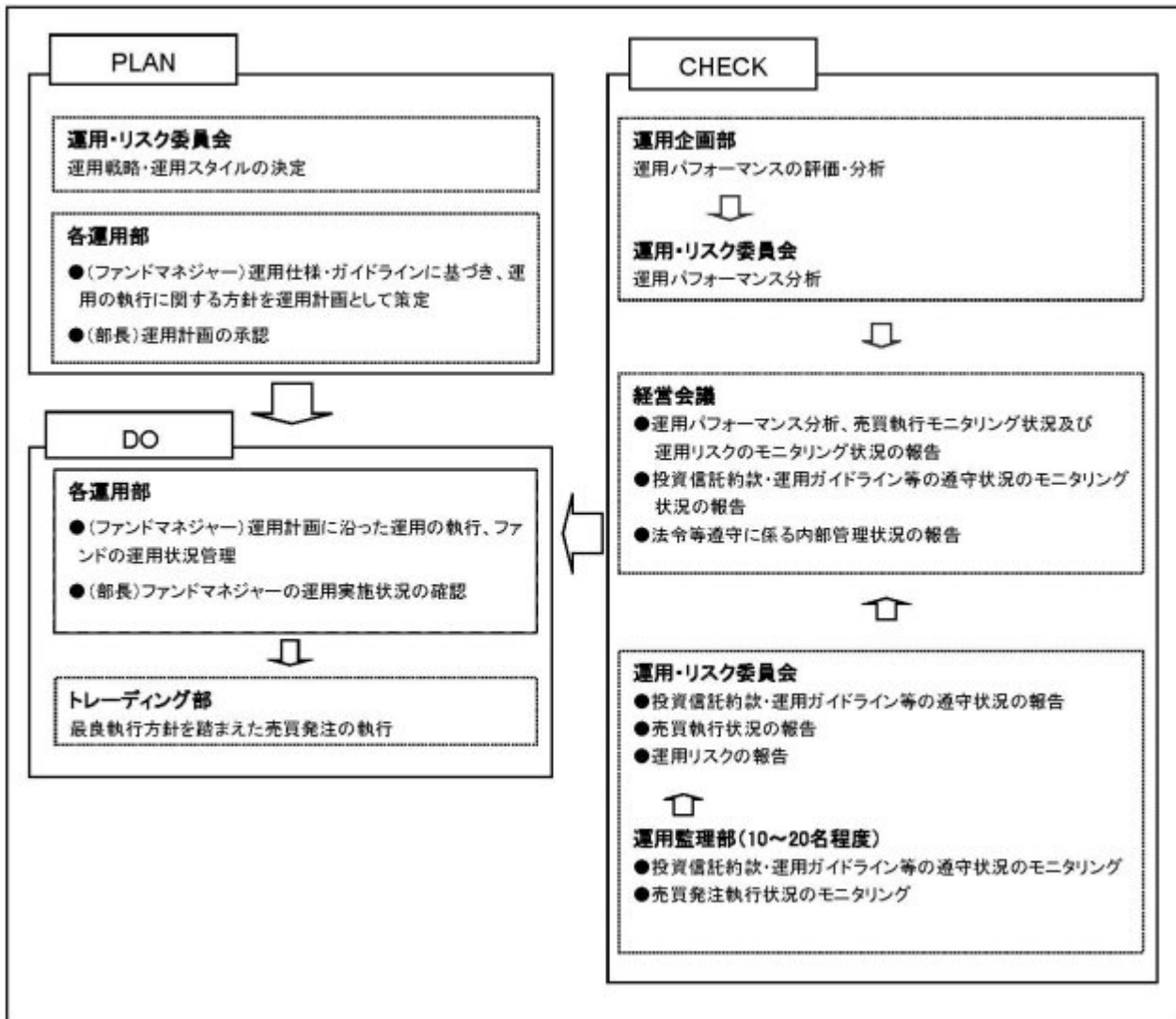
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

#### （3）【運用体制】

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



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

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

#### (4) 【分配方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

### A．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

### B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

### C．新株引受権証券等への投資割合

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

### D．同一銘柄の株式への投資割合

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

### E．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

### F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

### G．投資信託証券への投資割合

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

### H．投資する株式等の範囲

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

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

### I．信用取引の指図範囲

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

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

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

### J．先物取引等の運用指図

- イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
- ロ．委託会社は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- K．スワップ取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- L．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引及び為替先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- M．有価証券の貸付の指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の a．及び b．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
- a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- b．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ． a．及び b．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- N．公社債の空売りの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下記 O．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができますものとしてします。
- ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- 〇．公社債の借入れの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- Ｐ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- Ｑ．外国為替予約取引の指図
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- ロ．上記イ．の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- Ｒ．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図
- 委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。
- Ｓ．再投資の指図
- 委託会社は、上記Ｒ．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。
- Ｔ．資金の借入れ
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

- ハ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。
- ウ．受託会社による資金の立替え
- イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。
- ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。
- ヴ．利害関係人等との取引等
- イ．受託会社は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託会社が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）及び受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下イ．及び下記ロ．において同じ。））、信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記イ．からロ．まで及びQ．からT．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。
- ロ．受託会社は、受託会社がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託会社又は受託会社の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託会社の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ハ．委託会社は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託会社、その取締役、執行役及び委託会社の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）又は委託会社が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記イ．からロ．まで及びQ．からT．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができます。受託会社は、委託会社の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。
- 二．上記イ．からハ．までの場合、委託会社及び受託会社は、受益者に対して信託法第31条第3項及び同法第32条第3項の通知は行いません。
- W．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- X．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
- < 関連法令に基づく投資制限 >
- イ．同一の法人の発行する株式への投資制限  
（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）  
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数

に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### 為替変動リスク

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

##### 金利変動リスク

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

##### 信用リスク

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

##### 流動性リスク

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

##### カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### < その他の留意点 >

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

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

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落すること



になります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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

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

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

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

## （２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*2017年7月～2022年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

## 各資産クラスの指数について

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

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

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

ありません。

## (2) 【換金（解約）手数料】

## &lt; 解約手数料 &gt;

ありません。

## &lt; 信託財産留保額 &gt;

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.2%の率を乗じて得た額を信託財産留保額（ ）として当該基準価額から控除します。また、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

## ( 3 ) 【信託報酬等】

## 信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に以下の率を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

支払先		純資産総額		主な役務
		100億円以下の部分	100億円超の部分	
合計		年率0.66% ( 税抜0.6% ) ( )	年率0.55% ( 税抜0.5% )	
内訳 ( 純資産総額に対して )	委託会社	年率0.33% ( 税抜0.3% )	年率0.275% ( 税抜0.25% )	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
	販売会社	年率0.275% ( 税抜0.25% )	年率0.22% ( 税抜0.2% )	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
	受託会社	年率0.055% ( 税抜0.05% )	年率0.055% ( 税抜0.05% )	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

## ( 4 ) 【その他の手数料等】

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

##### イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

##### ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

##### ハ．損益通算について

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

##### ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。ご利用の場  
合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡

所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### 個別元本について

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

#### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2022年6月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、2022年6月30日現在の状況について記載してあります。

### 【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

#### （1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	3,765,499,878	99.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		15,159,768	0.40
合計(純資産総額)		3,780,659,646	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	475,367,033	2.7223	1,294,091,674	2.7381	1,301,602,473	34.43
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	279,084,664	4.5848	1,279,547,368	4.4229	1,234,363,560	32.65
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	573,129,094	2.2253	1,275,384,173	2.1453	1,229,533,845	32.52

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.60
合計	99.60

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

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3)【運用実績】

### 【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)

第6期計算期間末	(2013年 6月10日)	2,447,708,994	2,452,312,536	10,634	10,654
第7期計算期間末	(2014年 6月10日)	2,498,609,731	2,502,660,953	12,335	12,355
第8期計算期間末	(2015年 6月10日)	3,184,301,741	3,188,483,833	15,228	15,248
第9期計算期間末	(2016年 6月10日)	2,877,411,328	2,877,411,328	13,131	13,131
第10期計算期間末	(2017年 6月12日)	3,275,045,188	3,275,045,188	14,905	14,905
第11期計算期間末	(2018年 6月11日)	3,448,836,583	3,448,836,583	16,204	16,204
第12期計算期間末	(2019年 6月10日)	3,163,412,591	3,163,412,591	15,823	15,823
第13期計算期間末	(2020年 6月10日)	3,240,366,584	3,240,366,584	17,000	17,000
第14期計算期間末	(2021年 6月10日)	3,676,026,407	3,676,026,407	20,530	20,530
第15期計算期間末	(2022年 6月10日)	3,867,088,369	3,867,088,369	21,589	21,589
	2021年 6月末日	3,680,592,834		20,584	
	7月末日	3,681,365,559		20,568	
	8月末日	3,730,398,457		20,943	
	9月末日	3,736,099,821		21,019	
	10月末日	3,833,646,441		21,561	
	11月末日	3,774,100,913		21,185	
	12月末日	3,876,063,392		21,743	
	2022年 1月末日	3,696,140,280		20,752	
	2月末日	3,661,290,363		20,541	
	3月末日	3,870,960,100		21,774	
	4月末日	3,789,432,671		21,288	
	5月末日	3,795,812,656		21,266	
	6月末日	3,780,659,646		21,115	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第6期計算期間	2012年 6月12日～2013年 6月10日	20
第7期計算期間	2013年 6月11日～2014年 6月10日	20
第8期計算期間	2014年 6月11日～2015年 6月10日	20
第9期計算期間	2015年 6月11日～2016年 6月10日	0
第10期計算期間	2016年 6月11日～2017年 6月12日	0
第11期計算期間	2017年 6月13日～2018年 6月11日	0
第12期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	0
第13期計算期間	2019年 6月11日～2020年 6月10日	0
第14期計算期間	2020年 6月11日～2021年 6月10日	0
第15期計算期間	2021年 6月11日～2022年 6月10日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
--	-----	--------

第6期計算期間	2012年 6月12日～2013年 6月10日	45.5
第7期計算期間	2013年 6月11日～2014年 6月10日	16.2
第8期計算期間	2014年 6月11日～2015年 6月10日	23.6
第9期計算期間	2015年 6月11日～2016年 6月10日	13.8
第10期計算期間	2016年 6月11日～2017年 6月12日	13.5
第11期計算期間	2017年 6月13日～2018年 6月11日	8.7
第12期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	2.4
第13期計算期間	2019年 6月11日～2020年 6月10日	7.4
第14期計算期間	2020年 6月11日～2021年 6月10日	20.8
第15期計算期間	2021年 6月11日～2022年 6月10日	5.2

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

#### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第6期計算期間	2012年 6月12日～2013年 6月10日	407,062,229	778,854,935	2,301,771,113
第7期計算期間	2013年 6月11日～2014年 6月10日	366,034,410	642,194,197	2,025,611,326
第8期計算期間	2014年 6月11日～2015年 6月10日	355,749,941	290,314,770	2,091,046,497
第9期計算期間	2015年 6月11日～2016年 6月10日	331,285,768	230,971,419	2,191,360,846
第10期計算期間	2016年 6月11日～2017年 6月12日	259,687,608	253,825,441	2,197,223,013
第11期計算期間	2017年 6月13日～2018年 6月11日	217,108,019	285,901,685	2,128,429,347
第12期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	164,740,715	293,882,676	1,999,287,386
第13期計算期間	2019年 6月11日～2020年 6月10日	138,119,120	231,301,778	1,906,104,728
第14期計算期間	2020年 6月11日～2021年 6月10日	106,278,424	221,795,479	1,790,587,673
第15期計算期間	2021年 6月11日～2022年 6月10日	83,743,586	83,139,097	1,791,192,162

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

(参考)

日本株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	286,346,004,520	98.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,456,174,768	1.87
合計(純資産総額)		291,802,179,288	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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



## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	5,424,450,000	1.86

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

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	5,426,200	2,276.02	12,350,139,724	2,100.00	11,395,020,000	3.91
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	745,600	12,731.73	9,492,781,834	11,095.00	8,272,432,000	2.83
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,309,200	3,351.91	4,388,323,968	3,896.00	5,100,643,200	1.75
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,871,700	686.72	4,718,981,321	729.40	5,012,217,980	1.72
日本	株式	キーエンス	電気機器	107,900	59,232.95	6,391,235,743	46,380.00	5,004,402,000	1.71
日本	株式	任天堂	その他製品	67,200	54,339.60	3,651,621,539	58,680.00	3,943,296,000	1.35
日本	株式	日立製作所	電気機器	572,500	6,299.92	3,606,704,935	6,438.00	3,685,755,000	1.26
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	700,400	5,349.52	3,746,810,207	5,235.00	3,666,594,000	1.26
日本	株式	KDDI	情報・通信業	851,500	3,639.25	3,098,826,279	4,289.00	3,652,083,500	1.25
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	935,600	3,370.93	3,153,850,621	3,818.00	3,572,120,800	1.22
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	75,500	58,047.98	4,382,622,986	44,300.00	3,344,650,000	1.15
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	814,800	5,931.07	4,832,635,836	3,995.00	3,255,126,000	1.12
日本	株式	三菱商事	卸売業	768,700	3,875.68	2,979,235,216	4,037.00	3,103,241,900	1.06
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	761,800	4,165.17	3,173,030,185	4,032.00	3,071,577,600	1.05
日本	株式	第一三共	医薬品	863,400	2,609.85	2,253,344,490	3,437.00	2,967,505,800	1.02
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	870,200	3,383.77	2,944,556,654	3,293.00	2,865,568,600	0.98
日本	株式	ダイキン工業	機械	130,000	24,755.06	3,218,157,800	21,750.00	2,827,500,000	0.97
日本	株式	信越化学工業	化学	184,800	18,717.67	3,459,025,416	15,300.00	2,827,440,000	0.97
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,769,200	1,449.16	2,563,865,186	1,506.50	2,665,299,800	0.91
日本	株式	HOYA	精密機器	229,800	14,657.12	3,368,208,223	11,585.00	2,662,233,000	0.91
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	326,700	6,797.78	2,220,834,726	7,903.00	2,581,910,100	0.88
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	702,800	3,684.65	2,589,572,020	3,667.00	2,577,167,600	0.88
日本	株式	三井物産	卸売業	849,700	2,854.17	2,425,190,779	2,994.50	2,544,426,650	0.87

日本	株式	村田製作所	電気機器	324,800	8,574.62	2,785,036,576	7,396.00	2,402,220,800	0.82
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	121,000	18,896.77	2,286,509,170	18,920.00	2,289,320,000	0.78
日本	株式	ファナック	電気機器	104,500	22,976.22	2,401,015,564	21,240.00	2,219,580,000	0.76
日本	株式	日本電産	電気機器	264,600	10,991.85	2,908,443,510	8,380.00	2,217,348,000	0.76
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,407,600	1,584.35	2,230,141,347	1,543.00	2,171,926,800	0.74
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,017,700	1,935.04	1,969,295,499	2,115.00	2,152,435,500	0.74
日本	株式	S M C	機械	34,900	65,325.66	2,279,865,576	60,470.00	2,110,403,000	0.72

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.32
		建設業	2.21
		食料品	3.38
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.19
		化学	6.16
		医薬品	5.37
		石油・石炭製品	0.53
		ゴム製品	0.69
		ガラス・土石製品	0.71
		鉄鋼	0.76
		非鉄金属	0.71
		金属製品	0.59
		機械	5.21
		電気機器	17.02
		輸送用機器	7.92
		精密機器	2.57
		その他製品	2.48
		電気・ガス業	1.35
		陸運業	3.02
		海運業	0.61
		空運業	0.43
倉庫・運輸関連業	0.18		
情報・通信業	8.95		
卸売業	5.41		
小売業	4.24		
銀行業	5.29		

	証券、商品先物取引業	0.72
	保険業	2.31
	その他金融業	1.13
	不動産業	2.01
	サービス業	5.10
	小計	98.13
合計		98.13

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	290円		5,575,368,800	5,424,450,000	1.86

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

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

#### 外国株式マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	216,402,883,024	65.42
	イギリス	14,332,472,219	4.33
	カナダ	12,327,787,554	3.73
	スイス	10,705,264,667	3.24
	フランス	9,621,208,950	2.91
	ドイツ	7,205,823,745	2.18
	オーストラリア	6,790,893,136	2.05
	アイルランド	5,498,821,184	1.66
	オランダ	5,485,565,173	1.66
	スウェーデン	2,971,859,563	0.90
	デンマーク	2,544,088,356	0.77

	スペイン	2,355,851,766	0.71
	香港	2,241,331,467	0.68
	イタリア	1,595,487,765	0.48
	フィンランド	1,134,179,703	0.34
	シンガポール	1,022,457,383	0.31
	ジャージー	1,004,222,598	0.30
	ベルギー	805,616,119	0.24
	ノルウェー	775,425,015	0.23
	ケイマン	724,485,230	0.22
	イスラエル	708,285,289	0.21
	バミューダ	459,389,610	0.14
	キュラソー	344,568,397	0.10
	ルクセンブルク	246,508,733	0.07
	ニュージーランド	211,129,351	0.06
	オーストリア	173,402,506	0.05
	ポルトガル	168,232,435	0.05
	マン島	56,480,862	0.02
	リベリア	52,289,452	0.02
	パナマ	51,887,436	0.02
	小計	308,017,898,688	93.12
投資信託受益証券	オーストラリア	101,139,268	0.03
	香港	50,269,634	0.02
	小計	151,408,902	0.05
投資証券	アメリカ	6,585,788,871	1.99
	オーストラリア	384,450,328	0.12
	イギリス	173,200,716	0.05
	シンガポール	151,655,559	0.05
	香港	122,085,709	0.04
	フランス	117,608,805	0.04
	カナダ	42,652,304	0.01
	ベルギー	31,214,256	0.01
	小計	7,608,656,548	2.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		15,006,617,876	4.54
合計(純資産総額)		330,784,582,014	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	11,046,400,717	3.34
	買建	カナダ	882,411,840	0.27
	買建	ドイツ	2,314,130,603	0.70
	買建	イギリス	288,713,218	0.09
	買建	オーストラリア	495,491,520	0.15

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		2,390,431,239	0.72

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	809,683	23,519.08	19,043,007,021	19,029.95	15,408,232,188	4.66
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	353,374	41,728.65	14,745,822,940	35,572.33	12,570,338,944	3.80
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	454,960	21,424.16	9,747,139,753	14,887.18	6,773,073,961	2.05

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	14,930	390,120.11	5,824,493,349	305,347.22	4,558,834,001	1.38
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	14,103	389,978.73	5,499,870,096	306,864.36	4,327,708,188	1.31
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	43,619	125,013.05	5,452,944,574	93,690.03	4,086,665,837	1.24
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	46,721	66,065.35	3,086,639,652	70,487.24	3,293,234,471	1.00
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	130,558	23,469.83	3,064,174,636	24,190.99	3,158,327,690	0.95
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	124,147	33,100.66	4,109,348,533	21,242.80	2,637,230,587	0.80
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	114,468	32,405.46	3,709,388,332	22,407.31	2,564,921,014	0.78
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	210,256	11,171.99	2,348,979,194	12,044.24	2,532,374,062	0.77
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	64,127	43,054.24	2,760,939,640	37,380.61	2,397,106,583	0.72
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	119,071	22,056.41	2,626,279,605	19,435.89	2,314,251,573	0.70
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	146,660	20,791.82	3,049,328,768	15,759.20	2,311,244,859	0.70
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	139,868	17,050.46	2,384,814,719	16,095.67	2,251,270,570	0.68
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	82,381	31,180.14	2,568,651,149	27,267.65	2,246,337,098	0.68
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	52,079	48,943.55	2,548,931,588	37,432.55	1,949,449,855	0.59
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	279,392	7,244.21	2,023,974,528	6,962.47	1,945,260,989	0.59
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	96,745	18,730.64	1,812,096,413	20,089.22	1,943,532,208	0.59
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	43,362	52,166.75	2,262,054,829	44,091.60	1,911,900,011	0.58
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	87,899	19,257.50	1,692,715,030	21,067.85	1,851,843,404	0.56
アメリカ	株式	LILLY (ELI) & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	40,232	33,252.64	1,337,820,320	44,147.63	1,776,147,852	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	204,683	8,340.53	1,707,165,713	8,573.93	1,754,939,024	0.53
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	34,930	49,400.58	1,725,562,288	45,773.87	1,598,881,628	0.48
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	125,650	10,766.85	1,352,854,762	12,644.26	1,588,752,123	0.48
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	360,929	6,588.78	2,378,084,176	4,354.62	1,571,710,374	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	68,768	23,543.57	1,619,044,293	22,788.65	1,567,130,323	0.47
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	208,706	7,276.59	1,518,669,965	6,962.47	1,453,111,184	0.44

アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	19,450	81,180.43	1,578,959,496	73,249.54	1,424,703,662	0.43
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	22,048	70,884.40	1,562,859,360	64,217.73	1,415,872,537	0.43

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.07
		素材	4.12
		資本財	5.60
		商業・専門サービス	1.13
		運輸	1.87
		自動車・自動車部品	2.00
		耐久消費財・アパレル	1.53
		消費者サービス	1.64
		メディア・娯楽	5.56
		小売	4.42
		食品・生活必需品小売り	1.48
		食品・飲料・タバコ	4.27
		家庭用品・パーソナル用品	1.73
		ヘルスケア機器・サービス	4.71
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.00
		銀行	5.62
		各種金融	4.40
		保険	3.09
		不動産	0.40
		ソフトウェア・サービス	10.58
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.03
電気通信サービス	1.64		
公益事業	3.13		
半導体・半導体製造装置	4.09		
	小計	93.12	
投資信託受益証券			0.05
投資証券			2.30
合計			95.46

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	423	アメリカドル	79,694,366	10,892,625,944	80,819,437.5	11,046,400,717	3.34
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	36	カナダドル	8,478,090	898,677,540	8,324,640	882,411,840	0.27
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	59	スイスフラン	6,317,203	904,623,470	6,364,330	911,372,056	0.28
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	281	ユーロ	9,755,117	1,391,762,542	9,832,190	1,402,758,547	0.42
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	32	オーストラリアドル	5,256,749	493,608,731	5,276,800	495,491,520	0.15
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	24	イギリスポンド	1,715,810	284,326,874	1,742,280	288,713,218	0.09

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	12,955,600.00	1,756,103,196	1,769,984,387	0.54
	カナダドル	買建	400,000.00	42,276,400	42,386,880	0.01
	ユーロ	買建	2,000,000.00	284,407,520	285,346,480	0.09
	イギリスポンド	買建	680,000.00	112,683,656	112,644,098	0.03
	スイスフラン	買建	260,000.00	37,004,110	37,231,818	0.01
	スウェーデンクローナ	買建	1,900,000.00	25,460,000	25,326,430	0.01
	デンマーククローネ	買建	850,000.00	16,362,840	16,303,000	0.00
	オーストラリアドル	買建	380,000.00	35,694,806	35,680,176	0.01
	香港ドル	買建	1,900,000.00	32,958,350	33,075,770	0.01
	シンガポールドル	買建	210,000.00	20,594,910	20,594,490	0.01
	イスラエルシェケル	買建	300,000.00	11,855,160	11,857,710	0.00

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

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



## 外国債券マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	78,018,659,893	49.40
	フランス	13,383,360,898	8.47
	イタリア	12,547,937,541	7.95
	ドイツ	10,023,127,238	6.35
	スペイン	8,019,305,374	5.08
	イギリス	7,655,332,642	4.85
	中国	3,135,360,456	1.99
	カナダ	3,134,233,376	1.98
	ベルギー	3,095,963,125	1.96
	オランダ	2,632,451,850	1.67
	オーストラリア	2,316,825,339	1.47
	オーストリア	1,974,147,617	1.25
	メキシコ	1,187,928,605	0.75
	アイルランド	1,037,895,930	0.66
	フィンランド	806,200,620	0.51
	マレーシア	784,804,515	0.50
	シンガポール	677,335,177	0.43
	ポーランド	635,530,194	0.40
	イスラエル	614,555,595	0.39
	デンマーク	580,286,548	0.37
スウェーデン	411,270,504	0.26	
ノルウェー	316,048,549	0.20	
	小計	152,988,561,586	96.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,946,381,687	3.13
合計(純資産総額)		157,934,943,273	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	1,677,576,200	1.06
	買建	ドイツ	1,521,166,087	0.96

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		3,606,154,609	2.28

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	10,610,000	13,298.00	1,410,918,119	12,941.88	1,373,134,264	0.250	2024/6/15	0.87
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	9,450,000	12,907.24	1,219,734,448	11,770.49	1,112,311,990	1.375	2031/11/15	0.70
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	9,130,000	12,305.47	1,123,489,524	11,253.67	1,027,460,618	0.625	2030/8/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 2.25% 03/31/24	7,300,000	13,610.86	993,593,347	13,481.39	984,142,186	2.250	2024/3/31	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	6,900,000	14,226.33	981,617,431	13,224.85	912,515,193	2.625	2029/2/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 0.125% 06/30/23	6,630,000	13,480.33	893,746,007	13,293.46	881,356,717	0.125	2023/6/30	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/25	7,000,000	12,989.93	909,295,740	12,450.69	871,548,563	0.250	2025/9/30	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	7,400,000	12,346.04	913,607,562	11,317.74	837,513,112	0.625	2030/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/30/23	6,000,000	14,059.88	843,593,235	13,642.90	818,574,382	2.875	2023/11/30	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.625% 06/30/23	6,000,000	13,952.83	837,170,336	13,628.49	817,709,460	2.625	2023/6/30	0.52
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	13,844.72	837,605,741	13,284.65	803,721,650	2.000	2025/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	6,550,000	12,881.02	843,706,956	11,684.00	765,302,286	1.250	2031/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.125% 01/15/25	5,830,000	13,176.90	768,213,781	13,004.35	758,153,866	1.125	2025/1/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	5,750,000	13,623.15	783,331,233	12,947.22	744,465,531	1.625	2026/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	5,460,000	13,979.26	763,267,998	13,465.64	735,224,462	2.375	2024/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.25% 05/31/28	6,000,000	13,156.51	789,391,073	12,239.26	734,356,013	1.250	2028/5/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	5,500,000	13,948.83	767,185,911	13,269.70	729,833,830	2.250	2025/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/51	6,940,000	12,892.05	894,708,828	10,466.69	726,388,848	2.000	2051/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.375% 08/15/24	5,500,000	13,303.34	731,683,809	12,909.85	710,041,921	0.375	2024/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	6,160,000	12,542.52	772,619,579	11,459.76	705,921,447	0.875	2030/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	5,400,000	13,610.33	734,958,259	12,902.91	696,757,268	1.625	2026/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.25% 12/31/26	5,500,000	13,252.97	728,913,478	12,574.56	691,600,800	1.250	2026/12/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 01/31/24	5,090,000	13,918.66	708,460,248	13,502.75	687,290,283	2.250	2024/1/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	5,260,000	13,974.46	735,056,713	13,034.78	685,629,808	2.250	2027/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.125% 10/15/23	5,200,000	13,414.66	697,562,393	13,173.60	685,027,349	0.125	2023/10/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/28	5,550,000	13,343.79	740,580,720	12,332.16	684,435,247	1.500	2028/11/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 07/31/25	5,000,000	14,241.41	712,070,769	13,566.55	678,327,894	2.875	2025/7/31	0.43

アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	5,300,000	13,523.84	716,763,804	12,783.31	677,515,821	1.500	2026/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	5,230,000	13,384.49	700,009,127	12,932.27	676,358,100	0.750	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/31/25	5,000,000	14,183.21	709,160,974	13,505.15	675,257,931	2.750	2025/8/31	0.43

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	96.87
合計	96.87

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	43	アメリカドル	4,818,417.27	658,581,272	4,796,515.84	655,587,785	0.42
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	31	アメリカドル	3,667,852.53	501,322,083	3,642,984.53	497,923,125	0.32
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	28	アメリカドル	3,851,828.4	526,467,906	3,834,250	524,065,290	0.33
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	17	ユーロ	1,848,340.7	263,702,768	1,849,770	263,906,686	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	25	ユーロ	3,076,952.5	438,988,813	3,079,750	439,387,932	0.28
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	39	ユーロ	5,754,191.9	820,950,558	5,732,610	817,871,469	0.52

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	14,460,000.00	1,956,085,525	1,974,598,314	1.25
	カナダドル	買建	1,310,000.00	137,769,792	138,731,227	0.09
	ユーロ	買建	9,140,000.00	1,299,888,662	1,304,051,328	0.83
	イギリスポンド	買建	1,140,000.00	188,940,923	188,773,740	0.12

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

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

#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

## 運用実績

当初設定日：2008年3月3日  
作成基準日：2022年6月30日

## 基準価額・純資産の推移



基準価額	21,115円
純資産総額	37.81億円

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年6月	0円
2019年6月	0円
2020年6月	0円
2021年6月	0円
2022年6月	0円
設定来 分配金合計額	60円

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

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

## 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位租入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国債券 マザーファンド	34.4%	T 0.25% 06/15/24	アメリカ	国債	-	0.250%	2024/06/15	0.3%
		T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.2%
		T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.2%
		T 2.25% 03/31/24	アメリカ	国債	-	2.250%	2024/03/31	0.2%
外国株式 マザーファンド	32.6%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェア	-	-	1.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.2%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.7%
		ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	メディア・娯楽	-	-	0.4%
日本株式 マザーファンド	32.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.3%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.9%
		日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.6%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.6%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。  
※2022年は年初から作成基準日までの収益率です。  
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

#### < 申込手続 >

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

#### < 申込コース >

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

「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

ありません。

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

ありません。

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

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

### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

### < 一部解約手続 >

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

### < 一部解約の受付 >

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

### < 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

### < 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

### < 一部解約代金の支払い >

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

### < 受付不可日 >

ありません。

### < 一部解約受付の中止等 >

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

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

##### <基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### <主要な投資対象資産の評価方法>

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

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式、国内上場投信の評価方法

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

公社債等の評価方法

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）



b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

#### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （2）【保管】

該当事項はありません。

#### （3）【信託期間】

無期限とします。（2008年 3月 3日設定）

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

#### （4）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年6月11日から翌年6月10日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は2008年3月3日から2008年6月10日までとします。なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

#### （5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

## (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

## <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

### (1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

### (2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使

しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

#### 4【受益者の権利等】

##### (1)収益分配金に対する請求権

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

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

上記 の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

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

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

##### (2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

##### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間(2021年6月11日から2022年6月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第14期 ( 2021年 6月10日現在 )	第15期 ( 2022年 6月10日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	22,773,320	29,035,519
親投資信託受益証券	3,661,255,721	3,850,565,571
未収入金	4,616,617	50,520
流動資産合計	3,688,645,658	3,879,651,610
資産合計	3,688,645,658	3,879,651,610
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	920,020	51,312
未払受託者報酬	966,883	1,034,054
未払委託者報酬	10,635,696	11,374,496
未払利息	25	33
その他未払費用	96,627	103,346
流動負債合計	12,619,251	12,563,241
負債合計	12,619,251	12,563,241
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,790,587,673	1,791,192,162
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	1,885,438,734	2,075,896,207
( 分配準備積立金 )	1,504,059,804	1,620,544,407
元本等合計	3,676,026,407	3,867,088,369
純資産合計	3,676,026,407	3,867,088,369
負債純資産合計	3,688,645,658	3,879,651,610

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期		第15期	
	自	2020年 6月11日	自	2021年 6月11日
	至	2021年 6月10日	至	2022年 6月10日
営業収益				
受取利息		48		80
有価証券売買等損益		672,338,989		213,812,701
営業収益合計		672,339,037		213,812,781
営業費用				
支払利息		4,739		6,168
受託者報酬		1,867,274		2,068,864
委託者報酬		20,539,994		22,757,366
その他費用		186,603		206,766
営業費用合計		22,598,610		25,039,164
営業利益又は営業損失（ ）		649,740,427		188,773,617
経常利益又は経常損失（ ）		649,740,427		188,773,617
当期純利益又は当期純損失（ ）		649,740,427		188,773,617
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（ ）		31,503,596		4,141,304
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,334,261,856		1,885,438,734
剰余金増加額又は欠損金減少額		87,904,089		93,126,398
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		87,904,089		93,126,398
剰余金減少額又は欠損金増加額		154,964,042		87,301,238
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		154,964,042		87,301,238
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,885,438,734		2,075,896,207

## （３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第14期 (2021年 6月10日現在)	第15期 (2022年 6月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,790,587,673口	1,791,192,162口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.0530円 (20,530円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.1589円 (21,589円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第14期 自 2020年 6月11日 至 2021年 6月10日			第15期 自 2021年 6月11日 至 2022年 6月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	60,649,756円	費用控除後の配当等収益額	A	64,374,800円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	557,587,075円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	120,257,513円
収益調整金額	C	806,940,838円	収益調整金額	C	876,366,019円
分配準備積立金額	D	885,822,973円	分配準備積立金額	D	1,435,912,094円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,311,000,642円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,496,910,426円
当ファンドの期末残存口数	F	1,790,587,673口	当ファンドの期末残存口数	F	1,791,192,162口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	12,906円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	13,939円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項



	第15期 自 2021年 6月11日 至 2022年 6月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	第15期 (2022年 6月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第14期	第15期
	自 2020年 6月11日 至 2021年 6月10日	自 2021年 6月11日 至 2022年 6月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,906,104,728円	1,790,587,673円
期中追加設定元本額	106,278,424円	83,743,586円
期中一部解約元本額	221,795,479円	83,139,097円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第14期 (2021年 6月10日現在)	第15期 (2022年 6月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	610,010,810	201,858,011
合計	610,010,810	201,858,011

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	573,317,594	1,275,803,641	
	外国株式マザーファンド	279,160,110	1,279,921,188	
	外国債券マザーファンド	475,642,193	1,294,840,742	
合計		1,328,119,897	3,850,565,571	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 日本株式マザーファンド

#### 貸借対照表

	2022年 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,054,761,918
株式	295,520,076,660
未収配当金	2,531,345,505
前払金	15,352,300
差入委託証拠金	156,336,500
流動資産合計	301,277,872,883
資産合計	301,277,872,883
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,352,300
未払金	710,290,020
未払解約金	276,919,586
未払利息	3,487
流動負債合計	1,002,565,393
負債合計	1,002,565,393
純資産の部	
元本等	
元本	134,935,811,007
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	165,339,496,483
元本等合計	300,275,307,490
純資産合計	300,275,307,490
負債純資産合計	301,277,872,883

#### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2022年 6月10日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2022年 6月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	134,935,811,007口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.2253円 (1万口当たり純資産額) (22,253円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2022年 6月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2022年 6月10日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<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。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年 6月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2022年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 6月11日
期首元本額	133,684,734,050円
期中追加設定元本額	10,224,290,320円
期中一部解約元本額	8,973,213,363円
期末元本額	134,935,811,007円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	615,240,840円
D C日本株式インデックスファンド	292,800,581円
D C日本株式インデックスファンドL	53,733,270,765円
D C日本株式インデックスファンドA	665,618,363円
D Cバランスファンド30	2,286,873,264円
D Cバランスファンド50	3,611,601,078円
D Cバランスファンド70	2,168,820,313円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	573,317,594円
日本株式インデックスe	1,461,029,419円
インデックスコレクション（国内株式）	21,197,934,428円
インデックスコレクション（バランス株式30）	12,325,738,906円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,942,747,340円
インデックスコレクション（バランス株式70）	2,667,396,178円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,512,340,753円
日本株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	2,740,442,594円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	984,022,564円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	48,062,097円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	546,918,960円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	66,470,887円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	132,648,937円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	101,692,856円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	694,110,741円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	421,603,472円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	7,374,013,738円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	700,101,603円

区分	2022年 6月10日現在
V Aバランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	70,164,104円
V Aポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	1,208,980,263円
V Aポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	25,917,148円
バランスV A 4 0（適格機関投資家専用）	148,407,400円
バランスファンドV A（適格機関投資家専用）	1,916,001,132円
V Aバランスファンド 2（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	53,324,192円
V Aバランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	55,303,173円
V Aファンド 2 5（適格機関投資家専用）	21,295,597円
バランスファンドV A 2（適格機関投資家専用）	591,828,960円
バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用）	265,097,497円
バランスファンドV A 3（適格機関投資家専用）	4,468,439,385円
世界バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	82,244,607円
国内バランスV A 3 0（適格機関投資家専用）	34,465,479円
国内バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	8,108,641円
V Aバランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	118,833,457円
私募日本株式インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	2,581,701円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 6月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		2,188,890,608
合計		2,188,890,608

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 6月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,423,692,300	-	4,408,340,000	15,352,300
	合計	4,423,692,300	-	4,408,340,000	15,352,300

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,200	3,350.00	17,420,000	
日本水産	149,800	534.00	79,993,200	
マルハニチロ	22,100	2,339.00	51,691,900	
雪国まいたけ	11,500	889.00	10,223,500	
カネコ種苗	4,400	1,701.00	7,484,400	
サカタのタネ	17,600	4,580.00	80,608,000	
ホクト	12,400	1,902.00	23,584,800	
ホクリヨウ	2,100	635.00	1,333,500	
住石ホールディングス	27,500	196.00	5,390,000	
日鉄鉱業	3,200	5,750.00	18,400,000	
三井松島ホールディングス	6,600	3,020.00	19,932,000	
I N P E X	565,100	1,784.00	1,008,138,400	
石油資源開発	18,500	3,650.00	67,525,000	
K & O エナジーグループ	6,500	1,635.00	10,627,500	
ショーボンドホールディングス	19,700	6,120.00	120,564,000	
ミライト・ホールディングス	50,600	1,625.00	82,225,000	
タマホーム	9,500	2,394.00	22,743,000	
サンヨーホームズ	1,800	734.00	1,321,200	
日本アクア	6,200	601.00	3,726,200	
ファーストコーポレーション	3,800	758.00	2,880,400	
ベステラ	3,200	1,178.00	3,769,600	
R o b o t H o m e	26,200	197.00	5,161,400	
キャンディル	2,400	543.00	1,303,200	
ダイセキ環境ソリューション	3,000	994.00	2,982,000	
第一カッター興業	3,600	1,320.00	4,752,000	
安藤・間	73,800	822.00	60,663,600	
東急建設	43,500	622.00	27,057,000	
コムシスホールディングス	50,700	2,516.00	127,561,200	
ピーアールホールディングス	20,300	316.00	6,414,800	
高松コンストラクショングループ	9,600	2,059.00	19,766,400	
東建コーポレーション	4,400	8,600.00	37,840,000	
ソネック	1,600	1,016.00	1,625,600	
ヤマウラ	7,100	930.00	6,603,000	
オリエンタル白石	52,900	246.00	13,013,400	



大成建設	98,700	4,135.00	408,124,500
大林組	345,900	975.00	337,252,500
清水建設	321,300	736.00	236,476,800
飛島建設	9,700	1,009.00	9,787,300
長谷工コーポレーション	100,900	1,592.00	160,632,800
松井建設	12,800	673.00	8,614,400
銭高組	1,400	3,565.00	4,991,000
鹿島建設	253,400	1,451.00	367,683,400
不動テトラ	7,700	1,610.00	12,397,000
大末建設	3,800	1,587.00	6,030,600
鉄建建設	7,500	1,819.00	13,642,500
西松建設	22,000	4,255.00	93,610,000
三井住友建設	81,900	450.00	36,855,000
大豊建設	5,300	4,460.00	23,638,000
佐田建設	7,800	453.00	3,533,400
ナカノフドー建設	8,700	314.00	2,731,800
奥村組	19,000	2,950.00	56,050,000
東鉄工業	15,100	2,297.00	34,684,700
イチケン	2,600	1,838.00	4,778,800
富士ピー・エス	4,700	478.00	2,246,600
浅沼組	4,100	5,380.00	22,058,000
戸田建設	143,100	723.00	103,461,300
熊谷組	18,000	2,714.00	48,852,000
北野建設	2,200	2,103.00	4,626,600
植木組	3,000	1,449.00	4,347,000
矢作建設工業	15,000	768.00	11,520,000
ピーエス三菱	12,000	607.00	7,284,000
日本ハウスホールディングス	24,600	401.00	9,864,600
大東建託	37,200	11,410.00	424,452,000
新日本建設	15,400	746.00	11,488,400
東亜道路工業	1,900	5,550.00	10,545,000
日本道路	3,200	6,690.00	21,408,000
東亜建設工業	8,400	2,400.00	20,160,000
日本国土開発	30,600	514.00	15,728,400
若築建設	5,700	2,149.00	12,249,300
東洋建設	40,700	824.00	33,536,800
五洋建設	137,100	651.00	89,252,100
世紀東急工業	17,400	809.00	14,076,600
福田組	3,900	4,515.00	17,608,500
住友林業	84,000	2,009.00	168,756,000
日本基礎技術	9,200	604.00	5,556,800
巴コーポレーション	14,200	417.00	5,921,400

大和ハウス工業	303,400	3,137.00	951,765,800
ライト工業	20,600	1,782.00	36,709,200
積水ハウス	361,100	2,373.50	857,070,850
日特建設	7,500	789.00	5,917,500
北陸電気工事	6,800	769.00	5,229,200
ユアテック	20,800	709.00	14,747,200
日本リーテック	7,100	1,104.00	7,838,400
四電工	3,700	1,740.00	6,438,000
中電工	15,300	2,091.00	31,992,300
関電工	59,000	835.00	49,265,000
きんでん	76,200	1,523.00	116,052,600
東京エネシス	11,200	996.00	11,155,200
トーエネック	3,600	3,365.00	12,114,000
住友電設	9,000	2,489.00	22,401,000
日本電設工業	17,000	1,613.00	27,421,000
エクシオグループ	51,800	2,120.00	109,816,000
新日本空調	8,400	1,885.00	15,834,000
九電工	24,600	2,747.00	67,576,200
三機工業	23,600	1,511.00	35,659,600
日揮ホールディングス	105,700	2,011.00	212,562,700
中外炉工業	3,500	1,754.00	6,139,000
ヤマト	9,400	750.00	7,050,000
太平電業	7,100	2,789.00	19,801,900
高砂熱学工業	29,500	1,621.00	47,819,500
三晃金属工業	1,400	2,633.00	3,686,200
朝日工業社	4,600	1,621.00	7,456,600
明星工業	19,600	743.00	14,562,800
大気社	16,000	3,185.00	50,960,000
ダイダン	7,200	2,068.00	14,889,600
日比谷総合設備	10,500	1,888.00	19,824,000
フィル・カンパニー	1,900	1,217.00	2,312,300
テスホールディングス	10,100	1,350.00	13,635,000
インフロニア・ホールディングス	140,900	927.00	130,614,300
東洋エンジニアリング	15,200	664.00	10,092,800
レイズネクスト	16,200	1,174.00	19,018,800
ニッポン	30,200	1,555.00	46,961,000
日清製粉グループ本社	116,700	1,497.00	174,699,900
日東富士製粉	1,700	4,380.00	7,446,000
昭和産業	9,800	2,438.00	23,892,400
鳥越製粉	9,100	646.00	5,878,600
中部飼料	12,400	1,016.00	12,598,400
フィード・ワン	14,300	663.00	9,480,900

東洋精糖	2,000	960.00	1,920,000
日本甜菜製糖	6,100	1,649.00	10,058,900
D M三井製糖ホールディングス	9,800	1,871.00	18,335,800
塩水港精糖	13,800	210.00	2,898,000
日新製糖	5,500	1,723.00	9,476,500
森永製菓	24,700	3,855.00	95,218,500
中村屋	2,500	3,060.00	7,650,000
江崎グリコ	28,700	3,660.00	105,042,000
名糖産業	4,500	1,619.00	7,285,500
井村屋グループ	6,000	2,299.00	13,794,000
不二家	6,500	2,317.00	15,060,500
山崎製パン	76,600	1,483.00	113,597,800
第一屋製パン	2,200	514.00	1,130,800
モロゾフ	3,500	3,395.00	11,882,500
亀田製菓	6,200	4,335.00	26,877,000
寿スピリッツ	10,400	7,520.00	78,208,000
カルビー	53,000	2,413.00	127,889,000
森永乳業	20,300	4,415.00	89,624,500
六甲バター	8,000	1,406.00	11,248,000
ヤクルト本社	77,900	7,420.00	578,018,000
明治ホールディングス	67,600	6,230.00	421,148,000
雪印メグミルク	26,300	1,711.00	44,999,300
プリマハム	14,500	2,115.00	30,667,500
日本ハム	42,000	4,020.00	168,840,000
林兼産業	3,500	493.00	1,725,500
丸大食品	10,800	1,483.00	16,016,400
S Foods	10,400	3,025.00	31,460,000
柿安本店	4,000	2,432.00	9,728,000
伊藤ハム米久ホールディングス	74,800	661.00	49,442,800
サッポロホールディングス	35,900	2,843.00	102,063,700
アサヒグループホールディングス	249,100	4,431.00	1,103,762,100
キリンホールディングス	427,200	2,078.50	887,935,200
宝ホールディングス	69,400	968.00	67,179,200
オエノンホールディングス	31,400	296.00	9,294,400
養命酒製造	3,300	1,748.00	5,768,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	76,600	1,466.00	112,295,600
サントリー食品インターナショナル	77,800	4,850.00	377,330,000
ダイドーグループホールディングス	6,000	4,990.00	29,940,000
伊藤園	35,300	5,310.00	187,443,000
キーコーヒー	10,900	2,075.00	22,617,500
ユニカフェ	3,500	918.00	3,213,000
ジャパンフーズ	1,700	1,160.00	1,972,000

日清オイリオグループ	13,700	2,986.00	40,908,200
不二製油グループ本社	25,200	1,827.00	46,040,400
かどや製油	1,100	3,450.00	3,795,000
J・オイルミルズ	10,800	1,511.00	16,318,800
キッコーマン	74,400	6,870.00	511,128,000
味の素	238,100	2,993.50	712,752,350
ブルドックソース	4,400	1,839.00	8,091,600
キューピー	54,300	2,141.00	116,256,300
ハウス食品グループ本社	38,600	2,720.00	104,992,000
カゴメ	44,100	3,275.00	144,427,500
焼津水産化学工業	5,000	915.00	4,575,000
アリアケジャパン	10,600	5,330.00	56,498,000
ピエトロ	1,500	1,800.00	2,700,000
エバラ食品工業	2,500	2,987.00	7,467,500
やまみ	1,000	1,636.00	1,636,000
ニチレイ	46,600	2,262.00	105,409,200
東洋水産	53,200	4,760.00	253,232,000
イトアンドホールディングス	4,400	2,285.00	10,054,000
大冷	1,300	1,900.00	2,470,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,000	542.00	3,252,000
日清食品ホールディングス	40,000	8,320.00	332,800,000
永谷園ホールディングス	5,200	1,988.00	10,337,600
一正蒲鉾	4,700	834.00	3,919,800
フジッコ	10,800	1,917.00	20,703,600
ロック・フィールド	11,900	1,391.00	16,552,900
日本たばこ産業	623,200	2,383.00	1,485,085,600
ケンコーマヨネーズ	6,100	1,394.00	8,503,400
わらべや日洋ホールディングス	7,200	1,727.00	12,434,400
なとり	6,500	1,978.00	12,857,000
イフジ産業	2,000	986.00	1,972,000
ピクルスコーポレーション	5,500	1,313.00	7,221,500
ファーマフーズ	14,600	1,612.00	23,535,200
ユーグレナ	59,700	922.00	55,043,400
紀文食品	9,000	958.00	8,622,000
ミヨシ油脂	4,200	1,044.00	4,384,800
理研ビタミン	10,600	1,595.00	16,907,000
片倉工業	11,100	2,136.00	23,709,600
ゲンゼ	6,900	3,725.00	25,702,500
東洋紡	45,100	1,052.00	47,445,200
ユニチカ	32,400	239.00	7,743,600
富士紡ホールディングス	4,900	3,380.00	16,562,000
倉敷紡績	8,900	2,042.00	18,173,800

シキボウ	5,900	895.00	5,280,500
日本毛織	30,400	960.00	29,184,000
トーア紡コーポレーション	4,200	376.00	1,579,200
帝国繊維	12,300	1,607.00	19,766,100
帝人	102,200	1,376.00	140,627,200
東レ	743,500	727.30	540,747,550
住江織物	2,000	1,719.00	3,438,000
日本フェルト	7,100	421.00	2,989,100
イチカワ	1,600	1,383.00	2,212,800
日東製網	1,200	1,369.00	1,642,800
アツギ	8,500	534.00	4,539,000
ダイニック	3,900	685.00	2,671,500
セーレン	21,800	2,003.00	43,665,400
ソトー	4,300	830.00	3,569,000
東海染工	1,400	1,138.00	1,593,200
小松マテーレ	17,700	1,317.00	23,310,900
ワコールホールディングス	25,200	2,142.00	53,978,400
ホギメディカル	14,500	2,955.00	42,847,500
T S Iホールディングス	35,900	373.00	13,390,700
マツオカコーポレーション	3,500	1,004.00	3,514,000
ワールド	14,900	1,375.00	20,487,500
三陽商会	5,100	915.00	4,666,500
ナイガイ	4,300	311.00	1,337,300
オンワードホールディングス	64,800	264.00	17,107,200
ルックホールディングス	3,700	1,570.00	5,809,000
ゴールドウイン	19,400	8,390.00	162,766,000
デサント	20,300	3,100.00	62,930,000
キング	5,600	540.00	3,024,000
ヤマトインターナショナル	9,400	285.00	2,679,000
特種東海製紙	6,300	3,125.00	19,687,500
王子ホールディングス	449,800	562.00	252,787,600
日本製紙	48,800	954.00	46,555,200
三菱製紙	15,000	306.00	4,590,000
北越コーポレーション	69,900	665.00	46,483,500
中越パルプ工業	4,300	917.00	3,943,100
巴川製紙所	3,400	631.00	2,145,400
大王製紙	50,600	1,439.00	72,813,400
阿波製紙	2,700	319.00	861,300
レンゴー	94,200	706.00	66,505,200
トーモク	6,000	1,540.00	9,240,000
ザ・パック	7,600	2,244.00	17,054,400
北の達人コーポレーション	40,600	221.00	8,972,600

クラレ	157,400	1,150.00	181,010,000
旭化成	718,400	1,088.00	781,619,200
共和レザー	6,500	596.00	3,874,000
昭和電工	99,300	2,643.00	262,449,900
住友化学	793,600	565.00	448,384,000
住友精化	4,700	3,005.00	14,123,500
日産化学	54,800	7,520.00	412,096,000
ラサ工業	4,000	2,074.00	8,296,000
クレハ	8,500	10,730.00	91,205,000
多木化学	4,000	4,810.00	19,240,000
テイカ	7,100	1,306.00	9,272,600
石原産業	19,800	1,199.00	23,740,200
片倉コープアグリ	2,600	1,428.00	3,712,800
日本曹達	13,100	4,365.00	57,181,500
東ソー	148,100	1,795.00	265,839,500
トクヤマ	34,600	1,811.00	62,660,600
セントラル硝子	17,500	3,035.00	53,112,500
東亜合成	57,000	1,056.00	60,192,000
大阪ソーダ	9,300	3,070.00	28,551,000
関東電化工業	22,100	925.00	20,442,500
デンカ	39,300	3,315.00	130,279,500
信越化学工業	184,800	18,115.00	3,347,652,000
日本カーバイド工業	4,100	1,445.00	5,924,500
堺化学工業	7,500	1,964.00	14,730,000
第一稀元素化学工業	9,900	1,158.00	11,464,200
エア・ウォーター	96,400	1,724.00	166,193,600
日本酸素ホールディングス	98,600	2,458.00	242,358,800
日本化学工業	3,300	2,112.00	6,969,600
東邦アセチレン	2,400	1,168.00	2,803,200
日本パーカラライジング	50,900	920.00	46,828,000
高压ガス工業	16,700	665.00	11,105,500
チタン工業	1,300	1,721.00	2,237,300
四国化成工業	13,600	1,289.00	17,530,400
戸田工業	2,400	2,703.00	6,487,200
ステラ ケミファ	5,700	2,567.00	14,631,900
保土谷化学工業	3,200	3,885.00	12,432,000
日本触媒	17,100	5,550.00	94,905,000
大日精化工業	8,500	1,850.00	15,725,000
カネカ	26,100	3,415.00	89,131,500
三菱瓦斯化学	94,700	2,173.00	205,783,100
三井化学	93,200	3,220.00	300,104,000
J S R	105,700	4,160.00	439,712,000

東京応化工業	17,400	7,470.00	129,978,000
大阪有機化学工業	8,600	2,603.00	22,385,800
三菱ケミカルホールディングス	722,100	786.90	568,220,490
KHネオケム	17,800	2,610.00	46,458,000
ダイセル	156,100	903.00	140,958,300
住友ベークライト	16,600	4,675.00	77,605,000
積水化学工業	226,000	1,835.00	414,710,000
日本ゼオン	90,900	1,395.00	126,805,500
アイカ工業	28,400	2,805.00	79,662,000
UBE	53,500	2,097.00	112,189,500
積水樹脂	16,100	1,699.00	27,353,900
タキロンシーアイ	24,500	536.00	13,132,000
旭有機材	6,400	2,230.00	14,272,000
ニチバン	6,200	1,611.00	9,988,200
リケンテクノス	24,600	442.00	10,873,200
大倉工業	5,200	1,757.00	9,136,400
積水化成成品工業	14,100	412.00	5,809,200
群栄化学工業	2,400	2,805.00	6,732,000
タイガースポリマー	5,600	437.00	2,447,200
ミライアル	3,600	2,216.00	7,977,600
ダイキアクシス	4,400	762.00	3,352,800
ダイキョーニシカワ	23,900	515.00	12,308,500
竹本容器	4,100	820.00	3,362,000
森六ホールディングス	5,700	1,839.00	10,482,300
恵和	3,100	4,350.00	13,485,000
日本化薬	81,700	1,140.00	93,138,000
カーリットホールディングス	10,100	736.00	7,433,600
日本精化	7,900	2,000.00	15,800,000
扶桑化学工業	9,400	3,880.00	36,472,000
トリケミカル研究所	11,700	2,579.00	30,174,300
ADEKA	47,300	2,575.00	121,797,500
日油	34,800	5,130.00	178,524,000
新日本理化	17,000	257.00	4,369,000
ハリマ化成グループ	7,800	768.00	5,990,400
花王	244,800	5,265.00	1,288,872,000
第一工業製薬	4,000	2,233.00	8,932,000
石原ケミカル	5,400	1,325.00	7,155,000
日華化学	3,800	891.00	3,385,800
ニイタカ	2,200	2,207.00	4,855,400
三洋化成工業	6,800	4,765.00	32,402,000
有機合成薬品工業	7,900	282.00	2,227,800
大日本塗料	13,200	752.00	9,926,400

日本ペイントホールディングス	426,100	990.00	421,839,000
関西ペイント	104,600	1,745.00	182,527,000
神東塗料	8,900	156.00	1,388,400
中国塗料	25,300	867.00	21,935,100
日本特殊塗料	7,400	938.00	6,941,200
藤倉化成	14,100	490.00	6,909,000
太陽ホールディングス	16,700	3,095.00	51,686,500
D I C	43,300	2,554.00	110,588,200
サカタインクス	22,500	922.00	20,745,000
東洋インキS Cホールディングス	22,500	1,975.00	44,437,500
T & K T O K A	9,100	829.00	7,543,900
富士フィルムホールディングス	203,500	7,315.00	1,488,602,500
資生堂	215,700	5,500.00	1,186,350,000
ライオン	122,700	1,412.00	173,252,400
高砂香料工業	7,000	2,383.00	16,681,000
マンダム	23,100	1,472.00	34,003,200
ミルボン	14,300	5,060.00	72,358,000
ファンケル	46,900	2,321.00	108,854,900
コーセー	21,800	12,100.00	263,780,000
コタ	8,100	1,428.00	11,566,800
シーボン	1,500	1,712.00	2,568,000
ポーラ・オルビスホールディングス	49,400	1,587.00	78,397,800
ノエビアホールディングス	9,000	5,650.00	50,850,000
アジュバンホールディングス	2,600	989.00	2,571,400
新日本製薬	4,700	1,446.00	6,796,200
エステー	7,400	1,470.00	10,878,000
アグロ カネショウ	3,900	1,314.00	5,124,600
コニシ	18,100	1,578.00	28,561,800
長谷川香料	20,000	2,519.00	50,380,000
星光P M C	6,500	576.00	3,744,000
小林製薬	32,400	8,340.00	270,216,000
荒川化学工業	8,700	1,011.00	8,795,700
メック	8,200	2,596.00	21,287,200
日本高純度化学	2,900	2,332.00	6,762,800
タカラバイオ	30,300	1,912.00	57,933,600
J C U	12,200	3,570.00	43,554,000
新田ゼラチン	6,800	625.00	4,250,000
O A T アグリオ	4,800	1,853.00	8,894,400
デクセリアルズ	30,100	4,125.00	124,162,500
アース製薬	9,500	5,210.00	49,495,000
北興化学工業	10,100	1,100.00	11,110,000
大成ラミック	3,200	2,667.00	8,534,400



クマイ化学工業	43,100	1,107.00	47,711,700
日本農薬	20,600	790.00	16,274,000
アキレス	7,400	1,371.00	10,145,400
有沢製作所	16,100	1,098.00	17,677,800
日東電工	70,000	9,750.00	682,500,000
レック	14,200	701.00	9,954,200
三光合成	13,200	350.00	4,620,000
きもと	17,700	231.00	4,088,700
藤森工業	9,500	3,670.00	34,865,000
前澤化成工業	7,000	1,302.00	9,114,000
未来工業	4,100	1,529.00	6,268,900
ウェーブロックホールディングス	4,400	665.00	2,926,000
JSP	6,800	1,429.00	9,717,200
エフピコ	21,300	2,709.00	57,701,700
天馬	9,100	2,408.00	21,912,800
信越ポリマー	20,800	1,156.00	24,044,800
東リ	27,200	216.00	5,875,200
ニフコ	38,700	3,210.00	124,227,000
バルカー	9,400	2,867.00	26,949,800
ユニ・チャーム	223,200	4,205.00	938,556,000
ショーエイコーポレーション	3,100	581.00	1,801,100
協和キリン	123,000	2,940.00	361,620,000
武田薬品工業	910,200	3,632.00	3,305,846,400
アステラス製薬	990,100	2,077.50	2,056,932,750
住友ファーマ	71,500	1,084.00	77,506,000
塩野義製薬	138,200	7,002.00	967,676,400
わかもと製薬	12,100	267.00	3,230,700
日本新薬	26,900	7,600.00	204,440,000
中外製薬	362,200	3,608.00	1,306,817,600
科研製薬	17,100	3,725.00	63,697,500
エーザイ	131,500	5,395.00	709,442,500
ロート製薬	56,600	3,340.00	189,044,000
小野薬品工業	235,700	3,331.00	785,116,700
久光製薬	26,500	3,340.00	88,510,000
持田製薬	13,500	3,145.00	42,457,500
参天製薬	206,500	1,008.00	208,152,000
扶桑薬品工業	3,900	2,127.00	8,295,300
日本ケミファ	1,300	1,910.00	2,483,000
ツムラ	34,000	2,886.00	98,124,000
日医工	34,000	372.00	12,648,000
キッセイ薬品工業	18,000	2,460.00	44,280,000
生化学工業	20,400	817.00	16,666,800

栄研化学	18,300	1,620.00	29,646,000
日水製薬	4,300	1,711.00	7,357,300
鳥居薬品	6,200	2,944.00	18,252,800
JCRファーマ	32,600	2,401.00	78,272,600
東和薬品	16,700	2,441.00	40,764,700
富士製薬工業	6,500	945.00	6,142,500
ゼリア新薬工業	18,500	2,082.00	38,517,000
第一三共	863,400	3,370.00	2,909,658,000
キョーリン製薬ホールディングス	21,700	1,686.00	36,586,200
大幸薬品	17,500	585.00	10,237,500
ダイト	7,300	2,720.00	19,856,000
大塚ホールディングス	227,300	4,436.00	1,008,302,800
大正製薬ホールディングス	23,500	4,830.00	113,505,000
ペプチドリーム	60,800	1,485.00	90,288,000
あすか製薬ホールディングス	11,700	997.00	11,664,900
サワイグループホールディングス	23,300	3,950.00	92,035,000
日本コークス工業	97,800	131.00	12,811,800
ニチレキ	13,300	1,311.00	17,436,300
ユシロ化学工業	5,700	1,009.00	5,751,300
ビーピー・カストロール	4,100	1,222.00	5,010,200
富士石油	27,200	354.00	9,628,800
MORESCO	3,800	1,271.00	4,829,800
出光興産	121,400	3,915.00	475,281,000
ENEOSホールディングス	1,742,100	569.30	991,777,530
コスモエネルギーホールディングス	41,700	4,005.00	167,008,500
横浜ゴム	58,900	1,806.00	106,373,400
TOYO TIRE	57,300	1,841.00	105,489,300
ブリヂストン	316,500	5,253.00	1,662,574,500
住友ゴム工業	97,700	1,258.00	122,906,600
藤倉コンポジット	9,300	891.00	8,286,300
オカモト	6,000	3,875.00	23,250,000
フコク	5,100	975.00	4,972,500
ニッタ	11,200	2,932.00	32,838,400
住友理工	22,400	587.00	13,148,800
三ツ星ベルト	14,100	2,863.00	40,368,300
バンドー化学	18,700	905.00	16,923,500
日東紡績	15,300	2,598.00	39,749,400
AGC	100,900	5,150.00	519,635,000
日本板硝子	53,400	427.00	22,801,800
石塚硝子	1,900	1,714.00	3,256,600
日本山村硝子	4,200	748.00	3,141,600
日本電気硝子	44,200	2,831.00	125,130,200

オハラ	4,600	1,324.00	6,090,400
住友大阪セメント	19,700	3,455.00	68,063,500
太平洋セメント	65,800	2,082.00	136,995,600
日本ヒューム	10,300	697.00	7,179,100
日本コンクリート工業	21,700	290.00	6,293,000
三谷セキサン	5,000	4,680.00	23,400,000
アジアパイルホールディングス	17,100	466.00	7,968,600
東海カーボン	91,700	1,209.00	110,865,300
日本カーボン	6,000	4,360.00	26,160,000
東洋炭素	7,100	2,862.00	20,320,200
ノリタケカンパニーリミテド	6,100	4,255.00	25,955,500
TOTO	74,300	4,420.00	328,406,000
日本碍子	117,900	1,951.00	230,022,900
日本特殊陶業	83,200	2,647.00	220,230,400
MARUWA	4,000	14,720.00	58,880,000
品川リフラクトリーズ	2,700	3,590.00	9,693,000
黒崎播磨	2,000	4,315.00	8,630,000
ヨータイ	7,400	1,468.00	10,863,200
東京窯業	12,800	282.00	3,609,600
ニッカトー	5,100	486.00	2,478,600
フジインコーポレーテッド	9,300	5,970.00	55,521,000
クニミネ工業	3,700	950.00	3,515,000
エーアンドエーマテリアル	2,000	890.00	1,780,000
ニチアス	25,200	2,360.00	59,472,000
ニチハ	15,200	2,507.00	38,106,400
日本製鉄	489,800	2,150.00	1,053,070,000
神戸製鋼所	204,300	703.00	143,622,900
中山製鋼所	16,700	440.00	7,348,000
合同製鐵	5,800	1,362.00	7,899,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	279,900	1,623.00	454,277,700
東京製鐵	35,300	1,621.00	57,221,300
共英製鋼	11,900	1,368.00	16,279,200
大和工業	19,500	4,600.00	89,700,000
東京鐵鋼	4,900	1,250.00	6,125,000
大阪製鐵	6,100	1,473.00	8,985,300
淀川製鋼所	13,400	2,251.00	30,163,400
丸一鋼管	34,200	3,025.00	103,455,000
モリ工業	3,000	2,452.00	7,356,000
大同特殊鋼	16,700	3,655.00	61,038,500
日本高周波鋼業	4,300	341.00	1,466,300
日本冶金工業	8,000	2,219.00	17,752,000
山陽特殊製鋼	10,500	2,158.00	22,659,000

愛知製鋼	6,500	2,092.00	13,598,000
日立金属	123,400	2,024.00	249,761,600
日本金属	2,900	1,172.00	3,398,800
大太平洋金属	7,100	2,775.00	19,702,500
新日本電工	67,000	379.00	25,393,000
栗本鐵工所	4,900	1,635.00	8,011,500
虹技	1,500	977.00	1,465,500
三菱製鋼	7,400	997.00	7,377,800
日亜鋼業	13,800	265.00	3,657,000
日本精線	1,800	4,245.00	7,641,000
エンビプロ・ホールディングス	7,600	920.00	6,992,000
シンニッタン	14,000	226.00	3,164,000
新家工業	2,600	1,545.00	4,017,000
大紀アルミニウム工業所	15,200	1,337.00	20,322,400
日本軽金属ホールディングス	29,000	1,589.00	46,081,000
三井金属鉱業	30,900	3,425.00	105,832,500
東邦亜鉛	6,100	2,396.00	14,615,600
三菱マテリアル	69,400	2,030.00	140,882,000
住友金属鉱山	132,500	5,311.00	703,707,500
D O W Aホールディングス	28,200	4,725.00	133,245,000
古河機械金属	18,000	1,244.00	22,392,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,300	2,838.00	37,745,400
東邦チタニウム	20,500	2,817.00	57,748,500
U A C J	16,200	2,288.00	37,065,600
C Kサンエツ	2,200	4,030.00	8,866,000
古河電気工業	33,900	2,268.00	76,885,200
住友電気工業	409,200	1,520.00	621,984,000
フジクラ	127,700	835.00	106,629,500
昭和電線ホールディングス	10,000	1,750.00	17,500,000
東京特殊電線	1,600	2,390.00	3,824,000
タツタ電線	20,300	499.00	10,129,700
カナレ電気	1,700	1,659.00	2,820,300
平河ヒューテック	6,400	1,132.00	7,244,800
リョービ	12,600	1,116.00	14,061,600
アーレスティ	12,400	388.00	4,811,200
アサヒホールディングス	45,900	2,126.00	97,583,400
稲葉製作所	6,000	1,321.00	7,926,000
宮地エンジニアリンググループ	3,300	3,395.00	11,203,500
トーカロ	29,500	1,350.00	39,825,000
アルファC o	4,200	998.00	4,191,600
S U M C O	184,600	2,093.00	386,367,800
川田テクノロジーズ	2,200	3,505.00	7,711,000

RS Technologies	3,700	6,290.00	23,273,000
ジェイテックコーポレーション	1,500	2,257.00	3,385,500
信和	7,100	787.00	5,587,700
東洋製罐グループホールディングス	63,200	1,408.00	88,985,600
ホッカンホールディングス	5,700	1,257.00	7,164,900
コロナ	5,800	837.00	4,854,600
横河ブリッジホールディングス	17,500	2,018.00	35,315,000
駒井ハルテック	1,900	1,736.00	3,298,400
高田機工	1,000	2,506.00	2,506,000
三和ホールディングス	108,000	1,284.00	138,672,000
文化シャッター	34,600	987.00	34,150,200
三協立山	14,000	593.00	8,302,000
アルインコ	7,800	855.00	6,669,000
東洋シャッター	2,500	648.00	1,620,000
LIXIL	180,200	2,551.00	459,690,200
日本フィルコン	7,400	500.00	3,700,000
ノーリツ	19,500	1,507.00	29,386,500
長府製作所	11,600	1,781.00	20,659,600
リンナイ	20,400	9,060.00	184,824,000
ダイニチ工業	5,500	641.00	3,525,500
日東精工	13,400	503.00	6,740,200
三洋工業	1,400	1,738.00	2,433,200
岡部	18,900	637.00	12,039,300
ジーテクト	13,200	1,334.00	17,608,800
東プレ	18,800	1,070.00	20,116,000
高周波熱錬	18,100	694.00	12,561,400
東京製綱	7,000	933.00	6,531,000
サンコール	9,800	653.00	6,399,400
モリテック スチール	8,900	307.00	2,732,300
パイオラックス	15,500	2,070.00	32,085,000
エイチワン	10,500	624.00	6,552,000
日本発條	99,500	966.00	96,117,000
中央発條	5,500	712.00	3,916,000
アドバネクス	1,500	1,463.00	2,194,500
立川ブラインド工業	4,700	1,099.00	5,165,300
三益半導体工業	8,900	2,423.00	21,564,700
日本ドライケミカル	2,700	1,606.00	4,336,200
日本製鋼所	31,300	3,310.00	103,603,000
三浦工業	46,600	2,829.00	131,831,400
タクマ	35,000	1,420.00	49,700,000
ツガミ	24,100	1,244.00	29,980,400
オークマ	11,800	5,560.00	65,608,000

芝浦機械	13,000	3,090.00	40,170,000
アマダ	180,900	1,071.00	193,743,900
アイダエンジニアリング	26,900	905.00	24,344,500
滝澤鉄工所	3,400	1,256.00	4,270,400
F U J I	48,100	2,164.00	104,088,400
牧野フライス製作所	12,000	4,575.00	54,900,000
オーエスジー	51,200	1,670.00	85,504,000
ダイジェット工業	1,400	930.00	1,302,000
旭ダイヤモンド工業	29,000	603.00	17,487,000
D M G 森精機	65,000	1,927.00	125,255,000
ソディック	25,000	832.00	20,800,000
ディスコ	16,900	33,300.00	562,770,000
日東工器	5,800	1,551.00	8,995,800
日進工具	9,100	1,286.00	11,702,600
パンチ工業	9,800	479.00	4,694,200
富士ダイス	5,900	678.00	4,000,200
豊和工業	6,100	1,043.00	6,362,300
O K K	4,200	1,178.00	4,947,600
東洋機械金属	7,600	606.00	4,605,600
津田駒工業	2,000	566.00	1,132,000
エンシュウ	2,700	839.00	2,265,300
島精機製作所	16,800	2,235.00	37,548,000
オプトラン	14,400	2,028.00	29,203,200
N C ホールディングス	3,000	1,993.00	5,979,000
イワキポンプ	7,300	948.00	6,920,400
フリー	10,200	1,122.00	11,444,400
ヤマシンフィルタ	19,900	347.00	6,905,300
日阪製作所	12,600	840.00	10,584,000
やまびこ	20,100	1,197.00	24,059,700
野村マイクロ・サイエンス	3,800	4,000.00	15,200,000
平田機工	5,200	4,320.00	22,464,000
ペガサスミシン製造	11,700	611.00	7,148,700
マルマエ	4,700	2,031.00	9,545,700
タツモ	5,400	1,270.00	6,858,000
ナプテスコ	62,500	3,320.00	207,500,000
三井海洋開発	12,200	1,347.00	16,433,400
レオン自動機	12,300	1,300.00	15,990,000
S M C	33,900	69,600.00	2,359,440,000
ホソカワミクロン	7,700	2,672.00	20,574,400
ユニオンツール	4,300	3,650.00	15,695,000
オイレス工業	15,300	1,574.00	24,082,200
日精エー・エス・ビー機械	4,300	3,410.00	14,663,000

サトーホールディングス	15,100	1,889.00	28,523,900
技研製作所	10,200	3,340.00	34,068,000
日本エアータック	5,300	1,041.00	5,517,300
カワタ	3,500	1,065.00	3,727,500
日精樹脂工業	7,700	915.00	7,045,500
オカダアイヨン	3,700	1,525.00	5,642,500
ワイエイシーホールディングス	4,600	1,744.00	8,022,400
小松製作所	524,900	3,469.00	1,820,878,100
住友重機械工業	63,400	3,250.00	206,050,000
日立建機	46,500	3,355.00	156,007,500
日工	15,200	611.00	9,287,200
巴工業	4,300	2,361.00	10,152,300
井関農機	9,800	1,258.00	12,328,400
TOWA	9,900	1,811.00	17,928,900
丸山製作所	2,100	1,585.00	3,328,500
北川鉄工所	4,900	1,516.00	7,428,400
ローツェ	5,700	10,180.00	58,026,000
タカキタ	3,800	563.00	2,139,400
クボタ	561,100	2,452.00	1,375,817,200
荏原実業	5,400	2,412.00	13,024,800
三菱化工機	3,600	2,127.00	7,657,200
月島機械	19,400	910.00	17,654,000
帝国電機製作所	7,600	1,563.00	11,878,800
新東工業	23,200	699.00	16,216,800
澁谷工業	9,500	2,334.00	22,173,000
アイチ コーポレーション	16,700	871.00	14,545,700
小森コーポレーション	28,200	797.00	22,475,400
鶴見製作所	8,500	1,826.00	15,521,000
住友精密工業	1,700	2,946.00	5,008,200
日本ギア工業	4,400	273.00	1,201,200
酒井重工業	2,000	3,035.00	6,070,000
荏原製作所	46,400	5,680.00	263,552,000
石井鐵工所	1,600	2,862.00	4,579,200
西島製作所	9,900	1,375.00	13,612,500
北越工業	10,200	842.00	8,588,400
ダイキン工業	133,500	21,565.00	2,878,927,500
オルガノ	3,400	10,050.00	34,170,000
トーヨーカネツ	4,200	2,754.00	11,566,800
栗田工業	59,900	5,390.00	322,861,000
椿本チエイン	15,200	3,335.00	50,692,000
大同工業	5,100	859.00	4,380,900
木村化工機	9,400	699.00	6,570,600

アネスト岩田	18,100	883.00	15,982,300
ダイフク	57,700	8,280.00	477,756,000
サムコ	3,100	2,778.00	8,611,800
加藤製作所	5,700	842.00	4,799,400
油研工業	2,000	1,770.00	3,540,000
タダノ	57,600	967.00	55,699,200
フジテック	37,600	2,685.00	100,956,000
C K D	31,000	1,901.00	58,931,000
キトー	9,400	2,642.00	24,834,800
平和	32,300	1,945.00	62,823,500
理想科学工業	9,400	2,236.00	21,018,400
S A N K Y O	25,000	4,260.00	106,500,000
日本金銭機械	11,800	677.00	7,988,600
マースグループホールディングス	7,400	1,716.00	12,698,400
フクシマガリレイ	7,400	3,390.00	25,086,000
オーイズミ	4,200	424.00	1,780,800
ダイコク電機	5,400	1,218.00	6,577,200
竹内製作所	17,600	2,488.00	43,788,800
アマノ	30,300	2,485.00	75,295,500
J U K I	16,100	738.00	11,881,800
ジャノメ	9,900	703.00	6,959,700
マックス	14,300	1,609.00	23,008,700
グローリー	28,300	2,054.00	58,128,200
新晃工業	10,800	1,643.00	17,744,400
大和冷機工業	16,800	1,060.00	17,808,000
セガサミーホールディングス	114,900	2,379.00	273,347,100
日本ピストンリング	4,300	1,331.00	5,723,300
リケン	4,500	2,427.00	10,921,500
T P R	13,900	1,272.00	17,680,800
ツバキ・ナカシマ	25,500	1,007.00	25,678,500
ホシザキ	33,900	7,710.00	261,369,000
大豊工業	9,500	726.00	6,897,000
日本精工	204,900	780.00	159,822,000
N T N	223,400	296.00	66,126,400
ジェイテクト	102,900	1,101.00	113,292,900
不二越	8,700	3,785.00	32,929,500
日本トムソン	28,300	546.00	15,451,800
T H K	65,400	2,871.00	187,763,400
ユーシン精機	9,100	705.00	6,415,500
前澤給装工業	7,900	860.00	6,794,000
イーグル工業	13,200	1,005.00	13,266,000
前澤工業	7,300	618.00	4,511,400



日本ピラー工業	10,500	2,918.00	30,639,000
キット	34,800	699.00	24,325,200
マキタ	134,300	3,613.00	485,225,900
三井E & Sホールディングス	42,000	390.00	16,380,000
日立造船	94,100	918.00	86,383,800
三菱重工業	173,900	5,483.00	953,493,700
I H I	72,300	4,150.00	300,045,000
スター精密	16,200	1,770.00	28,674,000
日清紡ホールディングス	66,800	1,108.00	74,014,400
イビデン	57,600	4,435.00	255,456,000
コニカミノルタ	242,900	460.00	111,734,000
ブラザー工業	135,500	2,424.00	328,452,000
ミネベアミツミ	189,700	2,528.00	479,561,600
日立製作所	557,000	6,945.00	3,868,365,000
東芝	202,400	5,669.00	1,147,405,600
三菱電機	1,106,600	1,476.00	1,633,341,600
富士電機	66,200	6,160.00	407,792,000
東洋電機製造	4,000	919.00	3,676,000
安川電機	118,300	4,645.00	549,503,500
シンフォニアテクノロジー	12,500	1,420.00	17,750,000
明電舎	17,500	2,068.00	36,190,000
オリジン	2,700	1,256.00	3,391,200
山洋電気	4,700	5,530.00	25,991,000
デンヨー	8,800	1,593.00	14,018,400
P H Cホールディングス	18,500	1,345.00	24,882,500
東芝テック	12,400	4,160.00	51,584,000
芝浦メカトロニクス	2,100	11,280.00	23,688,000
マブチモーター	26,800	3,730.00	99,964,000
日本電産	271,700	8,866.00	2,408,892,200
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,300	468.00	2,948,400
トレックス・セミコンダクター	5,600	2,907.00	16,279,200
東光高岳	6,900	1,795.00	12,385,500
ダイヘン	11,400	4,335.00	49,419,000
ヤーマン	19,600	1,276.00	25,009,600
J V Cケンウッド	99,100	191.00	18,928,100
ミマキエンジニアリング	11,900	569.00	6,771,100
I - P E X	6,000	1,404.00	8,424,000
日新電機	27,100	1,571.00	42,574,100
大崎電気工業	20,100	500.00	10,050,000
オムロン	96,400	7,441.00	717,312,400
日東工業	14,500	2,333.00	33,828,500
I D E C	14,300	2,733.00	39,081,900

正興電機製作所	4,100	1,156.00	4,739,600
不二電機工業	2,900	1,141.00	3,308,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,200	2,193.00	79,386,600
サクサホールディングス	2,700	1,468.00	3,963,600
メルコホールディングス	3,300	3,495.00	11,533,500
テクノメディカ	3,200	1,580.00	5,056,000
日本電気	140,600	5,260.00	739,556,000
富士通	104,200	18,435.00	1,920,927,000
沖電気工業	44,900	801.00	35,964,900
岩崎通信機	4,700	831.00	3,905,700
電気興業	5,700	2,594.00	14,785,800
サンケン電気	10,200	5,370.00	54,774,000
ナカヨ	2,000	1,113.00	2,226,000
アイホン	5,700	1,723.00	9,821,100
ルネサスエレクトロニクス	630,000	1,439.00	906,570,000
セイコーエプソン	134,100	2,231.00	299,177,100
ワコム	90,800	927.00	84,171,600
アルバック	23,100	5,290.00	122,199,000
アクセル	5,600	848.00	4,748,800
E I Z O	8,400	3,815.00	32,046,000
日本信号	26,200	927.00	24,287,400
京三製作所	23,300	435.00	10,135,500
能美防災	14,400	1,763.00	25,387,200
ホーチキ	8,300	1,269.00	10,532,700
星和電機	6,700	492.00	3,296,400
エレコム	27,100	1,512.00	40,975,200
パナソニック ホールディングス	1,235,100	1,144.00	1,412,954,400
シャープ	117,400	1,026.00	120,452,400
アンリツ	74,600	1,507.00	112,422,200
富士通ゼネラル	31,400	2,474.00	77,683,600
ソニーグループ	725,400	12,130.00	8,799,102,000
T D K	167,900	4,690.00	787,451,000
帝国通信工業	5,700	1,378.00	7,854,600
タムラ製作所	42,700	583.00	24,894,100
アルプスアルパイン	97,800	1,502.00	146,895,600
池上通信機	3,400	614.00	2,087,600
日本電波工業	12,300	1,178.00	14,489,400
鈴木	6,700	839.00	5,621,300
メイコー	12,700	4,050.00	51,435,000
日本トリム	2,500	2,490.00	6,225,000
ローランド ディー . ジー .	7,100	3,350.00	23,785,000
フォスター電機	11,100	750.00	8,325,000

S M K	2,700	2,164.00	5,842,800
ヨコオ	8,400	2,303.00	19,345,200
ホシデン	27,100	1,227.00	33,251,700
ヒロセ電機	16,900	17,720.00	299,468,000
日本航空電子工業	24,300	2,140.00	52,002,000
T O A	12,400	781.00	9,684,400
マクセル	22,400	1,323.00	29,635,200
古野電気	14,600	1,070.00	15,622,000
ユニデンホールディングス	2,500	3,535.00	8,837,500
スミダコーポレーション	11,900	829.00	9,865,100
アイコム	3,900	2,430.00	9,477,000
リオン	4,500	2,602.00	11,709,000
本多通信工業	10,600	548.00	5,808,800
横河電機	109,500	2,379.00	260,500,500
新電元工業	4,200	3,340.00	14,028,000
アズビル	67,900	3,600.00	244,440,000
東亜ディーケーケー	6,700	905.00	6,063,500
日本光電工業	46,000	3,035.00	139,610,000
チノー	3,700	1,642.00	6,075,400
共和電業	11,100	335.00	3,718,500
日本電子材料	5,600	1,910.00	10,696,000
堀場製作所	20,400	6,740.00	137,496,000
アドバンテスト	86,100	8,210.00	706,881,000
小野測器	6,600	446.00	2,943,600
エスベック	9,300	1,895.00	17,623,500
キーエンス	104,900	50,390.00	5,285,911,000
日置電機	5,700	7,150.00	40,755,000
シスメックス	88,100	8,458.00	745,149,800
日本マイクロニクス	18,800	1,422.00	26,733,600
メガチップス	10,500	3,310.00	34,755,000
O B A R A G R O U P	5,100	2,943.00	15,009,300
澤藤電機	2,000	1,521.00	3,042,000
原田工業	6,400	941.00	6,022,400
コーセル	14,000	800.00	11,200,000
イリソ電子工業	10,000	3,355.00	33,550,000
オブテックスグループ	19,400	2,068.00	40,119,200
千代田インテグレ	5,000	2,029.00	10,145,000
レーザーテック	48,600	17,370.00	844,182,000
スタンレー電気	77,100	2,344.00	180,722,400
岩崎電気	4,200	2,550.00	10,710,000
ウシオ電機	56,800	1,732.00	98,377,600
岡谷電機産業	11,500	274.00	3,151,000

ヘリオス テクノ ホールディング	12,900	292.00	3,766,800
エノモト	3,800	1,630.00	6,194,000
日本セラミック	11,200	2,093.00	23,441,600
遠藤照明	6,500	772.00	5,018,000
古河電池	9,000	1,231.00	11,079,000
双信電機	7,100	577.00	4,096,700
山一電機	8,300	1,917.00	15,911,100
図研	7,800	2,991.00	23,329,800
日本電子	23,000	5,910.00	135,930,000
カシオ計算機	74,600	1,285.00	95,861,000
ファナック	101,600	21,320.00	2,166,112,000
日本シイエムケイ	23,100	469.00	10,833,900
エンプラス	3,100	3,480.00	10,788,000
大真空	15,600	995.00	15,522,000
ローム	49,500	10,470.00	518,265,000
浜松ホトニクス	79,300	6,060.00	480,558,000
三井ハイテック	10,500	11,560.00	121,380,000
新光電気工業	34,200	4,455.00	152,361,000
京セラ	163,000	7,487.00	1,220,381,000
太陽誘電	53,200	5,480.00	291,536,000
村田製作所	324,100	8,411.00	2,726,005,100
双葉電子工業	21,100	682.00	14,390,200
北陸電気工業	5,100	1,169.00	5,961,900
ニチコン	33,400	1,389.00	46,392,600
日本ケミコン	11,400	1,933.00	22,036,200
K O A	17,000	1,736.00	29,512,000
市光工業	16,100	391.00	6,295,100
小糸製作所	59,900	4,875.00	292,012,500
ミツバ	19,100	413.00	7,888,300
S C R E E Nホールディングス	18,900	11,200.00	211,680,000
キャノン電子	11,200	1,549.00	17,348,800
キャノン	575,400	3,328.00	1,914,931,200
リコー	290,800	1,159.00	337,037,200
象印マホービン	30,200	1,431.00	43,216,200
M U T O Hホールディングス	1,900	2,083.00	3,957,700
東京エレクトロン	73,500	55,660.00	4,091,010,000
トヨタ紡織	42,700	2,184.00	93,256,800
芦森工業	2,200	1,024.00	2,252,800
ユニプレス	18,400	948.00	17,443,200
豊田自動織機	85,900	8,440.00	724,996,000
モリタホールディングス	18,600	1,309.00	24,347,400
三櫻工業	16,000	682.00	10,912,000

デンソー	236,100	8,131.00	1,919,729,100
東海理化電機製作所	30,500	1,495.00	45,597,500
川崎重工業	80,500	2,943.00	236,911,500
名村造船所	31,500	429.00	13,513,500
日本車輛製造	3,900	2,082.00	8,119,800
三菱ロジスネクスト	15,300	834.00	12,760,200
近畿車輛	1,700	1,166.00	1,982,200
日産自動車	1,365,700	564.00	770,254,800
いすゞ自動車	344,800	1,645.00	567,196,000
トヨタ自動車	5,475,100	2,203.50	12,064,382,850
日野自動車	144,600	715.00	103,389,000
三菱自動車工業	428,600	453.00	194,155,800
エフテック	7,600	580.00	4,408,000
レシップホールディングス	4,600	560.00	2,576,000
G M B	2,100	721.00	1,514,100
ファルテック	2,000	611.00	1,222,000
武蔵精密工業	25,800	1,425.00	36,765,000
日産車体	17,000	604.00	10,268,000
新明和工業	31,000	1,162.00	36,022,000
極東開発工業	19,500	1,460.00	28,470,000
トピー工業	8,900	1,365.00	12,148,500
ティラド	3,000	2,829.00	8,487,000
曙ブレーキ工業	63,600	171.00	10,875,600
タチエス	19,400	1,180.00	22,892,000
N O K	47,700	1,227.00	58,527,900
フタバ産業	26,800	400.00	10,720,000
K Y B	10,800	3,085.00	33,318,000
大同メタル工業	22,200	534.00	11,854,800
プレス工業	53,200	443.00	23,567,600
ミクニ	13,900	368.00	5,115,200
太平洋工業	22,800	1,083.00	24,692,400
河西工業	14,200	284.00	4,032,800
アイシン	84,800	4,415.00	374,392,000
マツダ	348,300	1,174.00	408,904,200
今仙電機製作所	7,600	615.00	4,674,000
本田技研工業	868,400	3,398.00	2,950,823,200
スズキ	241,300	4,058.00	979,195,400
S U B A R U	313,400	2,544.50	797,446,300
安永	5,000	756.00	3,780,000
ヤマハ発動機	151,100	2,742.00	414,316,200
T B K	12,000	346.00	4,152,000
エクセディ	17,500	1,795.00	31,412,500

豊田合成	34,300	2,186.00	74,979,800
愛三工業	18,100	757.00	13,701,700
盟和産業	1,600	1,018.00	1,628,800
日本プラスト	8,600	470.00	4,042,000
ヨロズ	9,600	918.00	8,812,800
エフ・シー・シー	18,900	1,393.00	26,327,700
シマノ	44,100	22,150.00	976,815,000
テイ・エス テック	48,900	1,431.00	69,975,900
ジャムコ	6,800	1,215.00	8,262,000
テルモ	327,700	4,110.00	1,346,847,000
クリエートメディック	3,500	991.00	3,468,500
日機装	31,200	874.00	27,268,800
日本エム・ディ・エム	6,700	1,588.00	10,639,600
島津製作所	141,900	4,715.00	669,058,500
JMS	9,200	585.00	5,382,000
長野計器	7,900	1,172.00	9,258,800
ブイ・テクノロジー	5,100	2,945.00	15,019,500
東京計器	7,400	1,495.00	11,063,000
愛知時計電機	4,400	1,471.00	6,472,400
インターアクション	5,800	2,040.00	11,832,000
オーバル	10,400	312.00	3,244,800
東京精密	18,600	4,730.00	87,978,000
マニー	43,600	1,436.00	62,609,600
ニコン	167,800	1,735.00	291,133,000
トプコン	54,500	1,935.00	105,457,500
オリンパス	576,200	2,800.00	1,613,360,000
理研計器	8,200	3,965.00	32,513,000
タムロン	8,400	2,449.00	20,571,600
H O Y A	223,600	13,285.00	2,970,526,000
シード	5,400	517.00	2,791,800
ノーリツ鋼機	10,400	2,459.00	25,573,600
A & D ホロンホールディングス	13,000	1,004.00	13,052,000
朝日インテック	127,000	1,926.00	244,602,000
シチズン時計	120,600	583.00	70,309,800
リズム	3,600	1,891.00	6,807,600
大研医器	9,200	499.00	4,590,800
メニコン	36,600	2,841.00	103,980,600
シンシア	1,300	432.00	561,600
松風	4,200	1,685.00	7,077,000
セイコーホールディングス	16,400	2,845.00	46,658,000
ニプロ	82,200	1,035.00	85,077,000
中本パックス	3,200	1,616.00	5,171,200

スノーピーク	15,100	2,784.00	42,038,400
パラマウントベッドホールディングス	22,200	2,019.00	44,821,800
トランザクション	7,000	1,101.00	7,707,000
粧美堂	3,100	411.00	1,274,100
ニホンフラッシュ	9,300	981.00	9,123,300
前田工織	11,200	2,646.00	29,635,200
永大産業	13,500	273.00	3,685,500
アートネイチャー	9,900	730.00	7,227,000
バンダイナムコホールディングス	98,400	9,809.00	965,205,600
アイフィスジャパン	2,900	663.00	1,922,700
共立印刷	17,000	153.00	2,601,000
S H O E I	10,400	5,150.00	53,560,000
フランスベッドホールディングス	14,900	890.00	13,261,000
パイロットコーポレーション	17,500	5,120.00	89,600,000
萩原工業	7,100	1,152.00	8,179,200
フジシールインターナショナル	25,200	1,526.00	38,455,200
タカラトミー	47,800	1,289.00	61,614,200
広済堂ホールディングス	7,200	1,152.00	8,294,400
エステールホールディングス	2,600	638.00	1,658,800
タカノ	4,000	821.00	3,284,000
プロネクサス	9,000	1,084.00	9,756,000
ホクシン	8,200	148.00	1,213,600
ウッドワン	3,500	1,203.00	4,210,500
大建工業	6,200	1,814.00	11,246,800
凸版印刷	159,300	2,374.00	378,178,200
大日本印刷	129,300	2,844.00	367,729,200
共同印刷	3,100	2,645.00	8,199,500
N I S S H A	21,300	1,551.00	33,036,300
光村印刷	900	1,269.00	1,142,100
T A K A R A & C O M P A N Y	6,800	1,838.00	12,498,400
アシックス	93,300	2,591.00	241,740,300
ツツミ	2,900	1,961.00	5,686,900
ローランド	8,100	4,515.00	36,571,500
小松ウオール工業	3,500	1,894.00	6,629,000
ヤマハ	67,300	5,750.00	386,975,000
河合楽器製作所	3,000	2,805.00	8,415,000
クリナップ	10,800	571.00	6,166,800
ピジョン	70,000	1,854.00	129,780,000
兼松サステック	700	1,635.00	1,144,500
キングジム	9,000	913.00	8,217,000
リンテック	23,000	2,430.00	55,890,000
イトーキ	21,300	386.00	8,221,800

任天堂	65,400	58,940.00	3,854,676,000
三菱鉛筆	16,800	1,379.00	23,167,200
タカスタンダード	20,400	1,260.00	25,704,000
コクヨ	52,500	1,631.00	85,627,500
ナカバヤシ	9,700	496.00	4,811,200
グロープライド	9,200	2,249.00	20,690,800
オカムラ	35,000	1,089.00	38,115,000
美津濃	10,200	2,260.00	23,052,000
東京電力ホールディングス	866,700	508.00	440,283,600
中部電力	336,100	1,266.00	425,502,600
関西電力	416,300	1,227.00	510,800,100
中国電力	171,700	836.00	143,541,200
北陸電力	100,800	518.00	52,214,400
東北電力	259,200	709.00	183,772,800
四国電力	98,900	747.00	73,878,300
九州電力	227,300	831.00	188,886,300
北海道電力	100,600	476.00	47,885,600
沖縄電力	24,600	1,212.00	29,815,200
電源開発	90,000	2,168.00	195,120,000
エフオン	7,000	566.00	3,962,000
イーレックス	15,600	2,194.00	34,226,400
レノバ	22,700	2,078.00	47,170,600
東京瓦斯	211,400	2,714.00	573,739,600
大阪瓦斯	199,800	2,583.00	516,083,400
東邦瓦斯	47,900	3,235.00	154,956,500
北海道瓦斯	5,700	1,624.00	9,256,800
広島ガス	20,900	322.00	6,729,800
西部ガスホールディングス	11,700	1,900.00	22,230,000
静岡ガス	28,300	867.00	24,536,100
メタウォーター	12,000	2,061.00	24,732,000
SBSホールディングス	8,600	2,912.00	25,043,200
東武鉄道	108,100	3,055.00	330,245,500
相鉄ホールディングス	35,300	2,302.00	81,260,600
東急	277,100	1,534.00	425,071,400
京浜急行電鉄	135,500	1,435.00	194,442,500
小田急電鉄	154,600	1,771.00	273,796,600
京王電鉄	53,900	4,625.00	249,287,500
京成電鉄	72,300	3,640.00	263,172,000
富士急行	12,500	4,140.00	51,750,000
新京成電鉄	2,700	2,932.00	7,916,400
東日本旅客鉄道	185,700	7,043.00	1,307,885,100
西日本旅客鉄道	128,700	5,033.00	647,747,100



東海旅客鉄道	86,400	16,250.00	1,404,000,000
西武ホールディングス	143,400	1,405.00	201,477,000
鴻池運輸	17,100	1,193.00	20,400,300
西日本鉄道	29,200	2,848.00	83,161,600
ハマキョウレックス	7,700	2,963.00	22,815,100
サカイ引越センター	5,300	4,445.00	23,558,500
近鉄グループホールディングス	105,100	4,005.00	420,925,500
阪急阪神ホールディングス	131,000	3,615.00	473,565,000
南海電気鉄道	46,900	2,604.00	122,127,600
京阪ホールディングス	44,800	3,340.00	149,632,000
神戸電鉄	2,600	3,280.00	8,528,000
名古屋鉄道	110,800	2,210.00	244,868,000
山陽電気鉄道	8,000	2,104.00	16,832,000
アルプス物流	7,700	1,124.00	8,654,800
ヤマトホールディングス	153,700	2,142.00	329,225,400
山九	27,400	3,910.00	107,134,000
丸運	5,600	241.00	1,349,600
丸全昭和運輸	7,900	3,045.00	24,055,500
センコーグループホールディングス	52,700	859.00	45,269,300
トナミホールディングス	2,300	3,500.00	8,050,000
ニッコンホールディングス	35,200	2,098.00	73,849,600
日本石油輸送	1,200	2,551.00	3,061,200
福山通運	15,400	3,225.00	49,665,000
セイノーホールディングス	64,700	1,040.00	67,288,000
エスライン	3,100	857.00	2,656,700
神奈川中央交通	2,700	3,425.00	9,247,500
日立物流	21,200	8,570.00	181,684,000
丸和運輸機関	20,100	1,513.00	30,411,300
C & F ロジホールディングス	9,900	1,036.00	10,256,400
九州旅客鉄道	77,300	2,679.00	207,086,700
S Gホールディングス	191,900	2,275.00	436,572,500
NIPPON EXPRESSホールディングス	34,400	7,770.00	267,288,000
日本郵船	92,100	9,810.00	903,501,000
商船三井	174,500	3,230.00	563,635,000
川崎汽船	33,800	9,190.00	310,622,000
NSユナイテッド海運	6,300	3,950.00	24,885,000
飯野海運	50,200	748.00	37,549,600
共栄タンカー	5,000	1,035.00	5,175,000
乾汽船	6,900	1,790.00	12,351,000
日本航空	241,000	2,357.00	568,037,000
ANAホールディングス	267,000	2,538.50	677,779,500
パスコ	2,100	1,314.00	2,759,400

トランコム	3,100	6,450.00	19,995,000
日新	8,300	1,612.00	13,379,600
三菱倉庫	30,600	3,185.00	97,461,000
三井倉庫ホールディングス	11,000	2,996.00	32,956,000
住友倉庫	34,200	2,104.00	71,956,800
澁澤倉庫	5,800	2,272.00	13,177,600
東陽倉庫	16,500	305.00	5,032,500
日本トランスシティ	20,900	518.00	10,826,200
ケイヒン	1,900	1,350.00	2,565,000
中央倉庫	6,000	983.00	5,898,000
川西倉庫	2,000	1,109.00	2,218,000
安田倉庫	7,900	956.00	7,552,400
ファイズホールディングス	2,300	797.00	1,833,100
東洋埠頭	3,200	1,330.00	4,256,000
上組	56,500	2,560.00	144,640,000
サンリツ	2,900	763.00	2,212,700
キムラユニティー	2,900	1,501.00	4,352,900
キューソー流通システム	5,500	1,097.00	6,033,500
近鉄エクスプレス	20,700	4,175.00	86,422,500
東海運	6,200	295.00	1,829,000
エーアイティー	6,900	1,492.00	10,294,800
内外トランスライン	4,200	1,937.00	8,135,400
日本コンセプト	3,500	1,575.00	5,512,500
NEC ネットエスアイ	37,600	1,863.00	70,048,800
クロスキャット	6,000	1,034.00	6,204,000
システナ	162,400	443.00	71,943,200
デジタルアーツ	6,100	6,340.00	38,674,000
日鉄ソリューションズ	18,700	3,695.00	69,096,500
キューブシステム	5,900	925.00	5,457,500
WOW WORLD	1,700	1,112.00	1,890,400
コア	4,900	1,449.00	7,100,100
手間いらず	1,700	5,370.00	9,129,000
ラクーンホールディングス	9,700	1,375.00	13,337,500
ソリトンシステムズ	5,800	1,276.00	7,400,800
ソフトクリエイイトホールディングス	5,000	4,035.00	20,175,000
T I S	102,400	3,405.00	348,672,000
J N S ホールディングス	5,200	462.00	2,402,400
グリー	51,800	898.00	46,516,400
G M O ペパボ	1,200	2,097.00	2,516,400
コーエーテクモホールディングス	36,300	4,565.00	165,709,500
三菱総合研究所	5,300	4,200.00	22,260,000
電算	1,300	2,268.00	2,948,400

A G S	5,100	753.00	3,840,300
ファインデックス	9,800	634.00	6,213,200
ブレインパッド	9,700	1,187.00	11,513,900
K L a b	19,900	505.00	10,049,500
ポールトゥウィンホールディングス	16,600	1,080.00	17,928,000
ネクソン	258,200	3,260.00	841,732,000
アイスタイル	29,800	245.00	7,301,000
エムアップホールディングス	13,200	1,250.00	16,500,000
エイチーム	7,500	720.00	5,400,000
エニグモ	12,500	549.00	6,862,500
テクノスジャパン	9,000	504.00	4,536,000
コロプラ	37,600	639.00	24,026,400
ブロードリーフ	56,600	425.00	24,055,000
クロス・マーケティンググループ	4,500	864.00	3,888,000
デジタルハーツホールディングス	5,200	1,723.00	8,959,600
システム情報	8,600	1,019.00	8,763,400
メディアドゥ	4,100	1,878.00	7,699,800
じげん	32,500	355.00	11,537,500
ブイキューブ	11,700	1,042.00	12,191,400
エンカレッジ・テクノロジー	2,700	525.00	1,417,500
サイバーリンクス	3,900	1,121.00	4,371,900
フィックスターズ	11,400	950.00	10,830,000
C A R T A H O L D I N G S	4,700	1,923.00	9,038,100
オブティム	8,100	852.00	6,901,200
セレス	4,300	1,384.00	5,951,200
S H I F T	6,600	19,260.00	127,116,000
ティーガイア	10,200	1,623.00	16,554,600
セック	1,700	2,520.00	4,284,000
テクマトリックス	19,300	1,698.00	32,771,400
プロシップ	3,800	1,454.00	5,525,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	29,600	2,464.00	72,934,400
G M O ペイメントゲートウェイ	22,000	10,320.00	227,040,000
ザッパラス	4,400	407.00	1,790,800
システムリサーチ	3,400	2,025.00	6,885,000
インターネットイニシアティブ	30,300	4,710.00	142,713,000
さくらインターネット	12,400	572.00	7,092,800
ヴィンクス	3,300	1,105.00	3,646,500
G M O グローバルサイン・ホールディングス	2,500	5,950.00	14,875,000
S R A ホールディングス	5,500	2,865.00	15,757,500
システムインテグレータ	3,800	499.00	1,896,200
朝日ネット	10,600	602.00	6,381,200
e B A S E	13,800	552.00	7,617,600

アバント	12,300	1,354.00	16,654,200
アドソル日進	4,100	1,549.00	6,350,900
ODKソリューションズ	2,600	570.00	1,482,000
フリービット	6,000	922.00	5,532,000
コムチュア	12,800	2,787.00	35,673,600
サイバーコム	1,800	1,151.00	2,071,800
アステリア	8,300	1,101.00	9,138,300
アイル	5,800	1,549.00	8,984,200
マークラインズ	5,800	2,257.00	13,090,600
メディカル・データ・ビジョン	14,500	1,019.00	14,775,500
gumi	16,000	571.00	9,136,000
ショーケース	2,700	461.00	1,244,700
モバイルファクトリー	2,700	1,161.00	3,134,700
テラスカイ	4,200	1,474.00	6,190,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,100	1,430.00	7,293,000
PCIホールディングス	4,800	1,025.00	4,920,000
パイプドHD	2,100	2,810.00	5,901,000
アイビーシー	2,000	492.00	984,000
ネオジャパン	3,300	1,250.00	4,125,000
PR TIMES	2,500	2,092.00	5,230,000
ラクス	52,200	1,582.00	82,580,400
ランドコンピュータ	2,700	907.00	2,448,900
ダブルスタンダード	3,500	1,944.00	6,804,000
オープンドア	6,800	1,939.00	13,185,200
マイネット	4,100	525.00	2,152,500
アカツキ	5,100	2,916.00	14,871,600
ベネフィットジャパン	900	1,985.00	1,786,500
Ubicomホールディングス	3,000	2,525.00	7,575,000
カナミックネットワーク	13,500	525.00	7,087,500
ノムラシステムコーポレーション	6,400	228.00	1,459,200
チェンジ	22,800	1,906.00	43,456,800
シンクロ・フード	6,200	350.00	2,170,000
オークネット	6,100	1,862.00	11,358,200
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	694.00	1,596,200
セグエグループ	3,200	560.00	1,792,000
エイトレッド	1,700	2,058.00	3,498,600
マクロミル	22,900	976.00	22,350,400
ビーグリー	2,800	1,411.00	3,950,800
オロ	3,600	1,797.00	6,469,200
ユーザーローカル	3,500	1,674.00	5,859,000
テモナ	2,500	385.00	962,500
ニーズウェル	3,200	678.00	2,169,600

マネーフォワード	23,200	3,420.00	79,344,000
サインポスト	3,700	883.00	3,267,100
電算システムホールディングス	4,700	2,416.00	11,355,200
ソルクシーズ	10,000	381.00	3,810,000
フェイス	3,200	666.00	2,131,200
プロトコーポレーション	12,200	989.00	12,065,800
ハイマックス	3,100	1,286.00	3,986,600
野村総合研究所	205,000	3,680.00	754,400,000
サイバネットシステム	8,200	766.00	6,281,200
C Eホールディングス	5,900	441.00	2,601,900
日本システム技術	2,100	2,586.00	5,430,600
インテージホールディングス	13,200	1,462.00	19,298,400
東邦システムサイエンス	3,100	940.00	2,914,000
ソースネクスト	49,400	272.00	13,436,800
インフォコム	12,500	2,181.00	27,262,500
シンプレクス・ホールディングス	18,000	1,910.00	34,380,000
HEROZ	3,400	974.00	3,311,600
ラクスル	13,200	2,225.00	29,370,000
I P S	3,200	2,416.00	7,731,200
F I G	12,700	313.00	3,975,100
システムサポート	4,200	1,180.00	4,956,000
イーソル	7,200	591.00	4,255,200
アルテリア・ネットワークス	12,100	1,264.00	15,294,400
東海ソフト	1,900	997.00	1,894,300
ウイングアーク1st	8,700	1,455.00	12,658,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,700	1,583.00	4,274,100
サーバーワークス	2,000	2,168.00	4,336,000
東名	1,000	1,196.00	1,196,000
ヴィッツ	1,200	1,186.00	1,423,200
トビラシステムズ	2,400	782.00	1,876,800
S a n s a n	37,600	1,012.00	38,051,200
L i n k - U	2,200	674.00	1,482,800
ギフティ	9,800	1,230.00	12,054,000
ベース	2,000	5,830.00	11,660,000
J M D C	14,200	5,160.00	73,272,000
フォーカスシステムズ	7,400	912.00	6,748,800
クレスコ	8,300	2,032.00	16,865,600
フジ・メディア・ホールディングス	104,000	1,168.00	121,472,000
オービック	35,800	19,210.00	687,718,000
ジャストシステム	16,200	4,075.00	66,015,000
T D C ソフト	9,400	1,031.00	9,691,400
Zホールディングス	1,638,900	431.00	706,365,900

トレンドマイクロ	57,400	7,200.00	413,280,000
I Dホールディングス	7,300	854.00	6,234,200
日本オラクル	18,500	7,610.00	140,785,000
アルファシステムズ	3,100	4,195.00	13,004,500
フューチャー	24,100	1,620.00	39,042,000
C A C H o l d i n g s	6,200	1,446.00	8,965,200
S Bテクノロジー	5,000	2,325.00	11,625,000
トーセ	3,000	771.00	2,313,000
オービックビジネスコンサルタント	10,900	4,490.00	48,941,000
伊藤忠テクノソリューションズ	51,800	3,230.00	167,314,000
アイティフォー	13,900	792.00	11,008,800
東計電算	1,400	5,940.00	8,316,000
エクスネット	1,900	1,010.00	1,919,000
大塚商会	61,500	3,995.00	245,692,500
サイボウズ	15,300	1,036.00	15,850,800
電通国際情報サービス	14,900	3,975.00	59,227,500
A C C E S S	13,000	704.00	9,152,000
デジタルガレージ	18,800	4,030.00	75,764,000
E Mシステムズ	18,900	963.00	18,200,700
ウェザーニューズ	3,600	6,430.00	23,148,000
C I J	9,000	797.00	7,173,000
ビジネスエンジニアリング	2,600	2,115.00	5,499,000
日本エンタープライズ	12,300	162.00	1,992,600
WOWOW	5,000	1,507.00	7,535,000
スカラ	9,700	773.00	7,498,100
インテリジェント ウェイブ	5,900	712.00	4,200,800
I M A G I C A G R O U P	8,700	779.00	6,777,300
ネットワンシステムズ	42,000	2,873.00	120,666,000
システムソフト	31,700	109.00	3,455,300
アルゴグラフィックス	8,900	3,085.00	27,456,500
マーベラス	18,100	698.00	12,633,800
エイベックス	19,700	1,310.00	25,807,000
B I P R O G Y	35,500	2,954.00	104,867,000
兼松エレクトロニクス	6,200	3,985.00	24,707,000
都築電気	5,400	1,334.00	7,203,600
T B Sホールディングス	59,700	1,788.00	106,743,600
日本テレビホールディングス	94,900	1,304.00	123,749,600
朝日放送グループホールディングス	10,000	666.00	6,660,000
テレビ朝日ホールディングス	27,400	1,540.00	42,196,000
スカパーJ S A Tホールディングス	96,500	502.00	48,443,000
テレビ東京ホールディングス	7,400	2,008.00	14,859,200
日本BS放送	4,000	1,058.00	4,232,000

ビジョン	18,800	1,414.00	26,583,200
スマートバリュー	2,800	513.00	1,436,400
USEN-NEXT HOLDINGS	9,400	2,028.00	19,063,200
ワイヤレスゲート	5,000	319.00	1,595,000
コネクシオ	8,100	1,305.00	10,570,500
クロップス	2,200	1,047.00	2,303,400
日本電信電話	1,245,400	3,941.00	4,908,121,400
KDDI	828,500	4,488.00	3,718,308,000
ソフトバンク	1,721,200	1,470.00	2,530,164,000
光通信	13,100	13,970.00	183,007,000
エムティーアイ	9,800	457.00	4,478,600
GMOインターネット	39,900	2,550.00	101,745,000
ファイバーゲート	5,300	986.00	5,225,800
アйдママーケティングコミュニケーション	2,900	323.00	936,700
KADOKAWA	61,500	2,821.00	173,491,500
学研ホールディングス	16,200	881.00	14,272,200
ゼンリン	18,700	920.00	17,204,000
昭文社ホールディングス	4,900	392.00	1,920,800
インプレスホールディングス	9,400	220.00	2,068,000
アイネット	5,500	1,231.00	6,770,500
松竹	6,900	13,300.00	91,770,000
東宝	67,100	5,150.00	345,565,000
東映	3,400	18,120.00	61,608,000
エヌ・ティ・ティ・データ	302,600	1,949.00	589,767,400
ピー・シー・エー	6,700	1,186.00	7,946,200
ビジネスブレイン太田昭和	3,600	1,475.00	5,310,000
DTS	21,200	3,110.00	65,932,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	52,900	6,200.00	327,980,000
シーイーシー	12,300	1,241.00	15,264,300
カブコン	107,200	3,500.00	375,200,000
アイ・エス・ビー	5,400	1,052.00	5,680,800
ジャステック	6,700	1,191.00	7,979,700
SCSK	78,700	2,245.00	176,681,500
日本システムウエア	4,300	2,487.00	10,694,100
アイネス	9,600	1,549.00	14,870,400
TKC	18,000	3,320.00	59,760,000
富士ソフト	11,300	7,400.00	83,620,000
NSD	35,600	2,391.00	85,119,600
コナミホールディングス	41,300	8,590.00	354,767,000
福井コンピュータホールディングス	5,200	3,280.00	17,056,000
JBCホールディングス	7,700	1,628.00	12,535,600
ミロク情報サービス	10,100	1,170.00	11,817,000

ソフトバンクグループ	681,400	5,545.00	3,778,363,000
高千穂交易	4,200	1,870.00	7,854,000
オルパヘルスケアホールディングス	1,900	1,795.00	3,410,500
伊藤忠食品	2,400	4,730.00	11,352,000
エレマテック	9,100	1,330.00	12,103,000
あらた	8,600	3,960.00	34,056,000
トーメンデバイス	1,700	5,990.00	10,183,000
東京エレクトロン デバイス	3,400	5,710.00	19,414,000
フィールズ	10,000	1,045.00	10,450,000
双日	120,000	2,146.00	257,520,000
アルフレッサ ホールディングス	121,100	1,666.00	201,752,600
横浜冷凍	29,200	845.00	24,674,000
ラサ商事	5,300	972.00	5,151,600
アルコニクス	14,400	1,340.00	19,296,000
神戸物産	82,000	3,180.00	260,760,000
ハイパー	2,900	470.00	1,363,000
あい ホールディングス	16,300	1,634.00	26,634,200
ディーブイエックス	3,900	1,076.00	4,196,400
ダイワボウホールディングス	50,800	1,750.00	88,900,000
マクニカ・富士エレホールディングス	27,200	2,953.00	80,321,600
ラクト・ジャパン	3,900	2,055.00	8,014,500
グリムス	5,100	1,504.00	7,670,400
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,700	692.00	12,940,400
八洲電機	8,200	975.00	7,995,000
メディアスホールディングス	6,500	1,010.00	6,565,000
レスターホールディングス	10,800	2,014.00	21,751,200
ジューテックホールディングス	2,400	1,009.00	2,421,600
大光	4,900	718.00	3,518,200
O C H Iホールディングス	2,800	1,251.00	3,502,800
T O K A Iホールディングス	55,300	865.00	47,834,500
黒谷	3,100	601.00	1,863,100
C o m i n i x	2,000	724.00	1,448,000
三洋貿易	10,800	977.00	10,551,600
ビューティガレージ	1,800	2,596.00	4,672,800
ウイン・パートナーズ	8,300	1,010.00	8,383,000
ミタチ産業	2,900	931.00	2,699,900
シップヘルスケアホールディングス	34,100	2,388.00	81,430,800
明治電機工業	3,600	1,107.00	3,985,200
デリカフーズホールディングス	4,500	526.00	2,367,000
スターティアホールディングス	2,600	790.00	2,054,000
コメダホールディングス	24,900	2,300.00	57,270,000
ピーバンドットコム	1,600	548.00	876,800



アセンテック	3,900	730.00	2,847,000	
富士興産	2,900	1,127.00	3,268,300	
協栄産業	1,200	1,434.00	1,720,800	
フルサト・マルカホールディングス	10,400	3,225.00	33,540,000	
ヤマエグループホールディングス	6,800	1,205.00	8,194,000	
小野建	10,500	1,401.00	14,710,500	
南陽	2,200	1,844.00	4,056,800	
佐島電機	7,100	1,170.00	8,307,000	
エコートレーディング	2,400	591.00	1,418,400	
伯東	7,000	2,841.00	19,887,000	
コンドーテック	8,500	1,043.00	8,865,500	
中山福	6,100	337.00	2,055,700	
ナガイレーベン	14,200	1,907.00	27,079,400	
三菱食品	11,000	3,080.00	33,880,000	
松田産業	8,300	2,080.00	17,264,000	
第一興商	21,700	4,000.00	86,800,000	
メディパルホールディングス	111,400	1,790.00	199,406,000	
S P K	4,500	1,382.00	6,219,000	
萩原電気ホールディングス	4,000	2,073.00	8,292,000	
アズワン	16,400	6,120.00	100,368,000	
スズデン	3,700	2,020.00	7,474,000	
尾家産業	2,800	876.00	2,452,800	
シモジマ	7,000	953.00	6,671,000	
ドウシシャ	10,800	1,532.00	16,545,600	
小津産業	2,500	1,878.00	4,695,000	
高速	6,300	1,554.00	9,790,200	
たけびし	4,000	1,462.00	5,848,000	
リックス	2,400	1,902.00	4,564,800	
丸文	9,400	779.00	7,322,600	
ハビネット	9,000	1,563.00	14,067,000	
橋本総業ホールディングス	2,100	1,963.00	4,122,300	
日本ライフライン	33,800	925.00	31,265,000	
タカショー	8,800	813.00	7,154,400	
I D O M	34,600	728.00	25,188,800	
進和	6,700	2,161.00	14,478,700	
エスケイジャパン	2,800	467.00	1,307,600	
ダイトロン	4,600	2,000.00	9,200,000	
シークス	15,100	1,043.00	15,749,300	
田中商事	3,500	603.00	2,110,500	
オーハシテクニカ	5,800	1,292.00	7,493,600	
白銅	3,700	2,498.00	9,242,600	
ダイコー通産	1,400	1,147.00	1,605,800	

伊藤忠商事	721,800	3,844.00	2,774,599,200
丸紅	1,041,800	1,451.00	1,511,651,800
高島	1,600	2,439.00	3,902,400
長瀬産業	55,100	1,886.00	103,918,600
蝶理	6,400	1,954.00	12,505,600
豊田通商	106,100	5,060.00	536,866,000
三共生興	14,600	556.00	8,117,600
兼松	40,500	1,358.00	54,999,000
ツカモトコーポレーション	1,900	1,210.00	2,299,000
三井物産	846,400	3,459.00	2,927,697,600
日本紙パルプ商事	5,600	3,725.00	20,860,000
カメイ	12,600	1,080.00	13,608,000
東都水産	600	4,370.00	2,622,000
OUGホールディングス	1,700	2,800.00	4,760,000
スターゼン	8,000	1,951.00	15,608,000
山善	43,400	988.00	42,879,200
椿本興業	2,000	3,685.00	7,370,000
住友商事	689,900	1,961.00	1,352,893,900
内田洋行	4,600	5,300.00	24,380,000
三菱商事	783,500	4,733.00	3,708,305,500
第一実業	4,700	3,410.00	16,027,000
キャノンマーケティングジャパン	28,300	3,010.00	85,183,000
西華産業	5,200	1,636.00	8,507,200
佐藤商事	8,400	1,153.00	9,685,200
菱洋エレクトロ	6,800	2,332.00	15,857,600
東京産業	9,700	715.00	6,935,500
ユアサ商事	9,700	3,415.00	33,125,500
神鋼商事	2,600	3,875.00	10,075,000
トルク	6,200	204.00	1,264,800
阪和興業	20,800	2,999.00	62,379,200
正栄食品工業	7,400	3,965.00	29,341,000
カナデン	9,300	1,013.00	9,420,900
菱電商事	9,000	1,637.00	14,733,000
岩谷産業	26,000	5,560.00	144,560,000
ナイス	3,600	1,618.00	5,824,800
ニチモウ	1,500	2,455.00	3,682,500
極東貿易	3,300	2,676.00	8,830,800
アステナホールディングス	15,200	433.00	6,581,600
三愛オブリ	26,400	1,012.00	26,716,800
稲畑産業	22,800	2,325.00	53,010,000
G S I クレオス	5,500	1,314.00	7,227,000
明和産業	10,600	712.00	7,547,200

クワザワホールディングス	4,300	470.00	2,021,000	
ワキタ	21,800	1,149.00	25,048,200	
東邦ホールディングス	32,800	1,925.00	63,140,000	
サンゲツ	28,400	1,521.00	43,196,400	
ミツウロコグループホールディングス	14,200	947.00	13,447,400	
シナネンホールディングス	3,900	3,415.00	13,318,500	
伊藤忠エネクス	25,200	1,078.00	27,165,600	
サンリオ	33,100	2,600.00	86,060,000	
サンワテクノス	6,200	1,454.00	9,014,800	
リョーサン	12,000	2,350.00	28,200,000	
新光商事	15,700	887.00	13,925,900	
トーホー	4,600	1,224.00	5,630,400	
三信電気	4,900	1,617.00	7,923,300	
東陽テクニカ	11,300	1,105.00	12,486,500	
モスフードサービス	15,000	3,010.00	45,150,000	
加賀電子	9,600	3,080.00	29,568,000	
ソーダニッカ	10,100	621.00	6,272,100	
立花エレテック	7,900	1,561.00	12,331,900	
フォーバル	4,400	885.00	3,894,000	
PALTAC	16,000	4,265.00	68,240,000	
三谷産業	17,800	316.00	5,624,800	
西本Wismettacホールディングス	2,600	3,710.00	9,646,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,899.00	1,899,000	
コア商事ホールディングス	7,200	834.00	6,004,800	
国際紙パルプ商事	22,000	429.00	9,438,000	
ヤマタネ	5,000	1,611.00	8,055,000	
丸紅建材リース	1,000	1,912.00	1,912,000	
日鉄物産	7,400	5,280.00	39,072,000	
泉州電業	2,900	5,640.00	16,356,000	
トラスコ中山	23,700	1,808.00	42,849,600	
オートバックスセブン	36,400	1,383.00	50,341,200	
モリト	8,300	764.00	6,341,200	
加藤産業	13,700	3,075.00	42,127,500	
北恵	2,900	897.00	2,601,300	
イノテック	6,900	1,356.00	9,356,400	
イエローハット	18,600	1,615.00	30,039,000	
JKホールディングス	8,400	936.00	7,862,400	
日伝	8,300	1,972.00	16,367,600	
北沢産業	6,700	217.00	1,453,900	
杉本商事	5,300	2,223.00	11,781,900	
因幡電機産業	29,100	2,695.00	78,424,500	
東テク	3,500	2,905.00	10,167,500	

ミスミグループ本社	143,200	2,977.00	426,306,400
アルテック	7,300	236.00	1,722,800
タキヒヨー	3,200	1,072.00	3,430,400
蔵王産業	2,200	1,999.00	4,397,800
スズケン	42,100	3,495.00	147,139,500
ジェコス	7,900	841.00	6,643,900
グローセル	12,700	408.00	5,181,600
ローソン	25,300	4,290.00	108,537,000
サンエー	8,100	4,000.00	32,400,000
カワチ薬品	9,000	2,061.00	18,549,000
エービーシー・マート	17,800	5,830.00	103,774,000
ハードオフコーポレーション	5,300	886.00	4,695,800
アスクル	26,000	1,502.00	39,052,000
ゲオホールディングス	14,400	1,246.00	17,942,400
アダストリア	12,400	2,162.00	26,808,800
くら寿司	12,000	3,070.00	36,840,000
キャンドウ	4,300	2,220.00	9,546,000
アイケイ	4,000	534.00	2,136,000
パルグループホールディングス	10,100	1,765.00	17,826,500
エディオン	52,500	1,178.00	61,845,000
サーラコーポレーション	23,500	640.00	15,040,000
ワッツ	5,800	733.00	4,251,400
ハローズ	5,300	3,240.00	17,172,000
フジオフードグループ本社	8,900	1,370.00	12,193,000
あみやき亭	2,800	2,920.00	8,176,000
大黒天物産	3,700	4,385.00	16,224,500
ハニーズホールディングス	9,600	1,172.00	11,251,200
ファーマライズホールディングス	2,900	719.00	2,085,100
アルペン	8,600	1,965.00	16,899,000
ハブ	4,100	615.00	2,521,500
クオールホールディングス	14,200	1,333.00	18,928,600
ジーンズホールディングス	6,700	4,190.00	28,073,000
ビックカメラ	67,900	1,110.00	75,369,000
DCMホールディングス	68,000	1,030.00	70,040,000
Monotaro	144,300	2,026.00	292,351,800
東京一番フーズ	3,100	591.00	1,832,100
きちりホールディングス	3,000	420.00	1,260,000
アーランドサービスホールディングス	8,400	2,128.00	17,875,200
J.フロント リテイリング	129,900	1,159.00	150,554,100
ドトール・日レスホールディングス	18,700	1,530.00	28,611,000
マツキヨココカラ&カンパニー	68,000	5,090.00	346,120,000
ブロンコビリー	6,200	2,448.00	15,177,600

Z O Z O	78,500	2,527.00	198,369,500
トレジャー・ファクトリー	3,500	1,129.00	3,951,500
物語コーポレーション	5,700	6,010.00	34,257,000
三越伊勢丹ホールディングス	180,900	1,146.00	207,311,400
H a m e e	4,300	1,209.00	5,198,700
マーケットエンタープライズ	1,400	1,087.00	1,521,800
ウエルシアホールディングス	60,400	2,514.00	151,845,600
クリエイティブSDホールディングス	16,900	2,821.00	47,674,900
丸善C H Iホールディングス	13,300	386.00	5,133,800
ミサワ	2,700	639.00	1,725,300
ティーライフ	1,700	1,391.00	2,364,700
チムニー	3,500	1,212.00	4,242,000
シュッピン	9,600	1,494.00	14,342,400
オイシックス・ラ・大地	16,500	1,815.00	29,947,500
ネクステージ	23,300	2,252.00	52,471,600
ジョイフル本田	34,400	1,606.00	55,246,400
鳥貴族ホールディングス	4,000	2,055.00	8,220,000
ホットランド	8,700	1,338.00	11,640,600
すかいらーくホールディングス	141,900	1,607.00	228,033,300
S F Pホールディングス	5,600	1,570.00	8,792,000
綿半ホールディングス	8,300	1,321.00	10,964,300
ヨシックスホールディングス	2,300	2,353.00	5,411,900
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	33,400	1,047.00	34,969,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,100	1,463.00	8,924,300
B E E N O S	5,900	2,133.00	12,584,700
あさひ	9,600	1,302.00	12,499,200
日本調剤	7,100	1,297.00	9,208,700
コスモス薬品	11,500	11,770.00	135,355,000
トーエル	5,400	878.00	4,741,200
セブン&アイ・ホールディングス	403,800	5,545.00	2,239,071,000
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	71,200	966.00	68,779,200
ツルハホールディングス	24,900	6,710.00	167,079,000
サンマルクホールディングス	9,200	1,556.00	14,315,200
フェリシモ	2,700	1,172.00	3,164,400
トリドールホールディングス	28,500	2,285.00	65,122,500
T O K Y O B A S E	11,100	347.00	3,851,700
ウイルプラスホールディングス	2,400	921.00	2,210,400
J Mホールディングス	8,500	1,512.00	12,852,000
サツドラホールディングス	5,500	657.00	3,613,500
アレンザホールディングス	8,200	1,007.00	8,257,400
串カツ田中ホールディングス	3,200	1,873.00	5,993,600

パロックジャパンリミテッド	8,200	817.00	6,699,400
クスリのアオキホールディングス	10,600	5,420.00	57,452,000
力の源ホールディングス	5,800	715.00	4,147,000
FOOD & LIFE COMPANIES	61,300	3,080.00	188,804,000
メディカルシステムネットワーク	10,800	433.00	4,676,400
はるやまホールディングス	5,800	456.00	2,644,800
ノジマ	18,500	2,911.00	53,853,500
カッパ・クリエイト	16,000	1,407.00	22,512,000
ライトオン	8,500	751.00	6,383,500
良品計画	131,400	1,386.00	182,120,400
パリミキホールディングス	15,000	270.00	4,050,000
アドヴァングループ	10,600	809.00	8,575,400
アルビス	3,500	2,208.00	7,728,000
コナカ	12,700	339.00	4,305,300
ハウス オブ ローゼ	1,500	1,680.00	2,520,000
G - 7ホールディングス	12,800	1,371.00	17,548,800
イオン北海道	16,800	1,080.00	18,144,000
コジマ	20,000	584.00	11,680,000
ヒマラヤ	3,900	951.00	3,708,900
コーナン商事	16,300	3,580.00	58,354,000
エコス	4,000	2,033.00	8,132,000
ワタミ	13,800	940.00	12,972,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	228,100	2,048.00	467,148,800
西松屋チェーン	23,500	1,461.00	34,333,500
ゼンショーホールディングス	55,800	3,030.00	169,074,000
幸楽苑ホールディングス	6,800	1,285.00	8,738,000
ハークスレイ	5,200	583.00	3,031,600
サイゼリヤ	17,000	2,618.00	44,506,000
V Tホールディングス	43,400	472.00	20,484,800
魚力	3,300	2,291.00	7,560,300
フジ・コーポレーション	6,200	1,217.00	7,545,400
ユナイテッドアローズ	12,100	2,100.00	25,410,000
ハイデイ日高	16,600	2,104.00	34,926,400
YU - WA Creation Holdings	7,600	249.00	1,892,400
コロワイド	46,900	1,795.00	84,185,500
ピーシーデポコーポレーション	13,900	350.00	4,865,000
壱番屋	8,100	4,865.00	39,406,500
PLANT	3,100	653.00	2,024,300
スギホールディングス	22,800	5,220.00	119,016,000
薬王堂ホールディングス	5,800	2,044.00	11,855,200

スクロール	17,800	862.00	15,343,600
ヨンドシーホールディングス	10,000	1,786.00	17,860,000
木曽路	15,400	2,098.00	32,309,200
S R S ホールディングス	16,500	856.00	14,124,000
千趣会	21,200	397.00	8,416,400
リテールパートナーズ	16,400	1,130.00	18,532,000
ケーヨー	21,200	945.00	20,034,000
上新電機	11,900	1,873.00	22,288,700
日本瓦斯	55,500	2,007.00	111,388,500
ロイヤルホールディングス	18,800	2,259.00	42,469,200
いなげや	12,400	1,192.00	14,780,800
チヨダ	10,500	742.00	7,791,000
ライフコーポレーション	9,500	2,601.00	24,709,500
リンガーハット	13,400	2,321.00	31,101,400
MrMaxHD	14,600	604.00	8,818,400
AOKIホールディングス	22,400	697.00	15,612,800
オークワ	17,000	853.00	14,501,000
コメリ	17,700	2,650.00	46,905,000
青山商事	22,600	911.00	20,588,600
しまむら	13,300	11,110.00	147,763,000
はせがわ	6,800	284.00	1,931,200
高島屋	78,900	1,359.00	107,225,100
松屋	20,600	963.00	19,837,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	51,100	1,059.00	54,114,900
近鉄百貨店	3,700	2,478.00	9,168,600
丸井グループ	85,100	2,444.00	207,984,400
アクシアル リテイリング	8,100	3,015.00	24,421,500
イオン	397,200	2,291.00	909,985,200
イズミ	18,900	2,953.00	55,811,700
平和堂	17,700	1,887.00	33,399,900
フジ	27,100	2,215.00	60,026,500
ヤオコー	13,000	6,250.00	81,250,000
ゼビオホールディングス	15,800	909.00	14,362,200
ケーズホールディングス	100,000	1,253.00	125,300,000
Olympicグループ	5,600	703.00	3,936,800
日産東京販売ホールディングス	17,700	258.00	4,566,600
シルバーライフ	2,500	1,786.00	4,465,000
Genky DrugStores	5,100	3,340.00	17,034,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,800	907.00	2,539,600
ブックオフグループホールディングス	6,600	986.00	6,507,600
ギフトホールディングス	1,900	2,185.00	4,151,500
アインホールディングス	14,500	7,080.00	102,660,000

元気寿司	3,300	2,511.00	8,286,300
ヤマダホールディングス	415,600	471.00	195,747,600
アークランドサカモト	18,000	1,502.00	27,036,000
ニトリホールディングス	45,300	12,430.00	563,079,000
グルメ杵屋	9,300	1,014.00	9,430,200
愛眼	8,300	187.00	1,552,100
ケーユーホールディングス	6,200	1,078.00	6,683,600
吉野家ホールディングス	39,900	2,480.00	98,952,000
松屋フーズホールディングス	5,500	3,820.00	21,010,000
サガミホールディングス	16,900	1,150.00	19,435,000
関西フードマーケット	10,100	1,241.00	12,534,100
王将フードサービス	7,600	6,780.00	51,528,000
プレナス	12,900	1,933.00	24,935,700
ミニストップ	8,500	1,404.00	11,934,000
アークス	20,800	1,953.00	40,622,400
パローホールディングス	24,100	1,826.00	44,006,600
ベルク	5,100	5,170.00	26,367,000
大庄	6,300	1,170.00	7,371,000
ファーストリテイリング	15,300	69,180.00	1,058,454,000
サンドラッグ	43,000	2,890.00	124,270,000
サックスパー ホールディングス	11,100	576.00	6,393,600
ヤマザワ	2,600	1,512.00	3,931,200
やまや	2,300	2,500.00	5,750,000
ベルーナ	24,800	685.00	16,988,000
島根銀行	3,600	513.00	1,846,800
じもとホールディングス	7,700	580.00	4,466,000
めぶきフィナンシャルグループ	496,000	253.00	125,488,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,600	1,926.00	26,193,600
九州フィナンシャルグループ	211,000	394.00	83,134,000
ゆうちょ銀行	269,600	994.00	267,982,400
富山第一銀行	26,000	400.00	10,400,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	594,400	458.00	272,235,200
西日本フィナンシャルホールディングス	63,600	771.00	49,035,600
三十三フィナンシャルグループ	9,600	1,369.00	13,142,400
第四北越フィナンシャルグループ	16,900	2,516.00	42,520,400
ひろぎんホールディングス	153,500	608.00	93,328,000
おきなわフィナンシャルグループ	9,900	2,149.00	21,275,100
十六フィナンシャルグループ	14,000	2,283.00	31,962,000
北國フィナンシャルホールディングス	10,100	4,380.00	44,238,000
プロクレアホールディングス	11,800	1,917.00	22,620,600
新生銀行	74,500	1,966.00	146,467,000
あおぞら銀行	63,800	2,660.00	169,708,000



三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,844,900	745.00	5,099,450,500
りそなホールディングス	1,237,400	500.00	618,700,000
三井住友トラスト・ホールディングス	197,900	4,037.00	798,922,300
三井住友フィナンシャルグループ	757,700	3,977.00	3,013,372,900
千葉銀行	342,100	714.00	244,259,400
群馬銀行	194,000	377.00	73,138,000
武蔵野銀行	15,400	1,764.00	27,165,600
千葉興業銀行	25,400	260.00	6,604,000
筑波銀行	44,500	187.00	8,321,500
七十七銀行	32,200	1,833.00	59,022,600
秋田銀行	7,000	1,578.00	11,046,000
山形銀行	11,100	865.00	9,601,500
岩手銀行	7,100	2,058.00	14,611,800
東邦銀行	86,300	201.00	17,346,300
東北銀行	5,200	990.00	5,148,000
ふくおかフィナンシャルグループ	87,100	2,425.00	211,217,500
静岡銀行	249,700	786.00	196,264,200
スルガ銀行	100,200	357.00	35,771,400
八十二銀行	232,800	468.00	108,950,400
山梨中央銀行	11,800	1,130.00	13,334,000
大垣共立銀行	20,600	1,720.00	35,432,000
福井銀行	9,300	1,328.00	12,350,400
清水銀行	4,300	1,495.00	6,428,500
富山銀行	1,900	1,902.00	3,613,800
滋賀銀行	19,600	2,658.00	52,096,800
南都銀行	16,200	1,960.00	31,752,000
百五銀行	100,500	322.00	32,361,000
京都銀行	37,300	5,970.00	222,681,000
紀陽銀行	35,500	1,360.00	48,280,000
ほくほくフィナンシャルグループ	66,400	822.00	54,580,800
山陰合同銀行	64,900	669.00	43,418,100
中国銀行	86,600	925.00	80,105,000
鳥取銀行	3,600	1,210.00	4,356,000
伊予銀行	135,800	640.00	86,912,000
百十四銀行	11,100	1,729.00	19,191,900
四国銀行	15,800	807.00	12,750,600
阿波銀行	15,900	2,013.00	32,006,700
大分銀行	6,300	1,792.00	11,289,600
宮崎銀行	6,500	2,063.00	13,409,500
佐賀銀行	6,200	1,431.00	8,872,200
琉球銀行	24,800	794.00	19,691,200
セブン銀行	339,200	247.00	83,782,400

みずほフィナンシャルグループ	1,399,900	1,506.00	2,108,249,400
高知銀行	3,800	759.00	2,884,200
山口フィナンシャルグループ	120,400	762.00	91,744,800
長野銀行	3,600	1,272.00	4,579,200
名古屋銀行	7,400	2,994.00	22,155,600
北洋銀行	153,100	217.00	33,222,700
愛知銀行	3,700	5,000.00	18,500,000
中京銀行	3,700	1,618.00	5,986,600
大光銀行	3,600	1,314.00	4,730,400
愛媛銀行	15,200	884.00	13,436,800
トマト銀行	3,700	1,022.00	3,781,400
京葉銀行	47,600	460.00	21,896,000
栃木銀行	52,500	265.00	13,912,500
北日本銀行	3,400	1,561.00	5,307,400
東和銀行	19,200	514.00	9,868,800
福島銀行	12,400	227.00	2,814,800
大東銀行	5,200	653.00	3,395,600
トモニホールディングス	84,400	312.00	26,332,800
フィデアホールディングス	10,400	1,266.00	13,166,400
池田泉州ホールディングス	124,600	194.00	24,172,400
F P G	38,600	933.00	36,013,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	9,000	1,390.00	12,510,000
マーキュリアホールディングス	5,900	607.00	3,581,300
S B I ホールディングス	141,100	2,633.00	371,516,300
ジャフコ グループ	43,700	1,623.00	70,925,100
大和証券グループ本社	814,900	619.90	505,156,510
野村ホールディングス	1,744,200	492.80	859,541,760
岡三証券グループ	85,300	340.00	29,002,000
丸三証券	34,200	483.00	16,518,600
東洋証券	36,400	186.00	6,770,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	119,100	374.00	44,543,400
光世証券	2,700	478.00	1,290,600
水戸証券	29,400	264.00	7,761,600
いちよし証券	20,600	646.00	13,307,600
松井証券	56,100	818.00	45,889,800
マネックスグループ	95,400	489.00	46,650,600
極東証券	14,000	681.00	9,534,000
岩井コスモホールディングス	10,900	1,244.00	13,559,600
アイザワ証券グループ	16,700	696.00	11,623,200
マネーパートナーズグループ	12,800	249.00	3,187,200
スパークス・グループ	53,300	253.00	13,484,900
かんぽ生命保険	115,000	2,190.00	251,850,000

S O M P Oホールディングス	170,900	5,961.00	1,018,734,900
アニコム ホールディングス	35,100	656.00	23,025,600
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	241,900	4,115.00	995,418,500
第一生命ホールディングス	543,800	2,598.00	1,412,792,400
東京海上ホールディングス	334,200	7,572.00	2,530,562,400
T & Dホールディングス	268,300	1,579.00	423,645,700
アドバンスクリエイト	5,500	968.00	5,324,000
全国保証	27,300	4,275.00	116,707,500
あんしん保証	5,500	274.00	1,507,000
イントラスト	5,300	557.00	2,952,100
日本モーゲージサービス	6,600	964.00	6,362,400
C a s a	4,300	843.00	3,624,900
アルヒ	17,100	987.00	16,877,700
プレミアグループ	5,800	3,865.00	22,417,000
ネットプロテクションズホールディングス	35,100	571.00	20,042,100
クレディセゾン	69,100	1,538.00	106,275,800
芙蓉総合リース	10,600	7,740.00	82,044,000
みずほリース	15,400	3,150.00	48,510,000
東京センチュリー	19,200	4,250.00	81,600,000
日本証券金融	45,200	880.00	39,776,000
アイフル	192,400	347.00	66,762,800
リコーリース	10,200	3,455.00	35,241,000
イオンフィナンシャルサービス	62,300	1,240.00	77,252,000
アコム	226,100	315.00	71,221,500
ジャックス	11,900	3,360.00	39,984,000
オリエントコーポレーション	311,100	125.00	38,887,500
オリックス	678,700	2,421.50	1,643,472,050
三菱H C キャピタル	387,200	628.00	243,161,600
九州リースサービス	5,600	579.00	3,242,400
日本取引所グループ	272,500	2,105.50	573,748,750
イー・ギャランティ	17,000	1,972.00	33,524,000
アサックス	6,400	601.00	3,846,400
N E C キャピタルソリューション	4,800	1,970.00	9,456,000
いちご	130,600	302.00	39,441,200
日本駐車場開発	123,600	171.00	21,135,600
スター・マイカ・ホールディングス	6,900	1,593.00	10,991,700
S R E ホールディングス	3,500	2,179.00	7,626,500
A Dワークスグループ	21,500	154.00	3,311,000
ヒューリック	257,500	1,098.00	282,735,000
三栄建築設計	5,200	1,647.00	8,564,400
野村不動産ホールディングス	59,400	3,375.00	200,475,000
三重交通グループホールディングス	25,400	501.00	12,725,400

サムティ	17,800	2,020.00	35,956,000
ディア・ライフ	16,300	549.00	8,948,700
地主	7,700	2,024.00	15,584,800
プレサンスコーポレーション	14,000	1,526.00	21,364,000
ハウスコム	3,000	1,026.00	3,078,000
JPMC	6,500	1,032.00	6,708,000
サンセイランディック	4,600	872.00	4,011,200
フージャースホールディングス	14,600	827.00	12,074,200
オープンハウスグループ	36,500	5,410.00	197,465,000
東急不動産ホールディングス	320,700	696.00	223,207,200
飯田グループホールディングス	95,800	2,017.00	193,228,600
イーランド	2,400	1,509.00	3,621,600
ムゲンエステート	9,200	495.00	4,554,000
And Doホールディングス	5,600	904.00	5,062,400
シーアールイー	4,600	1,595.00	7,337,000
ケイアイスター不動産	5,300	4,775.00	25,307,500
グッドコムアセット	5,900	1,184.00	6,985,600
ジェイ・エス・ビー	2,600	3,390.00	8,814,000
ロードスターキャピタル	3,700	1,509.00	5,583,300
テンポイノベーション	4,400	850.00	3,740,000
フェイスネットワーク	2,300	1,363.00	3,134,900
パーク24	68,100	2,114.00	143,963,400
パラカ	3,800	1,793.00	6,813,400
三井不動産	471,800	2,932.00	1,383,317,600
三菱地所	684,300	1,994.00	1,364,494,200
平和不動産	18,900	3,955.00	74,749,500
東京建物	103,400	1,772.00	183,224,800
京阪神ビルディング	16,700	1,282.00	21,409,400
住友不動産	217,100	3,693.00	801,750,300
テーオーシー	20,000	633.00	12,660,000
東京楽天地	2,000	4,010.00	8,020,000
スターツコーポレーション	16,000	2,576.00	41,216,000
フジ住宅	14,900	646.00	9,625,400
空港施設	13,500	542.00	7,317,000
明和地所	7,200	622.00	4,478,400
ゴールドクレスト	9,600	1,713.00	16,444,800
エスリード	5,100	1,692.00	8,629,200
日神グループホールディングス	21,000	446.00	9,366,000
日本エスコン	21,300	769.00	16,379,700
タカラレーベン	47,900	344.00	16,477,600
AVANTIA	6,800	846.00	5,752,800
イオンモール	57,900	1,651.00	95,592,900

毎日コムネット	5,500	681.00	3,745,500
ファースト住建	5,200	1,111.00	5,777,200
カチタス	28,600	2,969.00	84,913,400
トーセイ	16,700	1,176.00	19,639,200
穴吹興産	3,000	2,363.00	7,089,000
サンフロンティア不動産	16,800	1,082.00	18,177,600
FJネクストホールディングス	12,200	1,081.00	13,188,200
インテリックス	2,600	610.00	1,586,000
ランドビジネス	4,200	237.00	995,400
サンネクスタグループ	4,600	1,174.00	5,400,400
グランディハウス	9,800	538.00	5,272,400
日本空港ビルデング	39,300	5,420.00	213,006,000
明豊ファシリティワークス	5,400	660.00	3,564,000
日本工営	7,100	3,300.00	23,430,000
LIFULL	35,100	171.00	6,002,100
ミクシィ	25,400	2,187.00	55,549,800
ジェイエイシーリクルートメント	9,100	1,727.00	15,715,700
日本M&Aセンターホールディングス	181,700	1,397.00	253,834,900
メンバーズ	3,100	2,785.00	8,633,500
中広	2,300	386.00	887,800
UTグループ	16,100	2,442.00	39,316,200
アイティメディア	5,400	1,690.00	9,126,000
E・Jホールディングス	6,600	1,152.00	7,603,200
夢真ビーネックスグループ	36,200	1,430.00	51,766,000
コシダカホールディングス	29,900	800.00	23,920,000
アルトナー	2,900	853.00	2,473,700
パソナグループ	12,100	1,982.00	23,982,200
CDS	2,900	1,959.00	5,681,100
リンクアンドモチベーション	24,400	450.00	10,980,000
エス・エム・エス	37,700	2,830.00	106,691,000
サニーサイドアップグループ	4,200	612.00	2,570,400
パーソルホールディングス	110,700	2,406.00	266,344,200
リニカル	6,500	815.00	5,297,500
クックパッド	35,800	222.00	7,947,600
アイ・ケイ・ケイホールディングス	5,800	618.00	3,584,400
学情	4,700	975.00	4,582,500
スタジオアリス	5,000	2,274.00	11,370,000
シミックホールディングス	5,800	1,455.00	8,439,000
エプコ	2,600	761.00	1,978,600
NJS	2,500	2,036.00	5,090,000
総合警備保障	41,600	3,505.00	145,808,000
カカコム	81,300	2,330.00	189,429,000

アイロムグループ	4,000	1,894.00	7,576,000
セントケア・ホールディング	7,400	844.00	6,245,600
サイネックス	2,200	595.00	1,309,000
ルネサンス	7,900	956.00	7,552,400
ディップ	19,500	3,710.00	72,345,000
デジタルホールディングス	7,900	1,316.00	10,396,400
新日本科学	13,600	1,929.00	26,234,400
キャリアデザインセンター	2,700	1,112.00	3,002,400
ベネフィット・ワン	40,400	1,856.00	74,982,400
エムスリー	195,300	3,908.00	763,232,400
ツカダ・グローバルホールディング	7,000	363.00	2,541,000
アウトソーシング	63,600	1,124.00	71,486,400
ウェルネット	10,700	510.00	5,457,000
ワールドホールディングス	4,500	2,383.00	10,723,500
ディー・エヌ・エー	42,300	1,849.00	78,212,700
博報堂D Yホールディングス	144,900	1,282.00	185,761,800
ぐるなび	17,300	430.00	7,439,000
タカミヤ	14,000	382.00	5,348,000
ジャパンベストレスキューシステム	6,700	785.00	5,259,500
ファンコミュニケーションズ	26,400	401.00	10,586,400
ライク	3,800	2,128.00	8,086,400
ビジネス・ブレークスルー	4,600	442.00	2,033,200
エスプール	31,400	1,229.00	38,590,600
WDBホールディングス	5,100	2,304.00	11,750,400
ティア	6,900	444.00	3,063,600
C D G	1,400	1,282.00	1,794,800
アドウェイズ	16,900	719.00	12,151,100
バリューコマース	8,700	3,260.00	28,362,000
インフォマート	121,700	456.00	55,495,200
J Pホールディングス	29,400	226.00	6,644,400
エコナックホールディングス	21,700	92.00	1,996,400
C Lホールディングス	2,600	1,010.00	2,626,000
プレステージ・インターナショナル	41,800	668.00	27,922,400
アミューズ	6,100	2,079.00	12,681,900
ドリームインキュベータ	3,400	2,311.00	7,857,400
クイック	7,300	1,437.00	10,490,100
T A C	7,000	227.00	1,589,000
電通グループ	107,200	4,375.00	469,000,000
イオンファンタジー	4,400	2,638.00	11,607,200
シーティーエス	12,700	853.00	10,833,100
ネクシィーズグループ	4,000	553.00	2,212,000
H . U . グループホールディングス	29,000	2,712.00	78,648,000

アルプス技研	9,200	1,865.00	17,158,000
ダイオーズ	2,400	1,151.00	2,762,400
日本空調サービス	11,900	795.00	9,460,500
オリエンタルランド	122,100	18,635.00	2,275,333,500
ダスキン	24,500	2,699.00	66,125,500
明光ネットワークジャパン	13,400	600.00	8,040,000
ファルコホールディングス	5,100	2,054.00	10,475,400
ラウンドワン	31,000	1,692.00	52,452,000
リゾートトラスト	48,200	2,178.00	104,979,600
ビー・エム・エル	14,100	3,545.00	49,984,500
りらいあコミュニケーションズ	16,500	1,068.00	17,622,000
リソー教育	51,200	333.00	17,049,600
早稲田アカデミー	6,300	1,130.00	7,119,000
ユー・エス・エス	124,000	2,425.00	300,700,000
東京個別指導学院	10,100	603.00	6,090,300
サイバーエージェント	248,700	1,405.00	349,423,500
楽天グループ	532,200	713.00	379,458,600
クリーク・アンド・リバー社	5,900	2,012.00	11,870,800
モーニングスター	19,800	521.00	10,315,800
テー・オー・ダブリュー	21,800	333.00	7,259,400
山田コンサルティンググループ	5,900	1,141.00	6,731,900
セントラルスポーツ	4,200	2,422.00	10,172,400
フルキャストホールディングス	9,500	2,161.00	20,529,500
エン・ジャパン	19,200	1,812.00	34,790,400
リソルホールディングス	1,200	4,715.00	5,658,000
テクノプロ・ホールディングス	66,300	2,930.00	194,259,000
アトラグループ	2,500	204.00	510,000
インターワークス	3,800	383.00	1,455,400
アイ・アールジャパンホールディングス	5,200	2,218.00	11,533,600
K e e P e r 技研	7,200	3,425.00	24,660,000
ファーストロジック	2,100	774.00	1,625,400
三機サービス	2,100	1,022.00	2,146,200
G u n o s y	6,300	921.00	5,802,300
デザインワン・ジャパン	4,300	179.00	769,700
イー・ガーディアン	4,100	2,969.00	12,172,900
リブセンス	7,400	167.00	1,235,800
ジャパンマテリアル	34,100	1,880.00	64,108,000
ベクトル	15,700	1,044.00	16,390,800
ウチヤマホールディングス	6,200	303.00	1,878,600
チャーム・ケア・コーポレーション	8,500	1,010.00	8,585,000
キャリアリンク	4,200	1,836.00	7,711,200
I B J	9,400	715.00	6,721,000

アサンテ	5,000	1,522.00	7,610,000
バリューHR	9,500	1,255.00	11,922,500
M&Aキャピタルパートナーズ	9,200	3,300.00	30,360,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,500	1,202.00	5,409,000
E R Iホールディングス	3,300	1,539.00	5,078,700
アビスト	1,800	2,877.00	5,178,600
シグマクシス・ホールディングス	13,500	1,090.00	14,715,000
ウィルグループ	8,400	1,152.00	9,676,800
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	13,900	176.00	2,446,400
メドピア	8,100	2,091.00	16,937,100
レアジョブ	2,500	601.00	1,502,500
リクルートホールディングス	813,100	4,448.00	3,616,668,800
エラン	15,500	1,016.00	15,748,000
土木管理総合試験所	5,800	334.00	1,937,200
ネットマーケティング	5,700	628.00	3,579,600
日本郵政	1,324,900	956.80	1,267,664,320
ベルシステム24ホールディングス	16,100	1,390.00	22,379,000
鎌倉新書	13,000	553.00	7,189,000
S MN	2,800	600.00	1,680,000
グローバルキッズCOMPANY	2,100	667.00	1,400,700
エアトリ	6,700	2,846.00	19,068,200
アトラエ	7,800	1,770.00	13,806,000
ストライク	4,700	3,675.00	17,272,500
ソラスト	27,500	695.00	19,112,500
セラク	3,700	1,181.00	4,369,700
インソース	11,800	2,238.00	26,408,400
ベイクレント・コンサルティング	7,800	35,500.00	276,900,000
Orchestra Holdings	2,200	2,642.00	5,812,400
アイモバイル	4,900	1,418.00	6,948,200
キャリアインデックス	4,200	509.00	2,137,800
MS - Japan	4,700	894.00	4,201,800
船場	2,500	676.00	1,690,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	35,200	1,507.00	53,046,400
フルテック	1,700	1,333.00	2,266,100
GameWith	3,800	500.00	1,900,000
MS&Consulting	1,900	721.00	1,369,900
ウェルビー	7,500	794.00	5,955,000
エル・ティー・エス	1,500	3,515.00	5,272,500
ミダックホールディングス	5,100	2,695.00	13,744,500
日総工産	9,000	607.00	5,463,000
キュービーネットホールディングス	5,300	1,323.00	7,011,900
RPAホールディングス	16,100	397.00	6,391,700



スプリックス	3,800	1,018.00	3,868,400
マネジメントソリューションズ	5,500	3,840.00	21,120,000
プロレド・パートナーズ	2,800	577.00	1,615,600
テノ・ホールディングス	1,700	680.00	1,156,000
フロンティア・マネジメント	3,100	1,284.00	3,980,400
ピアラ	2,100	762.00	1,600,200
コプロ・ホールディングス	2,400	940.00	2,256,000
ギークス	2,200	977.00	2,149,400
カーブスホールディングス	30,700	685.00	21,029,500
フォーラムエンジニアリング	7,300	936.00	6,832,800
Fast Fitness Japan	2,200	1,490.00	3,278,000
ダイレクトマーケティングミックス	11,900	1,812.00	21,562,800
ポピンズ	2,700	2,130.00	5,751,000
LITALICO	9,000	2,616.00	23,544,000
アドバンテッジリスクマネジメント	6,000	483.00	2,898,000
リログループ	60,600	2,105.00	127,563,000
東祥	8,400	1,351.00	11,348,400
ビーウィズ	3,100	1,390.00	4,309,000
TREホールディングス	19,000	1,969.00	37,411,000
人・夢・技術グループ	4,500	2,453.00	11,038,500
エイチ・アイ・エス	23,600	2,220.00	52,392,000
ラックランド	3,400	2,985.00	10,149,000
共立メンテナンス	19,800	5,020.00	99,396,000
イチネンホールディングス	11,500	1,219.00	14,018,500
建設技術研究所	6,000	2,581.00	15,486,000
スペース	7,700	916.00	7,053,200
燦ホールディングス	4,900	1,815.00	8,893,500
スバル興業	700	8,780.00	6,146,000
東京テアトル	4,100	1,232.00	5,051,200
タナベ経営	4,600	683.00	3,141,800
ナガワ	3,300	8,700.00	28,710,000
東京都競馬	8,300	3,805.00	31,581,500
カナモト	18,700	2,030.00	37,961,000
西尾レントオール	9,600	2,847.00	27,331,200
トランス・コスモス	14,100	3,515.00	49,561,500
乃村工藝社	47,700	914.00	43,597,800
藤田観光	4,800	2,941.00	14,116,800
KNT-CTホールディングス	6,900	1,735.00	11,971,500
日本管財	11,900	2,570.00	30,583,000
トーカイ	9,200	1,667.00	15,336,400
セコム	109,100	8,521.00	929,641,100
セントラル警備保障	5,400	2,248.00	12,139,200

丹青社	21,700	838.00	18,184,600	
メイテック	13,200	6,900.00	91,080,000	
応用地質	11,300	1,801.00	20,351,300	
船井総研ホールディングス	21,500	2,111.00	45,386,500	
進学会ホールディングス	4,200	355.00	1,491,000	
オオバ	7,400	774.00	5,727,600	
いであ	2,900	1,796.00	5,208,400	
学究社	3,700	1,578.00	5,838,600	
ベネッセホールディングス	37,000	2,069.00	76,553,000	
イオンディライト	12,800	2,850.00	36,480,000	
ナック	5,500	955.00	5,252,500	
ダイセキ	20,200	4,820.00	97,364,000	
ステップ	4,200	1,742.00	7,316,400	
合 計	120,594,100		295,520,076,660	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式マザーファンド

## 貸借対照表

	2022年 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	7,955,496,230
コール・ローン	1,072,371,055
株式	319,753,897,067
投資信託受益証券	156,335,368
投資証券	7,712,539,427
派生商品評価勘定	79,456,621
未収入金	3,142,005
未収配当金	513,847,555
前払金	412,779,115
差入委託証拠金	2,693,085,892
流動資産合計	340,352,950,335

	2022年 6月10日現在
項目	金額（円）
資産合計	340,352,950,335
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	454,214,844
未払解約金	132,555,274
未払利息	1,224
流動負債合計	586,771,342
負債合計	586,771,342
純資産の部	
元本等	
元本	74,104,729,838
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	265,661,449,155
元本等合計	339,766,178,993
純資産合計	339,766,178,993
負債純資産合計	340,352,950,335

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 6月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

	2022年 6月10日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	2022年 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	74,104,729,838口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 4.5849円 (45,849円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2022年 6月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2022年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 6月11日
期首元本額	70,987,930,886円
期中追加設定元本額	10,472,231,650円
期中一部解約元本額	7,355,432,698円
期末元本額	74,104,729,838円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,502,557,098円
DC外国株式インデックスファンド	4,879,108,908円
DC外国株式インデックスファンドL	26,273,043,128円
DCバランスファンド30	588,143,229円
DCバランスファンド50	1,210,427,478円
DCバランスファンド70	794,785,836円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	279,160,110円
外国株式インデックスe	4,646,178,404円
インデックスコレクション（外国株式）	15,254,821,052円
インデックスコレクション（バランス株式30）	3,230,106,563円
インデックスコレクション（バランス株式50）	986,188,507円
インデックスコレクション（バランス株式70）	973,985,363円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,111,220,496円
外国株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	1,460,371,874円
私募外国株式パッシブファンド2（適格機関投資家専用）	121,233,842円
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	426,483,217円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	24,615,815円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	260,782,774円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	32,775,530円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	65,402,737円

区分	2022年 6月10日現在
V Aバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	251,080,808円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	234,009,288円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	181,119,525円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	3,554,482,012円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	399,709,176円
V Aバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	103,813,932円
V Aポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	596,157,992円
V Aポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	12,779,832円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	72,732,009円
V Aバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	78,872,199円
V Aバランス50-50(適格機関投資家専用)	245,405,830円
V Aファンド25(適格機関投資家専用)	10,499,625円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	61,112,107円
V Aバランス20-80(適格機関投資家専用)	175,766,087円
私募外国株式インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	5,797,455円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	34,086,167,338
投資信託受益証券	8,847,536
投資証券	753,829,236
合計	34,831,149,038

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(2022年 6月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引 買建	12,214,366,368	うち1年超	11,801,587,253
			-	
合計		12,214,366,368	-	11,801,587,253
				412,779,115

## (注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2022年 6月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	995,166,386	-	1,032,476,129	37,309,743
	アメリカドル	783,590,846	-	811,117,499	27,526,653
	ユーロ	163,945,560	-	171,055,800	7,110,240
	イギリスポンド	47,629,980	-	50,302,830	2,672,850
	売建	150,285,588	-	149,574,439	711,149
	アメリカドル	93,943,850	-	93,937,760	6,090
	イギリスポンド	8,049,038	-	8,048,779	259
	オーストラリアドル	48,292,700	-	47,587,900	704,800
合計		1,145,451,974	-	1,182,050,568	38,020,892

### (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	17,739	50.04	887,659.56	
	BAKER HUGHES CO	47,945	36.08	1,729,855.60	
	CHENIERE ENERGY INC	11,266	137.35	1,547,385.10	
	CHEVRON CORP	96,745	177.52	17,174,172.40	
	CONOCOPHILLIPS	64,539	118.56	7,651,743.84	
	COTERRA ENERGY INC	41,058	34.96	1,435,387.68	
	DEVON ENERGY CORPORATION	31,794	77.85	2,475,162.90	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	8,090	157.83	1,276,844.70	
	EOG RESOURCES INC	28,920	142.49	4,120,810.80	



EQT CORPORATION	17,321	48.07	832,620.47
EXXON MOBIL	210,256	102.33	21,515,496.48
HALLIBURTON CO	44,379	42.21	1,873,237.59
HESS CORP	13,850	126.86	1,757,011.00
KINDER MORGAN INC	100,765	19.29	1,943,756.85
MARATHON OIL CORP	36,460	31.25	1,139,375.00
MARATHON PETROLEUM CORP	27,282	111.36	3,038,123.52
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	46,140	65.18	3,007,405.20
ONEOK INC	22,489	66.19	1,488,546.91
PHILLIPS 66	24,061	108.27	2,605,084.47
PIONEER NATURAL RESOURCES	11,583	276.78	3,205,942.74
SCHLUMBERGER	69,679	48.14	3,354,347.06
TARGA RESOURCES CORP	11,099	75.08	833,312.92
VALERO ENERGY CORP	20,210	143.41	2,898,316.10
WILLIAMS COS	60,051	35.59	2,137,215.09
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	10,917	253.62	2,768,769.54
ALBEMARLE CORP	5,885	241.78	1,422,875.30
ALCOA CORP	9,533	55.56	529,653.48
AMCOR PLC	72,748	13.17	958,091.16
AVERY DENNISON CORP	4,144	173.95	720,848.80
BALL CORP	15,147	70.42	1,066,651.74
CELANESE CORP-SERIES A	5,419	155.27	841,408.13
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	88.89	922,589.31
CLEVELAND-CLIFFS INC	27,048	20.64	558,270.72
CORTEVA INC	36,448	61.08	2,226,243.84
CROWN HOLDINGS INC	6,218	102.73	638,775.14
DOW INC	36,681	65.86	2,415,810.66
DUPONT DE NEMOURS INC	25,064	66.12	1,657,231.68
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,266	108.51	679,923.66
ECOLAB INC	12,620	164.71	2,078,640.20
FMC CORP	5,984	115.47	690,972.48
FREEMPORT-MCMORAN INC	72,123	40.52	2,922,423.96
INT'L PAPER CO	17,345	46.28	802,726.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	12,588	130.80	1,646,510.40
LINDE PLC	25,501	318.69	8,126,913.69
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,234	108.22	1,432,183.48
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,168	332.87	1,054,532.16
MOSAIC CO/THE	18,682	53.66	1,002,476.12
NEWMONT CORPORATION	40,062	64.58	2,587,203.96
NUCOR CORP	13,230	123.66	1,636,021.80
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,374	156.16	683,043.84
PPG INDUSTRIES INC	11,826	123.99	1,466,305.74

RPM INTERNATIONAL INC	5,987	84.50	505,901.50
SEALED AIR CORP	7,368	61.09	450,111.12
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	12,375	261.99	3,242,126.25
STEEL DYNAMICS INC	9,667	76.79	742,328.93
VULCAN MATERIALS CO	6,735	161.08	1,084,873.80
WESTLAKE CORP	2,096	130.44	273,402.24
WESTROCK CO	12,132	47.31	573,964.92
3 M COMPANY	28,021	144.18	4,040,067.78
AERCAP HOLDINGS NV	7,161	46.78	334,991.58
ALLEGION PLC	4,638	108.53	503,362.14
AMETEK INC	11,723	118.82	1,392,926.86
BOEING CO	27,320	133.73	3,653,503.60
CARRIER GLOBAL CORP	41,014	38.85	1,593,393.90
CATERPILLAR	26,471	223.67	5,920,768.57
CUMMINS INC	6,913	211.50	1,462,099.50
DEERE&CO	14,394	345.33	4,970,680.02
DOVER CORP	7,491	132.71	994,130.61
EATON CORP	19,500	142.50	2,778,750.00
EMERSON ELECTRIC CO	29,379	89.94	2,642,347.26
FASTENAL CO	29,312	52.84	1,548,846.08
FORTIVE CORP	16,407	61.13	1,002,959.91
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,412	69.09	443,005.08
GENERAC HOLDINGS INC	2,918	277.87	810,824.66
GENERAL DYNAMICS CORP	11,819	226.89	2,681,612.91
GENERAL ELECTRIC CO	54,947	74.78	4,108,936.66
GRAINGER (WW) INC	2,333	494.42	1,153,481.86
HEICO CORP	2,252	144.06	324,423.12
HEICO CORP-CLASS A	3,318	116.09	385,186.62
HONEYWELL INTL INC	34,145	192.01	6,556,181.45
HOWMET AEROSPACE INC	18,227	35.17	641,043.59
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	214.00	426,502.00
IDEX CORP	3,505	191.15	669,980.75
ILLINOIS TOOL WORKS	15,483	203.36	3,148,622.88
INGERSOLL-RAND INC	20,847	48.60	1,013,164.20
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,600	58.89	565,344.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	33,831	53.72	1,817,401.32
KORNIT DIGITAL LTD	2,600	39.90	103,740.00
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	9,818	240.59	2,362,112.62
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,584	206.26	326,715.84
LOCKHEED MARTIN CORP	12,232	432.72	5,293,031.04
MASCO CORP	12,110	56.70	686,637.00
NORDSON CORP	2,536	214.35	543,591.60

NORTHROP GRUMMAN CORP	7,408	462.92	3,429,311.36
OTIS WORLDWIDE CORP	21,403	76.00	1,626,628.00
OWENS CORNING	4,965	93.87	466,064.55
PACCAR INC	17,559	88.03	1,545,718.77
PARKER HANNIFIN CORP	6,517	276.96	1,804,948.32
PENTAIR PLC	7,637	49.51	378,107.87
PLUG POWER INC	23,605	16.92	399,396.60
QUANTA SERVICES INC	7,500	130.76	980,700.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	74,482	97.38	7,253,057.16
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,882	213.30	1,254,630.60
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,201	406.23	2,112,802.23
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,602	47.77	363,147.54
SMITH (A.O.) CORP	6,846	60.81	416,305.26
SNAP-ON INC	2,772	218.67	606,153.24
STANLEY BLACK&DECKER	8,223	117.92	969,656.16
TEXTRON	10,911	66.82	729,073.02
TRANE TECHNOLOGIES PLC	11,217	134.29	1,506,330.93
TRANSDIGM GROUP INC	2,661	607.90	1,617,621.90
UNITED RENTALS INC	3,678	298.40	1,097,515.20
WABTEC CORP	8,356	92.82	775,603.92
XYLEM INC	8,363	82.72	691,787.36
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	6,342	86.14	546,299.88
CINTAS CORP	4,794	390.92	1,874,070.48
CLARIVATE PLC	15,370	14.45	222,096.50
COPART INC	10,801	112.39	1,213,924.39
COSTAR GROUP INC	20,002	59.69	1,193,919.38
EQUIFAX INC	6,176	191.97	1,185,606.72
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,004	131.99	792,467.96
LEIDOS HOLDINGS	6,238	102.83	641,453.54
REPUBLIC SERVICES INC	11,169	128.48	1,434,993.12
ROBERT HALF INTL INC	5,212	87.62	456,675.44
ROLLINS INC	10,710	34.16	365,853.60
TRANSUNION	8,818	82.55	727,925.90
VERISK ANALYTICS INC	8,140	166.79	1,357,670.60
WASTE CONNECTIONS INC	12,957	124.56	1,613,923.92
WASTE MANAGEMENT INC	20,741	153.35	3,180,632.35
AMERCO	564	489.00	275,796.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,274	102.12	640,700.88
CSX CORP	107,460	31.17	3,349,528.20
DELTA AIR LINES INC	7,841	36.75	288,156.75
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,850	101.20	794,420.00
FEDEX CORP	12,306	217.00	2,670,402.00

GRAB HOLDINGS LTD - CL A	54,628	2.89	157,874.92
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,907	166.06	648,796.42
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,000	46.76	327,320.00
LYFT INC-A	11,829	16.94	200,383.26
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,893	237.45	2,823,992.85
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,619	252.27	1,165,235.13
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,754	42.04	283,938.16
UBER TECHNOLOGIES INC	71,603	25.44	1,821,580.32
UNION PACIFIC CORP	31,614	216.79	6,853,599.06
UNITED PARCEL SERVICE B	36,774	176.55	6,492,449.70
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	5,000	52.75	263,750.00
APTIV PLC	13,457	107.22	1,442,859.54
BORGWARNER INC	11,533	39.17	451,747.61
FORD MOTOR COMPANY	192,833	13.28	2,560,822.24
GENERAL MOTORS CO	69,921	36.65	2,562,604.65
LEAR CORP	2,989	140.87	421,060.43
LUCID GROUP INC	20,820	18.88	393,081.60
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	8,920	28.87	257,520.40
TESLA INC	43,619	719.12	31,367,295.28
DR HORTON INC	16,141	73.45	1,185,556.45
GARMIN LTD	7,784	101.88	793,033.92
HASBRO INC	6,002	87.28	523,884.57
LENNAR CORP-CL A	12,818	78.68	1,008,520.24
LULULEMON ATHLETICA INC	5,782	302.30	1,747,898.60
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,830	140.93	398,831.90
NEWELL BRANDS INC	17,598	19.98	351,608.04
NIKE B	63,624	118.60	7,545,806.40
NVR INC	164	4,338.02	711,435.28
PELOTON INTERACTIVE INC-A	12,862	11.12	143,025.44
PULTE GROUP INC	12,386	43.99	544,860.14
VF CORP	16,318	48.43	790,280.74
WHIRLPOOL CORP	3,060	170.61	522,066.60
AIRBNB INC-CLASS A	17,083	115.72	1,976,844.76
ARAMARK	11,643	33.76	393,067.68
BOOKING HOLDINGS INC	2,039	2,277.84	4,644,515.76
CAESARS ENTERTAINMENT INC	9,663	50.16	484,696.08
CARNIVAL CORPORATION	42,799	11.73	502,032.27
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,390	1,369.59	1,903,730.10
DARDEN RESTAURANTS INC	6,041	123.46	745,821.86
DOMINO'S PIZZA INC	1,797	385.44	692,635.68
EXPEDIA GROUP INC	7,394	121.99	901,994.06
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	13,745	135.80	1,866,571.00

LAS VEGAS SANDS CORP	15,969	35.29	563,546.01
MARRIOTT INTL A	13,789	167.65	2,311,725.85
MCDONALD'S CORP	36,983	242.16	8,955,803.28
MGM RESORTS INTERNATIONAL	18,299	34.32	628,021.68
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,621	49.37	524,358.77
STARBUCKS CORP	56,825	78.91	4,484,060.75
VAIL RESORTS INC	1,853	245.50	454,911.50
WYNN RESORTS LTD	5,210	66.28	345,318.80
YUM BRANDS INC	14,073	117.32	1,651,044.36
ACTIVISION BLIZZARD INC	38,655	76.78	2,967,930.90
ALPHABET INC-CL A	14,930	2,296.71	34,289,880.30
ALPHABET INC-CL C	14,103	2,298.36	32,413,771.08
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	24,885	12.78	318,030.30
CABLE ONE INC	247	1,312.97	324,303.59
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	6,158	482.26	2,969,757.08
COMCAST CORP-CL A	224,950	42.18	9,488,391.00
DISH NETWORK CORPORATION-A	12,603	19.91	250,925.73
ELECTRONIC ARTS INC	13,548	135.81	1,839,953.88
FOX CORP - CLASS A	15,560	33.48	520,948.80
FOX CORP- CLASS B	6,975	30.98	216,085.50
IAC/INTERACTIVECORP	3,853	85.00	327,505.00
INTERPUBLIC GROUP OF COS	17,946	30.25	542,866.50
LIBERTY BROADBAND-C	7,402	120.91	894,975.82
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,885	61.97	612,573.45
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,928	39.32	311,728.96
LIBERTY SIRIUSXM-A	3,171	39.38	124,873.98
LIVE NATION ENTERTAINMENT	8,618	93.92	809,402.56
MATCH GROUP INC	14,456	80.42	1,162,551.52
META PLATFORMS INC-CLASS A	114,468	184.00	21,062,112.00
NETFLIX INC	22,149	192.77	4,269,662.73
NEWS CORP-CLASS A	17,936	16.86	302,400.96
OMNICOM GROUP	9,954	69.85	695,286.90
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	30,808	29.15	898,053.20
PINTEREST INC- CLASS A	27,343	20.25	553,695.75
ROBLOX CORP -CLASS A	18,226	30.50	555,893.00
ROKU INC	5,586	92.37	515,978.82
SEA LTD-ADR	18,067	82.18	1,484,746.06
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,096	6.15	289,640.40
SNAP INC - A	52,578	14.10	741,349.80
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,203	129.23	1,060,073.69
THE WALT DISNEY CO	90,541	103.30	9,352,885.30
TWITTER INC	40,330	39.53	1,594,244.90

WARNER BROS DISCOVERY INC	111,814	15.63	1,747,652.82
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	14,227	37.34	531,236.18
ADVANCE AUTO PARTS	3,129	184.66	577,801.14
AMAZON.COM	454,960	116.15	52,843,604.00
AUTOZONE INC	1,035	2,101.15	2,174,690.25
BATH & BODY WORKS INC	13,789	35.35	487,441.15
BEST BUY COMPANY INC	10,832	74.93	811,641.76
BURLINGTON STORES INC	3,076	173.91	534,947.16
CARMAX INC	7,628	99.93	762,266.04
CARVANA CO	3,698	23.13	85,534.74
CHEWY INC - CLASS A	3,947	29.75	117,423.25
DOLLAR GENERAL CORP	11,647	237.71	2,768,608.37
DOLLAR TREE INC	10,956	159.85	1,751,316.60
DOORDASH INC - A	10,462	68.65	718,216.30
EBAY	29,667	46.69	1,385,152.23
ETSY INC	5,869	83.07	487,537.83
GENUINE PARTS CO	6,685	139.59	933,159.15
HOME DEPOT	52,079	299.86	15,616,408.94
LKQ CORP	13,325	51.29	683,439.25
LOWES COMPANIES	32,939	194.28	6,399,388.92
MERCADOLIBRE INC	2,180	748.40	1,631,522.90
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,383	619.13	2,094,516.79
POOL CORP	1,855	416.39	772,403.45
ROSS STORES INC	17,806	79.76	1,420,206.56
TARGET (DAYTON HUDSON)	23,475	154.55	3,628,061.25
TJX COMPANIES INC	58,528	60.65	3,549,723.20
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,411	201.65	1,091,128.15
ULTA BEAUTY INC	2,749	422.35	1,161,040.15
WAYFAIR INC- CLASS A	3,788	54.00	204,552.00
COSTCO WHOLESALE CORP	22,048	472.05	10,407,758.40
KROGER CO	33,615	50.43	1,695,204.45
SYSCO CORP	25,975	82.49	2,142,677.75
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	36,389	41.72	1,518,149.08
WALMART INC	75,871	121.02	9,181,908.42
ALTRIA GROUP INC	90,586	48.66	4,407,914.76
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	28,451	85.98	2,446,216.98
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,737	68.28	1,074,522.36
BUNGE LIMITED	7,221	110.19	795,681.99
CAMPBELL SOUP CO (US)	9,742	47.00	457,874.00
COCA-COLA CO	204,683	61.80	12,649,409.40
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	9,216	53.97	497,387.52
CONAGRA BRANDS INC	22,663	32.25	730,881.75

CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,917	241.65	1,913,143.05
GENERAL MILLS INC	30,271	67.93	2,056,309.03
HERSHEY FOODS CORPORATION	7,340	209.45	1,537,363.00
HORMEL FOODS CORP	13,714	45.30	621,244.20
JM SMUCKER CO	5,275	127.25	671,243.75
KELLOGG CO	11,938	68.66	819,663.08
KEURIG DR PEPPER INC	39,374	35.71	1,406,045.54
KRAFT HEINZ CO/THE	37,077	37.27	1,381,859.79
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	12,652	87.36	1,105,278.72
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	8,727	52.41	457,382.07
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	69,256	61.23	4,240,544.88
MONSTER BEVERAGE CORP	19,643	89.30	1,754,119.90
PEPSICO INC	68,768	162.78	11,194,055.04
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	77,103	101.69	7,840,604.07
TYSON FOODS INC	14,778	85.31	1,260,711.18
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,548	85.98	992,897.04
CLOROX COMPANY	5,866	132.09	774,839.94
COLGATE-PALMOLIVE CO	39,331	76.85	3,022,587.35
ESTEE LAUDER CO-CL A	11,283	258.79	2,919,927.57
KIMBERLY-CLARK CORP	16,900	127.46	2,154,074.00
PROCTER & GAMBLE CO	119,071	142.49	16,966,426.79
ABBOTT LABORATORIES	87,688	112.71	9,883,314.48
ABIOMED INC	2,088	257.11	536,845.68
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,719	262.55	976,423.45
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,784	143.96	1,120,584.64
ANTHEM INC	11,878	486.20	5,775,083.60
BAXTER INTERNATIONAL	25,237	72.03	1,817,821.11
BECTON DICKINSON & CO	14,222	248.37	3,532,318.14
BOSTON SCIENTIFIC CORP	70,019	37.97	2,658,621.43
CARDINAL HEALTH	13,608	52.35	712,378.80
CENTENE CORP	29,043	80.02	2,324,020.86
CIGNA CORP	16,011	257.58	4,124,113.38
CVS HEALTH CORP	65,355	92.74	6,061,022.70
DAVITA INC	3,582	93.61	335,311.02
DENTSPLY SIRONA INC	10,094	39.10	394,675.40
DEXCOM INC	4,780	296.45	1,417,031.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	30,691	93.64	2,873,905.24
HCA HEALTHCARE INC	12,224	201.26	2,460,202.24
HENRY SCHEIN INC	6,547	82.24	538,425.28
HOLOGIC INC	11,926	73.68	878,707.68
HUMANA INC	6,360	449.62	2,859,583.20
IDEXX LABORATORIES INC	4,215	359.70	1,516,135.50

INSULET CORP	3,546	219.31	777,673.26
INTUITIVE SURGICAL INC	17,481	209.95	3,670,135.95
LABORATORY CRP OF AMER	4,533	229.79	1,041,638.07
MASIMO CORP	2,735	139.42	381,313.70
MCKESSON CORP	7,488	312.03	2,336,480.64
MEDTRONIC PLC	66,841	93.20	6,229,581.20
MOLINA HEALTHCARE INC	2,739	276.99	758,675.61
NOVOCURE LTD	4,504	71.50	322,036.00
QUEST DIAGNOSTICS	6,246	134.89	842,522.94
RESMED INC	7,208	208.61	1,503,660.88
STERIS PLC	5,122	221.59	1,134,983.98
STRYKER CORP	16,646	218.97	3,644,974.62
TELADOC HEALTH INC	6,270	33.28	208,665.60
TELEFLEX INC	2,162	271.88	587,804.56
THE COOPER COS INC	2,279	337.07	768,182.53
UNITEDHEALTH GROUP INC	46,721	489.43	22,866,659.03
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	117.99	459,925.02
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,903	187.73	1,295,900.19
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,564	115.03	1,215,176.92
ABBVIE INC	87,899	145.43	12,783,151.57
AGILENT TECHNOLOGIES	15,096	124.14	1,874,017.44
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,156	135.00	831,060.00
AMGEN	27,728	241.75	6,703,244.00
AVANTOR INC	31,022	31.93	990,532.46
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,027	520.81	534,871.87
BIO-TECHNE CORP	1,796	355.44	638,370.24
BIOGEN INC	7,191	202.22	1,454,164.02
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,381	76.66	642,487.46
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	107,603	75.98	8,175,675.94
CATALENT INC	8,308	109.84	912,550.72
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,324	225.71	524,550.04
DANAHER CORP	33,807	258.76	8,747,899.32
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,778	23.52	488,698.56
EXACT SCIENCES CORP	9,063	44.59	404,119.17
GILEAD SCIENCES INC	61,511	61.18	3,763,242.98
HORIZON THERAPEUTICS PLC	10,243	87.05	891,653.15
ILLUMINA INC	7,888	224.47	1,770,619.36
INCYTE CORP	8,608	72.78	626,490.24
IQVIA HOLDINGS INC	9,501	216.65	2,058,391.65
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,663	148.06	394,283.78
JOHNSON & JOHNSON	130,558	173.71	22,679,230.18
LILLY (ELI) & CO	40,232	303.25	12,200,354.00



MERCK & CO	125,650	88.00	11,057,200.00
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,109	1,254.54	1,391,284.86
MODERNA INC	17,165	134.04	2,300,796.60
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,708	97.30	458,088.40
PERKINELMER INC	6,426	146.45	941,087.70
PFIZER	279,392	51.78	14,466,917.76
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,329	575.48	3,066,732.92
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,093	41.08	743,260.44
SEAGEN INC	7,007	141.75	993,242.25
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56,857	8.45	480,441.65
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	19,450	539.82	10,499,499.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,718	259.70	3,302,864.60
VIATRIS INC	57,073	11.62	663,188.26
WATERS CORP	2,876	336.98	969,154.48
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,764	304.54	1,146,288.56
ZOETIS INC	23,191	166.49	3,861,069.59
BANK OF AMERICA CORP	360,929	34.51	12,455,659.79
CITIGROUP	97,674	49.97	4,880,769.78
CITIZENS FINANCIAL GROUP	25,193	38.87	979,251.91
FIFTH THIRD BANCORP	33,182	37.56	1,246,315.92
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	578	665.65	384,745.70
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,838	147.65	1,304,930.70
HUNTINGTON BANCSHARES INC	69,030	13.08	902,912.40
JPMORGAN CHASE & CO	146,660	125.31	18,377,964.60
KEY CORP	44,974	18.65	838,765.10
M & T BANK CORP	8,756	171.36	1,500,428.16
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	20,656	163.00	3,366,928.00
REGIONS FINL CORP	46,064	21.09	971,489.76
SIGNATURE BANK	3,120	214.92	670,550.40
SVB FINANCIAL GROUP	2,803	470.67	1,319,288.01
TRUIST FINANCIAL CORP	65,536	47.71	3,126,722.56
US BANCORP	69,143	50.33	3,479,967.19
WEBSTER FINANCIAL CORP	8,680	48.21	418,462.80
WELLS FARGO & CO	189,752	42.67	8,096,717.84
ALLY FINANCIAL INC	18,129	40.46	733,499.34
AMERICAN EXPRESS	32,007	160.98	5,152,486.86
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,496	265.70	1,460,287.20
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	20,242	56.66	1,146,911.72
BANK NEW YORK CO	38,892	44.04	1,712,803.68
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	64,127	300.80	19,289,401.60
BLACKROCK INC	7,579	659.85	5,001,003.15
BLACKSTONE INC	34,948	113.85	3,978,829.80

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,406	119.34	2,435,252.04
CARLYLE GROUP INC/THE	10,351	37.77	390,957.27
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,962	113.62	563,782.44
CME GROUP INC	17,634	197.93	3,490,297.62
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	6,291	63.76	401,114.16
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,285	106.13	1,516,067.05
EQUITABLE HOLDINGS INC	18,461	28.70	529,830.70
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,750	369.60	646,800.00
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	25.65	378,286.20
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,286	45.15	103,212.90
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,837	304.22	5,122,152.14
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	27,704	99.50	2,756,548.00
INVESCO LTD	19,405	18.06	350,454.30
KKR & CO INC	28,014	53.17	1,489,504.38
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,096	195.13	799,252.48
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,762	274.01	482,805.62
MOODY'S CORP	8,230	279.44	2,299,791.20
MORGAN STANLEY	65,965	81.16	5,353,719.40
MSCI INC	4,065	427.08	1,736,080.20
NASDAQ INC	5,320	152.75	812,630.00
NORTHERN TRUST CORP	10,018	106.35	1,065,414.30
PRICE T ROWE GROUP INC	11,505	121.21	1,394,521.05
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,521	93.59	891,070.39
S&P GLOBAL INC	17,638	336.43	5,933,952.34
SCHWAB (CHARLES) CORP	72,232	64.25	4,640,906.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	56.50	355,328.50
STATE STREET CORP	18,501	68.14	1,260,658.14
SYNCHRONY FINANCIAL	27,139	33.85	918,655.15
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,522	68.06	307,767.32
UPSTART HOLDINGS INC	2,178	39.67	86,401.26
AFLAC	31,141	57.43	1,788,427.63
ALLEGHANY CORP	647	834.61	539,992.67
ALLSTATE CORP	14,193	127.86	1,814,716.98
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,803	138.72	527,552.16
AMERICAN INT'L GROUP	40,246	55.88	2,248,946.48
AON PLC	10,695	259.11	2,771,181.45
ARCH CAPITAL GROUP LTD	18,793	45.81	860,907.33
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,383	156.96	1,629,715.68
ASSURANT INC	2,684	178.76	479,791.84
BROWN & BROWN INC	11,065	56.84	628,934.60
CHUBB LTD	21,140	206.25	4,360,125.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,751	123.42	956,628.42

ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,444	177.43	256,208.92
EVEREST RE GROUP LTD	1,834	277.93	509,723.62
FNF GROUP	12,836	40.81	523,837.16
GLOBE LIFE INC	4,559	95.43	435,065.37
HARTFORD FINANCIAL SVCS	16,673	69.78	1,163,441.94
LINCOLN NATIONAL CORP	8,416	54.39	457,746.24
LOEWS CORP	10,482	61.57	645,376.74
MARKEL CORP	639	1,346.63	860,496.57
MARSH & MCLENNAN COS	24,739	153.00	3,785,067.00
METLIFE INC	35,762	66.01	2,360,649.62
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,725	70.29	894,440.25
PROGRESSIVE CORP	28,960	115.54	3,346,038.40
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,486	102.57	1,896,109.02
TRAVELERS COS INC/THE	11,830	171.53	2,029,199.90
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,009	202.18	1,214,899.62
WR BERKLEY CORP	9,829	69.65	684,589.85
CBRE GROUP INC-A	16,391	75.16	1,231,947.56
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	64,300	5.01	322,143.00
WEYERHAEUSER CO	36,674	37.84	1,387,744.16
ZILLOW GROUP INC-C	7,537	37.15	279,999.55
ACCENTURE PLC-CL A	31,433	295.43	9,286,251.19
ADOBE INC	23,458	426.42	10,002,960.36
AFFIRM HOLDINGS INC	8,787	21.18	186,108.66
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	7,539	99.82	752,542.98
ANSYS INC	4,382	250.81	1,099,049.42
APPLOVIN CORP-CLASS A	6,563	40.30	264,488.90
AUTODESK INC	10,882	195.06	2,122,642.92
AUTOMATIC DATA PROCESS	20,657	215.70	4,455,714.90
AVALARA INC	4,011	85.46	342,780.06
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,879	34.22	269,619.38
BILL.COM HOLDINGS INC	4,833	128.04	618,817.32
BLACK KNIGHT INC	8,009	67.25	538,605.25
BLOCK INC	24,992	76.58	1,913,887.36
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	5,961	142.49	849,382.89
CADENCE DESIGN SYSTEMS	13,920	155.81	2,168,875.20
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,963	55.11	383,730.93
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,676	125.55	712,621.80
CITRIX SYSTEMS INC	6,470	99.05	640,853.50
CLOUDFLARE INC - CLASS A	12,921	51.60	666,723.60
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	26,353	70.77	1,865,001.81
COUPA SOFTWARE INC	3,189	65.40	208,560.60
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,967	173.55	1,729,772.85

CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,100	139.11	292,131.00
DATADOG INC - CLASS A	10,804	103.64	1,119,726.56
DOCUSIGN INC	9,538	87.36	833,239.68
DROPBOX INC-CLASS A	16,505	22.71	374,828.55
DYNATRACE INC	8,780	42.39	372,184.20
EPAM SYSTEMS INC	2,842	316.60	899,777.20
FAIR ISAAC CORP	1,345	404.83	544,496.35
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	30,439	99.74	3,035,985.86
FISERV INC	30,979	95.82	2,968,407.78
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,879	241.43	936,506.97
FORTINET INC	6,902	303.50	2,094,757.00
GARTNER INC	4,134	256.18	1,059,048.12
GLOBAL PAYMENTS INC	14,011	122.09	1,710,602.99
GODADDY INC - CLASS A	8,747	72.57	634,769.79
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3,640	77.19	280,971.60
HUBSPOT INC	2,233	353.31	788,941.23
INTL BUSINESS MACHINES CORP	44,787	137.96	6,178,814.52
INTUIT INC	13,404	400.55	5,368,972.20
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,514	182.52	641,375.28
MASTERCARD INC-CLASS A	43,362	349.00	15,133,338.00
MICROSOFT CORP	353,374	264.79	93,569,901.46
MONGODB INC	3,415	290.38	991,647.70
NORTONLIFELOCK INC	29,838	24.27	724,168.26
OKTA INC	7,338	94.92	696,522.96
ORACLE CORP	78,820	69.22	5,455,920.40
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	74,206	8.68	644,108.08
PALO ALTO NETWORKS INC	4,839	516.15	2,497,649.85
PAYCHEX INC	16,029	122.60	1,965,155.40
PAYCOM SOFTWARE INC	2,625	302.40	793,800.00
PAYPAL HOLDINGS INC	54,270	84.11	4,564,649.70
PTC INC	5,381	113.03	608,214.43
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,503	58.03	203,279.09
SALESFORCE INC	49,010	187.11	9,170,261.10
SERVICENOW INC	9,974	492.22	4,909,402.28
SNOWFLAKE INC-CLASS A	10,361	133.23	1,380,396.03
SPLUNK INC	7,452	102.70	765,320.40
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,662	62.27	663,922.74
SYNOPSYS INC	7,555	317.08	2,395,539.40
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	21,590	52.51	1,133,690.90
TWILIO INC - A	7,960	98.49	783,980.40
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,028	351.61	713,065.08
UNITY SOFTWARE INC	10,116	41.30	417,790.80

VERISIGN INC	4,769	173.61	827,946.09
VISA INC-CLASS A SHARES	82,381	206.11	16,979,547.91
VMWARE INC-CLASS A	10,056	127.06	1,277,715.36
WESTERN UNION CO	20,387	17.47	356,160.89
WIX.COM LTD	2,353	60.40	142,121.20
WORKDAY INC-CLASS A	9,867	153.83	1,517,840.61
ZENDESK INC	5,395	69.04	372,470.80
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	10,363	110.40	1,144,075.20
ZSCALER INC	4,184	160.42	671,197.28
AMPHENOL CORPORATION	29,472	69.14	2,037,694.08
APPLE INC	809,683	142.64	115,493,183.12
ARISTA NETWORKS INC	12,447	98.41	1,224,909.27
ARROW ELECTRONICS INC	3,851	121.81	469,090.31
CDW CORP/DE	6,651	173.59	1,154,547.09
CISCO SYSTEMS	205,941	44.26	9,114,948.66
COGNEX CORP	8,069	45.71	368,833.99
CORNING	40,515	34.26	1,388,043.90
DELL TECHNOLOGIES -C	14,009	50.35	705,353.15
F5 INC	2,841	161.99	460,213.59
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	66,144	14.68	970,993.92
HP INC	52,913	36.67	1,940,319.71
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	29.58	482,390.64
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,238	143.86	1,328,978.68
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,455	214.25	1,811,483.75
NETAPP INC	10,843	67.77	734,830.11
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,880	82.85	818,558.00
TE CONNECTIVITY LTD	16,345	127.79	2,088,727.55
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,404	393.73	946,526.92
TRIMBLE IMS HOLDINGS	11,609	65.04	755,049.36
WESTERN DIGITAL CORP	15,203	56.58	860,185.74
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,482	315.66	783,468.12
AT&T INC	355,457	20.88	7,421,942.16
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,831	23.05	180,504.55
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,877	24.13	455,502.01
LUMEN TECHNOLOGIES INC	42,975	11.45	492,063.75
T-MOBILE US INC	31,168	133.02	4,145,967.36
VERIZON COMMUNICATIONS	208,706	50.94	10,631,483.64
AES CORP	30,838	21.55	664,558.90
ALLIANT ENERGY CORPORATION	12,663	59.63	755,094.69
AMEREN CORPORATION	13,199	89.94	1,187,118.06
AMERICAN ELECTRIC POWER	24,953	98.26	2,451,881.78
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,178	150.56	1,381,839.68

ATMOS ENERGY CORP	6,926	112.95	782,291.70
CENTERPOINT ENERGY INC	31,584	30.61	966,786.24
CMS ENERGY CORP	14,716	67.87	998,774.92
CONSOLIDATED EDISON INC	17,915	94.51	1,693,146.65
CONSTELLATION ENERGY	16,151	61.21	988,602.71
DOMINION ENERGY INC	39,780	79.34	3,156,145.20
DTE ENERGY COMPANY	9,793	128.44	1,257,812.92
DUKE ENERGY CORP	38,378	107.73	4,134,461.94
EDISON INTL	19,236	66.74	1,283,810.64
ENERGY CORP	10,274	116.19	1,193,736.06
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,385	45.75	520,863.75
EVERGY INC	11,724	67.37	789,845.88
EVERSOURCE ENERGY	17,349	87.82	1,523,589.18
EXELON CORP	48,454	46.66	2,260,863.64
FIRSTENERGY CORP	27,438	40.78	1,118,921.64
NEXTERA ENERGY INC	97,684	77.34	7,554,880.56
NISOURCE INC	20,005	30.23	604,751.15
NRG ENERGY INC	12,298	45.52	559,804.96
PG&E CORP	68,966	11.63	802,074.58
PPL CORPORATION	35,742	29.14	1,041,521.88
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	25,028	65.16	1,630,824.48
SEMPRA ENERGY	15,948	155.16	2,474,491.68
SOUTHERN CO	52,914	72.89	3,856,901.46
UGI CORP	9,579	43.21	413,908.59
VISTRA CORP	23,603	26.20	618,398.60
WEC ENERGY GROUP INC	15,877	99.52	1,580,079.04
XCEL ENERGY INC	26,807	71.28	1,910,802.96
ADVANCED MICRO DEVICES	81,339	98.80	8,036,293.20
ANALOG DEVICES	26,323	161.61	4,254,060.03
APPLIED MATERIALS	44,314	107.24	4,752,233.36
BROADCOM INC	20,363	556.22	11,326,307.86
ENPHASE ENERGY INC	6,604	200.51	1,324,168.04
ENTEGRIS INC	6,990	107.86	753,941.40
INTEL CORP	202,547	40.01	8,103,905.47
KLA CORP	7,545	349.58	2,637,581.10
LAM RESEARCH CORP	6,968	493.45	3,438,359.60
MARVELL TECHNOLOGY INC	42,282	56.48	2,388,087.36
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	27,084	66.63	1,804,606.92
MICRON TECHNOLOGY	54,679	66.02	3,609,907.58
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,249	444.08	998,735.92
NVIDIA CORP	124,147	180.48	22,406,050.56
NXP SEMICONDUCTORS NV	13,089	184.22	2,411,255.58

	ON SEMICONDUCTOR CORP	21,863	62.66	1,369,935.58
	QORVO INC	5,297	105.13	556,873.61
	QUALCOMM	56,084	136.71	7,667,243.64
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,742	103.47	801,064.74
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2,629	291.67	766,800.43
	TERADYNE INC	7,707	101.19	779,871.33
	TEXAS INSTRUMENTS	45,951	161.58	7,424,762.58
	アメリカドル 小計	16,304,256		1,733,909,487.62 (232,725,331,428)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	36,244	21.47	778,158.68
	CAMECO CORP	19,186	33.20	636,975.20
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	58,757	84.67	4,974,955.19
	CENOVUS ENERGY INC	70,732	30.70	2,171,472.40
	ENBRIDGE	101,209	58.65	5,935,907.85
	IMPERIAL OIL	11,645	71.36	830,987.20
	KEYERA CORP	10,963	34.62	379,539.06
	PARKLAND CORP	8,544	39.00	333,216.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	28,103	52.41	1,472,878.23
	SUNCOR ENERGY	70,924	53.05	3,762,518.20
	TC ENERGY CORP	48,340	72.71	3,514,801.40
	TOURMALINE OIL CORP	14,710	77.33	1,137,524.30
	AGNICO EAGLE MINES	22,981	65.19	1,498,131.39
	BARRICK GOLD CORP	88,471	25.53	2,258,664.63
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	61.06	445,860.12
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	30,312	34.53	1,046,673.36
	FRANCO-NEVADA CORP	9,313	179.60	1,672,614.80
	IVANHOE MINES LTD-CL A	26,291	10.14	266,590.74
	KINROSS GOLD CORP	56,706	5.49	311,315.94
	LUNDIN MINING CORP	30,173	10.94	330,092.62
	NUTRIEN LTD	27,681	113.31	3,136,534.11
	PAN AMERICAN SILVER CORP	9,343	28.06	262,164.58
	TECK RESOURCES LTD-CL B	24,191	55.60	1,345,019.60
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,500	112.48	506,160.00
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	23,120	51.46	1,189,755.20
	CAE INC	16,864	32.67	550,946.88
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,269	107.51	458,960.19
	WSP GLOBAL INC	5,400	146.37	790,398.00
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	10,920	37.56	410,155.20
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,665	76.93	435,808.45
	THOMSON REUTERS CORP	7,995	126.15	1,008,569.25
	AIR CANADA	6,737	20.78	139,994.86
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	29,791	143.16	4,264,879.56

CP RAILWAY LIMITED	46,278	92.77	4,293,210.06
TFI INTERNATIONAL INC	4,630	100.56	465,592.80
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,682	81.97	1,203,483.54
BRP INC/CA- SUB VOTING	2,814	85.50	240,597.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	38.99	389,900.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,221	65.31	994,083.51
QUEBECOR INC -CL B	5,999	27.34	164,012.66
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	24,782	35.26	873,813.32
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,586	170.68	441,378.48
DOLLARAMA INC	13,514	72.77	983,413.78
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	42,716	56.65	2,419,861.40
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	40.42	296,278.60
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	114.34	1,036,835.12
METRO INC	11,419	69.27	790,994.13
WESTON (GEORGE) LTD	3,705	149.75	554,823.75
SAPUTO INC	11,041	26.26	289,936.66
BAUSCH HEALTH COS INC	14,544	10.64	154,748.16
BANK MONTREAL	31,608	134.63	4,255,385.04
BANK NOVA SCOTIA	60,770	83.32	5,063,356.40
CANADIAN IMPERIAL BANK	44,598	68.53	3,056,300.94
NATIONAL BANK OF CANADA	16,160	94.79	1,531,806.40
ROYAL BANK OF CANADA	69,804	130.93	9,139,437.72
TORONTO-DOMINION BANK	90,808	93.27	8,469,662.16
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	69,288	62.00	4,295,856.00
IGM FINANCIAL INC	3,890	37.48	145,797.20
ONEX CORP	3,361	74.20	249,386.20
TMX GROUP LTD	2,508	136.03	341,163.24
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,198	684.93	820,546.14
GREAT-WEST LIFECO INC	12,491	33.26	415,450.66
IA FINANCIAL CORP INC	5,415	65.49	354,628.35
INTACT FINANCIAL CORP	8,967	184.80	1,657,101.60
MANULIFE FINANCIAL CORP	96,584	23.31	2,251,373.04
POWER CORP OF CANADA	25,684	36.31	932,586.04
SUN LIFE FINANCIAL INC	29,314	62.75	1,839,453.50
FIRSTSERVICE CORP	2,028	160.15	324,784.20
BLACKBERRY LIMITED	25,075	7.35	184,301.25
CGI INC - CL A	11,043	103.88	1,147,146.84
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,007	1,929.53	1,943,036.71
LIGHTSPEED COMMERCE INC	5,859	32.01	187,546.59
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,153	60.86	131,031.58
OPEN TEXT CORP	12,469	50.33	627,564.77
SHOPIFY INC - CLASS A	5,599	471.52	2,640,040.48



	BCE INC	3,102	67.66	209,881.32
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	18,199	61.79	1,124,516.21
	TELUS CORP	23,120	30.70	709,784.00
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	37,267	18.17	677,141.39
	ALTAGAS INCOME LTD	14,516	29.99	435,334.84
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,264	47.49	297,477.36
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	39.63	236,908.14
	EMERA INC	13,595	61.95	842,210.25
	FORTIS INC	22,342	61.64	1,377,160.88
	HYDRO ONE LTD	14,776	34.32	507,112.32
	NORTHLAND POWER INC	9,907	39.99	396,180.93
	カナダドル 小計	1,974,458		122,669,636.85 (12,958,820,436)
ユーロ	ENI	126,764	14.02	1,777,991.86
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	23,722	12.83	304,353.26
	NESTE OIL OYJ	21,882	45.11	987,097.02
	OMV AG	7,462	54.74	408,469.88
	REPSOL SA	68,089	15.71	1,070,018.63
	TENARIS SA	27,420	15.26	418,429.20
	TOTALENERGIES SE	122,539	55.71	6,826,647.69
	AIR LIQUIDE	26,132	141.88	3,707,608.16
	AKZO NOBEL	9,224	77.98	719,287.52
	ARCELORMITTAL	32,320	28.50	921,120.00
	ARKEMA	2,799	112.55	315,027.45
	BASF SE	44,781	51.87	2,322,790.47
	COVESTRO AG	10,438	43.36	452,591.68
	CRH PLC	39,369	37.58	1,479,683.86
	EVONIK INDUSTRIES AG	9,603	25.62	246,028.86
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,738	53.90	363,178.20
	KONINKLIJKE DSM NV	8,702	156.30	1,360,122.60
	OCI NV	5,799	31.96	185,336.04
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,335	36.08	408,966.80
	SOLVAY SA	3,676	92.56	340,250.56
	STORA ENSO OYJ R	26,361	16.83	443,787.43
	SYMRISE AG	7,051	101.50	715,676.50
	UMICORE	9,946	40.38	401,619.48
	UPM KYMMENE OYJ	27,619	32.85	907,284.15
	VOESTALPINE AG	5,948	27.92	166,068.16
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	10,930	25.64	280,245.20
	AIRBUS SE	29,872	105.40	3,148,508.80
	ALSTOM	16,908	26.45	447,216.60
	BOUYGUES ORD	11,344	31.58	358,243.52

BRENTAG SE	6,989	70.68	493,982.52
CNH INDUSTRIAL NV	46,753	13.63	637,243.39
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	20,876	29.37	613,232.50
DASSAULT AVIATION SA	1,210	160.00	193,600.00
EIFFAGE	3,659	94.00	343,946.00
FERROVIAL SA	22,380	25.00	559,500.00
GEA GROUP AG	7,649	37.41	286,149.09
IMCD NV	3,050	143.25	436,912.50
KINGSPAN GROUP PLC	7,694	75.90	583,974.60
KION GROUP AG	3,430	44.67	153,218.10
KNORR-BREMSE AG	3,221	64.24	206,917.04
KONE OYJ-B	15,737	48.11	757,107.07
LEGRAND SA	13,075	77.78	1,016,973.50
MTU AERO ENGINES AG	2,396	180.70	432,957.20
PRYSMIAN SPA	11,275	29.84	336,446.00
RATIONAL AG	268	614.50	164,686.00
RHEINMETALL AG	2,442	207.90	507,691.80
SAFRAN SA	17,120	95.07	1,627,598.40
SAINT-GOBAIN	25,279	55.36	1,399,445.44
SCHNEIDER ELECTRIC SE	27,347	127.00	3,473,069.00
SIEMENS	38,409	121.68	4,673,607.12
SIEMENS ENERGY AG	24,753	17.22	426,246.66
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	12,322	18.02	222,042.44
THALES SA	5,540	113.15	626,851.00
VINCI S.A.	26,015	90.80	2,362,162.00
WARTSILA OYJ	18,738	7.82	146,643.58
BUREAU VERITAS SA	12,892	26.28	338,801.76
RANDSTAD NV	5,866	52.28	306,674.48
TELEPERFORMANCE	3,110	299.60	931,756.00
WOLTERS KLUWER	13,534	86.78	1,174,480.52
ADP	1,532	129.15	197,857.80
AENA SME SA	3,518	138.35	486,715.30
ATLANTIA SPA	26,089	22.57	588,828.73
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	38,499	6.32	243,506.17
DEUTSCHE POST AG-REG	48,367	35.78	1,730,813.09
GETLINK	18,993	17.37	329,908.41
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	16,643	82.66	1,375,710.38
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,582	75.95	196,102.90
CONTINENTAL AG	4,993	75.36	376,272.48
FERRARI NV	6,331	176.50	1,117,421.50
MERCEDES-BENZ GROUP AG	40,641	66.95	2,720,914.95
MICHELIN	8,304	121.10	1,005,614.40

PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	6,979	74.96	523,145.84
RENAULT SA	8,441	27.25	230,017.25
STELLANTIS NV	113,390	13.71	1,554,803.68
VALEO SA	10,032	21.39	214,584.48
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,112	157.20	1,432,406.40
VOLKSWAGEN STAMM	1,657	209.90	347,804.30
ADIDAS AG	8,492	181.40	1,540,448.80
ESSILORLUXOTTICA	14,035	145.75	2,045,601.25
HERMES INTERNATIONAL	1,565	1,074.00	1,680,810.00
KERING	3,703	515.00	1,907,045.00
LVMH	13,872	587.60	8,151,187.20
MONCLER SPA	9,963	43.68	435,183.84
PUMA SE	4,644	70.48	327,309.12
SEB SA	1,310	94.45	123,729.50
ACCOR	7,911	30.01	237,409.11
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8,339	105.90	883,100.10
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,332	33.90	180,754.80
SODEXO	3,888	69.66	270,838.08
BOLLORE SE	37,200	4.75	176,700.00
PUBLICIS GROUPE	11,624	49.21	572,017.04
SCOUT24 SE	4,128	57.60	237,772.80
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,969	46.63	231,704.47
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	36,953	21.06	778,414.94
VIVENDI SE	33,016	11.04	364,496.64
D' IETEREN GROUP	1,703	155.10	264,135.30
DELIVERY HERO SE	7,305	38.79	283,360.95
INDITEX	54,582	23.75	1,296,322.50
JUST EAT TAKEAWAY	8,459	20.41	172,690.48
PROSUS	41,585	50.97	2,119,587.45
ZALANDO SE	11,285	31.59	356,493.15
CARREFOUR	30,831	18.64	574,843.99
HELLOFRESH SE	7,756	33.68	261,222.08
JERONIMO MARTINS	13,062	18.54	242,169.48
KESKO OYJ-B SHS	14,326	22.85	327,349.10
KONINKLIJKE AHOLD NV	50,995	25.35	1,292,978.22
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	42,993	50.81	2,184,474.33
DANONE (GROUPE)	32,878	53.34	1,753,712.52
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	26,648	9.77	260,510.84
HEINEKEN HOLDING NV	5,127	72.20	370,169.40
HEINEKEN NV	12,980	91.54	1,188,189.20
JDE PEET'S BV	4,123	26.88	110,826.24
KERRY GROUP PLC-A	7,323	92.60	678,109.80

PERNOD-RICARD	10,396	176.85	1,838,532.60
REMY COINTREAU	1,020	169.30	172,686.00
BEIERSDORF AG	4,515	98.72	445,720.80
HENKEL AG & CO KGAA	4,647	61.05	283,699.35
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	8,553	61.36	524,812.08
LOREAL	12,190	322.35	3,929,446.50
AMPLIFON SPA	6,606	30.75	203,134.50
BIOMERIEUX	2,374	91.52	217,268.48
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,091	123.40	258,029.40
DIASORIN SPA	1,418	119.15	168,954.70
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	9,705	51.28	497,672.40
FRESENIUS SE&CO KGAA	20,026	30.41	608,990.66
KONINKLIJKE PHILIPS	45,856	22.96	1,052,853.76
SARTORIUS AG-VORZUG	1,216	368.20	447,731.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,577	54.78	798,528.06
ARGENX SE	2,207	309.70	683,507.90
BAYER	48,711	65.39	3,185,212.29
EUROFINS SCIENTIFIC	6,490	84.44	548,015.60
GRIFOLS SA	14,240	18.63	265,291.20
IPSEN	1,866	90.65	169,152.90
MERCK KGAA	6,723	173.05	1,163,415.15
ORION OYJ-CLASS B	5,393	36.65	197,653.45
QIAGEN N.V.	11,006	43.46	478,320.76
RECORDATI SPA	5,195	38.74	201,254.30
SANOFI	56,690	98.26	5,570,359.40
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,235	320.20	395,447.00
UCB (GROUPE)	6,718	83.10	558,265.80
ABN AMRO BANK NV-CVA	19,718	10.77	212,461.45
BANCO BILBAO VIZCAYA	328,517	4.74	1,558,320.38
BANCO SANTANDER SA	847,548	2.90	2,462,974.48
BNP PARIBAS	54,846	51.19	2,807,566.74
CAIXABANK	219,234	3.46	760,084.27
COMMERZBANK AG	46,222	8.19	378,558.18
CREDIT AGRICOLE SA	64,475	9.80	632,435.27
ERSTE GROUP BANK AG	18,119	29.15	528,168.85
FINECOBANK SPA	27,362	12.04	329,438.48
ING GROEP NV-CVA	193,144	10.21	1,972,000.24
INTESA SANPAOLO	823,869	1.96	1,620,385.54
KBC GROEP NV	12,855	57.54	739,676.70
MEDIOBANCA	29,447	9.65	284,222.44
SOCIETE GENERALE	38,744	24.88	963,950.72
UNICREDIT SPA	103,949	10.56	1,098,533.03

AMUNDI SA	2,812	51.95	146,083.40
DEUTSCHE BANK NAMEN	101,640	10.01	1,017,822.96
DEUTSCHE BOERSE	9,759	150.55	1,469,217.45
EURAZEO SA	2,340	70.55	165,087.00
EURONEXT NV	4,500	75.44	339,480.00
EXOR NV	4,845	66.14	320,448.30
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,582	84.94	474,135.08
SOFINA	752	210.60	158,371.20
WENDEL	1,047	93.45	97,842.15
AEGON	79,881	4.87	389,339.99
AGEAS	8,621	43.21	372,513.41
ALLIANZ SE-REG	19,980	189.38	3,783,812.40
ASSICURAZIONI GENERALI	58,531	16.48	964,883.53
AXA SA	95,834	23.41	2,243,473.94
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,976	142.55	424,228.80
MUENCHENER RUECKVERSICH.	6,875	225.20	1,548,250.00
NN GROUP NV	13,557	46.32	627,960.24
POSTE ITALIANE SPA	25,777	9.73	250,913.31
SAMPO OYJ-A SHS	25,899	42.09	1,090,088.91
AROUNDTOWN SA	52,418	4.05	212,554.99
LEG IMMOBILIEN SE	3,774	88.04	332,262.96
VONOVIA SE	36,313	33.88	1,230,284.44
ADYEN NV	1,088	1,417.60	1,542,348.80
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	22,519	55.76	1,255,659.44
BECHTLE AG	4,296	41.21	177,038.16
CAPGEMINI SA	7,986	176.45	1,409,129.70
DASSAULT SYSTEMES SA	33,230	37.73	1,253,934.05
EDENRED	12,673	44.23	560,526.79
NEMETSCHKE SE	3,320	65.12	216,198.40
NEXI SPA	26,598	8.76	233,211.26
SAP SE	52,396	92.35	4,838,770.60
WORLDLINE SA	10,832	38.95	421,906.40
NOKIA OYJ	272,288	4.63	1,262,463.31
CELLNEX TELECOM SA	27,196	41.18	1,119,931.28
DEUTSCHE TELEKOM	158,666	18.56	2,944,840.96
ELISA A	6,367	53.06	337,833.02
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,877	10.19	151,596.63
KPN (KON.)	173,861	3.31	575,827.63
ORANGE	97,536	10.85	1,058,460.67
PROXIMUS	7,531	15.32	115,374.92
TELECOM ITALIA ORD	489,749	0.27	133,309.67
TELEFONICA	251,947	4.55	1,148,374.42

	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	2.72	111,354.39
	TELEFONICA SA-RTS	251,947	0.14	36,910.23
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,889	28.86	169,956.54
	ACCIONA SA	1,278	188.00	240,264.00
	E.ON SE	109,829	9.57	1,051,502.84
	EDP RENOVAVEIS SA	15,418	23.19	357,543.42
	ELECTRICITE DE FRANCE	21,082	8.61	181,684.67
	ELIA GROUP SA/NV	1,502	147.90	222,145.80
	ENAGAS	11,944	22.00	262,768.00
	ENDESA	17,138	20.76	355,784.88
	ENEL	398,046	5.72	2,280,405.53
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	139,324	4.71	656,494.68
	ENGIE	91,232	12.46	1,136,750.72
	FORTUM OYJ	20,155	17.04	343,541.97
	IBERDROLA SA	284,072	10.59	3,008,322.48
	NATURGY ENERGY GROUP SA	9,726	28.13	273,592.38
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,296	18.86	439,479.04
	RWE STAMM	31,648	41.05	1,299,150.40
	SNAM SPA	90,959	5.29	481,536.94
	TERNA SPA	63,339	7.66	485,430.09
	UNIPER SE	4,137	22.28	92,172.36
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	31,290	26.46	827,933.40
	VERBUND AG	3,100	95.75	296,825.00
	ASM INTERNATIONAL NV	2,248	281.90	633,711.20
	ASML HOLDING NV	20,078	520.70	10,454,614.60
	INFINEON TECHNOLOGIES	64,521	27.53	1,776,263.13
	STMICROELECTRONICS	34,099	35.98	1,226,882.02
	ユーロ 小計	9,275,368		213,803,205.36 (30,475,508,892)
イギリスポンド	BP PLC	975,033	4.48	4,371,072.93
	SHELL PLC-NEW	379,061	23.95	9,080,406.25
	ANGLO AMERICAN PLC	63,630	39.04	2,484,433.35
	ANTOFAGASTA PLC	17,358	14.84	257,592.72
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,013	64.74	454,021.62
	GLENCORE PLC	495,828	5.33	2,643,754.89
	JOHNSON MATTHEY PLC	8,824	20.45	180,450.80
	MONDI PLC	22,378	15.16	339,362.37
	RIO TINTO PLC REG	56,429	59.00	3,329,311.00
	ASHTREAD GROUP PLC	22,405	40.49	907,178.45
	BAE SYSTEMS PLC	156,168	7.77	1,214,050.03
	BUNZL PLC	15,472	26.57	411,091.04
	DCC PLC	4,499	55.68	250,504.32

FERGUSON PLC	11,566	93.10	1,076,794.60
MELROSE INDUSTRIES PLC	215,001	1.64	353,246.64
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	385,471	0.91	353,438.35
SMITHS GROUP PLC	20,046	15.43	309,309.78
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,672	102.00	374,544.00
EXPERIAN PLC	46,007	24.87	1,144,194.09
INTERTEK GROUP PLC	7,435	44.48	330,708.80
RELX PLC	95,541	21.81	2,083,749.21
RENTOKIL INITIAL PLC	85,410	4.91	419,619.33
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	5.03	256,725.20
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,048	42.06	254,378.88
BURBERRY GROUP PLC	18,587	16.84	313,098.01
PERSIMMON PLC	14,327	21.93	314,191.11
TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.28	213,952.84
COMPASS GROUP PLC	90,247	17.76	1,603,237.95
ENTAIN PLC	26,944	14.50	390,688.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	10,141	49.23	499,241.43
WHITBREAD PLC	10,170	27.46	279,268.20
AUTO TRADER GROUP PLC	43,890	5.58	245,081.76
INFORMA PLC	69,112	5.52	381,498.24
PEARSON	34,302	7.35	252,325.51
WPP PLC	56,693	8.71	494,249.57
JD SPORTS FASHION PLC	114,330	1.21	138,910.95
KINGFISHER PLC	96,593	2.46	238,294.93
NEXT PLC	6,143	63.72	391,431.96
OCADO GROUP PLC	23,500	9.15	215,119.00
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.09	171,745.69
TESCO PLC	393,967	2.52	993,584.77
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	15,871	16.52	262,188.92
BRITISH AMERICAN TOBACCO	109,104	34.96	3,814,275.84
COCA-COLA HBC AG-CDI	9,115	17.75	161,791.25
DIAGEO	115,944	35.98	4,172,244.84
IMPERIAL BRANDS PLC	45,617	17.95	818,825.15
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	35,301	60.68	2,142,064.68
UNILEVER PLC	126,231	36.38	4,592,283.78
SMITH & NEPHEW PLC	42,096	12.32	518,622.72
ASTRAZENECA	77,234	100.56	7,766,651.04
GSK PLC	254,427	17.09	4,350,192.84
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	8,586	16.11	138,320.46
BARCLAYS	811,088	1.65	1,345,757.20
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,012,138	5.11	5,180,122.28
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,573,042	0.44	1,600,365.51

	NATWEST GROUP PLC	302,525	2.28	690,664.57
	STANDARD CHARTERED PLC	124,429	5.96	742,592.27
	3I GROUP PLC	45,010	11.66	525,041.65
	ABRDN PLC	100,722	1.83	184,472.34
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,246	8.11	148,048.04
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	16,399	71.10	1,165,968.90
	M&G PLC	118,170	2.13	252,647.46
	SCHRODERS PLC	5,525	27.80	153,595.00
	ST JAMES'S PLACE PLC	26,728	11.90	318,196.84
	ADMIRAL GROUP PLC	9,872	22.00	217,184.00
	AVIVA PLC	138,721	4.22	586,512.38
	LEGAL & GENERAL GROUP	289,782	2.53	734,887.15
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	43,255	6.30	272,852.54
	PRUDENTIAL	138,731	10.30	1,429,622.95
	AVEVA GROUP PLC	4,523	23.78	107,556.94
	SAGE GROUP PLC	48,541	6.40	310,662.40
	HALMA PLC	17,484	21.62	378,004.08
	BT GROUP PLC	323,026	1.81	585,484.62
	VODAFONE GROUP PLC	1,374,547	1.26	1,731,929.22
	NATIONAL GRID PLC	179,691	10.84	1,948,748.89
	SEVERN TRENT PLC	11,927	29.02	346,121.54
	SSE PLC	50,382	17.64	888,990.39
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	10.43	362,087.88
	イギリスポンド 小計	14,067,031		90,961,437.13 (15,255,142,621)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	8,748	19.29	168,748.92
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	310	779.00	241,490.00
	GIVAUDAN-REG	454	3,400.00	1,543,600.00
	HOLCIM LTD	28,055	48.80	1,369,084.00
	SIKA AG-BR	7,320	256.00	1,873,920.00
	ABB LTD	79,686	29.63	2,361,096.18
	GEBERIT AG-REG	1,777	516.60	917,998.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	911	183.80	167,441.80
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,021	186.65	377,219.65
	VAT GROUP AG	1,440	265.60	382,464.00
	ADECCO GROUP AG-REG	6,959	36.85	256,439.15
	SGS SA	347	2,255.00	782,485.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,730	227.00	619,710.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	25,653	107.85	2,766,676.05
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,285	244.80	314,568.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	46.54	139,806.16
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	189	2,122.00	401,058.00



	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	97,600.00	488,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	55	9,520.00	523,600.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	139,868	110.54	15,461,008.72	
	ALCON INC	24,786	72.06	1,786,079.16	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,490	333.60	830,664.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,767	115.45	665,800.15	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,950	74.45	145,177.50	
	LONZA GROUP AG-REG	3,643	557.00	2,029,151.00	
	NOVARTIS	108,984	85.33	9,299,604.72	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,394	362.40	505,185.60	
	ROCHE HOLDING GENUSS	34,930	318.05	11,109,486.50	
	VIFOR PHARMA AG/NEW	2,126	170.30	362,057.80	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	129,034	6.57	848,269.51	
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,425	49.24	513,327.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,152	987.20	1,137,254.40	
	UBS GROUP AG	175,968	17.22	3,031,048.80	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	158.70	370,405.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,612	540.00	870,480.00	
	SWISS RE LTD	15,298	78.88	1,206,706.24	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,419	432.80	3,210,943.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,622	91.40	331,050.80	
	TEMENOS AG - REG	3,520	84.92	298,918.40	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,298	57.16	474,313.68	
	SWISSCOM	1,331	553.80	737,107.80	
	スイスフラン 小計	856,900		70,919,445.89 (9,715,964,086)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	9,250	482.30	4,461,275.00	
	BOLIDEN AB	13,081	403.50	5,278,183.50	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,106	473.40	2,417,180.40	
	SCA SV CELLULOSA B	26,880	170.60	4,585,728.00	
	ALFA LAVAL AB	14,260	257.50	3,671,950.00	
	ASSA ABLOY AB-B	50,678	239.70	12,147,516.60	
	ATLAS COPCO A	132,288	109.26	14,453,786.88	
	ATLAS COPCO B	71,092	95.60	6,796,395.20	
	EPIROC AB-A	29,649	189.30	5,612,555.70	
	EPIROC AB-B	17,442	164.60	2,870,953.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	85.80	1,873,957.80	
	INDUTRADE AB	14,669	224.40	3,291,723.60	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,081	228.90	1,849,740.90	
	LIFCO AB-B SHS	13,590	185.95	2,527,060.50	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	80,939	84.66	6,852,295.74	
	SANDVIK AB	56,973	201.10	11,457,270.30	

	SKANSKA B	14,869	167.45	2,489,814.05	
	SKF AB-B	18,340	173.30	3,178,322.00	
	VOLVO AB-A SHS	8,748	183.90	1,608,757.20	
	VOLVO B	71,980	175.54	12,635,369.20	
	SECURITAS B	15,577	97.86	1,524,365.22	
	VOLVO CAR AB-B	35,544	85.00	3,021,240.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	12,053	144.06	1,736,355.18	
	EVOLUTION AB	9,622	1,015.40	9,770,178.80	
	EMBRACER GROUP AB	34,541	91.80	3,170,863.80	
	HENNES & MAURITZ B	33,524	139.78	4,685,984.72	
	SWEDISH MATCH AB	74,128	101.00	7,486,928.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	31,655	255.00	8,072,025.00	
	GETINGE AB-B SHS	12,650	275.80	3,488,870.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	9,481	206.50	1,957,826.50	
	NORDEA BANK ABP	161,977	98.72	15,990,369.44	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	82,855	111.90	9,271,474.50	
	SVENSKA HANDELSBK A	70,420	97.84	6,889,892.80	
	SWEDBANK AB-A	40,897	155.55	6,361,528.35	
	EQT AB	15,478	255.70	3,957,724.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,848	253.00	1,732,544.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	249.70	2,155,160.70	
	INVESTOR AB-A SHS	23,000	199.10	4,579,300.00	
	INVESTOR AB-B SHS	90,842	179.80	16,333,391.60	
	KINNEVIK AB - B	10,757	181.65	1,954,009.05	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,093	448.90	1,837,347.70	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	32,478	61.64	2,001,943.92	
	SAGAX AB-B	9,400	241.70	2,271,980.00	
	SINCH AB	27,717	40.51	1,122,954.25	
	ERICSSON (LM) B	145,922	81.32	11,866,377.04	
	HEXAGON AB-B SHS	98,582	116.70	11,504,519.40	
	TELE2 AB-B SHS	24,520	119.95	2,941,174.00	
	TELIA CO AB	138,487	39.50	5,470,236.50	
	スウェーデンクローナ 小計	1,941,435		263,216,400.84 (3,561,317,903)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	4,410	413.20	1,822,212.00	
	EQUINOR ASA	47,036	356.25	16,756,575.00	
	NORSK HYDRO	61,358	71.58	4,392,005.64	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,719	479.60	3,702,032.40	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,500	337.80	1,520,100.00	
	ADEVINTA ASA	16,857	75.35	1,270,174.95	
	MOWI ASA	23,314	237.10	5,527,749.40	
	ORKLA	39,803	72.26	2,876,164.78	

	SALMAR ASA	2,953	681.00	2,010,993.00
	DNB BANK ASA	46,261	188.85	8,736,389.85
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	199.50	2,225,023.50
	TELENOR ASA	30,180	128.25	3,870,585.00
	ノルウェークローネ 小計	295,544		54,710,005.52 (764,845,877)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,314	496.10	2,636,275.40
	NOVOZYMES A/S	10,786	424.60	4,579,735.60
	ROCKWOOL A/S-B SHS	428	1,887.00	807,636.00
	VESTAS WIND SYSSEMS A/S	48,316	179.76	8,685,284.16
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	152	18,940.00	2,878,880.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	251	19,150.00	4,806,650.00
	DSV A/S	9,463	1,038.00	9,822,594.00
	PANDORA A/S	4,249	530.00	2,251,970.00
	CARLSBERG AS-B	4,526	864.80	3,914,084.80
	COLOPLAST-B	6,218	806.00	5,011,708.00
	DEMANT A/S	4,463	300.40	1,340,685.20
	GN STORE NORD A/S	6,740	263.50	1,775,990.00
	GENMAB A/S	3,223	2,103.00	6,777,969.00
	NOVO NORDISK A/S-B	83,884	794.00	66,603,896.00
	DANSKE BANK A/S	31,666	116.15	3,678,005.90
TRYG A/S	16,972	158.95	2,697,699.40	
ORSTED A/S	9,594	757.30	7,265,536.20	
	デンマーククローネ 小計	246,245		135,534,599.66 (2,596,842,929)
オーストラリアドル	AMPOL LTD	12,821	36.15	463,479.15
	SANTOS	153,046	8.66	1,325,378.36
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,345	25.19	260,590.55
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	92,816	35.39	3,284,758.24
	BHP GROUP LTD	251,852	46.24	11,645,636.48
	BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	18.11	390,252.39
	EVOLUTION MINING LTD	88,310	3.58	316,149.80
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	85,584	21.56	1,845,191.04
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	20,170	34.30	691,831.00
	MINERAL RESOURCES LTD	10,000	57.92	579,200.00
	NEWCREST MINING LIMITED	45,440	23.76	1,079,654.40
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	58,122	8.48	492,874.56
	ORICA LTD	19,570	16.23	317,621.10
	RIO TINTO LTD	18,796	117.47	2,207,966.12
	SOUTH32 LTD	217,613	5.01	1,090,241.13
	REECE LTD	12,870	14.08	181,209.60
BRAMBLES LTD	66,936	10.82	724,247.52	

	AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	4.18	391,264.72
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	39,948	5.21	208,129.08
	TRANSURBAN GROUP	153,930	14.20	2,185,806.00
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	31,473	34.65	1,090,539.45
	CROWN RESORTS LTD	18,801	13.00	244,413.00
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,685	63.70	171,034.50
	IDP EDUCATION LTD	12,550	23.42	293,921.00
	LOTTERY CORP LTD/THE	98,817	4.57	451,593.69
	REA GROUP LTD	3,000	105.00	315,000.00
	SEEK LTD	17,113	22.33	382,133.29
	WESFARMERS LTD	56,329	44.79	2,522,975.91
	COLES GROUP LTD	68,071	17.61	1,198,730.31
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	58,785	7.13	419,137.05
	WOOLWORTHS GROUP LTD	63,525	34.51	2,192,247.75
	TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	11.07	381,693.60
	COCHLEAR LIMITED	3,460	216.30	748,398.00
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,641	77.47	746,888.27
	SONIC HEALTHCARE LTD	20,560	34.18	702,740.80
	CSL LIMITED	24,011	271.69	6,523,548.59
	AUST AND NZ BANKING GROUP	140,921	23.35	3,290,505.35
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	84,943	94.95	8,065,337.85
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	161,135	28.25	4,552,063.75
	WESTPAC BANKING	178,990	21.17	3,789,218.30
	ASX LTD	8,713	79.12	689,372.56
	MACQUARIE GROUP LIMITED	18,256	178.68	3,261,982.08
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	114,505	4.29	491,226.45
	MEDIBANK PRIVATE LTD	129,252	3.18	411,021.36
	QBE INSURANCE GROUP	78,253	12.23	957,034.19
	SUNCORP GROUP LIMITED	57,398	10.94	627,934.12
	COMPUTERSHARE LIMITED	28,589	23.51	672,127.39
	WISETECH GLOBAL LTD	6,445	39.60	255,222.00
	XERO LTD	7,073	79.72	563,859.56
	TELSTRA CORP	199,810	3.86	771,266.60
	ORIGIN ENERGY LIMITED	87,883	6.21	545,753.43
	オーストラリアドル 小計	3,298,789		77,010,401.44 (7,330,620,113)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	64,661	7.80	504,355.80
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	24,554	20.26	497,464.04
	SPARK NEW ZEALAND LTD	104,543	4.81	502,851.83
	MERCURY NZ LTD	19,343	5.78	111,802.54
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	4.71	301,600.14
		277,135		1,918,074.35

	ニュージーランドドル 小計			(164,532,417)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	139,448	53.45	7,453,495.60
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	69,000	100.40	6,927,600.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	102,000	18.20	1,856,400.00
	MTR CORP	82,500	41.85	3,452,625.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	81,000	27.60	2,235,600.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	97,000	44.00	4,268,000.00
	SANDS CHINA LTD	127,000	16.08	2,042,160.00
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	89,600	13.74	1,231,104.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	83,000	21.55	1,788,650.00
	WH GROUP LTD	446,619	5.76	2,572,525.44
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	191,500	29.65	5,677,975.00
	HANG SENG BANK	39,600	135.70	5,373,720.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	58,600	355.40	20,826,440.00
	AIA GROUP LTD	599,400	82.40	49,390,560.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	98,448	52.40	5,158,675.20
	ESR CAYMAN LTD	92,400	22.80	2,106,720.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	115,000	15.12	1,738,800.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	79,761	30.35	2,420,746.35
	NEW WORLD DEVELOPMENT	76,250	30.20	2,302,750.00
	SINO LAND CO	116,600	11.22	1,308,252.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	71,500	96.30	6,885,450.00
	SWIRE PACIFIC A	20,000	48.95	979,000.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,000	19.62	1,353,780.00
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	81,000	36.60	2,964,600.00	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	50.70	1,622,400.00	
CLP HOLDINGS	81,000	75.80	6,139,800.00	
HONG KONG & CHINA GAS	519,990	8.54	4,440,714.60	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	50.30	3,697,050.00	
	香港ドル 小計	3,732,716		158,215,593.19 (2,705,486,643)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	80,200	6.92	554,984.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	4.14	309,672.00
	SINGAPORE AIRLINES	54,650	5.36	292,924.00
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	0.77	247,767.50
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	81,700	4.17	340,689.00
	DBS GROUP	89,600	30.36	2,720,256.00
	OCBC BANK	171,350	11.76	2,015,076.00
	UNITED OVERSEAS BANK	57,900	28.05	1,624,095.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.72	413,100.00
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	118,900	3.86	458,954.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	8.30	182,600.00

	UOL GROUP LIMITED	24,800	7.35	182,280.00	
	VENTURE CORP LTD	14,300	17.54	250,822.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	420,880	2.54	1,069,035.20	
	シンガポールドル 小計	1,573,280		10,662,254.70 (1,035,838,044)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	28,484	34.45	981,273.80	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,248	692.40	864,115.20	
	BANK HAPOALIM BM	63,371	31.64	2,005,058.44	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,692	32.96	2,330,008.32	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,227	19.56	1,256,280.12	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,272	116.00	727,552.00	
	AZRIELI GROUP	1,471	241.40	355,099.40	
	NICE LTD	3,165	693.10	2,193,661.50	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	5,624	160.90	904,901.60	
	イスラエルシェケル 小計	244,554		11,617,950.38 (463,645,678)	
	合 計	54,087,711		319,753,897,067 (319,753,897,067)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	63,405	736,132.05	
		LENLEASE GROUP	36,448	371,769.60	
		オーストラリアドル 小計	99,853	1,107,901.65 (105,461,158)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000	991,900.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	1,983,200.00	
		香港ドル 小計	315,000	2,975,100.00 (50,874,210)	
		投資信託受益証券合計	414,853	156,335,368 (156,335,368)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,686	1,156,512.42	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	16,172	587,043.60	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	22,709	5,908,881.80	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	71,103	472,834.95	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,916	1,347,720.92	
		BOSTON PROPERTIES	6,840	674,218.80	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,093	687,096.63	
		CROWN CASTLE INTL CORP	21,569	3,874,439.47	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,046	1,871,208.12	

	DUKE REALTY CORP	19,458	1,007,535.24
	EQUINIX INC	4,536	2,986,593.12
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,979	640,023.12
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	17,656	1,275,116.32
	ESSEX PROPERTY TRUST	3,024	819,201.60
	EXTRA SPACE STORAGE INC	6,789	1,149,581.37
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	24,947	647,624.12
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,496	646,995.36
	INVITATION HOMES INC	30,792	1,128,834.72
	IRON MOUNTAIN INC	13,240	692,319.60
	KIMCO REALTY CORP	31,093	663,213.69
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	27,097	437,074.61
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,856	989,254.08
	PROLOGIS INC	36,906	4,508,806.02
	PUBLIC STORAGE	7,808	2,418,606.08
	REALTY INCOME CORP	29,689	1,967,786.92
	REGENCY CENTERS CORP	7,026	439,265.52
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,468	1,824,398.20
	SIMON PROPERTY GROUP	16,262	1,689,133.94
	SUN COMMUNITIES INC	5,410	854,888.20
	UDR INC	14,820	670,012.20
	VENTAS INC	20,307	1,082,769.24
	VICI PROPERTIES INC	46,821	1,436,468.28
	VORNADO REALTY TRUST	7,639	240,628.50
	WELLTOWER INC	22,461	1,869,429.03
	WP CAREY INC	8,887	726,156.77
	アメリカドル 小計	627,601	49,391,672.56 (6,629,350,291)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,069	241,081.64
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	195,001.00
	カナダドル 小計	14,014	436,082.64 (46,067,770)
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	-
	COVIVIO(FP)	3,076	194,249.40
	GECINA SA	1,966	207,609.60
	KLEPIERRE	8,356	173,637.68
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,185	380,872.30
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,235	237,597.40
	ユーロ 小計	1,632,402	1,193,966.38 (170,187,967)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	39,175	203,396.60
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	241,825.43
	SEGRO PLC	63,208	656,415.08

	イギリスポンド 小計	134,515	1,101,637.11 (184,755,559)
オーストラリアドル	DEXUS	49,283	487,408.87
	GOODMAN GROUP	83,969	1,604,647.59
	GPT GROUP	85,529	386,591.08
	MIRVAC GROUP	176,235	368,331.15
	SCENTRE GROUP	234,255	639,516.15
	STOCKLAND	121,481	451,909.32
	VICINITY CENTERS	163,023	300,777.43
	オーストラリアドル 小計	913,775	4,239,181.59 (403,527,695)
香港ドル	LINK REIT	107,800	7,519,050.00
	香港ドル 小計	107,800	7,519,050.00 (128,575,755)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	135,809	387,055.65
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	276,190	618,665.60
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	132,200	241,926.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	174,778	297,122.60
	シンガポールドル 小計	718,977	1,544,769.85 (150,074,390)
	投資証券合計	4,149,084	7,712,539,427 (7,712,539,427)
	合計		7,868,874,795 (7,868,874,795)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

- 1.通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
- 2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
- 4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 604銘柄	97.2%			71.0%
	投資証券 35銘柄			2.8%	2.0%
カナダドル	株式 86銘柄	99.6%			4.0%
	投資証券 2銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式 224銘柄	99.4%			9.3%
	投資証券 6銘柄			0.6%	0.1%
イギリスポンド	株式 78銘柄	98.8%			4.7%



	投資証券 3銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 41銘柄	100.0%			3.0%
スウェーデンクローナ	株式 48銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 51銘柄	93.5%			2.2%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.3%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.1%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 28銘柄	93.8%			0.8%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.8%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.5%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	87.3%			0.3%
	投資証券 4銘柄			12.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	134,383,668
コール・ローン	2,255,286,793
国債証券	152,280,471,329
派生商品評価勘定	87,146,999
未収入金	4,493,359
未収利息	812,334,682
前払金	27,565,452
前払費用	39,220,199
差入委託証拠金	141,037,623
流動資産合計	155,781,940,104
資産合計	155,781,940,104

	2022年 6月10日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	27,682,597
未払金	2,394,402
未払解約金	101,960,861
未払利息	2,574
流動負債合計	132,040,434
負債合計	132,040,434
純資産の部	
元本等	
元本	57,175,787,391
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	98,474,112,279
元本等合計	155,649,899,670
純資産合計	155,649,899,670
負債純資産合計	155,781,940,104

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

2022年 6月10日現在	
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2022年 6月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	57,175,787,391口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.7223円 (27,223円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

2022年 6月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<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。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

元本の移動

区分	2022年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 6月11日
期首元本額	55,650,103,041円
期中追加設定元本額	7,295,088,605円
期中一部解約元本額	5,769,404,255円

区分	2022年 6月10日現在
期末元本額	57,175,787,391円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	1,988,179,036円
D C 外国債券インデックスファンド	1,903,452,851円
D C 外国債券インデックスファンド L	14,211,419,867円
D C バランスファンド 3 0	893,866,182円
D C バランスファンド 5 0	926,532,673円
D C バランスファンド 7 0	214,704,991円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	475,642,193円
外国債券インデックス e	1,051,873,136円
インデックスコレクション（外国債券）	8,786,883,050円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	4,752,427,473円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	784,455,582円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	250,446,636円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	4,686,496,483円
外国債券パッシブファンド私募 A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	2,788,585,830円
外国債券インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	447,197,935円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	95,400,394円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	441,076,070円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	260,032,007円
V A バランスファンド（株 5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	173,010,652円
V A バランスファンド（株 6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	207,226,542円
バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	1,318,340,601円
バランス V A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	559,479,925円
バランス V A 5 0 L（適格機関投資家専用）	5,929,106,816円
バランス V A 7 5（適格機関投資家専用）	321,091,477円
V A バランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	200,169,567円
V A ポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	1,478,341,946円
V A ポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	84,510,168円
バランス V A 4 0（適格機関投資家専用）	179,313,717円
V A バランスファンド 2（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	86,937,313円
V A バランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	45,077,492円
V A ファンド 2 5（適格機関投資家専用）	69,442,673円
バランス V A 2 5 L（適格機関投資家専用）	225,575,586円
世界バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	66,486,502円
V A バランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	1,259,343,268円
私募外国債券インデックスファンド A L（適格機関投資家専用）	13,660,757円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 6月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		14,495,566,924
合計		14,495,566,924

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

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 債券関連

(2022年 6月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	2,058,139,663	-	2,030,574,211	27,565,452
合計		2,058,139,663	-	2,030,574,211	27,565,452

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

(2022年 6月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,139,746,588	-	2,226,621,219	86,874,631
	アメリカドル	1,145,086,324	-	1,190,274,170	45,187,846
	カナダドル	85,521,942	-	89,773,430	4,251,488
	ユーロ	790,728,398	-	822,493,305	31,764,907
	イギリスポンド	118,409,924	-	124,080,314	5,670,390
	売建	33,491,935	-	33,336,712	155,223
	イギリスポンド	33,491,935	-	33,336,712	155,223
合計		2,173,238,523	-	2,259,957,931	87,029,854

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	5,000,000.00	4,800,585.95	
		T 0.125% 06/30/23	6,630,000.00	6,472,149.04	
		T 0.125% 10/15/23	5,200,000.00	5,031,507.83	
		T 0.25% 03/15/24	4,500,000.00	4,308,134.76	
		T 0.25% 05/15/24	5,070,000.00	4,828,679.86	
		T 0.25% 05/31/25	1,180,000.00	1,087,950.78	
		T 0.25% 06/15/24	10,610,000.00	10,078,256.61	
		T 0.25% 06/30/25	4,310,000.00	3,964,189.86	
		T 0.25% 07/31/25	2,200,000.00	2,017,898.43	
		T 0.25% 09/30/25	7,000,000.00	6,389,140.66	
		T 0.375% 01/31/26	1,700,000.00	1,543,082.02	
		T 0.375% 07/31/27	4,000,000.00	3,487,656.24	
		T 0.375% 08/15/24	5,500,000.00	5,213,613.29	
		T 0.375% 09/15/24	4,600,000.00	4,347,898.42	
		T 0.375% 09/30/27	4,000,000.00	3,470,312.52	
		T 0.375% 11/30/25	3,770,000.00	3,438,210.55	
		T 0.5% 02/28/26	3,500,000.00	3,184,863.29	
		T 0.5% 03/31/25	4,000,000.00	3,733,593.76	
		T 0.5% 05/31/27	5,500,000.00	4,846,015.62	
		T 0.5% 06/30/27	2,500,000.00	2,198,437.50	
		T 0.5% 08/31/27	1,100,000.00	962,972.65	
		T 0.5% 10/31/27	3,580,000.00	3,119,354.70	
		T 0.625% 03/31/27	3,400,000.00	3,029,187.50	
		T 0.625% 05/15/30	7,400,000.00	6,142,578.16	
		T 0.625% 07/31/26	4,000,000.00	3,620,156.24	
		T 0.625% 08/15/30	9,130,000.00	7,533,676.56	
		T 0.625% 10/15/24	3,250,000.00	3,082,929.68	
		T 0.625% 11/30/27	3,700,000.00	3,240,390.62	
		T 0.625% 12/31/27	3,000,000.00	2,621,835.93	

T 0.75% 01/31/28	3,500,000.00	3,074,667.96	
T 0.75% 03/31/26	2,750,000.00	2,521,728.52	
T 0.75% 04/30/26	3,500,000.00	3,203,320.33	
T 0.75% 08/31/26	3,000,000.00	2,724,375.00	
T 0.75% 11/15/24	5,230,000.00	4,963,801.15	
T 0.875% 09/30/26	5,000,000.00	4,557,031.25	
T 0.875% 11/15/30	6,160,000.00	5,175,362.50	
T 1.125% 01/15/25	5,830,000.00	5,563,550.81	
T 1.125% 02/15/31	5,600,000.00	4,788,000.00	
T 1.125% 05/15/40	1,550,000.00	1,078,824.22	
T 1.125% 08/15/40	4,000,000.00	2,765,000.00	
T 1.125% 08/31/28	4,000,000.00	3,552,656.24	
T 1.125% 10/31/26	2,700,000.00	2,483,683.58	
T 1.25% 03/31/28	5,300,000.00	4,778,488.26	
T 1.25% 05/15/50	5,120,000.00	3,243,600.02	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,394,140.64	
T 1.25% 06/30/28	1,000,000.00	897,773.44	
T 1.25% 07/31/23	3,950,000.00	3,896,381.83	
T 1.25% 08/15/31	6,550,000.00	5,612,531.25	
T 1.25% 09/30/28	3,800,000.00	3,396,695.32	
T 1.25% 11/30/26	3,000,000.00	2,771,835.93	
T 1.25% 12/31/26	5,500,000.00	5,073,535.16	
T 1.375% 08/15/50	2,300,000.00	1,506,679.69	
T 1.375% 08/31/23	3,450,000.00	3,402,562.50	
T 1.375% 09/30/23	3,550,000.00	3,495,779.28	
T 1.375% 10/31/28	1,700,000.00	1,529,734.37	
T 1.375% 11/15/31	9,450,000.00	8,159,484.37	
T 1.375% 11/15/40	4,650,000.00	3,352,722.67	
T 1.5% 02/15/30	1,820,000.00	1,628,757.82	
T 1.5% 08/15/26	5,300,000.00	4,969,371.10	
T 1.5% 09/30/24	3,000,000.00	2,908,242.18	
T 1.5% 11/30/28	5,550,000.00	5,029,470.71	
T 1.625% 02/15/26	5,750,000.00	5,461,601.56	
T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	5,109,750.00	
T 1.625% 05/15/31	4,690,000.00	4,171,535.17	
T 1.625% 05/31/23	4,350,000.00	4,318,734.37	
T 1.625% 08/15/29	2,260,000.00	2,052,715.62	
T 1.625% 09/30/26	2,150,000.00	2,024,947.27	
T 1.625% 11/15/50	5,400,000.00	3,782,953.15	
T 1.625% 11/30/26	3,030,000.00	2,847,489.85	
T 1.75% 01/31/29	2,500,000.00	2,300,390.62	
T 1.75% 06/30/24	2,000,000.00	1,956,953.12	



T 1.75% 08/15/41	3,800,000.00	2,897,796.89
T 1.75% 11/15/29	3,220,000.00	2,946,300.00
T 1.75% 12/31/26	4,300,000.00	4,059,132.83
T 1.875% 02/15/32	3,500,000.00	3,157,382.83
T 1.875% 02/15/41	4,750,000.00	3,737,656.25
T 1.875% 02/15/51	4,500,000.00	3,361,640.62
T 1.875% 02/28/27	3,000,000.00	2,843,203.14
T 1.875% 06/30/26	3,980,000.00	3,800,900.00
T 1.875% 07/31/26	1,800,000.00	1,716,960.94
T 1.875% 11/15/51	3,400,000.00	2,542,031.25
T 1% 07/31/28	2,000,000.00	1,765,000.00
T 1% 12/15/24	3,070,000.00	2,926,813.29
T 2.125% 02/29/24	1,400,000.00	1,386,027.34
T 2.125% 03/31/24	1,200,000.00	1,186,593.75
T 2.125% 05/15/25	3,850,000.00	3,757,960.93
T 2.125% 07/31/24	1,500,000.00	1,478,027.34
T 2.125% 09/30/24	2,200,000.00	2,163,648.43
T 2.125% 11/30/23	2,700,000.00	2,681,068.35
T 2.125% 11/30/24	1,400,000.00	1,373,695.31
T 2.25% 01/31/24	5,090,000.00	5,053,117.40
T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	3,756,492.20
T 2.25% 02/15/52	1,600,000.00	1,313,000.00
T 2.25% 03/31/24	7,300,000.00	7,232,275.41
T 2.25% 03/31/26	1,500,000.00	1,456,757.82
T 2.25% 04/30/24	2,600,000.00	2,574,964.83
T 2.25% 05/15/41	1,600,000.00	1,336,750.00
T 2.25% 08/15/27	2,320,000.00	2,225,478.11
T 2.25% 08/15/46	2,180,000.00	1,761,712.50
T 2.25% 08/15/49	4,110,000.00	3,368,915.62
T 2.25% 10/31/24	2,500,000.00	2,462,500.00
T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	4,921,875.00
T 2.25% 11/15/25	5,500,000.00	5,357,343.75
T 2.25% 11/15/27	5,260,000.00	5,035,011.70
T 2.25% 12/31/23	3,500,000.00	3,477,578.12
T 2.25% 12/31/24	2,900,000.00	2,851,062.50
T 2.375% 02/15/42	1,350,000.00	1,147,605.47
T 2.375% 02/29/24	4,280,000.00	4,255,339.83
T 2.375% 04/30/26	1,820,000.00	1,775,139.83
T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,480,890.61
T 2.375% 05/15/29	3,890,000.00	3,717,989.06
T 2.375% 05/15/51	1,600,000.00	1,346,625.00
T 2.375% 08/15/24	5,460,000.00	5,403,053.89
T 2.375% 11/15/49	2,010,000.00	1,694,995.31

T 2.5% 01/31/25	4,000,000.00	3,952,812.52	
T 2.5% 02/15/45	2,150,000.00	1,827,667.97	
T 2.5% 02/15/46	2,250,000.00	1,912,324.23	
T 2.5% 02/28/26	650,000.00	637,482.42	
T 2.5% 05/15/24	3,700,000.00	3,680,199.22	
T 2.5% 05/15/46	1,810,000.00	1,538,358.60	
T 2.5% 08/15/23	3,450,000.00	3,449,730.48	
T 2.625% 01/31/26	1,350,000.00	1,330,488.28	
T 2.625% 02/15/29	6,900,000.00	6,707,554.71	
T 2.625% 03/31/25	2,500,000.00	2,476,953.12	
T 2.625% 06/30/23	6,000,000.00	6,014,179.68	
T 2.75% 02/15/24	3,900,000.00	3,901,828.12	
T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	4,584,079.28	
T 2.75% 06/30/25	2,000,000.00	1,985,546.88	
T 2.75% 07/31/23	4,000,000.00	4,012,656.24	
T 2.75% 08/15/42	850,000.00	764,468.75	
T 2.75% 08/15/47	2,450,000.00	2,196,386.73	
T 2.75% 08/31/25	5,000,000.00	4,958,007.80	
T 2.75% 11/15/23	4,450,000.00	4,459,560.55	
T 2.75% 11/15/42	1,040,000.00	933,643.75	
T 2.75% 11/15/47	2,500,000.00	2,243,359.37	
T 2.875% 04/30/25	2,300,000.00	2,292,453.12	
T 2.875% 05/15/28	4,460,000.00	4,402,856.25	
T 2.875% 05/15/43	1,050,000.00	960,011.72	
T 2.875% 05/15/49	4,400,000.00	4,101,625.00	
T 2.875% 07/31/25	5,000,000.00	4,980,468.75	
T 2.875% 08/15/28	4,200,000.00	4,143,562.50	
T 2.875% 08/15/45	1,480,000.00	1,347,609.38	
T 2.875% 09/30/23	1,650,000.00	1,656,960.93	
T 2.875% 11/30/23	6,000,000.00	6,020,390.64	
T 2% 02/15/25	6,050,000.00	5,901,585.93	
T 2% 02/15/50	3,370,000.00	2,603,325.00	
T 2% 04/30/24	3,000,000.00	2,957,402.34	
T 2% 05/31/24	1,500,000.00	1,477,236.33	
T 2% 06/30/24	1,000,000.00	983,828.13	
T 2% 08/15/25	3,750,000.00	3,632,958.97	
T 2% 08/15/51	6,940,000.00	5,345,968.74	
T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,577,023.45	
T 2% 11/15/41	4,140,000.00	3,300,356.25	
T 3.125% 02/15/42	1,000,000.00	959,375.00	
T 3.125% 02/15/43	1,100,000.00	1,048,265.62	
T 3.125% 05/15/48	1,400,000.00	1,356,031.25	

T	3.125%	08/15/44	1,550,000.00	1,472,257.81	
T	3.125%	11/15/28	3,960,000.00	3,961,546.89	
T	3.125%	11/15/41	870,000.00	835,811.72	
T	3.375%	05/15/44	1,700,000.00	1,682,070.32	
T	3.375%	11/15/48	1,000,000.00	1,017,578.13	
T	3.5%	02/15/39	900,000.00	936,210.94	
T	3.625%	02/15/44	1,600,000.00	1,645,750.00	
T	3.625%	08/15/43	1,600,000.00	1,646,375.00	
T	3.75%	08/15/41	1,100,000.00	1,153,796.87	
T	3.75%	11/15/43	900,000.00	943,734.37	
T	3.875%	08/15/40	680,000.00	731,743.75	
T	3%	02/15/47	2,400,000.00	2,247,375.00	
T	3%	02/15/48	3,100,000.00	2,925,382.82	
T	3%	02/15/49	1,940,000.00	1,849,062.50	
T	3%	05/15/42	1,100,000.00	1,033,312.50	
T	3%	05/15/45	600,000.00	558,046.87	
T	3%	05/15/47	1,900,000.00	1,780,359.37	
T	3%	08/15/48	3,060,000.00	2,895,525.00	
T	3%	09/30/25	3,660,000.00	3,657,140.62	
T	3%	10/31/25	1,000,000.00	998,593.75	
T	3%	11/15/44	1,550,000.00	1,440,046.87	
T	4.25%	05/15/39	850,000.00	967,140.62	
T	4.25%	11/15/40	900,000.00	1,013,203.12	
T	4.375%	02/15/38	500,000.00	578,828.12	
T	4.375%	05/15/40	750,000.00	862,500.00	
T	4.375%	05/15/41	550,000.00	627,773.43	
T	4.375%	11/15/39	650,000.00	748,566.40	
T	4.5%	02/15/36	600,000.00	704,015.62	
T	4.5%	05/15/38	970,000.00	1,138,007.03	
T	4.5%	08/15/39	750,000.00	878,496.09	
T	4.625%	02/15/40	700,000.00	831,195.31	
T	4.75%	02/15/41	750,000.00	899,707.03	
T	5.0%	05/15/37	650,000.00	800,261.72	
T	5.25%	11/15/28	900,000.00	1,012,570.31	
T	5.375%	02/15/31	750,000.00	881,894.53	
T	6.0%	02/15/26	600,000.00	661,125.00	
T	6.125%	11/15/27	1,050,000.00	1,207,171.87	
T	6.25%	05/15/30	720,000.00	881,718.75	
T	6.25%	08/15/23	1,350,000.00	1,409,748.04	
アメリカドル 小計			619,380,000.00	573,242,659.40 (76,940,629,744)	
カナダドル	CAN	0.25%	03/01/26	890,000.00	800,848.70
	CAN	0.25%	04/01/24	990,000.00	942,133.50

CAN 0.25% 08/01/23	640,000.00	620,908.80	
CAN 0.5% 09/01/25	1,330,000.00	1,224,078.80	
CAN 0.5% 11/01/23	530,000.00	512,144.30	
CAN 0.5% 12/01/30	2,320,000.00	1,850,524.80	
CAN 0.75% 02/01/24	430,000.00	414,399.60	
CAN 1.25% 03/01/25	500,000.00	476,370.00	
CAN 1.25% 03/01/27	640,000.00	586,611.20	
CAN 1.25% 06/01/30	1,940,000.00	1,670,999.60	
CAN 1.5% 06/01/23	2,010,000.00	1,983,246.90	
CAN 1.5% 06/01/26	840,000.00	789,801.60	
CAN 1.5% 06/01/31	2,010,000.00	1,738,951.50	
CAN 1.5% 09/01/24	660,000.00	638,101.20	
CAN 1.5% 12/01/31	1,230,000.00	1,057,357.20	
CAN 1.75% 12/01/53	1,270,000.00	920,153.10	
CAN 1% 06/01/27	880,000.00	793,689.60	
CAN 1% 09/01/26	1,220,000.00	1,117,373.60	
CAN 2.25% 03/01/24	670,000.00	661,497.70	
CAN 2.25% 06/01/25	670,000.00	654,636.90	
CAN 2.25% 06/01/29	390,000.00	367,068.00	
CAN 2.5% 06/01/24	1,780,000.00	1,761,612.60	
CAN 2.75% 12/01/48	510,000.00	472,545.60	
CAN 2.75% 12/01/64	460,000.00	418,089.40	
CAN 2% 06/01/28	500,000.00	468,205.00	
CAN 2% 06/01/32	400,000.00	358,156.00	
CAN 2% 09/01/23	1,180,000.00	1,166,406.40	
CAN 2% 12/01/51	2,510,000.00	1,962,744.70	
CAN 3.5% 12/01/45	490,000.00	514,152.10	
CAN 4.0% 06/01/41	490,000.00	543,022.90	
CAN 5.75% 06/01/29	960,000.00	1,112,160.00	
CAN 5.75% 06/01/33	480,000.00	588,048.00	
CAN 5% 06/01/37	390,000.00	470,702.70	
カナダドル 小計		32,210,000.00	29,656,742.00 (3,132,938,224)
メキシコベ ソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	6,942,464.00
	MBONO 10% 12/05/24	20,780,000.00	21,121,623.20
	MBONO 5.5% 03/04/27	2,240,000.00	1,928,640.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	20,410,000.00	18,203,679.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	21,620,000.00	20,289,289.00
	MBONO 7.75% 05/29/31	15,240,000.00	14,125,194.00
	MBONO 7.75% 11/13/42	13,980,000.00	12,255,147.60
	MBONO 7.75% 11/23/34	4,970,000.00	4,527,173.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	20,740,000.00	20,212,374.40

	MBONO 8.5% 11/18/38	12,980,000.00	12,453,661.00
	MBONO 8% 09/05/24	18,940,000.00	18,459,302.80
	MBONO 8% 11/07/47	14,310,000.00	12,773,106.00
	MBONO 8% 12/07/23	13,220,000.00	12,992,483.80
	メキシコペソ 小計	185,830,000.00	176,284,137.80 (1,203,245,010)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	730,000.00	639,392.40
	BGB 0.2% 10/22/23	640,000.00	637,414.40
	BGB 0.35% 06/22/32	700,000.00	593,215.00
	BGB 0.4% 06/22/40	400,000.00	286,512.00
	BGB 0.5% 10/22/24	490,000.00	484,703.10
	BGB 0.65% 06/22/71	300,000.00	141,567.00
	BGB 0.8% 06/22/25	1,100,000.00	1,088,406.00
	BGB 0.8% 06/22/27	750,000.00	727,057.50
	BGB 0.8% 06/22/28	810,000.00	776,514.60
	BGB 0.9% 06/22/29	990,000.00	940,608.90
	BGB 0% 10/22/27	600,000.00	554,928.00
	BGB 0% 10/22/31	730,000.00	610,061.00
	BGB 1.25% 04/22/33	550,000.00	512,946.50
	BGB 1.4% 06/22/53	290,000.00	220,400.00
	BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	360,300.00
	BGB 1.6% 06/22/47	640,000.00	536,448.00
	BGB 1.7% 06/22/50	710,000.00	598,018.80
	BGB 1.9% 06/22/38	510,000.00	485,841.30
	BGB 1% 06/22/26	1,080,000.00	1,067,342.40
	BGB 1% 06/22/31	910,000.00	844,589.20
	BGB 2.15% 06/22/66	470,000.00	420,941.40
	BGB 2.25% 06/22/23	830,000.00	845,496.10
	BGB 2.25% 06/22/57	380,000.00	357,010.00
	BGB 2.6% 06/22/24	1,000,000.00	1,035,340.00
	BGB 3.75% 06/22/45	580,000.00	714,739.80
	BGB 3% 06/22/34	350,000.00	383,435.50
	BGB 4.25% 03/28/41	1,110,000.00	1,420,122.90
	BGB 4.5% 03/28/26	750,000.00	841,560.00
	BGB 4% 03/28/32	620,000.00	733,596.40
	BGB 5.5% 03/28/28	1,190,000.00	1,458,464.00
	BGB 5% 03/28/35	1,270,000.00	1,677,593.80
	BKO 0% 09/15/23	700,000.00	696,367.00
	BKO 0% 12/15/23	1,250,000.00	1,241,212.50
	BTPS 0.25% 03/15/28	1,250,000.00	1,074,225.00
	BTPS 0.3% 08/15/23	1,100,000.00	1,092,850.00
	BTPS 0.35% 02/01/25	900,000.00	860,499.00
	BTPS 0.45% 02/15/29	810,000.00	680,278.50

BTPS 0.5% 02/01/26	1,500,000.00	1,399,065.00	
BTPS 0.5% 07/15/28	730,000.00	630,785.70	
BTPS 0.6% 06/15/23	720,000.00	719,272.80	
BTPS 0.6% 08/01/31	1,500,000.00	1,163,535.00	
BTPS 0.65% 10/15/23	1,130,000.00	1,124,496.90	
BTPS 0.85% 01/15/27	1,100,000.00	1,013,727.00	
BTPS 0.9% 04/01/31	1,300,000.00	1,050,582.00	
BTPS 0.95% 03/01/37	600,000.00	413,946.00	
BTPS 0.95% 06/01/32	880,000.00	688,494.40	
BTPS 0.95% 08/01/30	1,330,000.00	1,102,583.30	
BTPS 0.95% 09/15/27	1,000,000.00	909,480.00	
BTPS 0.95% 12/01/31	1,120,000.00	890,187.20	
BTPS 0% 01/15/24	300,000.00	293,580.00	
BTPS 0% 04/01/26	2,700,000.00	2,451,546.00	
BTPS 0% 04/15/24	980,000.00	951,668.20	
BTPS 0% 08/01/26	1,330,000.00	1,194,499.60	
BTPS 0% 08/15/24	1,610,000.00	1,548,304.80	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,170,000.00	1,102,748.40	
BTPS 1.35% 04/01/30	750,000.00	651,180.00	
BTPS 1.45% 03/01/36	1,130,000.00	858,359.30	
BTPS 1.45% 05/15/25	1,070,000.00	1,046,106.90	
BTPS 1.45% 11/15/24	1,520,000.00	1,498,963.20	
BTPS 1.5% 04/30/45	710,000.00	466,100.80	
BTPS 1.5% 06/01/25	1,500,000.00	1,469,550.00	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,303,924.50	
BTPS 1.65% 03/01/32	1,340,000.00	1,137,338.40	
BTPS 1.65% 12/01/30	1,830,000.00	1,596,455.40	
BTPS 1.7% 09/01/51	750,000.00	473,287.50	
BTPS 1.75% 07/01/24	1,840,000.00	1,839,521.60	
BTPS 1.8% 03/01/41	790,000.00	578,319.50	
BTPS 1.85% 05/15/24	750,000.00	753,067.50	
BTPS 1.85% 07/01/25	820,000.00	809,364.60	
BTPS 2.05% 08/01/27	1,040,000.00	1,002,840.80	
BTPS 2.1% 07/15/26	1,470,000.00	1,443,157.80	
BTPS 2.15% 03/01/72	310,000.00	197,773.80	
BTPS 2.15% 09/01/52	510,000.00	352,838.40	
BTPS 2.2% 06/01/27	1,110,000.00	1,081,761.60	
BTPS 2.25% 09/01/36	990,000.00	830,639.70	
BTPS 2.45% 09/01/33	990,000.00	884,406.60	
BTPS 2.45% 09/01/50	970,000.00	738,383.40	
BTPS 2.45% 10/01/23	870,000.00	885,433.80	
BTPS 2.5% 11/15/25	660,000.00	662,864.40	

BTPS 2.5% 12/01/24	1,300,000.00	1,315,379.00
BTPS 2.7% 03/01/47	940,000.00	777,934.60
BTPS 2.8% 03/01/67	600,000.00	466,878.00
BTPS 2.8% 12/01/28	1,260,000.00	1,244,817.00
BTPS 2.95% 09/01/38	850,000.00	767,728.50
BTPS 2% 02/01/28	930,000.00	889,507.80
BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,036,948.50
BTPS 3.1% 03/01/40	670,000.00	609,492.30
BTPS 3.25% 09/01/46	980,000.00	897,905.40
BTPS 3.35% 03/01/35	1,100,000.00	1,060,202.00
BTPS 3.45% 03/01/48	1,120,000.00	1,051,926.40
BTPS 3.5% 03/01/30	1,950,000.00	1,994,460.00
BTPS 3.75% 09/01/24	1,040,000.00	1,083,513.60
BTPS 3.85% 09/01/49	840,000.00	839,613.60
BTPS 3% 08/01/29	1,210,000.00	1,198,807.50
BTPS 4.5% 03/01/24	1,130,000.00	1,189,336.30
BTPS 4.5% 03/01/26	930,000.00	1,000,038.30
BTPS 4.75% 08/01/23	1,610,000.00	1,681,113.70
BTPS 4.75% 09/01/28	1,810,000.00	1,990,674.20
BTPS 4.75% 09/01/44	1,180,000.00	1,347,371.20
BTPS 4% 02/01/37	1,800,000.00	1,858,068.00
BTPS 5.0% 08/01/39	1,440,000.00	1,661,097.60
BTPS 5.25% 11/01/29	1,770,000.00	2,023,605.60
BTPS 5.75% 02/01/33	1,320,000.00	1,574,509.20
BTPS 5% 03/01/25	1,740,000.00	1,875,076.20
BTPS 5% 08/01/34	1,260,000.00	1,429,558.20
BTPS 5% 09/01/40	1,600,000.00	1,853,824.00
BTPS 6.5% 11/01/27	2,070,000.00	2,457,234.90
BTPS 6% 05/01/31	1,940,000.00	2,331,201.00
BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	418,904.50
BTPS 9% 11/01/23	1,800,000.00	1,994,904.00
DBR 0.25% 02/15/27	1,230,000.00	1,180,763.10
DBR 0.25% 02/15/29	1,160,000.00	1,084,936.40
DBR 0.25% 08/15/28	1,300,000.00	1,223,001.00
DBR 0.5% 02/15/25	2,090,000.00	2,067,072.70
DBR 0.5% 02/15/26	2,300,000.00	2,255,357.00
DBR 0.5% 02/15/28	1,510,000.00	1,449,418.80
DBR 0.5% 08/15/27	940,000.00	907,015.40
DBR 0% 02/15/30	1,660,000.00	1,502,847.80
DBR 0% 02/15/31	1,240,000.00	1,103,724.00
DBR 0% 02/15/32	840,000.00	732,589.20
DBR 0% 05/15/35	1,280,000.00	1,049,548.80
DBR 0% 05/15/36	1,320,000.00	1,063,365.60

DBR 0% 08/15/26	1,620,000.00	1,547,958.60	
DBR 0% 08/15/29	2,430,000.00	2,216,500.20	
DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,329,143.60	
DBR 0% 08/15/31	2,310,000.00	2,035,710.60	
DBR 0% 08/15/50	2,120,000.00	1,356,418.40	
DBR 0% 08/15/52	700,000.00	431,417.00	
DBR 0% 11/15/27	1,580,000.00	1,479,606.80	
DBR 0% 11/15/28	1,510,000.00	1,393,548.80	
DBR 1.25% 08/15/48	1,880,000.00	1,749,246.00	
DBR 1.5% 05/15/24	1,020,000.00	1,034,820.60	
DBR 1.75% 02/15/24	1,250,000.00	1,273,800.00	
DBR 1% 08/15/24	1,610,000.00	1,615,924.80	
DBR 1% 08/15/25	1,880,000.00	1,881,052.80	
DBR 2.5% 07/04/44	1,670,000.00	1,961,047.60	
DBR 2.5% 08/15/46	1,830,000.00	2,179,658.10	
DBR 2% 08/15/23	1,890,000.00	1,926,911.70	
DBR 3.25% 07/04/42	1,160,000.00	1,490,449.20	
DBR 4.0% 01/04/37	1,670,000.00	2,201,711.30	
DBR 4.25% 07/04/39	1,090,000.00	1,522,359.40	
DBR 4.75% 07/04/28	700,000.00	844,207.00	
DBR 4.75% 07/04/34	1,440,000.00	1,963,238.40	
DBR 4.75% 07/04/40	1,250,000.00	1,865,687.50	
DBR 5.5% 01/04/31	1,640,000.00	2,191,761.60	
DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	1,856,460.00	
DBR 6.25% 01/04/24	1,370,000.00	1,493,135.60	
DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	827,196.60	
DBR 6.5% 07/04/27	1,270,000.00	1,600,225.40	
FRTR 0.25% 11/25/26	2,050,000.00	1,949,222.00	
FRTR 0.5% 05/25/25	3,160,000.00	3,103,625.60	
FRTR 0.5% 05/25/26	2,930,000.00	2,838,378.90	
FRTR 0.5% 05/25/29	2,830,000.00	2,621,429.00	
FRTR 0.5% 05/25/40	1,260,000.00	932,664.60	
FRTR 0.5% 05/25/72	390,000.00	172,317.60	
FRTR 0.5% 06/25/44	790,000.00	544,381.10	
FRTR 0.75% 05/25/28	2,960,000.00	2,827,066.40	
FRTR 0.75% 05/25/52	1,930,000.00	1,256,623.00	
FRTR 0.75% 05/25/53	770,000.00	490,051.10	
FRTR 0.75% 11/25/28	2,990,000.00	2,837,121.30	
FRTR 0% 02/25/24	1,850,000.00	1,829,465.00	
FRTR 0% 02/25/26	2,220,000.00	2,118,146.40	
FRTR 0% 02/25/27	2,320,000.00	2,168,643.20	
FRTR 0% 03/25/24	2,240,000.00	2,210,611.20	



FRTR 0% 03/25/25	3,280,000.00	3,182,748.00
FRTR 0% 05/25/32	1,670,000.00	1,374,827.50
FRTR 0% 11/25/29	2,760,000.00	2,434,954.80
FRTR 0% 11/25/30	3,330,000.00	2,862,434.70
FRTR 0% 11/25/31	2,460,000.00	2,058,774.00
FRTR 1.25% 05/25/34	2,400,000.00	2,189,448.00
FRTR 1.25% 05/25/36	2,660,000.00	2,372,188.00
FRTR 1.5% 05/25/31	3,230,000.00	3,147,473.50
FRTR 1.5% 05/25/50	1,960,000.00	1,616,255.20
FRTR 1.75% 05/25/66	850,000.00	693,702.00
FRTR 1.75% 06/25/39	1,910,000.00	1,797,367.30
FRTR 1.75% 11/25/24	2,020,000.00	2,057,410.40
FRTR 1% 05/25/27	2,180,000.00	2,133,413.40
FRTR 1% 11/25/25	2,240,000.00	2,223,200.00
FRTR 2.25% 05/25/24	2,290,000.00	2,352,173.50
FRTR 2.5% 05/25/30	2,900,000.00	3,075,334.00
FRTR 2.75% 10/25/27	3,280,000.00	3,496,053.60
FRTR 2% 05/25/48	1,890,000.00	1,753,485.30
FRTR 3.25% 05/25/45	1,800,000.00	2,095,272.00
FRTR 3.5% 04/25/26	3,120,000.00	3,382,641.60
FRTR 4.25% 10/25/23	2,870,000.00	3,016,743.10
FRTR 4.5% 04/25/41	2,340,000.00	3,122,332.20
FRTR 4.75% 04/25/35	1,340,000.00	1,742,938.00
FRTR 4% 04/25/55	1,070,000.00	1,437,170.50
FRTR 4% 04/25/60	1,080,000.00	1,480,442.40
FRTR 4% 10/25/38	1,600,000.00	2,000,368.00
FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	3,129,125.00
FRTR 5.75% 10/25/32	2,150,000.00	2,913,207.00
FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	1,680,782.00
IRISH 0.2% 05/15/27	430,000.00	405,034.20
IRISH 0.2% 10/18/30	470,000.00	411,320.50
IRISH 0.35% 10/18/32	170,000.00	143,367.80
IRISH 0.4% 05/15/35	280,000.00	225,960.00
IRISH 0.55% 04/22/41	220,000.00	162,019.00
IRISH 0.9% 05/15/28	440,000.00	423,002.80
IRISH 0% 10/18/31	440,000.00	366,850.00
IRISH 1.1% 05/15/29	550,000.00	531,454.00
IRISH 1.3% 05/15/33	380,000.00	351,591.20
IRISH 1.35% 03/18/31	420,000.00	404,077.80
IRISH 1.5% 05/15/50	400,000.00	326,232.00
IRISH 1.7% 05/15/37	440,000.00	414,827.60
IRISH 1% 05/15/26	730,000.00	724,079.70
IRISH 2.4% 05/15/30	660,000.00	695,541.00

IRISH 2% 02/18/45	620,000.00	584,895.60
IRISH 3.4% 03/18/24	380,000.00	397,996.80
IRISH 5.4% 03/13/25	700,000.00	783,034.00
NETHER 0.25% 07/15/25	1,050,000.00	1,023,739.50
NETHER 0.25% 07/15/29	760,000.00	695,301.20
NETHER 0.5% 01/15/40	620,000.00	489,986.00
NETHER 0.5% 07/15/26	1,260,000.00	1,224,178.20
NETHER 0.5% 07/15/32	320,000.00	283,715.20
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	873,324.00
NETHER 0.75% 07/15/28	1,090,000.00	1,046,574.40
NETHER 0% 01/15/24	1,080,000.00	1,068,886.80
NETHER 0% 01/15/26	640,000.00	612,761.60
NETHER 0% 01/15/27	750,000.00	706,260.00
NETHER 0% 01/15/29	450,000.00	407,209.50
NETHER 0% 01/15/38	530,000.00	395,088.50
NETHER 0% 01/15/52	740,000.00	429,370.20
NETHER 0% 07/15/30	850,000.00	749,266.50
NETHER 0% 07/15/31	700,000.00	604,793.00
NETHER 1.75% 07/15/23	820,000.00	831,635.80
NETHER 2.5% 01/15/33	920,000.00	986,828.80
NETHER 2.75% 01/15/47	1,210,000.00	1,430,207.90
NETHER 2% 07/15/24	1,110,000.00	1,136,218.20
NETHER 3.75% 01/15/42	1,150,000.00	1,493,700.50
NETHER 4% 01/15/37	1,070,000.00	1,360,772.50
NETHER 5.5% 01/15/28	650,000.00	793,143.00
OBL 0% 04/05/24	1,880,000.00	1,856,556.40
OBL 0% 04/10/26	1,500,000.00	1,440,435.00
OBL 0% 04/11/25	1,420,000.00	1,382,909.60
OBL 0% 04/16/27	700,000.00	661,045.00
OBL 0% 10/09/26	630,000.00	600,093.90
OBL 0% 10/10/25	2,770,000.00	2,680,418.20
OBL 0% 10/18/24	1,390,000.00	1,361,908.10
RAGB 0.25% 10/20/36	360,000.00	276,930.00
RAGB 0.5% 02/20/29	810,000.00	750,594.60
RAGB 0.5% 04/20/27	650,000.00	622,264.50
RAGB 0.7% 04/20/71	200,000.00	106,584.00
RAGB 0.75% 02/20/28	730,000.00	699,077.20
RAGB 0.75% 03/20/51	360,000.00	251,629.20
RAGB 0.75% 10/20/26	900,000.00	877,860.00
RAGB 0.85% 06/30/20	200,000.00	87,610.00
RAGB 0.9% 02/20/32	370,000.00	335,886.00
RAGB 0% 02/20/30	660,000.00	576,912.60

RAGB 0% 02/20/31	720,000.00	612,914.40
RAGB 0% 04/20/25	370,000.00	358,641.00
RAGB 0% 07/15/23	650,000.00	646,698.00
RAGB 0% 07/15/24	660,000.00	648,601.80
RAGB 0% 10/20/40	330,000.00	221,565.30
RAGB 1.2% 10/20/25	640,000.00	641,619.20
RAGB 1.5% 02/20/47	490,000.00	432,400.50
RAGB 1.5% 11/02/86	200,000.00	141,728.00
RAGB 1.65% 10/21/24	560,000.00	569,990.40
RAGB 1.75% 10/20/23	750,000.00	762,945.00
RAGB 1.85% 05/23/49	220,000.00	205,900.20
RAGB 2.1% 09/20/17	360,000.00	306,367.20
RAGB 2.4% 05/23/34	530,000.00	552,127.50
RAGB 3.15% 06/20/44	420,000.00	499,560.60
RAGB 3.8% 01/26/62	220,000.00	307,914.20
RAGB 4.15% 03/15/37	920,000.00	1,162,604.00
RAGB 4.85% 03/15/26	590,000.00	671,201.70
RAGB 6.25% 07/15/27	540,000.00	669,951.00
RFGB 0.125% 04/15/36	270,000.00	207,011.70
RFGB 0.125% 04/15/52	210,000.00	118,305.60
RFGB 0.125% 09/15/31	370,000.00	315,295.50
RFGB 0.25% 09/15/40	210,000.00	150,750.60
RFGB 0.5% 04/15/26	600,000.00	581,994.00
RFGB 0.5% 04/15/43	180,000.00	128,975.40
RFGB 0.5% 09/15/27	380,000.00	361,463.60
RFGB 0.5% 09/15/28	290,000.00	270,819.40
RFGB 0.5% 09/15/29	290,000.00	266,686.90
RFGB 0.75% 04/15/31	270,000.00	246,742.20
RFGB 0.875% 09/15/25	300,000.00	296,820.00
RFGB 0% 09/15/23	150,000.00	149,212.50
RFGB 0% 09/15/24	360,000.00	352,609.20
RFGB 0% 09/15/30	400,000.00	345,112.00
RFGB 1.125% 04/15/34	270,000.00	244,139.40
RFGB 1.375% 04/15/47	250,000.00	216,505.00
RFGB 2.625% 07/04/42	350,000.00	375,081.00
RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	406,459.40
RFGB 2% 04/15/24	310,000.00	317,114.50
RFGB 4% 07/04/25	320,000.00	347,734.40
SPGB 0.1% 04/30/31	1,570,000.00	1,278,011.40
SPGB 0.25% 07/30/24	1,000,000.00	979,870.00
SPGB 0.35% 07/30/23	640,000.00	638,700.80
SPGB 0.5% 04/30/30	1,780,000.00	1,553,779.80
SPGB 0.5% 10/31/31	1,180,000.00	981,559.40

SPGB 0.6% 10/31/29	1,200,000.00	1,069,248.00	
SPGB 0.7% 04/30/32	1,140,000.00	952,071.00	
SPGB 0.8% 07/30/27	590,000.00	556,305.10	
SPGB 0.85% 07/30/37	640,000.00	477,625.60	
SPGB 0% 01/31/25	1,040,000.00	1,002,331.20	
SPGB 0% 01/31/26	1,070,000.00	1,004,804.90	
SPGB 0% 01/31/27	800,000.00	731,040.00	
SPGB 0% 01/31/28	1,080,000.00	962,895.60	
SPGB 0% 05/31/24	1,480,000.00	1,447,839.60	
SPGB 1.2% 10/31/40	950,000.00	708,434.00	
SPGB 1.25% 10/31/30	1,200,000.00	1,099,140.00	
SPGB 1.3% 10/31/26	1,460,000.00	1,431,208.80	
SPGB 1.4% 04/30/28	1,920,000.00	1,851,091.20	
SPGB 1.4% 07/30/28	780,000.00	749,548.80	
SPGB 1.45% 04/30/29	750,000.00	716,160.00	
SPGB 1.45% 10/31/27	1,330,000.00	1,292,241.30	
SPGB 1.45% 10/31/71	260,000.00	140,657.40	
SPGB 1.5% 04/30/27	1,460,000.00	1,431,296.40	
SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,254,500.00	
SPGB 1.85% 07/30/35	1,290,000.00	1,156,368.90	
SPGB 1.9% 10/31/52	420,000.00	311,430.00	
SPGB 1.95% 04/30/26	1,340,000.00	1,349,916.00	
SPGB 1.95% 07/30/30	1,350,000.00	1,312,942.50	
SPGB 1% 07/30/42	340,000.00	238,686.80	
SPGB 1% 10/31/50	1,040,000.00	627,941.60	
SPGB 2.15% 10/31/25	1,760,000.00	1,792,524.80	
SPGB 2.35% 07/30/33	1,090,000.00	1,057,430.80	
SPGB 2.7% 10/31/48	1,060,000.00	988,132.00	
SPGB 2.75% 10/31/24	1,560,000.00	1,615,395.60	
SPGB 2.9% 10/31/46	1,100,000.00	1,073,028.00	
SPGB 3.45% 07/30/66	900,000.00	902,475.00	
SPGB 3.8% 04/30/24	1,500,000.00	1,576,320.00	
SPGB 4.2% 01/31/37	1,310,000.00	1,528,783.10	
SPGB 4.4% 10/31/23	1,320,000.00	1,386,105.60	
SPGB 4.65% 07/30/25	1,410,000.00	1,542,540.00	
SPGB 4.7% 07/30/41	1,300,000.00	1,636,440.00	
SPGB 4.8% 01/31/24	1,150,000.00	1,221,599.00	
SPGB 4.9% 07/30/40	1,180,000.00	1,515,002.00	
SPGB 5.15% 10/31/28	1,100,000.00	1,298,121.00	
SPGB 5.15% 10/31/44	950,000.00	1,285,445.00	
SPGB 5.75% 07/30/32	1,450,000.00	1,867,266.50	
SPGB 5.9% 07/30/26	1,360,000.00	1,584,658.40	

	SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	2,921,684.50	
	ユーロ 小計	379,680,000.00	376,157,739.00 (53,617,524,117)	
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	780,000.00	731,515.20	
	UKT 0.125% 01/31/24	980,000.00	952,226.80	
	UKT 0.125% 01/31/28	1,320,000.00	1,187,709.60	
	UKT 0.25% 01/31/25	710,000.00	677,482.00	
	UKT 0.25% 07/31/31	1,890,000.00	1,573,443.90	
	UKT 0.375% 10/22/26	970,000.00	903,564.70	
	UKT 0.375% 10/22/30	1,090,000.00	941,258.60	
	UKT 0.5% 01/31/29	480,000.00	431,452.80	
	UKT 0.5% 10/22/61	730,000.00	388,323.50	
	UKT 0.625% 06/07/25	1,160,000.00	1,117,822.40	
	UKT 0.625% 07/31/35	1,390,000.00	1,098,475.30	
	UKT 0.625% 10/22/50	670,000.00	419,232.40	
	UKT 0.75% 07/22/23	860,000.00	850,488.40	
	UKT 0.875% 01/31/46	400,000.00	282,568.00	
	UKT 0.875% 07/31/33	400,000.00	340,796.00	
	UKT 0.875% 10/22/29	820,000.00	751,407.00	
	UKT 1.125% 01/31/39	500,000.00	404,155.00	
	UKT 1.125% 10/22/73	220,000.00	145,747.80	
	UKT 1.25% 07/22/27	740,000.00	714,692.00	
	UKT 1.25% 07/31/51	450,000.00	334,971.00	
	UKT 1.25% 10/22/41	1,440,000.00	1,155,960.00	
	UKT 1.5% 07/22/26	440,000.00	432,559.60	
	UKT 1.5% 07/22/47	1,010,000.00	818,372.70	
	UKT 1.5% 07/31/53	260,000.00	206,268.40	
	UKT 1.625% 10/22/28	480,000.00	469,171.20	
	UKT 1.625% 10/22/54	720,000.00	587,491.20	
	UKT 1.625% 10/22/71	710,000.00	575,078.70	
	UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	511,938.00	
	UKT 1.75% 07/22/57	1,050,000.00	887,050.50	
	UKT 1.75% 09/07/37	1,110,000.00	1,000,731.60	
	UKT 1% 04/22/24	1,450,000.00	1,427,829.50	
	UKT 2.25% 09/07/23	1,160,000.00	1,165,394.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	860,000.00	902,114.20	
	UKT 2.75% 09/07/24	980,000.00	997,257.80	
UKT 2% 09/07/25	1,090,000.00	1,092,507.00		
UKT 3.25% 01/22/44	1,240,000.00	1,382,463.60		
UKT 3.5% 01/22/45	1,230,000.00	1,427,685.60		
UKT 3.5% 07/22/68	910,000.00	1,212,429.40		
UKT 3.75% 07/22/52	800,000.00	1,015,688.00		
UKT 4.25% 03/07/36	790,000.00	951,989.50		

	UKT 4.25% 06/07/32	1,070,000.00	1,253,055.60	
	UKT 4.25% 09/07/39	670,000.00	830,511.90	
	UKT 4.25% 12/07/27	750,000.00	836,535.00	
	UKT 4.25% 12/07/40	790,000.00	987,910.80	
	UKT 4.25% 12/07/46	910,000.00	1,192,027.20	
	UKT 4.25% 12/07/49	810,000.00	1,086,882.30	
	UKT 4.25% 12/07/55	990,000.00	1,401,087.60	
	UKT 4.5% 09/07/34	780,000.00	948,324.00	
	UKT 4.5% 12/07/42	1,120,000.00	1,466,528.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	850,000.00	1,020,042.50	
	UKT 4.75% 12/07/38	880,000.00	1,145,214.40	
	UKT 4% 01/22/60	780,000.00	1,097,202.60	
	UKT 5% 03/07/25	600,000.00	648,252.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	570,000.00	705,973.50	
	イギリスポンド 小計	46,460,000.00	47,086,860.30 (7,896,937,340)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	3,150,000.00	2,712,528.00	
	SGB 0.75% 05/12/28	3,590,000.00	3,378,118.20	
	SGB 0.75% 11/12/29	3,840,000.00	3,555,993.60	
	SGB 1.5% 11/13/23	6,100,000.00	6,108,906.00	
	SGB 1% 11/12/26	4,940,000.00	4,774,707.60	
	SGB 2.25% 06/01/32	2,560,000.00	2,661,222.40	
	SGB 2.5% 05/12/25	4,430,000.00	4,524,447.60	
	SGB 3.5% 03/30/39	2,610,000.00	3,173,942.70	
	スウェーデンクローナ 小計	31,220,000.00	30,889,866.10 (417,939,888)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	2,120,000.00	1,825,298.80	
	NGB 1.375% 08/19/30	3,280,000.00	2,902,045.60	
	NGB 1.5% 02/19/26	3,110,000.00	2,959,631.50	
	NGB 1.75% 02/17/27	2,790,000.00	2,646,649.80	
	NGB 1.75% 03/13/25	3,120,000.00	3,033,045.60	
	NGB 1.75% 09/06/29	2,470,000.00	2,273,289.20	
	NGB 2.125% 05/18/32	1,520,000.00	1,405,346.40	
	NGB 2% 04/26/28	2,510,000.00	2,381,437.80	
	NGB 3% 03/14/24	3,630,000.00	3,657,696.90	
	ノルウェークローネ 小計	24,550,000.00	23,084,441.60 (322,720,493)	
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	2,880,000.00	1,794,902.40	
	DGB 0.5% 11/15/27	4,350,000.00	4,113,229.50	
	DGB 0.5% 11/15/29	5,650,000.00	5,193,988.50	
	DGB 0% 11/15/24	740,000.00	720,353.00	
	DGB 0% 11/15/31	3,170,000.00	2,685,402.10	

	DGB 1.5% 11/15/23	4,170,000.00	4,221,457.80	
	DGB 1.75% 11/15/25	2,610,000.00	2,650,428.90	
	DGB 4.5% 11/15/39	6,700,000.00	9,247,541.00	
デンマーククローネ 小計		30,270,000.00	30,627,303.20	(586,819,129)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,430,000.00	1,073,229.30	
	POLGB 0.75% 04/25/25	720,000.00	609,818.40	
	POLGB 1.25% 10/25/30	1,760,000.00	1,147,977.60	
	POLGB 1.75% 04/25/32	470,000.00	300,433.40	
	POLGB 2.25% 10/25/24	2,470,000.00	2,232,731.80	
	POLGB 2.5% 04/25/24	1,880,000.00	1,740,240.80	
	POLGB 2.5% 07/25/26	3,600,000.00	3,021,012.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	2,010,000.00	1,618,854.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,190,000.00	1,753,817.70	
	POLGB 2.75% 10/25/29	3,410,000.00	2,611,787.20	
	POLGB 3.25% 07/25/25	2,470,000.00	2,215,738.20	
	POLGB 4% 10/25/23	1,890,000.00	1,827,800.10	
	POLGB 5.75% 04/25/29	900,000.00	848,385.00	
	ポーランドズロチ 小計		25,200,000.00	21,001,825.50
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	1,520,000.00	1,425,015.20	
	ACGB 0.25% 11/21/25	1,340,000.00	1,211,159.00	
	ACGB 0.5% 09/21/26	780,000.00	693,739.80	
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,140,000.00	914,770.20	
	ACGB 1.5% 06/21/31	1,190,000.00	997,124.80	
	ACGB 1.75% 06/21/51	990,000.00	618,314.40	
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,380,000.00	1,153,376.40	
	ACGB 1% 11/21/31	1,810,000.00	1,432,886.50	
	ACGB 1% 12/21/30	1,480,000.00	1,199,214.40	
	ACGB 2.25% 05/21/28	630,000.00	589,944.60	
	ACGB 2.5% 05/21/30	1,320,000.00	1,222,874.40	
	ACGB 2.75% 04/21/24	680,000.00	679,986.40	
	ACGB 2.75% 05/21/41	810,000.00	682,603.20	
	ACGB 2.75% 06/21/35	630,000.00	564,341.40	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,160,000.00	1,123,413.60	
	ACGB 2.75% 11/21/28	770,000.00	737,921.80	
	ACGB 2.75% 11/21/29	940,000.00	891,054.20	
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,250,000.00	1,255,112.50	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,180,000.00	1,161,603.80	
	ACGB 3.25% 06/21/39	650,000.00	599,423.50	
ACGB 3.75% 04/21/37	660,000.00	654,376.80		
ACGB 3% 03/21/47	730,000.00	619,791.90		
ACGB 3% 11/21/33	810,000.00	758,629.80		

	ACGB 4.25% 04/21/26	1,200,000.00	1,242,588.00	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,040,000.00	1,118,031.20	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,080,000.00	1,148,407.20	
オーストラリアドル 小計		27,170,000.00	24,695,705.00 (2,350,784,158)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	210,000.00	196,083.30	
	SIGB 1.25% 11/01/26	90,000.00	84,852.90	
	SIGB 1.625% 07/01/31	200,000.00	179,624.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	390,000.00	315,837.60	
	SIGB 1.875% 10/01/51	150,000.00	122,725.50	
	SIGB 2.125% 06/01/26	670,000.00	657,437.50	
	SIGB 2.25% 08/01/36	440,000.00	400,417.60	
	SIGB 2.375% 06/01/25	500,000.00	498,320.00	
	SIGB 2.375% 07/01/39	230,000.00	210,091.20	
	SIGB 2.625% 05/01/28	280,000.00	278,146.40	
	SIGB 2.75% 03/01/46	420,000.00	403,263.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	300,000.00	287,508.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	540,000.00	543,704.40	
	SIGB 2.875% 07/01/29	560,000.00	561,674.40	
	SIGB 2.875% 09/01/30	460,000.00	458,661.40	
	SIGB 2% 02/01/24	270,000.00	269,181.90	
	SIGB 3.375% 09/01/33	420,000.00	434,788.20	
	SIGB 3.5% 03/01/27	530,000.00	549,122.40	
	SIGB 3% 09/01/24	510,000.00	516,834.00	
	シンガポールドル 小計		7,170,000.00	6,968,273.70 (676,967,789)
マレーシア リンギット	MGS 3.478% 06/14/24	200,000.00	200,762.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	920,000.00	906,016.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	560,000.00	552,384.00	
	MGS 3.757% 05/22/40	1,110,000.00	983,826.30	
	MGS 3.8% 08/17/23	550,000.00	556,616.50	
	MGS 3.828% 07/05/34	250,000.00	234,515.00	
	MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	821,687.00	
	MGS 3.882% 03/14/25	690,000.00	697,603.80	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,890,000.00	1,861,404.30	
	MGS 3.892% 03/15/27	300,000.00	300,975.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,960,000.00	1,963,234.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	1,140,000.00	1,148,094.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	750,000.00	755,280.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	1,030,000.00	1,041,948.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,060,000.00	1,078,168.40	
	MGS 4.065% 06/15/50	740,000.00	645,383.60	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,180,000.00	1,199,706.00	



	MGS 4.232% 06/30/31	850,000.00	852,601.00
	MGS 4.254% 05/31/35	1,270,000.00	1,236,383.10
	MGS 4.392% 04/15/26	1,160,000.00	1,188,895.60
	MGS 4.498% 04/15/30	1,260,000.00	1,286,560.80
	MGS 4.642% 11/07/33	1,160,000.00	1,183,675.60
	MGS 4.736% 03/15/46	640,000.00	625,945.60
	MGS 4.762% 04/07/37	1,160,000.00	1,183,060.80
	MGS 4.893% 06/08/38	940,000.00	964,317.80
	MGS 4.921% 07/06/48	1,450,000.00	1,448,883.50
	MGS 4.935% 09/30/43	530,000.00	536,577.30
マレーシアリングット 小計		25,610,000.00	25,454,505.00 (776,672,947)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	1,700,000.00	1,672,299.35
	ILGOV 0.5% 02/27/26	490,000.00	453,471.82
	ILGOV 0.5% 04/30/25	660,000.00	624,805.30
	ILGOV 1.3% 04/30/32	250,000.00	214,501.02
	ILGOV 1.5% 05/31/37	930,000.00	728,691.27
	ILGOV 1.5% 11/30/23	720,000.00	720,726.91
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,040,000.00	1,023,652.76
	ILGOV 1% 03/31/30	1,480,000.00	1,289,753.10
	ILGOV 2.25% 09/28/28	1,070,000.00	1,037,636.88
	ILGOV 2% 03/31/27	1,240,000.00	1,203,059.90
	ILGOV 3.75% 03/31/24	1,560,000.00	1,606,028.58
	ILGOV 3.75% 03/31/47	1,520,000.00	1,554,968.36
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,130,000.00	1,456,525.93
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,550,000.00	1,776,743.76
イスラエルシェケル 小計		15,340,000.00	15,362,864.94 (613,096,605)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	14,410,000.00	14,246,878.80
	CGB 2.28% 03/17/24	5,100,000.00	5,104,335.00
	CGB 2.47% 09/02/24	9,290,000.00	9,326,974.20
	CGB 2.48% 04/15/27	13,270,000.00	13,229,924.60
	CGB 2.56% 10/21/23	14,620,000.00	14,698,070.80
	CGB 2.68% 05/21/30	6,850,000.00	6,776,499.50
	CGB 2.69% 08/12/26	8,220,000.00	8,266,278.60
	CGB 2.8% 03/24/29	3,270,000.00	3,276,638.10
	CGB 2.84% 04/08/24	6,020,000.00	6,085,377.20
	CGB 2.85% 06/04/27	6,010,000.00	6,076,110.00
	CGB 2.89% 11/18/31	2,620,000.00	2,633,650.20
	CGB 2.91% 10/14/28	14,300,000.00	14,440,426.00
	CGB 3.01% 05/13/28	3,750,000.00	3,812,737.50
	CGB 3.02% 05/27/31	7,400,000.00	7,509,742.00

	CGB 3.03% 03/11/26	15,210,000.00	15,497,621.10	
	CGB 3.27% 11/19/30	3,430,000.00	3,553,788.70	
	CGB 3.28% 12/03/27	2,630,000.00	2,717,500.10	
	CGB 3.39% 03/16/50	2,760,000.00	2,786,772.00	
	CGB 3.53% 10/18/51	1,390,000.00	1,446,211.60	
	CGB 3.72% 04/12/51	3,150,000.00	3,373,587.00	
	CGB 3.81% 09/14/50	3,730,000.00	4,051,675.20	
	CGB 3.86% 07/22/49	2,890,000.00	3,158,654.40	
	CGB 4.08% 10/22/48	2,030,000.00	2,296,599.90	
	オフショア人民元 小計	152,350,000.00	154,366,052.50 (3,093,773,550)	
	合計		152,280,471,329 (152,280,471,329)	

## 有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 195銘柄	100.0%	50.5%
カナダドル	国債証券 33銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 335銘柄	100.0%	35.2%
イギリスポンド	国債証券 54銘柄	100.0%	5.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 27銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券 23銘柄	100.0%	2.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 2【ファンドの現況】

## 【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

## 【純資産額計算書】

(2022年 6月30日現在)

資産総額	3,782,083,826円
負債総額	1,424,180円
純資産総額( - )	3,780,659,646円
発行済口数	1,790,485,480口
1口当たり純資産額( / )	2.1115円
(1万口当たり純資産額)	(21,115円)

(参考)

## 日本株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 6月30日現在)

資産総額	295,379,310,442円
負債総額	3,577,131,154円
純資産総額( - )	291,802,179,288円
発行済口数	136,017,335,153口
1口当たり純資産額( / )	2.1453円
(1万口当たり純資産額)	(21,453円)

## 外国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 6月30日現在)

資産総額	331,056,103,076円
負債総額	271,521,062円
純資産総額( - )	330,784,582,014円
発行済口数	74,789,739,923口
1口当たり純資産額( / )	4.4229円
(1万口当たり純資産額)	(44,229円)

## 外国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 6月30日現在)

資産総額	158,054,497,116円
負債総額	119,553,843円
純資産総額（ - ）	157,934,943,273円
発行済口数	57,680,072,853口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7381円
（1万口当たり純資産額）	（27,381円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

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

## 受益権の譲渡

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

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

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

## 受益権の譲渡の対抗要件

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

## 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2022年6月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ DO（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2022年 9月 9日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年6月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	540	13,694,779
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	71	226,954
単位型公社債投資信託	51	220,516
合計	662	14,142,249

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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



- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位: 百万円)	
	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,589	21,675
金銭の信託	10,857	14,913
前払費用	397	166
未収委託者報酬	8,471	9,067
未収運用受託報酬	6,151	6,252
未収収益	177	179
その他	3,428	4,891
流動資産合計	51,072	57,146
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 301	1 289
器具備品	1 692	1 687
その他	1 0	1 -
有形固定資産合計	993	976
無形固定資産		
ソフトウェア	4,104	6,292
その他	41	31
無形固定資産合計	4,145	6,324
投資その他の資産		
投資有価証券	9,950	6,607
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	311	907
その他	39	31
投資その他の資産合計	15,937	13,182
固定資産合計	21,077	20,482
資産合計	72,149	77,629

(単位: 百万円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	44	47
未払金	7,572	8,285
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,154	4,561
その他未払金	3,417	3,723
未払費用	1,046	1,049
未払法人税等	517	504
賞与引当金	556	578
その他	818	1,958
流動負債合計	10,555	12,423
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	626	820
資産除去債務	133	153
その他	8	12
固定負債合計	768	986
負債合計	11,324	13,410
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
<b>資本剰余金</b>		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	500	500
<b>その他利益剰余金</b>		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	38,258	41,948
利益剰余金合計	40,858	44,548
株主資本合計	60,098	63,788
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	791	941
繰延ヘッジ損益	65	509
評価・換算差額等合計	726	431
純資産合計	60,824	64,219
負債・純資産合計	72,149	77,629

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	37,224	41,730
運用受託報酬	10,982	11,883
その他営業収益	403	390
営業収益合計	48,611	54,004
営業費用		
支払手数料	17,936	20,567
広告宣伝費	203	286
調査費	5,064	5,567
調査費	898	1,062
委託調査費	4,154	4,487
図書費	11	17
営業雑経費	4,492	5,201
通信費	56	68
印刷費	449	454
協会費	58	55
諸会費	18	35
情報機器関連費	3,815	4,473
その他営業雑経費	93	112
営業費用合計	27,696	31,622
一般管理費		
給料	5,976	6,295
役員報酬	214	249
給料・手当	4,861	5,072
賞与	901	972
退職給付費用	170	254
福利費	608	632
交際費	1	3
旅費交通費	13	20
租税公課	315	327
不動産賃借料	276	323
寄付金	3	5
減価償却費	748	989
業務委託費	966	1,081
諸経費	848	1,301
一般管理費合計	9,929	11,234
営業利益	10,984	11,147

（単位：百万円）

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

営業外収益		
受取利息	2	2
収益分配金	101	16
金銭の信託運用益	3,038	-
投資有価証券売却益	1	0
投資有価証券償還益	54	219
その他	45	8
営業外収益合計	3,243	247
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	332
投資有価証券売却損	0	0
投資有価証券償還損	0	-
為替差損	158	291
デリバティブ費用	3,782	1,191
その他	5	33
営業外費用合計	3,946	1,848
経常利益	10,281	9,545
特別損失		
退職給付費用	-	120
システム統合費用	110	-
特別損失合計	110	120
税引前当期純利益	10,170	9,425
法人税、住民税及び事業税	3,242	3,403
法人税等調整額	65	465
法人税等合計	3,177	2,937
当期純利益	6,993	6,487

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金			株主資本合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計
		別途積立金	繰越利益 剰余金		

当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	-	3,136	3,330	3,330
当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	587	284	302	56,464
当期変動額				
剰余金の配当				3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,379	349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	349	1,029	4,360
当期末残高	791	65	726	60,824

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	

当期首残高	791	65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	444	295	295
当期変動額合計	149	444	295	3,394
当期末残高	941	509	431	64,219

## 注記事項

### （重要な会計方針）

#### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

##### （1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

##### （2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

#### 2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

#### 3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

#### 4．固定資産の減価償却の方法

##### （1）有形固定資産

定額法によっております。

##### （2）無形固定資産

定額法によっております。

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

#### 5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

#### 6．引当金の計上基準

##### （1）賞与引当金

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

##### （2）退職給付引当金

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

過去勤務費用           ：発生事業年度に損益処理

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

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

#### 7．収益及び費用の計上基準

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

##### （1）投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応

じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(3) 投資助言業務

当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(4) 成功報酬

当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、翌事業年度より、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月21日）を適用する予定であります。

(会計方針の変更)

1. 「収益認識に関する会計基準」等の適用

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

2. 「時価の算定に関する会計基準」等の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日）第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載していません。

（未適用の会計基準等）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）

（1）概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

（2）適用予定日

2023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

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」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、

（追加情報）

退職給付債務及び費用の算定方法の変更

従来、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る事業年度末の自己都合要支給額を退職給付とする方法を用いた簡便法を適用しておりましたが、対象となる従業員数の増加に伴い、当事業年度より原則法による計算を併用しております。これにより、退職給付引当金が120百万円増加し、同額を退職給付費用として特別損失に計上しております。

なお、退職給付見込額の各期間への帰属方法などについては、「重要な会計方針6．引当金の計上基準（2）退職給付引当金」をご参照ください。

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
建 物	106	百万円	146	百万円
器具備品	391	〃	535	〃
そ の 他	4	〃	-	〃
計	503	〃	681	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31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	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3．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(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

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



決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	配当金の原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,797	利益剰余金	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

#### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

#### 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

#### 3. 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(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

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

2022年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

#### 1. 金融商品の状況に関する事項

##### （1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

##### （2）金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。

これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針 8 . ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

#### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

#### 資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

## 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日。以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した投資信託、市場価格のない株式等及び、時価算定適用指針第27項に従い経過措置を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）\*2、\*3及び（注2）参照）。

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

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

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

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

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

### (1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）（*1）
金銭の信託	10,857
投資有価証券 その他有価証券	9,950
デリバティブ取引（*2）	
ヘッジ会計が適用されていないもの	(357)
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)
デリバティブ取引計	(431)

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2022年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1、*2）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*3)	-	196	-	196
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(1,333)	(80)	-	(1,413)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(71)	-	(71)
デリバティブ取引計	(1,333)	(151)	-	(1,485)

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 投資有価証券のうち、投資信託（貸借対照表計上額6,474百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額133百万円）は上記に含めておりません。

(\*3) 金銭の信託の信託財産のうち、投資信託（貸借対照表計上額13,876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額840百万円）は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,913百万円であります。

(\*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

#### 金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

#### デリバティブ取引

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2021年3月31日）

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,589	-	-	-
未収委託者報酬	8,471	-	-	-
未収運用受託報酬	6,151	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	10	5,751	0

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,675	-	-	-
未収委託者報酬	9,067	-	-	-
未収運用受託報酬	6,252	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	108	1,712	0

（有価証券関係）

## 1．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636

## 2．その他有価証券

前事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9	10	1
小計	9	10	1
合計	9,950	8,809	1,141

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,585	1,711	126
小計	1,585	1,711	126
合計	6,474	5,115	1,358

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

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
非上場株式	0	0
組合出資金等		133

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	109	1	0

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2021年3月31日）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	2,889	-	41	41
	英ポンド	128	-	0	0
	カナダドル	21	-	0	0
	スイスフラン	51	-	0	0
	香港ドル	128	-	1	1
	ユーロ	246	-	0	0
	買建				
	米ドル	99	-	1	1
	香港ドル	2	-	0	0
合計		3,567	-	41	41

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## (2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	13,711	-	315	315
合計		13,711	-	315	315

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式				
	米ドル		3,993	-	57	
	英ポンド		3,108	-	15	
	カナダドル		3	-	0	
	スイスフラン		57	-	0	
	香港ドル		110	-	1	
	ユーロ		108	-	0	
	人民元		6	-	0	
	買建					
	米ドル		38	-	0	
	香港ドル		3	-	0	
	人民元		1	-	0	
	合計		7,431	-	73	

当事業年度（2022年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)	
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,498	-	54	
	英ポンド	277	-	1	
	カナダドル	111	-	1	
	スイスフラン	139	-	2	
	香港ドル	190	-	1	
	ユーロ	676	-	18	
	買建				
	ユーロ	21	-	0	
	合計	6,915	-	80	80

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	17,197	-	1,333
合計	17,197	-	1,333	1,333

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
--------------	----	---------	---------------	-------------------------	-------------

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		4,422	-	43
	英ポンド		3,297	-	21
	スイスフラン		79	-	1
	香港ドル		119	-	1
	ユーロ		125	-	3
	人民元		13	-	0
	合計		8,057	-	71

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。当社が有する退職一時金制度は従来簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しておりましたが、当事業年度より原則法と簡便法の併用により、これら計算を行っておりません。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
退職給付債務の期首残高	600	626
勤務費用	-	124
利息費用	-	2
転籍者受入	18	-
退職給付の支払額	69	81
簡便法で計算した退職給付費用	77	8
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	120
その他	-	18
退職給付債務の期末残高	626	820

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

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

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	626	820
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626	820
退職給付引当金	626	820
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626	820

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
勤務費用	-	124
利息費用	-	2
簡便法で計算した退職給付費用	77	8

簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	120
その他	-	18
確定給付制度に係る退職給付費用	77	274

(5) 年金資産に関する事項  
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
割引率	-	0.4%

### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度92百万円、当事業年度100百万円であります。

(税効果会計関係)

#### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	107 百万円	112 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	170 "	177 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	191 "	251 "
税務上の収益認識差額	71 "	74 "
税務上の費用認識差額	-	439
繰延ヘッジ損益	28 "	224 "
その他	123 "	76 "
繰延税金資産 合計	693 "	1,357 "
繰延税金負債		
有価証券評価差額	349 "	415 "
その他	32 "	34 "
繰延税金負債 合計	382 "	450 "
繰延税金資産の純額	311 "	907 "

#### 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

#### 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

#### 2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

#### 3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報  
重要性が乏しいため記載を省略しております。



## （セグメント情報等）

## 〔セグメント情報〕

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

## 〔関連情報〕

## 1．製品及びサービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,372百万円

(\*)当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載しております。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,395百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395百万円

(\*)当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載しております。

## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

## （関連当事者情報）

## 1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,365	未収運用受託報酬	5,402
							投信販売代行手数料等	9,124	未払手数料	1,888

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

## 運用受託報酬

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

## 投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

## 運用受託報酬

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

## 投信販売代行手数料等

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

## (エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

前事業年度（2021年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2022年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

## (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1株当たり純資産額	20,274,967円09銭	21,406,512円22銭
1株当たり当期純利益金額	2,331,221円85銭	2,162,405円20銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

(重要な後発事象)

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。

##### (1)自己又はその役員との取引

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

##### (2)運用財産相互間の取引

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

##### (3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

##### (4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

##### (5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

## 5【その他】

## (1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

## (2)訴訟事件その他の重要事項

2022年 9月 9日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1)受託会社

名称 : 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 : 342,037百万円（2022年3月末日現在）

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

## (2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2022年3月末日現在）	事業の内容
野村證券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

## (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

## (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

## (1)受託会社

該当事項はありません。

## (2)販売会社

該当事項はありません。

## (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2022年3月末日現在）

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する

る法律に基づき信託業務を営んでいます。

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

### 第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

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

**独立監査人の監査報告書**

2022年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2022年8月23日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル・インデックス・バランス・ファンドの2021年6月11日から2022年6月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル・インデックス・バランス・ファンドの2022年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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



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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。