

## 【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】	2024年3月12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】	上坪 直樹
【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】

2024年 3月13日から2024年 9月10日までとします。

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

### （８）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（ 9 ）【払込期日】

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

（ 10 ）【払込取扱場所】

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

（ 11 ）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ）【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、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金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。

以下同じ。)における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付けを中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### <ファンドの目的>

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

###### <信託金限度額>

上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

###### <基本的性格>

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

##### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### 属性区分表

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

株式 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
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回  年4回  年6回 (隔月)  年12回 (毎月)	日本  北米  欧州  アジア	ファン ド・オブ・ファ ンズ	なし	TOPIX  その他 ( )	条件付運用型  ロング・ ショート型/ 絶対収益追求 型  その他 ( )
不動産投信	日々	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。

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

< ファンドの特色 >

## ● 国内外の株式及び外国の公社債に分散投資します。

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

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

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

### <投資対象とするマザーファンド>

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

## ● 3つの資産への均等配分を基本配分比率とします。

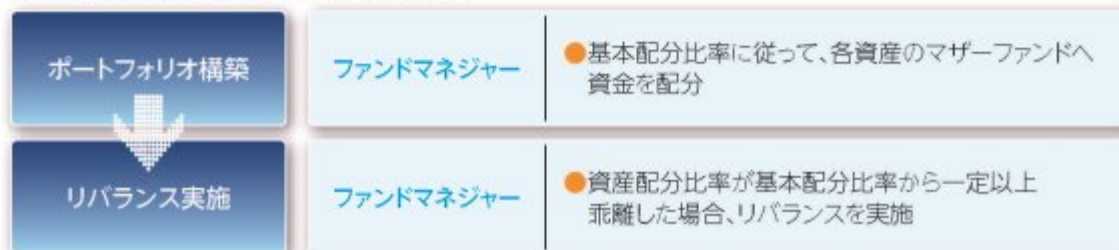
### 基本配分比率



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

### ポートフォリオ構築プロセス

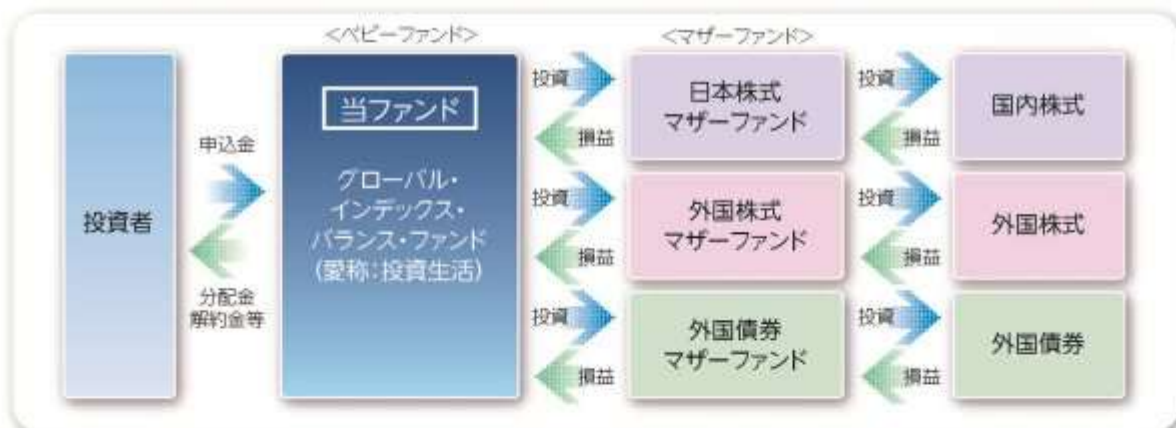
ファンドマネジャーは基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

## ● ファンドの仕組み

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



## ● 主な投資制限

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

## ● 分配方針

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

ただし、分配を行わないことがあります。

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

### ◆各マザーファンドが対象とする指数は次のとおりです。

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

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

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

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

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

「MSCIコクサイ・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。

MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.はMSCIコクサイ・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

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

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

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

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

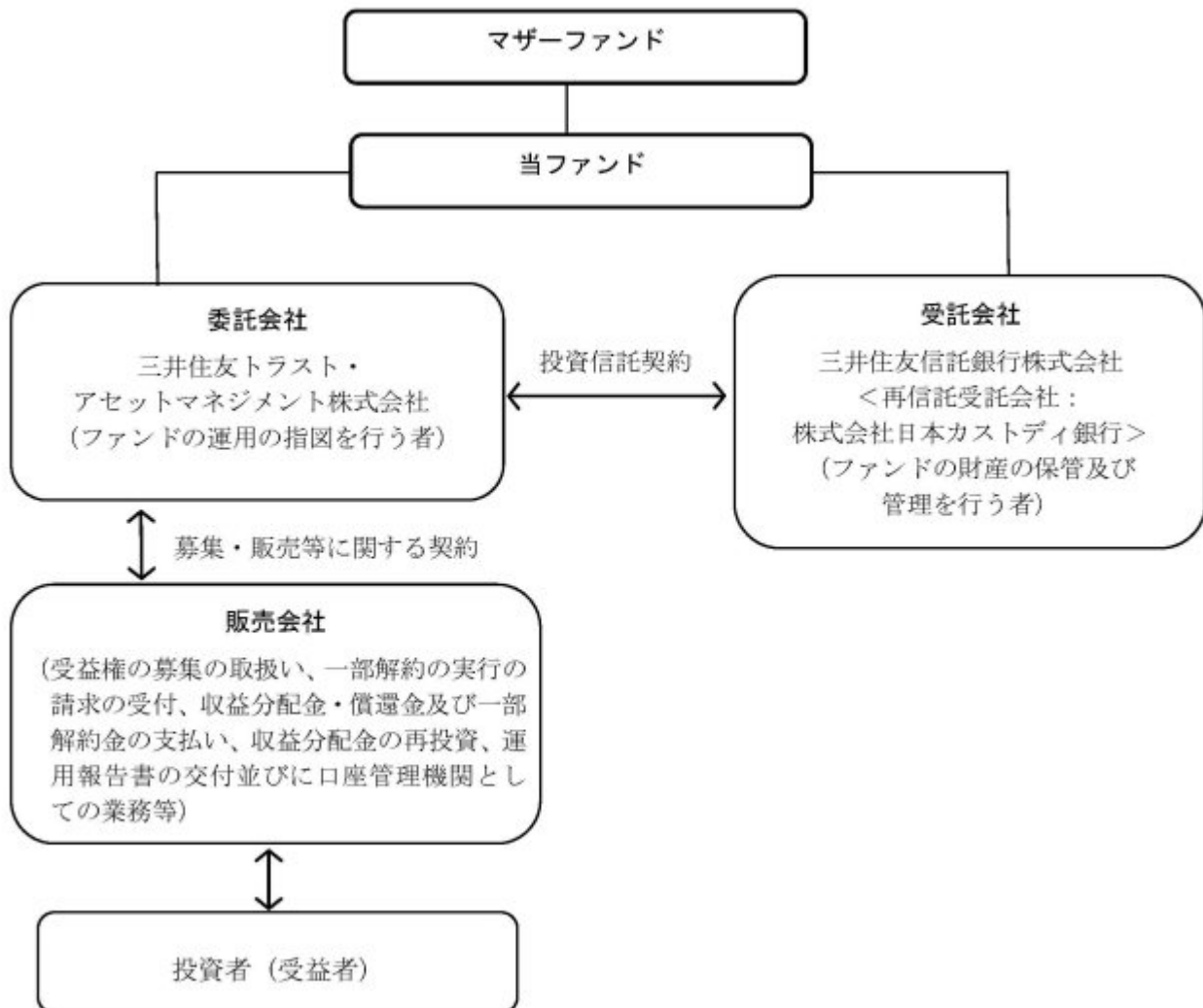
## (2) 【ファンドの沿革】

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

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

### (3)【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2023年12月29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。
- E．信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び債券先物取引等を活用することがあります。このため、株式及び債券の組入総額と株価指数先物取引及び債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- F．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- G．ただし、資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
- H．信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- I．信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。





17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
  19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  22. 外国の者に対する権利で上記21.の有価証券の性質を有するもの
- なお、上記1.の証券又は証券並びに上記12.及び17.の証券又は証券のうち上記1.の証券又は証券の性質を有するものを以下「株式」といい、上記2.から6.までの証券並びに上記12.及び17.の証券又は証券のうち上記2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記13.の証券及び上記14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 運用指図できる金融商品

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

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

#### B. 金融商品による運用の特例

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

### (参考)マザーファンドの概要

#### 「日本株式マザーファンド」の概要

##### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

##### 2. 運用方法

###### (1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

###### (2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

### 3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

### 「外国株式マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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



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

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

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

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

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

### 3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

## 「外国債券マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

## （２）投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

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

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

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

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

## ３．投資制限

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

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

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## （３）【運用体制】

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



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

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

#### (4) 【分配方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

### <約款に定める投資制限>

#### A．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

#### B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

#### C．新株引受権証券等への投資割合

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

#### D．同一銘柄の株式への投資割合

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

#### E．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

#### F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

#### G．投資信託証券への投資割合

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

#### H．投資する株式等の範囲

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

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

#### I．信用取引の指図範囲

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

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

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

#### J．先物取引等の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を

保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

- ．委託会社は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ハ．委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- K．スワップ取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。
- ．スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- L．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ．金利先渡取引及び為替先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- M．有価証券の貸付の指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の a．及び b．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
- a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- b．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ． a．及び b．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- N．公社債の空売りの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下

記O.の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができますものとしします。

□.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□.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します。

#### O. 公社債の借入れの指図及び範囲

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

□.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□.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します。

ニ.上記イ.の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

#### P. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### Q. 外国為替予約取引の指図

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に係る外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

#### R. 一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

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

#### S. 再投資の指図

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

#### T. 資金の借入れ

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

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

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

二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

U．受託会社による資金の立替え

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

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

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

V．利害関係人等との取引等

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

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

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

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

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

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生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

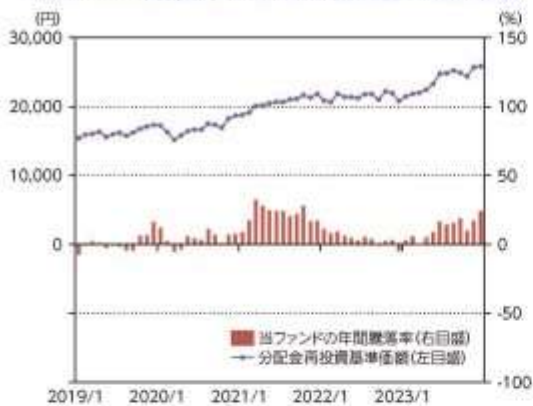
## （２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

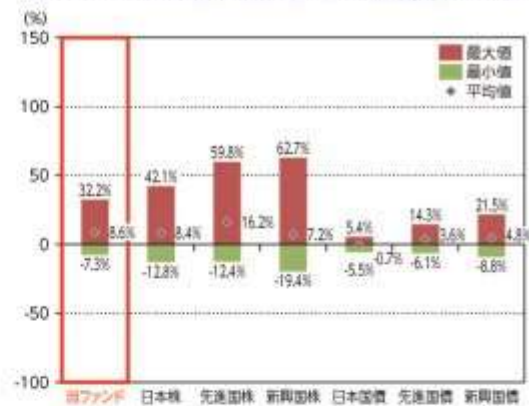
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*2019年1月～2023年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

## 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数) (償当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPXが算出・公表する指数で、日本の株式市場を広くに網羅するとともに、投資対象としての多様性を有するマーケットベンチマークで、連動ベースの時価総額加重方式により算出されます。「償当込み」指数は、配当利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指数値に算入標準又は指標として、株式会社JPXが算出した株式会社の業績会社(以下「JPX会社」といふ。)の当期の決算(前年度の決算)の算出の算出、算出値の公表、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存する標準又は指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。本指数は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本指数の提供、販売及び販売促進活動に際してはかかる責任を負いません。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 (償当込み、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「償当込み」指数は、配当利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マーキング・マーケット・インデックス(償当込み、円ベース)	MSCIマーキング・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「償当込み」指数は、配当利益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリーリサーチ・コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募債定期付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリーリサーチ・コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリーリサーチ・コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (償当込み、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのインデクサーではなく、本ファンドの相対、競争あるいは他資産価値を付けておりません。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抄し、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、遅延又は中断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の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 Fidelity Emerging Markets Bond Index (償当込み、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していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの許可による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

ありません。

## (2) 【換金(解約)手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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す（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

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

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2024年1月1日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

### ●（参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率①+②	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.68%	0.66%	0.02%

※対象期間は2022年6月11日～2023年6月12日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、購入時手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した値（年率）です。

※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

## 5【運用状況】

以下は、2023年12月29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	4,405,400,823	99.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		17,735,399	0.40
合計(純資産総額)		4,423,136,222	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	257,064,224	5.1491	1,323,649,396	5.8311	1,498,967,196	33.89
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	498,354,595	2.7494	1,370,176,124	2.9299	1,460,129,127	33.01
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	512,855,750	2.6366	1,352,195,471	2.8201	1,446,304,500	32.70

(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
第16期計算期間末	(2023年 6月12日)	4,249,557,428	4,249,557,428	23,676	23,676

2022年12月末日	3,730,071,526		20,714
2023年 1月末日	3,852,995,715		21,350
2月末日	3,918,538,524		21,740
3月末日	3,953,005,997		21,906
4月末日	4,030,635,880		22,348
5月末日	4,152,950,052		23,148
6月末日	4,398,793,065		24,650
7月末日	4,375,293,017		24,704
8月末日	4,445,785,207		25,095
9月末日	4,355,004,014		24,797
10月末日	4,265,281,583		24,249
11月末日	4,463,220,882		25,586
12月末日	4,423,136,222		25,717

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
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
第16期計算期間	2022年 6月11日～2023年 6月12日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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
第16期計算期間	2022年 6月11日～2023年 6月12日	9.7
第17期中間計算期間	2023年 6月13日～2023年12月12日	7.6

(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
第16期計算期間	2022年 6月11日～2023年 6月12日	76,767,682	73,076,833	1,794,883,011
第17期中間計算期間	2023年 6月13日～2023年12月12日	31,226,581	84,852,880	1,741,256,712

(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	368,223,822,160	98.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,620,530,152	1.24
合計(純資産総額)		372,844,352,312	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	4,590,040,000	1.23

(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	6,019,000	1,901.40	11,444,573,621	2,590.50	15,592,219,500	4.18
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	775,400	11,495.71	8,913,779,389	13,410.00	10,398,114,000	2.79
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,576,200	940.87	6,187,349,294	1,211.50	7,967,066,300	2.14



日本	株式	キーエンス	電気機器	109,700	58,526.01	6,420,303,859	62,120.00	6,814,564,000	1.83
日本	株式	信越化学工業	化学	995,700	3,546.74	3,531,492,545	5,917.00	5,891,556,900	1.58
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	232,000	15,330.60	3,556,701,295	25,255.00	5,859,160,000	1.57
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	32,702,100	153.62	5,023,881,755	172.30	5,634,571,830	1.51
日本	株式	日立製作所	電気機器	532,100	6,780.77	3,608,052,659	10,170.00	5,411,457,000	1.45
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	767,600	5,544.19	4,255,725,209	6,880.00	5,281,088,000	1.42
日本	株式	三菱商事	卸売業	2,298,000	1,535.32	3,528,185,796	2,253.50	5,178,543,000	1.39
日本	株式	任天堂	その他製品	692,100	5,556.83	3,845,887,779	7,359.00	5,093,163,900	1.37
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	834,300	4,216.37	3,517,723,401	5,963.00	4,974,930,900	1.33
日本	株式	三井物産	卸売業	873,800	3,998.05	3,493,498,427	5,298.00	4,629,392,400	1.24
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	779,600	4,261.42	3,322,203,563	5,767.00	4,495,953,200	1.21
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	973,000	4,204.68	4,091,155,091	4,054.00	3,944,542,000	1.06
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,673,100	1,042.74	2,787,355,032	1,466.00	3,918,764,600	1.05
日本	株式	KDDI	情報・通信業	849,500	4,030.77	3,424,142,614	4,486.00	3,810,857,000	1.02
日本	株式	HOYA	精密機器	215,800	13,754.73	2,968,270,734	17,625.00	3,803,475,000	1.02
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,067,100	2,733.62	2,917,050,782	3,529.00	3,765,795,900	1.01
日本	株式	第一三共	医薬品	957,800	4,275.03	4,094,625,679	3,872.00	3,708,601,600	0.99
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,457,200	2,000.38	2,914,964,394	2,412.50	3,515,495,000	0.94
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	542,300	5,989.93	3,248,342,467	6,293.00	3,412,693,900	0.92
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	596,400	4,117.66	2,455,773,246	5,251.00	3,131,696,400	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,768,900	1,482.90	2,623,109,080	1,759.50	3,112,379,550	0.83
日本	株式	ダイキン工業	機械	132,200	22,332.09	2,952,302,959	22,985.00	3,038,617,000	0.81
日本	株式	村田製作所	電気機器	997,400	2,496.02	2,489,535,291	2,993.00	2,985,218,200	0.80
日本	株式	S M C	機械	33,100	62,980.86	2,084,666,765	75,760.00	2,507,656,000	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,232,200	1,379.84	1,700,247,031	1,999.00	2,463,167,800	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	655,900	2,665.13	1,748,060,883	3,645.00	2,390,755,500	0.64
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	399,700	6,046.34	2,416,722,899	5,595.00	2,236,321,500	0.60

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.34
		建設業	2.09
		食料品	3.33
		繊維製品	0.40
		パルプ・紙	0.17
		化学	6.12
		医薬品	4.56
		石油・石炭製品	0.46

ゴム製品	0.69
ガラス・土石製品	0.67
鉄鋼	0.95
非鉄金属	0.67
金属製品	0.52
機械	5.27
電気機器	17.33
輸送用機器	8.09
精密機器	2.34
その他製品	2.35
電気・ガス業	1.39
陸運業	2.81
海運業	0.83
空運業	0.45
倉庫・運輸関連業	0.15
情報・通信業	7.63
卸売業	6.91
小売業	4.25
銀行業	6.79
証券、商品先物取引業	0.80
保険業	2.35
その他金融業	1.14
不動産業	1.93
サービス業	4.93
小計	98.76
合計	98.76

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	194円		4,549,074,500	4,590,040,000	1.23

(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	315,549,867,591	68.44
	イギリス	17,825,724,500	3.87
	カナダ	15,490,717,751	3.36
	スイス	14,288,202,238	3.10
	フランス	14,115,251,131	3.06
	ドイツ	10,883,867,133	2.36
	オーストラリア	8,878,403,465	1.93
	オランダ	8,640,853,436	1.87
	アイルランド	8,209,277,882	1.78
	デンマーク	4,305,902,675	0.93
	スウェーデン	4,146,769,773	0.90
	スペイン	3,342,566,856	0.72
	イタリア	2,551,809,923	0.55
	香港	2,124,412,205	0.46
	シンガポール	1,397,569,226	0.30
	フィンランド	1,396,724,955	0.30
	ジャージー	1,216,005,759	0.26
	ベルギー	1,009,970,481	0.22
	イスラエル	872,749,446	0.19
	ノルウェー	853,668,740	0.19
	キュラソー	580,355,164	0.13
	ケイマン	577,593,831	0.13
	バミューダ	565,399,180	0.12
	ニュージーランド	342,805,164	0.07
	ルクセンブルク	248,645,868	0.05
	ポルトガル	246,193,660	0.05
	リベリア	237,443,783	0.05
オーストリア	228,488,018	0.05	
パナマ	152,361,321	0.03	
マン島	60,515,133	0.01	
	小計	440,340,116,288	95.50
新株予約権証券	カナダ	-	-
投資信託受益証券	オーストラリア	52,368,015	0.01
	香港	30,958,455	0.01
	小計	83,326,470	0.02
投資証券	アメリカ	7,893,725,726	1.71
	オーストラリア	581,430,601	0.13
	フランス	182,225,076	0.04
	シンガポール	181,518,231	0.04
	イギリス	144,055,406	0.03
	香港	117,630,694	0.03
	カナダ	44,302,461	0.01

	ベルギー	32,647,839	0.01
	小計	9,177,536,034	1.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,466,734,541	2.49
合計(純資産総額)		461,067,713,333	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	8,464,171,516	1.84
	買建	カナダ	353,744,008	0.08
	買建	ドイツ	1,530,328,204	0.33
	買建	イギリス	671,739,331	0.15
	買建	オーストラリア	442,453,548	0.10

(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		2,303,108,082	0.50

(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	873,971	21,634.74	18,908,142,520	27,455.45	23,995,268,316	5.20
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	394,718	36,916.93	14,571,777,740	53,225.96	21,009,245,427	4.56
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	519,518	14,729.54	7,652,264,362	21,753.88	11,301,535,035	2.45
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	138,165	31,506.72	4,353,126,674	70,237.05	9,704,302,372	2.10
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	331,772	14,734.73	4,888,571,468	19,888.82	6,598,553,888	1.43
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	124,375	27,032.44	3,362,160,855	50,820.52	6,320,802,871	1.37
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	291,656	14,741.81	4,299,537,395	20,037.74	5,844,127,797	1.27
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	159,515	27,874.07	4,446,333,116	35,908.51	5,727,947,472	1.24

アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	24,818	84,482.89	2,096,696,374	159,191.41	3,950,812,421	0.86
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	163,426	20,101.51	3,285,110,718	24,153.64	3,947,334,241	0.86
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	52,063	67,604.80	3,519,708,837	74,446.56	3,875,911,618	0.84
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	45,116	49,085.61	2,214,546,807	82,381.95	3,716,744,304	0.81
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	金融サービス	73,282	43,994.04	3,223,971,899	50,714.15	3,716,434,567	0.81
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	89,644	32,537.22	2,916,766,577	36,932.53	3,310,779,899	0.72
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	223,505	15,823.97	3,536,737,108	14,209.94	3,175,994,361	0.69
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	134,646	23,100.16	3,110,344,485	22,207.74	2,990,183,549	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	47,345	52,852.07	2,502,281,309	60,464.96	2,862,713,796	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	56,243	46,407.21	2,610,080,884	49,266.06	2,770,871,508	0.60
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	131,778	20,095.45	2,648,139,206	20,668.88	2,723,704,446	0.59
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	182,764	10,199.69	1,864,136,400	14,718.05	2,689,930,787	0.58
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	22,598	97,393.95	2,200,908,559	107,768.60	2,435,355,004	0.53
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	149,344	18,685.65	2,790,589,792	16,283.94	2,431,910,169	0.53
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	24,829	73,245.34	1,818,608,580	94,047.47	2,335,104,707	0.51
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	142,254	14,772.81	2,101,492,693	15,426.84	2,194,530,992	0.48
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	98,887	20,537.98	2,030,939,361	21,948.19	2,170,390,912	0.47
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	101,663	23,940.21	2,433,833,658	21,241.87	2,159,513,155	0.47
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	25,550	53,984.98	1,379,316,365	84,462.60	2,158,019,471	0.47
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	54,562	24,062.08	1,312,875,325	37,667.21	2,055,198,388	0.45
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	401,937	5,101.73	2,050,575,814	4,805.20	1,931,387,833	0.42
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	230,231	8,516.40	1,960,741,547	8,332.51	1,918,402,685	0.42

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.59
		素材	3.99
		資本財	6.78
		商業・専門サービス	1.54
		運輸	1.79
		自動車・自動車部品	2.02
		耐久消費財・アパレル	1.54
		消費者サービス	2.05
		メディア・娯楽	5.88
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.53
		生活必需品流通・小売り	1.68
		食品・飲料・タバコ	3.45
		家庭用品・パーソナル用品	1.59
		ヘルスケア機器・サービス	4.26
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.74
		銀行	5.37
		金融サービス	6.63
		保険	2.97
		エクイティ不動産投資信託 (REIT)	0.04
		ソフトウェア・サービス	9.90
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.58
電気通信サービス	1.12		
公益事業	2.62		
半導体・半導体製造装置	6.49		
不動産管理・開発	0.34		
	小計	95.50	
新株予約権証券			
投資信託受益証券			0.02
投資証券			1.99
合計			97.51

(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	247	アメリカドル	58,116,716.35	8,242,693,880	59,678,287.5	8,464,171,516	1.84
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	13	カナダドル	3,219,230.5	345,230,278	3,298,620	353,744,008	0.08

ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	24	スイスフラン	2,664,008	448,192,705	2,644,320	444,880,396	0.10
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	152	ユーロ	6,954,916.4	1,092,756,465	6,908,400	1,085,447,808	0.24
オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	24	オーストラリアドル	4,457,518	432,111,795	4,564,200	442,453,548	0.10
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	48	イギリス債券	3,654,860	660,360,105	3,717,840	671,739,331	0.15

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	11,943,600.00	1,708,678,512	1,691,402,878	0.37
	カナダドル	買建	600,000.00	64,416,600	64,288,260	0.01
	ユーロ	買建	1,850,000.00	290,310,480	290,277,970	0.06
	イギリス債券	買建	550,000.00	99,953,850	99,214,030	0.02
	スイスフラン	買建	210,000.00	35,360,010	35,318,619	0.01
	デンマーククローネ	買建	2,000,000.00	42,256,000	42,133,000	0.01
	オーストラリアドル	買建	550,000.00	53,475,950	53,275,475	0.01
	香港ドル	買建	1,500,000.00	27,186,000	27,197,850	0.01

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

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

## 外国債券マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	79,609,670,232	46.06
	フランス	14,435,655,769	8.35
	イタリア	12,958,974,879	7.50
	中国	12,757,309,881	7.38
	ドイツ	11,272,892,315	6.52
	イギリス	8,965,330,751	5.19
	スペイン	8,436,919,797	4.88
	カナダ	3,408,625,387	1.97
	ベルギー	3,077,137,526	1.78
	オランダ	2,614,438,275	1.51
	オーストラリア	2,446,529,161	1.42
	オーストリア	2,059,329,536	1.19
	メキシコ	1,551,848,528	0.90
アイルランド	1,012,047,742	0.59	

	フィンランド	908,461,320	0.53
	ポーランド	878,211,902	0.51
	マレーシア	856,053,559	0.50
	シンガポール	731,856,362	0.42
	イスラエル	507,782,319	0.29
	デンマーク	482,652,191	0.28
	ニュージーランド	422,345,900	0.24
	スウェーデン	366,533,195	0.21
	ノルウェー	309,739,867	0.18
	小計	170,070,346,394	98.40
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,765,734,283	1.60
合計（純資産総額）		172,836,080,677	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	390,455,778	0.23
	買建	ドイツ	375,389,532	0.22

(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		828,471,881	0.48

(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 2.875% 04/30/25	10,770,000	13,734.24	1,479,177,765	13,863.60	1,493,110,313	2.875	2025/4/30	0.86
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,110,000	11,809.56	1,430,138,150	11,810.39	1,430,238,783	1.375	2031/11/15	0.83
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	10,200,000	13,514.84	1,378,514,461	13,570.80	1,384,222,021	2.875	2028/8/15	0.80
中国	国債証券	CGB 1.99% 04/09/25	63,260,000	1,973.35	1,248,345,382	1,987.49	1,257,286,485	1.990	2025/4/9	0.73
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/30/25	8,000,000	12,998.49	1,039,879,837	13,414.56	1,073,165,557	0.375	2025/4/30	0.62
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	9,130,000	11,396.26	1,040,478,724	11,521.74	1,051,935,628	0.625	2030/8/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	7,460,000	13,557.51	1,011,390,978	13,702.93	1,022,239,221	3.125	2028/11/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 1.25% 04/30/28	7,800,000	12,578.90	981,154,865	12,692.12	989,985,585	1.250	2028/4/30	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	6,900,000	13,289.91	917,004,080	13,360.82	921,897,215	2.625	2029/2/15	0.53



アメリカ	国債証券	T 1.125% 10/31/26	6,850,000	12,783.13	875,644,946	13,080.77	896,032,773	1.125	2026/10/31	0.52
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	7,400,000	11,454.43	847,628,160	11,607.62	858,964,032	0.625	2030/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 3% 07/15/25	6,100,000	13,673.26	834,069,432	13,869.69	846,051,687	3.000	2025/7/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	13,512.07	817,480,693	13,760.83	832,530,469	2.000	2025/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	6,000,000	14,070.73	844,243,921	13,799.33	827,960,327	3.500	2033/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	5,690,000	14,277.37	812,382,586	14,462.78	822,932,284	4.125	2032/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 3.75% 04/15/26	5,800,000	13,885.49	805,358,758	14,048.64	814,821,657	3.750	2026/4/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/29	6,000,000	13,363.04	801,782,719	13,405.15	804,309,066	2.750	2029/5/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.125% 01/15/25	5,830,000	13,300.99	775,447,990	13,656.81	796,192,559	1.125	2025/1/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	5,750,000	13,180.21	757,862,515	13,433.96	772,452,717	1.625	2026/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	6,550,000	11,759.70	770,260,442	11,768.56	770,841,059	1.250	2031/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.25% 05/31/28	6,000,000	12,441.15	746,469,019	12,666.63	759,998,273	1.250	2028/5/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	6,200,000	12,290.45	762,008,268	12,229.51	758,229,823	1.875	2032/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/15/25	5,500,000	13,571.57	746,436,398	13,697.12	753,341,681	1.750	2025/3/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	5,500,000	13,474.40	741,092,219	13,655.29	751,041,097	2.250	2025/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	5,400,000	13,128.13	708,919,526	13,375.78	722,292,545	1.625	2026/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.25% 12/31/26	5,500,000	12,805.14	704,282,902	13,083.81	719,609,962	1.250	2026/12/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	6,160,000	11,574.10	712,964,786	11,675.21	719,193,111	0.875	2030/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 4% 12/15/25	5,000,000	14,128.70	706,435,289	14,102.38	705,119,482	4.000	2025/12/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/28	5,550,000	12,493.22	693,374,185	12,682.98	703,905,474	1.500	2028/11/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	5,300,000	13,014.01	689,742,555	13,268.30	703,220,285	1.500	2026/8/15	0.41

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.40
合計	98.40

(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	10	アメリカ ドル	1,071,754.56	152,006,949	1,086,875	154,151,481	0.09
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	7	アメリカ ドル	774,894.6	109,903,301	790,234.41	112,078,946	0.06
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	7	アメリカ ドル	840,425.85	119,197,598	875,875	124,225,351	0.07
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	4	ユーロ	424,268.4	66,661,051	426,440	67,002,253	0.04
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	6	ユーロ	709,352.6	111,453,480	717,960	112,805,875	0.07
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	9	ユーロ	1,216,528.9	191,141,020	1,244,790	195,581,404	0.11

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

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

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	2,810,000.00	405,452,264	397,400,035	0.23
	カナダドル	買建	310,000.00	33,075,466	33,158,003	0.02
	ユーロ	買建	1,780,000.00	278,847,504	279,063,772	0.16
	イギリスポンド	買建	270,000.00	49,080,299	48,647,196	0.03
	オフショア人民元	買建	3,530,000.00	71,065,325	70,202,875	0.04

(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：2023年12月29日

## 基準価額・純資産の推移



基準価額 25,717円

純資産総額 44.23億円

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年6月	0円
2020年6月	0円
2021年6月	0円
2022年6月	0円
2023年6月	0円
設定後 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)を再投資したもとして計算しております。

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

## 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式 マザーファンド	33.9%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア	-	-	1.8%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	1.5%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	一般消費財/サービス流通(電子)	-	-	0.8%
		NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体/半導体製造装置	-	-	0.7%
外国債券 マザーファンド	33.0%	T 2.875% 04/30/25	アメリカ	国債	-	2.875%	2025/04/30	0.3%
		T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.3%
		T 2.875% 08/15/28	アメリカ	国債	-	2.875%	2028/08/15	0.3%
		CGB 1.99% 04/09/25	中国	国債	-	1.990%	2025/04/09	0.2%
日本株式 マザーファンド	32.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.4%
		シーメンスグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.9%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.7%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	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)を再投資したもとして計算しております。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

## &lt; 申込手続 &gt;

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

#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として午後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、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。

## &lt;その他&gt;

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。

## &lt;問い合わせ先&gt;

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】

## &lt;基準価額の算出方法&gt;

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。

## &lt;基準価額の算出頻度&gt;

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。

## &lt;主要な投資対象資産の評価方法&gt;

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ち、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します。

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

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

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

#### < 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

##### (1) 投資信託約款の変更等

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

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

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

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて、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します。

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

上記からまでの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記



録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっては、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）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）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16期計算期間(2022年6月11日から2023年6月12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15期 ( 2022年 6月10日現在 )	第16期 ( 2023年 6月12日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	29,035,519	17,254,883
親投資信託受益証券	3,850,565,571	4,232,527,808
未収入金	50,520	13,269,778
流動資産合計	3,879,651,610	4,263,052,469
資産合計	3,879,651,610	4,263,052,469
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	51,312	270,066
未払受託者報酬	1,034,054	1,092,981
未払委託者報酬	11,374,496	12,022,724
未払利息	33	35
その他未払費用	103,346	109,235
流動負債合計	12,563,241	13,495,041
負債合計	12,563,241	13,495,041
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,791,192,162	1,794,883,011
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	2,075,896,207	2,454,674,417
( 分配準備積立金 )	1,620,544,407	1,929,863,034
元本等合計	3,867,088,369	4,249,557,428
純資産合計	3,867,088,369	4,249,557,428
負債純資産合計	3,879,651,610	4,263,052,469

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期		第16期	
	自	2021年 6月11日	自	2022年 6月11日
	至	2022年 6月10日	至	2023年 6月12日
<b>営業収益</b>				
受取利息		80		62
有価証券売買等損益		213,812,701		402,864,286
営業収益合計		213,812,781		402,864,348
<b>営業費用</b>				
支払利息		6,168		7,439
受託者報酬		2,068,864		2,162,661
委託者報酬		22,757,366		23,789,104
その他費用		206,766		216,143
営業費用合計		25,039,164		26,175,347
営業利益又は営業損失（ ）		188,773,617		376,689,001
経常利益又は経常損失（ ）		188,773,617		376,689,001
当期純利益又は当期純損失（ ）		188,773,617		376,689,001
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（ ）		4,141,304		3,243,235
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,885,438,734		2,075,896,207
剰余金増加額又は欠損金減少額		93,126,398		89,708,906
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		93,126,398		89,708,906
剰余金減少額又は欠損金増加額		87,301,238		84,376,462
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		87,301,238		84,376,462
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,075,896,207		2,454,674,417

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月11日から翌年6月10日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第16期計算期間は2022年6月11日から2023年6月12日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第15期 (2022年6月10日現在)	第16期 (2023年6月12日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,791,192,162口	1,794,883,011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) 2.1589円 (21,589円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.3676円 (23,676円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自 2021年6月11日 至 2022年6月10日			第16期 自 2022年6月11日 至 2023年6月12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	64,374,800円	費用控除後の配当等収益額	A	81,460,806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	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	291,984,960円
収益調整金額	C	876,366,019円	収益調整金額	C	946,123,974円
分配準備積立金額	D	1,435,912,094円	分配準備積立金額	D	1,556,417,268円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,496,910,426円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,875,987,008円
当ファンドの期末残存口数	F	1,791,192,162口	当ファンドの期末残存口数	F	1,794,883,011口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	13,939円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	16,023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16期 自 2022年6月11日 至 2023年6月12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16期 (2023年6月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第16期 (2023年 6月12日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	第15期 自 2021年 6月11日 至 2022年 6月10日	第16期 自 2022年 6月11日 至 2023年 6月12日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,790,587,673円	1,791,192,162円
期中追加設定元本額	83,743,586円	76,767,682円
期中一部解約元本額	83,139,097円	73,076,833円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第15期 (2022年 6月10日現在)	第16期 (2023年 6月12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	201,858,011	396,930,730
合計	201,858,011	396,930,730

## （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	555,160,460	1,462,903,328	
	外国株式マザーファンド	277,368,351	1,426,588,639	
	外国債券マザーファンド	488,910,026	1,343,035,841	
合計		1,321,438,837	4,232,527,808	

(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

	2023年 6月12日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	2,695,615,923
株式	347,819,937,808
派生商品評価勘定	58,735,350
未収入金	1,403,700
未収配当金	2,654,191,267
差入委託証拠金	244,488,000
流動資産合計	353,474,372,048
資産合計	353,474,372,048
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受金	58,737,000
未払解約金	220,578,577
未払利息	5,484
流動負債合計	279,321,061
負債合計	279,321,061
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	134,033,097,855
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	219,161,953,132
元本等合計	353,195,050,987
純資産合計	353,195,050,987
負債純資産合計	353,474,372,048

### 注記表

#### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 6月12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）



		2023年 6月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		134,033,097,855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)	2.6351円 (26,351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

		2023年 6月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。また、当ファンドは、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。
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

		2023年 6月12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	2023年 6月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月11日
期首元本額	134,935,811,007円
期中追加設定元本額	10,419,937,799円
期中一部解約元本額	11,322,650,951円
期末元本額	134,033,097,855円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	590,452,046円
DC日本株式インデックスファンド	281,297,230円

区分	2023年 6月12日現在
DC日本株式インデックスファンドL	53,838,936,893円
DC日本株式インデックスファンドA	647,848,699円
DCバランスファンド30	2,334,100,886円
DCバランスファンド50	3,578,598,620円
DCバランスファンド70	2,366,946,076円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	555,160,460円
日本株式インデックスe	1,420,386,302円
インデックスコレクション（国内株式）	22,463,992,475円
インデックスコレクション（バランス株式30）	12,406,347,239円
インデックスコレクション（バランス株式50）	3,623,097,294円
インデックスコレクション（バランス株式70）	3,360,926,924円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,785,675,507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）	2,712,321,272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）	681,687,562円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	31,059,090円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	388,280,870円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	49,172,157円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	115,604,719円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	38,833,262円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	511,597,152円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	353,351,436円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	6,132,265,266円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	594,978,112円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	49,820,182円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	977,507,882円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	19,076,923円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	124,040,444円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,577,928,682円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	41,133,450円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	45,486,284円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	13,917,315円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	463,844,265円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	231,140,512円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	3,430,599,057円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	70,762,269円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	24,668,572円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	6,995,371円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	90,609,531円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	2,649,567円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 6月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	45,520,489,193
合計	45,520,489,193

(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

（2023年 6月12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	5,174,673,000	-	58,737,000

合計	5,174,673,000	-	5,233,410,000	58,737,000
----	---------------	---	---------------	------------

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,800	3,665.00	21,257,000	
ニッスイ	152,300	642.10	97,791,830	
マルハニチロ	22,600	2,476.00	55,957,600	
雪国まいたけ	13,000	966.00	12,558,000	
カネコ種苗	4,700	1,469.00	6,904,300	
サカタのタネ	17,300	4,050.00	70,065,000	
ホクト	13,600	1,876.00	25,513,600	
ホクリヨウ	1,700	915.00	1,555,500	
住石ホールディングス	18,400	379.00	6,973,600	
日鉄鉱業	6,100	3,970.00	24,217,000	
三井松島ホールディングス	6,900	2,645.00	18,250,500	
I N P E X	563,200	1,578.00	888,729,600	
石油資源開発	17,600	4,325.00	76,120,000	
K & O エナジーグループ	6,900	2,305.00	15,904,500	
ショーボンドホールディングス	20,700	5,729.00	118,590,300	
ミライト・ワン	50,400	1,771.00	89,258,400	
タマホーム	9,600	3,490.00	33,504,000	
サンヨーホームズ	1,400	714.00	999,600	
日本アクア	4,900	890.00	4,361,000	
ファーストコーポレーション	3,000	775.00	2,325,000	
ベステラ	2,600	1,109.00	2,883,400	
Robot Home	25,900	189.00	4,895,100	
キャンディル	2,100	574.00	1,205,400	
ダイセキ環境ソリューション	2,400	1,075.00	2,580,000	
第一カッター興業	3,900	1,318.00	5,140,200	
安藤・間	88,200	1,061.00	93,580,200	
東急建設	43,400	731.00	31,725,400	
コムシスホールディングス	51,500	2,800.50	144,225,750	
ビーアールホールディングス	24,200	393.00	9,510,600	
高松コンストラクショングループ	9,900	2,443.00	24,185,700	
東建コーポレーション	4,400	7,630.00	33,572,000	

ソネック	1,300	982.00	1,276,600	
ヤマウラ	7,700	1,199.00	9,232,300	
オリエンタル白石	54,700	300.00	16,410,000	
大成建設	99,700	4,560.00	454,632,000	
大林組	381,000	1,166.50	444,436,500	
清水建設	320,300	874.30	280,038,290	
飛鳥建設	11,800	1,282.00	15,127,600	
長谷工コーポレーション	110,000	1,692.00	186,120,000	
松井建設	9,900	685.00	6,781,500	
銭高組	1,000	3,050.00	3,050,000	
鹿島建設	236,200	2,078.00	490,823,600	
不動テトラ	7,400	1,813.00	13,416,200	
大末建設	3,000	1,282.00	3,846,000	
鉄建建設	7,600	2,004.00	15,230,400	
西松建設	18,100	3,504.00	63,422,400	
三井住友建設	85,900	369.00	31,697,100	
大豊建設	4,400	3,850.00	16,940,000	
佐田建設	5,300	450.00	2,385,000	
ナカノフドー建設	5,900	370.00	2,183,000	
奥村組	17,300	4,035.00	69,805,500	
東鉄工業	14,700	2,565.00	37,705,500	
イチケン	1,900	1,906.00	3,621,400	
富士ピー・エス	3,700	442.00	1,635,400	
浅沼組	8,500	3,190.00	27,115,000	
戸田建設	131,100	814.80	106,820,280	
熊谷組	17,800	3,140.00	55,892,000	
北野建設	1,600	2,984.00	4,774,400	
植木組	2,300	1,325.00	3,047,500	
矢作建設工業	14,500	1,150.00	16,675,000	
ピーエス三菱	13,500	739.00	9,976,500	
日本ハウスホールディングス	21,100	381.00	8,039,100	
新日本建設	15,000	1,153.00	17,295,000	
東亜道路工業	4,200	4,350.00	18,270,000	
日本道路	2,100	8,900.00	18,690,000	
東亜建設工業	9,100	3,160.00	28,756,000	
日本国土開発	31,900	586.00	18,693,400	
若築建設	4,700	3,095.00	14,546,500	
東洋建設	34,500	1,015.00	35,017,500	
五洋建設	151,000	756.50	114,231,500	
世紀東急工業	13,700	1,299.00	17,796,300	
福田組	4,000	4,735.00	18,940,000	
住友林業	81,700	3,338.00	272,714,600	

日本基礎技術	5,000	506.00	2,530,000
巴コーポレーション	9,300	453.00	4,212,900
大和ハウス工業	297,700	3,687.00	1,097,619,900
ライト工業	19,700	1,922.00	37,863,400
積水ハウス	323,000	2,707.50	874,522,500
日特建設	10,200	1,011.00	10,312,200
北陸電気工事	7,300	891.00	6,504,300
ユアテック	23,500	850.00	19,975,000
日本リーテック	9,400	1,445.00	13,583,000
四電工	4,500	2,177.00	9,796,500
中電工	16,500	2,263.00	37,339,500
関電工	58,400	1,108.00	64,707,200
きんでん	75,000	1,928.00	144,600,000
東京エネシス	10,600	1,004.00	10,642,400
トーエネック	3,500	3,665.00	12,827,500
住友電設	10,100	3,015.00	30,451,500
日本電設工業	17,500	1,886.00	33,005,000
エクシオグループ	49,100	2,770.00	136,007,000
新日本空調	5,900	2,267.00	13,375,300
九電工	25,900	4,022.00	104,169,800
三機工業	23,600	1,508.00	35,588,800
日揮ホールディングス	105,400	1,830.50	192,934,700
中外炉工業	3,500	2,061.00	7,213,500
ヤマト	6,900	898.00	6,196,200
太平電業	6,600	4,285.00	28,281,000
高砂熱学工業	25,700	2,442.00	62,759,400
三晃金属工業	1,000	4,355.00	4,355,000
朝日工業社	4,400	2,223.00	9,781,200
明星工業	18,300	951.00	17,403,300
大気社	12,300	3,995.00	49,138,500
ダイダン	7,000	2,608.00	18,256,000
日比谷総合設備	9,100	2,161.00	19,665,100
フィル・カンパニー	1,900	937.00	1,780,300
テスホールディングス	11,500	1,068.00	12,282,000
インフロニア・ホールディングス	111,600	1,327.50	148,149,000
東洋エンジニアリング	14,100	578.00	8,149,800
レイズネクスト	15,400	1,373.00	21,144,200
ニッポン	28,800	1,840.00	52,992,000
日清製粉グループ本社	98,900	1,815.50	179,552,950
日東富士製粉	1,900	4,695.00	8,920,500
昭和産業	9,300	2,711.00	25,212,300
鳥越製粉	6,700	616.00	4,127,200

中部飼料	14,800	1,100.00	16,280,000
フィード・ワン	15,600	729.00	11,372,400
東洋精糖	1,600	1,432.00	2,291,200
日本甜菜製糖	6,200	1,859.00	11,525,800
D M三井製糖ホールディングス	10,600	2,679.00	28,397,400
塩水港精糖	10,000	204.00	2,040,000
ウェルネオシュガー	5,500	1,970.00	10,835,000
森永製菓	19,600	4,618.00	90,512,800
中村屋	2,700	3,065.00	8,275,500
江崎グリコ	30,600	3,862.00	118,177,200
名糖産業	4,200	1,625.00	6,825,000
井村屋グループ	5,800	2,251.00	13,055,800
不二家	7,300	2,488.00	18,162,400
山崎製パン	71,600	2,039.00	145,992,400
第一屋製パン	1,600	390.00	624,000
モロゾフ	3,500	3,615.00	12,652,500
亀田製菓	6,800	4,245.00	28,866,000
寿スピリッツ	11,400	10,710.00	122,094,000
カルビー	49,000	2,794.50	136,930,500
森永乳業	19,400	5,072.00	98,396,800
六甲バター	7,800	1,314.00	10,249,200
ヤクルト本社	76,400	9,179.00	701,275,600
明治ホールディングス	132,600	3,222.00	427,237,200
雪印メグミルク	25,900	1,940.00	50,246,000
プリマハム	14,400	2,194.00	31,593,600
日本ハム	41,800	3,921.00	163,897,800
林兼産業	2,500	480.00	1,200,000
丸大食品	10,800	1,489.00	16,081,200
S Foods	11,800	3,275.00	38,645,000
柿安本店	4,200	2,328.00	9,777,600
伊藤ハム米久ホールディングス	81,700	719.00	58,742,300
サッポロホールディングス	35,200	3,781.00	133,091,200
アサヒグループホールディングス	247,100	5,662.00	1,399,080,200
キリンホールディングス	482,600	2,104.00	1,015,390,400
宝ホールディングス	73,000	1,051.00	76,723,000
オエノンホールディングス	32,000	381.00	12,192,000
養命酒製造	3,500	1,840.00	6,440,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	83,800	1,609.00	134,834,200
サントリー食品インターナショナル	75,300	5,322.00	400,746,600
ダイトーグループホールディングス	6,100	5,060.00	30,866,000
伊藤園	36,200	4,207.00	152,293,400
キーコーヒー	12,000	2,062.00	24,744,000

ユニカフェ	2,800	907.00	2,539,600
ジャパンフーズ	1,300	1,100.00	1,430,000
日清オイリオグループ	15,100	3,430.00	51,793,000
不二製油グループ本社	24,900	2,024.50	50,410,050
かどや製油	1,000	3,470.00	3,470,000
J・オイルミルズ	10,900	1,626.00	17,723,400
キッコーマン	70,900	8,410.00	596,269,000
味の素	258,200	5,611.00	1,448,760,200
ブルドックソース	5,700	2,002.00	11,411,400
キューピー	57,500	2,278.00	130,985,000
ハウス食品グループ本社	32,700	3,291.00	107,615,700
カゴメ	49,800	3,390.00	168,822,000
焼津水産化学工業	3,300	805.00	2,656,500
アリアケジャパン	9,300	5,168.00	48,062,400
ピエトロ	1,200	1,822.00	2,186,400
エバラ食品工業	2,900	2,945.00	8,540,500
やまみ	800	1,372.00	1,097,600
ニチレイ	49,000	3,076.00	150,724,000
東洋水産	54,000	6,390.00	345,060,000
イトアンドホールディングス	4,500	2,185.00	9,832,500
大冷	1,000	1,948.00	1,948,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,800	881.00	5,990,800
日清食品ホールディングス	37,600	12,085.00	454,396,000
永谷園ホールディングス	5,200	2,125.00	11,050,000
一正蒲鉾	3,600	798.00	2,872,800
フジッコ	11,000	1,927.00	21,197,000
ロック・フィールド	12,000	1,497.00	17,964,000
日本たばこ産業	704,100	3,148.00	2,216,506,800
ケンコーマヨネーズ	7,400	1,282.00	9,486,800
わらべや日洋ホールディングス	7,900	2,274.00	17,964,600
なとり	6,700	1,945.00	13,031,500
イフジ産業	1,400	1,062.00	1,486,800
ファーマフーズ	15,400	1,871.00	28,813,400
ユーグレナ	69,100	921.00	63,641,100
紀文食品	8,300	987.00	8,192,100
ピククルスホールディングス	6,300	1,304.00	8,215,200
ミヨシ油脂	2,900	1,001.00	2,902,900
理研ビタミン	9,200	2,111.00	19,421,200
片倉工業	10,200	1,667.00	17,003,400
ゲンゼ	7,800	4,475.00	34,905,000
東洋紡	47,400	1,005.00	47,637,000
ユニチカ	34,700	227.00	7,876,900

富士紡ホールディングス	4,400	3,095.00	13,618,000
倉敷紡績	8,300	2,254.00	18,708,200
シキボウ	4,700	991.00	4,657,700
日本毛織	29,100	1,021.00	29,711,100
トーア紡コーポレーション	3,300	392.00	1,293,600
帝国繊維	12,500	1,622.00	20,275,000
帝人	104,800	1,370.50	143,628,400
東レ	729,500	769.80	561,569,100
住江織物	1,800	2,185.00	3,933,000
日本フェルト	5,500	414.00	2,277,000
イチカワ	1,300	1,348.00	1,752,400
日東製網	900	1,365.00	1,228,500
アツギ	5,200	423.00	2,199,600
ダイニック	2,200	733.00	1,612,600
セーレン	21,200	2,306.00	48,887,200
ソトー	2,800	800.00	2,240,000
東海染工	900	1,138.00	1,024,200
小松マテーレ	16,000	676.00	10,816,000
ワコールホールディングス	21,000	3,030.00	63,630,000
ホギメディカル	14,600	3,220.00	47,012,000
T S Iホールディングス	36,800	698.00	25,686,400
マツオカコーポレーション	2,400	1,114.00	2,673,600
ワールド	14,000	1,517.00	21,238,000
三陽商会	3,200	1,588.00	5,081,600
ナイガイ	3,300	280.00	924,000
オンワードホールディングス	70,900	381.00	27,012,900
ルックホールディングス	2,500	2,356.00	5,890,000
ゴールドウイン	19,300	12,580.00	242,794,000
デサント	18,800	3,975.00	74,730,000
キング	3,900	567.00	2,211,300
ヤマトインターナショナル	7,100	275.00	1,952,500
特種東海製紙	4,900	3,345.00	16,390,500
王子ホールディングス	453,200	553.30	250,755,560
日本製紙	56,700	1,278.00	72,462,600
三菱製紙	10,200	588.00	5,997,600
北越コーポレーション	68,700	907.00	62,310,900
中越パルプ工業	3,400	1,366.00	4,644,400
巴川製紙所	2,700	671.00	1,811,700
大王製紙	48,100	1,133.50	54,521,350
阿波製紙	2,000	574.00	1,148,000
レンゴー	99,100	867.50	85,969,250
トーモク	6,300	1,990.00	12,537,000



ザ・バック	8,100	3,095.00	25,069,500
北の達人コーポレーション	45,800	303.00	13,877,400
クラレ	173,000	1,350.00	233,550,000
旭化成	679,400	957.00	650,185,800
共和レザー	4,900	530.00	2,597,000
レゾナック・ホールディングス	105,100	2,228.50	234,215,350
住友化学	807,100	426.00	343,824,600
住友精化	4,500	4,235.00	19,057,500
日産化学	51,700	6,274.00	324,365,800
ラサ工業	4,200	2,043.00	8,580,600
クレハ	9,300	8,370.00	77,841,000
多木化学	4,200	4,420.00	18,564,000
テイカ	7,300	1,289.00	9,409,700
石原産業	19,700	1,297.00	25,550,900
片倉コープアグリ	1,700	1,305.00	2,218,500
日本曹達	11,700	5,060.00	59,202,000
東ソー	145,200	1,682.00	244,226,400
トクヤマ	35,100	2,345.50	82,327,050
セントラル硝子	17,500	3,160.00	55,300,000
東亜合成	54,600	1,277.00	69,724,200
大阪ソーダ	6,500	4,850.00	31,525,000
関東電化工業	21,000	874.00	18,354,000
デンカ	39,600	2,662.00	105,415,200
信越化学工業	904,400	4,582.00	4,143,960,800
日本カーバイド工業	3,200	1,309.00	4,188,800
堺化学工業	8,300	1,857.00	15,413,100
第一稀元素化学工業	9,900	953.00	9,434,700
エア・ウォーター	102,700	1,857.50	190,765,250
日本酸素ホールディングス	105,600	3,147.00	332,323,200
日本化学工業	3,600	1,848.00	6,652,800
東邦アセチレン	1,800	1,368.00	2,462,400
日本パーカラライジング	53,900	1,061.00	57,187,900
高压ガス工業	15,800	736.00	11,628,800
チタン工業	1,000	1,390.00	1,390,000
四国化成ホールディングス	12,900	1,473.00	19,001,700
戸田工業	2,500	2,397.00	5,992,500
ステラ ケミファ	6,400	2,944.00	18,841,600
保土谷化学工業	3,100	3,255.00	10,090,500
日本触媒	16,600	5,460.00	90,636,000
大日精化工業	7,600	1,945.00	14,782,000
カネカ	24,900	3,959.00	98,579,100
三菱瓦斯化学	81,200	2,072.00	168,246,400

三井化学	89,700	3,864.00	346,600,800
J S R	101,600	3,300.00	335,280,000
東京応化工業	19,000	8,455.00	160,645,000
大阪有機化学工業	8,200	2,530.00	20,746,000
三菱ケミカルグループ	734,200	810.70	595,215,940
K Hネオケム	18,100	2,362.00	42,752,200
ダイセル	160,000	1,223.00	195,680,000
住友ベークライト	16,100	5,705.00	91,850,500
積水化学工業	222,500	2,021.00	449,672,500
日本ゼオン	65,300	1,446.00	94,423,800
アイカ工業	27,500	3,070.00	84,425,000
U B E	56,100	2,353.50	132,031,350
積水樹脂	15,800	2,220.00	35,076,000
タキロンシーアイ	23,800	532.00	12,661,600
旭有機材	7,200	4,260.00	30,672,000
ニチバン	6,700	1,884.00	12,622,800
リケンテクノス	23,400	610.00	14,274,000
大倉工業	5,000	2,056.00	10,280,000
積水化成成品工業	15,300	422.00	6,456,600
群栄化学工業	2,600	2,529.00	6,575,400
タイガースポリマー	3,900	575.00	2,242,500
ミライアル	2,600	1,600.00	4,160,000
ダイキアクシス	3,100	719.00	2,228,900
ダイキョーニシカワ	24,000	786.00	18,864,000
竹本容器	2,800	815.00	2,282,000
森六ホールディングス	5,500	1,944.00	10,692,000
恵和	7,000	1,132.00	7,924,000
日本化薬	83,100	1,251.00	103,958,100
カーリットホールディングス	9,800	785.00	7,693,000
日本精化	6,200	2,798.00	17,347,600
扶桑化学工業	10,100	3,970.00	40,097,000
トリケミカル研究所	14,500	2,571.00	37,279,500
A D E K A	37,900	2,537.00	96,152,300
日油	33,600	6,127.00	205,867,200
新日本理化	11,700	240.00	2,808,000
ハリマ化成グループ	5,900	851.00	5,020,900
花王	264,900	5,058.00	1,339,864,200
第一工業製薬	3,900	1,798.00	7,012,200
石原ケミカル	5,000	1,660.00	8,300,000
日華化学	3,400	851.00	2,893,400
ニイタカ	1,500	2,100.00	3,150,000
三洋化成工業	6,700	4,255.00	28,508,500

有機合成薬品工業	6,200	297.00	1,841,400
大日本塗料	13,300	896.00	11,916,800
日本ペイントホールディングス	481,400	1,207.00	581,049,800
関西ペイント	99,700	2,152.50	214,604,250
神東塗料	7,100	129.00	915,900
中国塗料	17,900	1,134.00	20,298,600
日本特殊塗料	5,400	1,006.00	5,432,400
藤倉化成	14,600	429.00	6,263,400
太陽ホールディングス	16,500	2,515.00	41,497,500
D I C	42,500	2,590.00	110,075,000
サカタインクス	24,200	1,234.00	29,862,800
東洋インキＳＣホールディングス	21,300	2,192.00	46,689,600
T & K T O K A	9,700	1,212.00	11,756,400
富士フィルムホールディングス	209,000	8,776.00	1,834,184,000
資生堂	227,500	6,697.00	1,523,567,500
ライオン	130,700	1,380.00	180,366,000
高砂香料工業	7,400	2,636.00	19,506,400
マンダム	23,500	1,482.00	34,827,000
ミルボン	16,100	5,140.00	82,754,000
ファンケル	47,700	2,416.50	115,267,050
コーセー	22,200	14,475.00	321,345,000
コタ	10,000	1,653.00	16,530,000
シーボン	1,100	1,554.00	1,709,400
ポーラ・オルビスホールディングス	55,800	2,084.50	116,315,100
ノエビアホールディングス	9,700	5,380.00	52,186,000
アジュバンホールディングス	2,100	920.00	1,932,000
新日本製薬	6,200	1,405.00	8,711,000
アクシージャ	5,500	1,220.00	6,710,000
エステー	8,400	1,530.00	12,852,000
アグロ カネショウ	4,400	1,579.00	6,947,600
コニシ	18,200	2,191.00	39,876,200
長谷川香料	20,800	3,225.00	67,080,000
星光P M C	4,300	569.00	2,446,700
小林製薬	31,700	8,119.00	257,372,300
荒川化学工業	9,200	1,001.00	9,209,200
メック	9,000	3,310.00	29,790,000
日本高純度化学	2,700	2,688.00	7,257,600
タカラバイオ	29,300	1,674.00	49,048,200
J C U	12,200	3,585.00	43,737,000
新田ゼラチン	5,200	748.00	3,889,600
O A T アグリオ	3,500	1,842.00	6,447,000
デクセリアルズ	31,500	3,009.00	94,783,500

アース製薬	9,900	5,150.00	50,985,000
北興化学工業	11,000	947.00	10,417,000
大成ラミック	3,400	2,871.00	9,761,400
クミアイ化学工業	43,300	1,111.00	48,106,300
日本農薬	20,000	649.00	12,980,000
アキレス	6,900	1,447.00	9,984,300
有沢製作所	17,700	1,095.00	19,381,500
日東電工	79,100	10,535.00	833,318,500
レック	15,500	823.00	12,756,500
三光合成	13,700	549.00	7,521,300
きもと	12,500	188.00	2,350,000
藤森工業	8,600	3,370.00	28,982,000
前澤化成工業	7,000	1,628.00	11,396,000
未来工業	3,900	2,589.00	10,097,100
ウェーブロックホールディングス	2,500	575.00	1,437,500
J S P	7,700	1,792.00	13,798,400
エフピコ	20,600	2,982.00	61,429,200
天馬	9,300	2,682.00	24,942,600
信越ポリマー	20,100	1,419.00	28,521,900
東リ	19,000	314.00	5,966,000
ニフコ	39,300	3,836.00	150,754,800
バルカー	9,100	3,760.00	34,216,000
ユニ・チャーム	227,000	5,499.00	1,248,273,000
ショーエイコーポレーション	2,500	559.00	1,397,500
協和キリン	131,600	2,719.50	357,886,200
武田薬品工業	964,100	4,504.00	4,342,306,400
アステラス製薬	1,029,100	2,277.00	2,343,260,700
住友ファーマ	80,800	658.70	53,222,960
塩野義製薬	137,300	6,174.00	847,690,200
わかもと製薬	7,900	235.00	1,856,500
日本新薬	25,700	6,561.00	168,617,700
中外製薬	341,000	4,049.00	1,380,709,000
科研製薬	18,700	3,672.00	68,666,400
エーザイ	132,500	10,795.00	1,430,337,500
ロート製薬	105,500	3,118.00	328,949,000
小野薬品工業	210,200	2,718.00	571,323,600
久光製薬	24,200	3,649.00	88,305,800
持田製薬	12,500	3,355.00	41,937,500
参天製薬	198,500	1,250.00	248,125,000
扶桑薬品工業	3,500	1,981.00	6,933,500
日本ケミファ	800	1,815.00	1,452,000
ツムラ	34,300	2,834.00	97,206,200

キッセイ薬品工業	16,800	2,925.00	49,140,000
生化学工業	20,800	761.00	15,828,800
栄研化学	17,700	1,548.00	27,399,600
鳥居薬品	5,800	3,640.00	21,112,000
JCRファーマ	36,900	1,396.00	51,512,400
東和薬品	16,700	1,800.00	30,060,000
富士製薬工業	8,000	1,128.00	9,024,000
ゼリア新薬工業	15,100	2,546.00	38,444,600
そーせいグループ	37,400	3,005.00	112,387,000
第一三共	949,000	5,111.00	4,850,339,000
杏林製薬	23,600	1,746.00	41,205,600
大幸薬品	19,800	389.00	7,702,200
ダイト	7,600	2,400.00	18,240,000
大塚ホールディングス	249,200	5,447.00	1,357,392,400
大正製薬ホールディングス	24,200	5,348.00	129,421,600
ペプチドリーム	52,800	2,388.00	126,086,400
あすか製薬ホールディングス	11,200	1,272.00	14,246,400
サワイグループホールディングス	24,900	3,366.00	83,813,400
日本コークス工業	98,200	105.00	10,311,000
ニチレキ	12,900	1,759.00	22,691,100
ユシロ化学工業	5,600	1,029.00	5,762,400
ビーピー・カストロール	3,300	891.00	2,940,300
富士石油	22,200	264.00	5,860,800
MORESCO	2,800	1,149.00	3,217,200
出光興産	121,000	2,849.50	344,789,500
ENEOSホールディングス	1,847,900	482.40	891,426,960
コスモエネルギーホールディングス	43,100	4,182.00	180,244,200
横浜ゴム	62,000	3,107.00	192,634,000
TOYO TIRE	62,600	1,916.00	119,941,600
ブリヂストン	347,900	5,855.00	2,036,954,500
住友ゴム工業	106,800	1,317.00	140,655,600
藤倉コンポジット	6,000	913.00	5,478,000
オカモト	6,000	3,975.00	23,850,000
フコク	5,700	1,276.00	7,273,200
ニッタ	11,100	3,050.00	33,855,000
住友理工	21,100	843.00	17,787,300
三ツ星ベルト	15,900	4,155.00	66,064,500
バンドー化学	17,300	1,365.00	23,614,500
日東紡績	12,300	2,541.00	31,254,300
AGC	110,900	5,261.00	583,444,900
日本板硝子	55,500	604.00	33,522,000
石塚硝子	1,400	1,539.00	2,154,600

日本山村硝子	3,300	885.00	2,920,500
日本電気硝子	44,500	2,572.00	114,454,000
オハラ	5,300	1,251.00	6,630,300
住友大阪セメント	15,400	3,714.00	57,195,600
太平洋セメント	69,400	2,688.50	186,581,900
日本ヒューム	9,700	771.00	7,478,700
日本コンクリート工業	21,600	293.00	6,328,800
三谷セキサン	4,600	5,110.00	23,506,000
アジアパイルホールディングス	17,200	603.00	10,371,600
東海カーボン	91,500	1,219.00	111,538,500
日本カーボン	6,300	4,425.00	27,877,500
東洋炭素	6,800	5,010.00	34,068,000
ノリタケカンパニーリミテド	5,500	5,160.00	28,380,000
TOTO	71,900	4,383.00	315,137,700
日本碍子	126,700	1,733.00	219,571,100
日本特殊陶業	83,000	2,659.50	220,738,500
MARUWA	4,000	19,590.00	78,360,000
品川リフラクトリーズ	3,100	5,070.00	15,717,000
黒崎播磨	2,200	7,520.00	16,544,000
ヨータイ	7,400	1,466.00	10,848,400
東京窯業	8,100	326.00	2,640,600
ニッカトー	4,000	607.00	2,428,000
フジインコーポレーテッド	8,700	9,070.00	78,909,000
クニミネ工業	2,600	935.00	2,431,000
エーアンドエーマテリアル	1,700	1,033.00	1,756,100
ニチアス	27,600	2,807.00	77,473,200
ニチハ	13,700	3,165.00	43,360,500
日本製鉄	501,800	2,889.00	1,449,700,200
神戸製鋼所	225,400	1,223.00	275,664,200
中山製鋼所	23,100	813.00	18,780,300
合同製鐵	5,600	3,335.00	18,676,000
JFEホールディングス	299,500	1,894.50	567,402,750
東京製鐵	31,500	1,451.00	45,706,500
共英製鋼	12,800	1,996.00	25,548,800
大和工業	18,500	5,870.00	108,595,000
東京鐵鋼	5,300	2,796.00	14,818,800
大阪製鐵	5,200	1,395.00	7,254,000
淀川製鋼所	12,700	3,195.00	40,576,500
中部鋼鈹	9,200	1,876.00	17,259,200
丸一鋼管	34,100	3,246.00	110,688,600
モリ工業	2,000	3,335.00	6,670,000
大同特殊鋼	14,100	5,415.00	76,351,500

日本高周波鋼業	3,000	332.00	996,000
日本冶金工業	8,200	4,035.00	33,087,000
山陽特殊製鋼	11,100	2,745.00	30,469,500
愛知製鋼	6,500	2,711.00	17,621,500
日本金属	1,900	882.00	1,675,800
大平洋金属	8,000	1,569.00	12,552,000
新日本電工	71,700	284.00	20,362,800
栗本鐵工所	5,300	2,025.00	10,732,500
虹技	1,100	1,214.00	1,335,400
三菱製鋼	7,000	1,284.00	8,988,000
日亜鋼業	8,900	317.00	2,821,300
日本精線	1,500	4,665.00	6,997,500
エンビプロ・ホールディングス	6,000	570.00	3,420,000
シンニッタン	9,500	243.00	2,308,500
新家工業	1,900	2,290.00	4,351,000
大紀アルミニウム工業所	16,000	1,317.00	21,072,000
日本軽金属ホールディングス	30,300	1,382.00	41,874,600
三井金属鉱業	32,600	3,262.00	106,341,200
東邦亜鉛	6,700	1,655.00	11,088,500
三菱マテリアル	74,800	2,473.50	185,017,800
住友金属鉱山	130,000	4,655.00	605,150,000
D O W Aホールディングス	25,200	4,393.00	110,703,600
古河機械金属	16,500	1,547.00	25,525,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	16,500	3,050.00	50,325,000
東邦チタニウム	20,300	1,835.00	37,250,500
U A C J	15,700	2,657.00	41,714,900
C Kサンエツ	2,700	4,200.00	11,340,000
古河電気工業	37,300	2,424.00	90,415,200
住友電気工業	387,000	1,701.50	658,480,500
フジクラ	120,200	1,171.50	140,814,300
S W C C	12,600	1,895.00	23,877,000
タツタ電線	22,900	714.00	16,350,600
カナレ電気	1,400	1,359.00	1,902,600
平河ヒューテック	6,500	1,446.00	9,399,000
リョービ	12,000	1,768.00	21,216,000
アーレスティ	9,700	628.00	6,091,600
アサヒホールディングス	45,400	1,952.00	88,620,800
稲葉製作所	5,800	1,660.00	9,628,000
宮地エンジニアリンググループ	3,100	3,975.00	12,322,500
トーカロ	30,800	1,372.00	42,257,600
アルファC o	3,200	1,151.00	3,683,200
S U M C O	213,400	2,007.00	428,293,800

川田テクノロジーズ	2,600	5,260.00	13,676,000
RS Technologies	7,500	3,140.00	23,550,000
ジェイテックコーポレーション	1,200	2,534.00	3,040,800
信和	4,800	734.00	3,523,200
東洋製罐グループホールディングス	66,900	2,124.50	142,129,050
ホッカンホールディングス	6,000	1,374.00	8,244,000
コロナ	6,300	890.00	5,607,000
横河ブリッジホールディングス	14,000	2,390.00	33,460,000
駒井ハルテック	1,400	1,799.00	2,518,600
高田機工	700	2,751.00	1,925,700
三和ホールディングス	103,200	1,751.00	180,703,200
文化シャッター	32,300	1,104.00	35,659,200
三協立山	12,800	666.00	8,524,800
アルインコ	8,500	995.00	8,457,500
東洋シャッター	2,000	606.00	1,212,000
LIXIL	163,300	1,840.00	300,472,000
日本フィルコン	5,700	462.00	2,633,400
ノーリツ	16,500	1,791.00	29,551,500
長府製作所	11,300	2,453.00	27,718,900
リンナイ	61,000	3,002.00	183,122,000
ダイニチ工業	4,300	748.00	3,216,400
日東精工	16,200	590.00	9,558,000
三洋工業	1,000	1,919.00	1,919,000
岡部	18,000	785.00	14,130,000
ジーテクト	12,500	1,414.00	17,675,000
東プレ	19,700	1,460.00	28,762,000
高周波熱錬	17,300	941.00	16,279,300
東京製綱	6,600	1,094.00	7,220,400
サンコール	7,700	509.00	3,919,300
モリテック スチール	6,400	273.00	1,747,200
パイオラックス	15,500	1,980.00	30,690,000
エイチワン	11,500	677.00	7,785,500
日本発條	99,100	997.50	98,852,250
中央発條	8,300	695.00	5,768,500
アドバネクス	1,100	986.00	1,084,600
立川ブラインド工業	5,100	1,279.00	6,522,900
三益半導体工業	8,700	3,000.00	26,100,000
日本ドライケミカル	2,100	1,651.00	3,467,100
日本製綱所	30,300	2,996.50	90,793,950
三浦工業	45,800	3,807.00	174,360,600
タクマ	33,800	1,504.00	50,835,200
ツガミ	24,400	1,383.00	33,745,200



オークマ	11,000	7,087.00	77,957,000
芝浦機械	11,000	4,790.00	52,690,000
アマダ	175,100	1,360.50	238,223,550
アイダエンジニアリング	22,700	915.00	20,770,500
TAKISAWA	2,300	1,225.00	2,817,500
FUJI	47,700	2,488.50	118,701,450
牧野フライス製作所	12,200	5,330.00	65,026,000
オーエスジー	52,400	1,987.00	104,118,800
ダイジェット工業	1,000	863.00	863,000
旭ダイヤモンド工業	30,700	820.00	25,174,000
DMG森精機	66,600	2,497.50	166,333,500
ソディック	30,300	712.00	21,573,600
ディスコ	52,800	21,150.00	1,116,720,000
日東工器	5,300	1,949.00	10,329,700
日進工具	9,200	1,156.00	10,635,200
パンチ工業	7,800	489.00	3,814,200
富士ダイス	4,000	695.00	2,780,000
豊和工業	4,800	794.00	3,811,200
東洋機械金属	6,000	646.00	3,876,000
エンシュウ	1,900	708.00	1,345,200
島精機製作所	17,500	1,916.00	33,530,000
オプトラン	16,200	2,367.00	38,345,400
NCホールディングス	1,800	2,289.00	4,120,200
イワキポンプ	7,300	1,374.00	10,030,200
フリー	11,500	1,064.00	12,236,000
ヤマシンフィルタ	26,300	313.00	8,231,900
日阪製作所	10,700	876.00	9,373,200
やまびこ	17,900	1,524.00	27,279,600
野村マイクロ・サイエンス	3,700	6,470.00	23,939,000
平田機工	5,300	8,340.00	44,202,000
PEGASUS	12,200	560.00	6,832,000
マルマエ	4,800	1,679.00	8,059,200
タツモ	6,000	2,396.00	14,376,000
ナプテスコ	68,900	3,222.00	221,995,800
三井海洋開発	13,800	1,421.00	19,609,800
レオン自動機	11,600	1,456.00	16,889,600
S M C	35,600	80,860.00	2,878,616,000
ホソカワミクロン	7,700	2,970.00	22,869,000
ユニオンツール	4,800	3,320.00	15,936,000
オイレス工業	15,400	1,914.00	29,475,600
日精エー・エス・ビー機械	4,400	4,110.00	18,084,000
サトーホールディングス	15,600	1,943.00	30,310,800

技研製作所	10,300	2,022.00	20,826,600
日本エアージェット	5,600	1,177.00	6,591,200
カワタ	2,500	965.00	2,412,500
日精樹脂工業	8,200	980.00	8,036,000
オカダアイヨン	2,600	2,211.00	5,748,600
ワイエイシイホールディングス	3,600	3,360.00	12,096,000
小松製作所	514,100	3,567.00	1,833,794,700
住友重機械工業	64,900	3,352.00	217,544,800
日立建機	43,700	3,805.00	166,278,500
日工	16,400	642.00	10,528,800
巴工業	4,700	2,890.00	13,583,000
井関農機	10,300	1,223.00	12,596,900
TOWA	11,200	2,495.00	27,944,000
丸山製作所	1,500	1,857.00	2,785,500
北川鉄工所	4,400	1,188.00	5,227,200
ローツェ	5,700	11,720.00	66,804,000
タカキタ	2,500	442.00	1,105,000
クボタ	580,600	2,029.50	1,178,327,700
荏原実業	5,300	3,250.00	17,225,000
三菱化工機	3,600	2,763.00	9,946,800
月島ホールディングス	14,900	1,210.00	18,029,000
帝国電機製作所	7,700	2,413.00	18,580,100
新東工業	22,300	1,072.00	23,905,600
澁谷工業	10,300	2,660.00	27,398,000
アイチ コーポレーション	15,400	833.00	12,828,200
小森コーポレーション	25,500	926.00	23,613,000
鶴見製作所	8,400	2,532.00	21,268,800
日本ギア工業	3,000	387.00	1,161,000
酒井重工業	1,400	4,835.00	6,769,000
荏原製作所	44,900	6,607.00	296,654,300
石井鐵工所	1,000	2,478.00	2,478,000
西島製作所	9,500	1,700.00	16,150,000
北越工業	11,100	1,345.00	14,929,500
ダイキン工業	131,000	28,790.00	3,771,490,000
オルガノ	15,100	3,995.00	60,324,500
トーヨーカネツ	4,200	3,440.00	14,448,000
栗田工業	61,400	5,847.00	359,005,800
椿本チエイン	15,600	3,625.00	56,550,000
大同工業	3,500	721.00	2,523,500
木村化工機	8,500	740.00	6,290,000
アネスト岩田	18,700	1,097.00	20,513,900
ダイフク	169,700	2,965.50	503,245,350

サムコ	2,900	6,190.00	17,951,000
加藤製作所	4,100	1,218.00	4,993,800
油研工業	1,300	2,023.00	2,629,900
タダノ	57,900	1,106.50	64,066,350
フジテック	38,500	3,737.00	143,874,500
C K D	30,400	2,271.00	69,038,400
平和	36,500	2,372.00	86,578,000
理想科学工業	9,800	2,305.00	22,589,000
S A N K Y O	21,600	5,823.00	125,776,800
日本金銭機械	12,100	1,078.00	13,043,800
マースグループホールディングス	6,500	2,647.00	17,205,500
フクシマガリレイ	8,100	5,640.00	45,684,000
オーイズミ	3,300	484.00	1,597,200
ダイコク電機	6,000	2,910.00	17,460,000
竹内製作所	19,900	4,195.00	83,480,500
アマノ	31,200	3,001.00	93,631,200
J U K I	17,100	580.00	9,918,000
ジャノメ	11,200	604.00	6,764,800
マックス	13,500	2,430.00	32,805,000
グローリー	26,400	2,806.50	74,091,600
新晃工業	11,100	2,066.00	22,932,600
大和冷機工業	16,800	1,411.00	23,704,800
セガサミーホールディングス	88,200	2,894.50	255,294,900
日本ピストンリング	2,900	1,434.00	4,158,600
リケン	4,300	2,820.00	12,126,000
T P R	12,600	1,504.00	18,950,400
ツバキ・ナカシマ	27,100	852.00	23,089,200
ホシザキ	70,600	5,312.00	375,027,200
大豊工業	9,500	832.00	7,904,000
日本精工	201,600	853.10	171,984,960
N T N	216,300	289.30	62,575,590
ジェイテクト	97,600	1,208.00	117,900,800
不二越	8,100	3,975.00	32,197,500
日本トムソン	27,000	573.00	15,471,000
T H K	63,300	3,037.00	192,242,100
ユーシン精機	8,800	707.00	6,221,600
前澤給装工業	7,700	1,139.00	8,770,300
イーグル工業	12,200	1,637.00	19,971,400
前澤工業	4,900	774.00	3,792,600
日本ピラー工業	10,200	4,560.00	46,512,000
キッツ	40,400	1,097.00	44,318,800
マキタ	136,500	3,867.00	527,845,500

三井E & S	51,000	488.00	24,888,000
日立造船	90,000	869.00	78,210,000
三菱重工業	191,900	6,663.00	1,278,629,700
I H I	69,100	3,780.00	261,198,000
スター精密	20,700	1,831.00	37,901,700
日清紡ホールディングス	89,300	1,103.50	98,542,550
イビデン	63,000	7,664.00	482,832,000
コニカミノルタ	245,500	469.20	115,188,600
ブラザー工業	146,700	2,156.00	316,285,200
ミネベアミツミ	190,900	2,716.00	518,484,400
日立製作所	533,500	8,684.00	4,632,914,000
東芝	211,100	4,533.00	956,916,300
三菱電機	1,133,800	2,003.50	2,271,568,300
富士電機	66,700	6,269.00	418,142,300
東洋電機製造	2,800	973.00	2,724,400
安川電機	130,000	6,529.00	848,770,000
シンフォニアテクノロジー	12,100	1,672.00	20,231,200
明電舎	16,600	1,915.00	31,789,000
オリジン	1,900	1,252.00	2,378,800
山洋電気	4,800	7,550.00	36,240,000
デンヨー	8,400	1,916.00	16,094,400
P H C ホールディングス	15,500	1,446.00	22,413,000
ソシオネクスト	15,100	20,880.00	315,288,000
東芝テック	16,400	4,205.00	68,962,000
芝浦メカトロニクス	2,100	19,440.00	40,824,000
マブチモーター	27,300	3,953.00	107,916,900
ニデック	267,000	7,428.00	1,983,276,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	8,500	573.00	4,870,500
トレックス・セミコンダクター	5,300	2,205.00	11,686,500
東光高岳	6,700	2,123.00	14,224,100
ダブル・スコープ	35,900	1,263.00	45,341,700
ダイヘン	9,900	5,530.00	54,747,000
ヤーマン	19,200	1,166.00	22,387,200
J V C ケンウッド	100,400	527.00	52,910,800
ミマキエンジニアリング	10,700	812.00	8,688,400
I - P E X	6,300	1,390.00	8,757,000
大崎電気工業	26,000	541.00	14,066,000
オムロン	100,500	8,985.00	902,992,500
日東工業	14,800	3,400.00	50,320,000
I D E C	16,200	3,180.00	51,516,000
正興電機製作所	3,500	1,024.00	3,584,000
不二電機工業	1,900	1,162.00	2,207,800

ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,100	2,571.50	92,831,150
サクサホールディングス	1,800	1,792.00	3,225,600
メルコホールディングス	2,800	3,220.00	9,016,000
テクノメディカ	2,800	1,911.00	5,350,800
日本電気	155,200	6,908.00	1,072,121,600
富士通	109,300	19,085.00	2,085,990,500
沖電気工業	49,600	874.00	43,350,400
岩崎通信機	3,700	819.00	3,030,300
電気興業	4,400	2,274.00	10,005,600
サンケン電気	10,200	12,140.00	123,828,000
ナカヨ	1,400	1,144.00	1,601,600
アイホン	6,700	2,359.00	15,805,300
ルネサスエレクトロニクス	715,900	2,475.50	1,772,210,450
セイコーエプソン	140,800	2,202.50	310,112,000
ワコム	83,700	652.00	54,572,400
アルバック	26,100	5,912.00	154,303,200
アクセル	3,400	1,689.00	5,742,600
E I Z O	8,000	4,755.00	38,040,000
日本信号	25,000	1,081.00	27,025,000
京三製作所	23,000	443.00	10,189,000
能美防災	14,900	1,853.00	27,609,700
ホーチキ	8,300	1,726.00	14,325,800
星和電機	3,900	487.00	1,899,300
エレコム	26,400	1,538.00	40,603,200
パナソニック ホールディングス	1,295,900	1,647.50	2,134,995,250
シャープ	132,100	809.60	106,948,160
アンリツ	77,300	1,218.00	94,151,400
富士通ゼネラル	31,100	3,242.00	100,826,200
ソニーグループ	768,400	13,805.00	10,607,762,000
T D K	173,800	5,532.00	961,461,600
帝国通信工業	5,100	1,563.00	7,971,300
タムラ製作所	47,100	689.00	32,451,900
アルプスアルパイン	98,200	1,246.00	122,357,200
池上通信機	2,700	618.00	1,668,600
日本電波工業	13,300	1,308.00	17,396,400
鈴木	6,100	956.00	5,831,600
メイコー	12,100	2,562.00	31,000,200
日本トリム	2,500	2,883.00	7,207,500
ローランド ディー . ジー .	6,100	3,380.00	20,618,000
フォスター電機	10,200	947.00	9,659,400
S M K	2,600	2,349.00	6,107,400
ヨコオ	8,800	1,711.00	15,056,800

ホシデン	25,700	1,803.00	46,337,100
ヒロセ電機	18,100	19,500.00	352,950,000
日本航空電子工業	22,500	2,734.00	61,515,000
TOA	12,500	874.00	10,925,000
マクセル	22,400	1,487.00	33,308,800
古野電気	14,500	1,058.00	15,341,000
スミダコーポレーション	10,200	1,324.00	13,504,800
アイコム	4,200	2,945.00	12,369,000
リオン	4,600	1,860.00	8,556,000
横河電機	120,000	2,714.50	325,740,000
新電元工業	4,200	3,270.00	13,734,000
アズビル	75,900	4,626.00	351,113,400
東亜ディーケーケー	4,200	836.00	3,511,200
日本光電工業	50,200	3,817.00	191,613,400
チノー	4,500	2,279.00	10,255,500
共和電業	7,900	354.00	2,796,600
日本電子材料	7,200	1,658.00	11,937,600
堀場製作所	24,200	7,770.00	188,034,000
アドバンテスト	85,600	18,365.00	1,572,044,000
小野測器	3,600	437.00	1,573,200
エスペック	8,800	2,259.00	19,879,200
キーエンス	108,700	70,010.00	7,610,087,000
日置電機	5,700	9,010.00	51,357,000
シスメックス	93,700	10,100.00	946,370,000
日本マイクロニクス	18,000	1,796.00	32,328,000
メガチップス	9,000	3,730.00	33,570,000
OBARA GROUP	6,000	4,085.00	24,510,000
澤藤電機	1,200	1,335.00	1,602,000
原田工業	4,000	808.00	3,232,000
コーセル	13,300	1,197.00	15,920,100
イリソ電子工業	10,000	4,270.00	42,700,000
オブテックスグループ	20,000	1,992.00	39,840,000
千代田インテグレ	3,900	2,408.00	9,391,200
レーザーテック	49,800	21,160.00	1,053,768,000
スタンレー電気	77,400	2,907.00	225,001,800
ウシオ電機	55,300	1,920.50	106,203,650
岡谷電機産業	7,300	272.00	1,985,600
ヘリオス テクノ ホールディング	8,100	613.00	4,965,300
エノモト	2,300	1,660.00	3,818,000
日本セラミック	11,100	2,523.00	28,005,300
遠藤照明	4,000	1,203.00	4,812,000
古河電池	8,200	1,027.00	8,421,400

双信電機	4,000	356.00	1,424,000
山一電機	9,600	2,237.00	21,475,200
図研	9,500	3,610.00	34,295,000
日本電子	27,300	5,099.00	139,202,700
カシオ計算機	80,900	1,211.50	98,010,350
ファナック	533,100	5,130.00	2,734,803,000
日本シイエムケイ	23,600	512.00	12,083,200
エンプラス	3,200	5,650.00	18,080,000
大真空	13,600	643.00	8,744,800
ローム	50,200	12,680.00	636,536,000
浜松ホトニクス	87,200	7,130.00	621,736,000
三井ハイテック	11,200	9,400.00	105,280,000
新光電気工業	38,500	5,612.00	216,062,000
京セラ	168,800	7,804.00	1,317,315,200
太陽誘電	53,000	4,260.00	225,780,000
村田製作所	329,400	8,509.00	2,802,864,600
双葉電子工業	21,100	512.00	10,803,200
北陸電気工業	3,300	1,211.00	3,996,300
ニチコン	22,300	1,371.00	30,573,300
日本ケミコン	10,800	1,298.00	14,018,400
K O A	16,600	1,703.00	28,269,800
市光工業	16,100	537.00	8,645,700
小糸製作所	130,700	2,681.00	350,406,700
ミツバ	20,400	739.00	15,075,600
S C R E E Nホールディングス	18,600	15,545.00	289,137,000
キャノン電子	12,100	1,920.00	23,232,000
キャノン	595,900	3,586.00	2,136,897,400
リコー	272,300	1,232.50	335,609,750
象印マホービン	32,600	1,729.00	56,365,400
M U T O Hホールディングス	1,300	1,714.00	2,228,200
東京エレクトロン	229,900	18,955.00	4,357,754,500
イノテック	7,400	1,588.00	11,751,200
トヨタ紡織	45,800	2,427.50	111,179,500
芦森工業	1,600	1,919.00	3,070,400
ユニプレス	19,500	1,058.00	20,631,000
豊田自動織機	79,400	9,302.00	738,578,800
モリタホールディングス	19,100	1,528.00	29,184,800
三櫻工業	16,700	738.00	12,324,600
デンソー	224,000	9,188.00	2,058,112,000
東海理化電機製作所	30,600	2,040.00	62,424,000
川崎重工業	81,800	3,427.00	280,328,600
名村造船所	21,700	574.00	12,455,800

日本車輛製造	4,200	2,031.00	8,530,200
三菱ロジスネクスト	17,300	1,190.00	20,587,000
近畿車輛	1,200	1,453.00	1,743,600
日産自動車	1,543,000	524.30	808,994,900
いすゞ自動車	315,800	1,737.50	548,702,500
トヨタ自動車	5,964,300	2,069.00	12,340,136,700
日野自動車	140,000	611.50	85,610,000
三菱自動車工業	423,700	479.90	203,333,630
エフテック	5,900	973.00	5,740,700
レシップホールディングス	3,300	491.00	1,620,300
G M B	1,700	2,893.00	4,918,100
ファルテック	1,400	617.00	863,800
武蔵精密工業	26,600	1,717.00	45,672,200
日産車体	19,200	861.00	16,531,200
新明和工業	34,100	1,303.00	44,432,300
極東開発工業	17,900	1,691.00	30,268,900
トピー工業	8,800	2,117.00	18,629,600
ティラド	2,800	1,790.00	5,012,000
曙ブレーキ工業	66,300	140.00	9,282,000
タチエス	17,200	1,494.00	25,696,800
N O K	42,200	1,999.50	84,378,900
フタバ産業	29,200	482.00	14,074,400
K Y B	10,500	4,585.00	48,142,500
大同メタル工業	21,300	492.00	10,479,600
プレス工業	48,600	586.00	28,479,600
ミクニ	9,800	413.00	4,047,400
太平洋工業	24,900	1,285.00	31,996,500
アイシン	83,800	4,238.00	355,144,400
マツダ	359,300	1,286.50	462,239,450
今仙電機製作所	5,400	629.00	3,396,600
本田技研工業	882,900	4,297.00	3,793,821,300
スズキ	199,500	5,004.00	998,298,000
S U B A R U	343,700	2,562.50	880,731,250
安永	3,700	935.00	3,459,500
ヤマハ発動機	170,700	3,769.00	643,368,300
T B K	8,500	372.00	3,162,000
エクセディ	17,800	2,232.00	39,729,600
豊田合成	31,700	2,415.50	76,571,350
愛三工業	18,000	1,023.00	18,414,000
盟和産業	1,200	970.00	1,164,000
日本プラスト	6,700	443.00	2,968,100
ヨロズ	10,200	858.00	8,751,600



エフ・シー・シー	19,300	1,777.00	34,296,100
シマノ	44,400	23,500.00	1,043,400,000
テイ・エス テック	49,700	1,856.50	92,268,050
ジャムコ	4,600	1,357.00	6,242,200
テルモ	334,100	4,466.00	1,492,090,600
クリエートメディック	2,800	898.00	2,514,400
日機装	25,300	896.00	22,668,800
日本エム・ディ・エム	6,500	980.00	6,370,000
島津製作所	132,300	4,555.00	602,626,500
JMS	10,100	564.00	5,696,400
長野計器	7,900	1,901.00	15,017,900
ブイ・テクノロジー	5,300	2,552.00	13,525,600
東京計器	8,300	1,271.00	10,549,300
愛知時計電機	4,200	1,667.00	7,001,400
インターアクション	5,200	1,473.00	7,659,600
オーバル	7,500	405.00	3,037,500
東京精密	23,800	6,780.00	161,364,000
マニー	43,500	1,641.50	71,405,250
ニコン	157,100	1,585.00	249,003,500
トプコン	57,200	2,050.50	117,288,600
オリンパス	668,600	2,220.00	1,484,292,000
理研計器	6,700	4,955.00	33,198,500
タムロン	8,100	3,630.00	29,403,000
HOYA	232,000	17,435.00	4,044,920,000
シード	4,300	555.00	2,386,500
ノーリツ鋼機	10,300	2,278.00	23,463,400
A & Dホロンホールディングス	15,800	1,704.00	26,923,200
朝日インテック	121,400	2,758.00	334,821,200
シチズン時計	119,400	843.00	100,654,200
リズム	2,600	1,652.00	4,295,200
大研医器	6,400	515.00	3,296,000
メニコン	37,300	2,542.00	94,816,600
シンシア	800	552.00	441,600
松風	4,900	2,253.00	11,039,700
セイコーグループ	16,800	2,584.00	43,411,200
ニプロ	90,600	1,008.50	91,370,100
KYORITSU	12,500	142.00	1,775,000
中本パックス	2,600	1,611.00	4,188,600
スノーピーク	18,600	1,912.00	35,563,200
パラマウントベッドホールディングス	25,100	2,438.00	61,193,800
トランザクション	7,200	1,684.00	12,124,800
粧美堂	2,300	378.00	869,400

ニホンフラッシュ	10,200	990.00	10,098,000	
前田工織	9,200	3,180.00	29,256,000	
永大産業	9,000	207.00	1,863,000	
アートネイチャー	11,200	753.00	8,433,600	
バンダイナムコホールディングス	297,600	3,420.00	1,017,792,000	
アイフィスジャパン	2,300	609.00	1,400,700	
SHOEI	24,500	2,617.00	64,116,500	
フランスベッドホールディングス	13,500	1,110.00	14,985,000	
パイロットコーポレーション	17,000	4,485.00	76,245,000	
萩原工業	7,300	1,263.00	9,219,900	
フジシールインターナショナル	22,000	1,528.00	33,616,000	
タカラトミー	50,200	1,726.00	86,645,200	
広済堂ホールディングス	5,700	2,271.00	12,944,700	
エステールホールディングス	2,000	611.00	1,222,000	
タカノ	3,100	737.00	2,284,700	
プロネクサス	9,000	979.00	8,811,000	
ホクシン	6,500	133.00	864,500	
ウッドワン	2,800	1,166.00	3,264,800	
大建工業	6,600	2,320.00	15,312,000	
凸版印刷	142,000	3,053.00	433,526,000	
大日本印刷	118,700	3,958.00	469,814,600	
共同印刷	3,100	2,959.00	9,172,900	
NISSHA	20,700	1,583.00	32,768,100	
光村印刷	700	1,184.00	828,800	
TAKARA & COMPANY	6,900	2,250.00	15,525,000	
アシックス	100,300	4,062.00	407,418,600	
ツツミ	1,900	2,089.00	3,969,100	
ローランド	8,000	4,150.00	33,200,000	
小松ウオール工業	4,000	2,586.00	10,344,000	
ヤマハ	68,500	5,583.00	382,435,500	
河合楽器製作所	2,900	3,150.00	9,135,000	
クリナップ	12,200	684.00	8,344,800	
ピジョン	69,200	2,160.00	149,472,000	
キングジム	9,600	921.00	8,841,600	
リンテック	21,800	2,242.50	48,886,500	
イトーキ	22,300	948.00	21,140,400	
任天堂	685,800	6,126.00	4,201,210,800	
三菱鉛筆	15,400	1,702.00	26,210,800	
タカラスタンダード	20,000	1,790.00	35,800,000	
コクヨ	52,300	1,906.50	99,709,950	
ナカバヤシ	11,700	484.00	5,662,800	
グローブライド	8,800	2,216.00	19,500,800	

オカムラ	32,700	1,883.00	61,574,100
美津濃	10,800	3,760.00	40,608,000
東京電力ホールディングス	979,100	504.40	493,858,040
中部電力	400,300	1,737.00	695,321,100
関西電力	419,400	1,745.00	731,853,000
中国電力	173,000	958.70	165,855,100
北陸電力	102,500	812.70	83,301,750
東北電力	265,500	905.10	240,304,050
四国電力	92,700	1,046.50	97,010,550
九州電力	250,400	935.50	234,249,200
北海道電力	104,900	629.60	66,045,040
沖縄電力	25,400	1,231.00	31,267,400
電源開発	81,800	2,123.50	173,702,300
エフオン	7,000	548.00	3,836,000
イーレックス	19,300	1,200.00	23,160,000
レノバ	28,900	1,615.00	46,673,500
東京瓦斯	229,600	3,188.00	731,964,800
大阪瓦斯	220,000	2,294.00	504,680,000
東邦瓦斯	42,800	2,538.50	108,647,800
北海道瓦斯	6,500	2,240.00	14,560,000
広島ガス	22,900	369.00	8,450,100
西部ガスホールディングス	10,200	2,147.00	21,899,400
静岡ガス	24,800	1,224.00	30,355,200
メタウォーター	13,600	1,808.00	24,588,800
SBSホールディングス	9,700	3,155.00	30,603,500
東武鉄道	119,300	3,732.00	445,227,600
相鉄ホールディングス	35,900	2,587.50	92,891,250
東急	304,600	1,815.50	553,001,300
京浜急行電鉄	123,200	1,318.00	162,377,600
小田急電鉄	164,600	1,982.00	326,237,200
京王電鉄	57,400	4,711.00	270,411,400
京成電鉄	70,000	5,591.00	391,370,000
富士急行	13,400	5,080.00	68,072,000
東日本旅客鉄道	184,200	7,895.00	1,454,259,000
西日本旅客鉄道	138,800	5,995.00	832,106,000
東海旅客鉄道	83,700	17,580.00	1,471,446,000
西武ホールディングス	131,400	1,477.50	194,143,500
鴻池運輸	18,500	1,545.00	28,582,500
西日本鉄道	29,000	2,405.00	69,745,000
ハマキョウレックス	8,500	3,675.00	31,237,500
サカイ引越センター	5,200	4,810.00	25,012,000
近鉄グループホールディングス	108,400	4,873.00	528,233,200

阪急阪神ホールディングス	144,600	4,637.00	670,510,200
南海電気鉄道	51,800	3,203.00	165,915,400
京阪ホールディングス	59,800	3,627.00	216,894,600
神戸電鉄	2,900	3,035.00	8,801,500
名古屋鉄道	119,800	2,359.00	282,608,200
山陽電気鉄道	8,200	2,199.00	18,031,800
アルプス物流	8,600	1,370.00	11,782,000
ヤマトホールディングス	138,900	2,488.50	345,652,650
山九	27,600	4,908.00	135,460,800
丸運	4,100	240.00	984,000
丸全昭和運輸	6,700	3,810.00	25,527,000
センコーグループホールディングス	57,400	957.00	54,931,800
トナミホールディングス	2,400	4,370.00	10,488,000
ニッコンホールディングス	34,700	2,765.00	95,945,500
日本石油輸送	900	2,657.00	2,391,300
福山通運	8,200	3,415.00	28,003,000
セイノーホールディングス	67,500	1,645.50	111,071,250
エスライン	2,400	786.00	1,886,400
神奈川中央交通	3,100	3,175.00	9,842,500
A Z - C O M丸和ホールディングス	26,200	2,044.00	53,552,800
C & F ロジホールディングス	10,400	1,186.00	12,334,400
九州旅客鉄道	76,700	3,033.00	232,631,100
S Gホールディングス	208,100	2,045.00	425,564,500
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	40,500	8,095.00	327,847,500
日本郵船	290,300	3,003.00	871,770,900
商船三井	191,400	3,212.00	614,776,800
川崎汽船	81,700	3,182.00	259,969,400
N S ユナイテッド海運	6,000	3,435.00	20,610,000
飯野海運	40,600	818.00	33,210,800
共栄タンカー	2,300	841.00	1,934,300
乾汽船	14,200	1,304.00	18,516,800
日本航空	266,300	2,768.00	737,118,400
A N Aホールディングス	295,100	3,143.00	927,499,300
パスコ	1,600	1,670.00	2,672,000
トランコム	3,100	6,660.00	20,646,000
日新	8,200	2,436.00	19,975,200
三菱倉庫	23,300	3,491.00	81,340,300
三井倉庫ホールディングス	10,100	3,470.00	35,047,000
住友倉庫	29,200	2,337.00	68,240,400
澁澤倉庫	4,300	2,463.00	10,590,900
東陽倉庫	11,200	271.00	3,035,200
日本トランスシティ	21,800	609.00	13,276,200

ケイヒン	1,500	1,710.00	2,565,000
中央倉庫	5,200	1,036.00	5,387,200
川西倉庫	1,400	1,005.00	1,407,000
安田倉庫	7,400	975.00	7,215,000
ファイブホールディングス	1,500	1,240.00	1,860,000
東洋埠頭	2,400	1,334.00	3,201,600
上組	52,000	3,186.00	165,672,000
サンリツ	1,900	717.00	1,362,300
キムラユニティー	4,000	1,129.00	4,516,000
キューソー流通システム	5,000	959.00	4,795,000
東海運	4,900	282.00	1,381,800
エーアイティー	6,800	1,728.00	11,750,400
内外トランスライン	3,900	2,494.00	9,726,600
日本コンセプト	3,400	1,669.00	5,674,600
NEC ネットズエスアイ	36,500	1,984.00	72,416,000
クロスキャット	6,400	1,168.00	7,475,200
システナ	183,700	304.00	55,844,800
デジタルアーツ	6,900	5,950.00	41,055,000
日鉄ソリューションズ	18,600	4,055.00	75,423,000
キューブシステム	6,600	1,255.00	8,283,000
コア	4,900	1,715.00	8,403,500
手間いらず	1,900	3,955.00	7,514,500
ラクーンホールディングス	9,300	763.00	7,095,900
ソリトンシステムズ	5,800	1,190.00	6,902,000
ソフトクリエイイトホールディングス	9,000	1,693.00	15,237,000
T I S	119,200	3,662.00	436,510,400
J N Sホールディングス	4,200	539.00	2,263,800
グリー	29,400	673.00	19,786,200
G M Oペパボ	1,600	1,780.00	2,848,000
コーエーテクモホールディングス	68,300	2,353.00	160,709,900
三菱総合研究所	5,400	5,300.00	28,620,000
電算	1,100	1,626.00	1,788,600
A G S	3,800	717.00	2,724,600
ファインデックス	8,900	620.00	5,518,000
ブレインパッド	8,400	994.00	8,349,600
K L a b	21,700	344.00	7,464,800
ポールトゥウィンホールディングス	18,800	883.00	16,600,400
ネクソン	282,200	2,863.50	808,079,700
アイスタイル	31,900	650.00	20,735,000
エムアップホールディングス	13,500	1,183.00	15,970,500
エイチーム	6,700	695.00	4,656,500
エニグモ	14,300	401.00	5,734,300

テクノスジャパン	7,200	619.00	4,456,800
コロプラ	42,500	675.00	28,687,500
ブロードリーフ	64,000	440.00	28,160,000
クロス・マーケティンググループ	5,300	774.00	4,102,200
デジタルハーツホールディングス	6,900	1,291.00	8,907,900
システム情報	8,900	749.00	6,666,100
メディアドゥ	4,500	1,468.00	6,606,000
じげん	32,000	734.00	23,488,000
ブイキューブ	13,400	509.00	6,820,600
エンカレッジ・テクノロジー	2,300	519.00	1,193,700
サイバーリンクス	2,900	676.00	1,960,400
フィックスターズ	12,400	1,367.00	16,950,800
CARTA HOLDINGS	5,200	1,349.00	7,014,800
オブティム	9,100	1,057.00	9,618,700
セレス	4,500	999.00	4,495,500
SHIFT	7,200	25,505.00	183,636,000
ティーガイア	11,500	1,748.00	20,102,000
セック	1,200	3,325.00	3,990,000
テクマトリックス	20,000	1,843.00	36,860,000
プロシップ	4,900	1,450.00	7,105,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	32,000	2,843.50	90,992,000
GMOペイメントゲートウェイ	21,800	11,565.00	252,117,000
ザッパラス	2,700	365.00	985,500
システムリサーチ	3,500	2,526.00	8,841,000
インターネットイニシアティブ	60,800	2,785.00	169,328,000
さくらインターネット	12,500	695.00	8,687,500
ヴィンクス	2,600	1,465.00	3,809,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,400	3,275.00	11,135,000
SRAホールディングス	5,600	3,245.00	18,172,000
システムインテグレータ	2,900	460.00	1,334,000
朝日ネット	12,000	606.00	7,272,000
eBASE	15,500	781.00	12,105,500
アバントグループ	13,900	1,473.00	20,474,700
アドソル日進	4,700	1,816.00	8,535,200
ODKソリューションズ	2,100	575.00	1,207,500
フリービット	5,800	1,800.00	10,440,000
コムチュア	14,500	2,182.00	31,639,000
サイバーコム	1,500	1,533.00	2,299,500
アステリア	8,800	781.00	6,872,800
アイル	5,100	2,761.00	14,081,100
マークライنز	6,000	2,557.00	15,342,000
メディカル・データ・ビジョン	16,500	744.00	12,276,000

g u m i	16,200	671.00	10,870,200
ショーケース	2,400	415.00	996,000
モバイルファクトリー	1,900	909.00	1,727,100
テラスカイ	4,800	2,689.00	12,907,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,400	1,571.00	10,054,400
P C Iホールディングス	3,400	1,029.00	3,498,600
アイビーシー	1,600	637.00	1,019,200
ネオジャパン	3,800	965.00	3,667,000
P R T I M E S	2,800	1,435.00	4,018,000
ラクス	51,600	2,379.50	122,782,200
ランドコンピュータ	2,200	1,321.00	2,906,200
ダブルスタンダード	4,500	2,509.00	11,290,500
オープンドア	7,700	1,202.00	9,255,400
アカツキ	5,200	2,129.00	11,070,800
ベネフィットジャパン	600	1,215.00	729,000
U b i c o mホールディングス	3,500	1,745.00	6,107,500
カナミックネットワーク	12,100	440.00	5,324,000
ノムラシステムコーポレーション	9,300	119.00	1,106,700
チェンジホールディングス	26,700	2,098.00	56,016,600
シンクロ・フード	5,600	684.00	3,830,400
オークネット	5,500	1,667.00	9,168,500
キャピタル・アセット・プランニング	1,800	729.00	1,312,200
セグエグループ	2,500	1,091.00	2,727,500
エイトレッド	1,400	1,368.00	1,915,200
マクロミル	21,600	874.00	18,878,400
ビーグリー	1,500	1,178.00	1,767,000
オロ	3,400	2,212.00	7,520,800
ユーザーローカル	4,000	3,050.00	12,200,000
テモナ	2,400	285.00	684,000
ニーズウェル	4,800	726.00	3,484,800
マネーフォワード	26,300	6,248.00	164,322,400
サインポスト	3,300	509.00	1,679,700
S u n A s t e r i s k	7,800	1,232.00	9,609,600
電算システムホールディングス	5,300	3,490.00	18,497,000
A p p i e r G r o u p	41,400	1,593.00	65,950,200
ソルクシーズ	7,300	441.00	3,219,300
フェイス	2,700	503.00	1,358,100
プロトコーポレーション	13,800	1,151.00	15,883,800
ハイマックス	3,500	1,455.00	5,092,500
野村総合研究所	217,100	3,744.00	812,822,400
サイバネットシステム	9,300	878.00	8,165,400
C Eホールディングス	4,600	598.00	2,750,800

日本システム技術	3,600	2,498.00	8,992,800
インテージホールディングス	12,400	1,605.00	19,902,000
東邦システムサイエンス	2,500	1,229.00	3,072,500
ソースネクスト	56,100	207.00	11,612,700
インフォコム	14,100	2,325.00	32,782,500
シンプレクス・ホールディングス	18,700	2,418.00	45,216,600
HEROZ	3,800	2,189.00	8,318,200
ラクスル	26,200	1,358.00	35,579,600
メルカリ	65,700	3,115.00	204,655,500
I P S	3,600	2,256.00	8,121,600
F I G	10,400	281.00	2,922,400
システムサポート	4,300	2,030.00	8,729,000
イーソル	7,100	982.00	6,972,200
アルテリア・ネットワークス	10,200	1,967.00	20,063,400
東海ソフト	1,400	1,028.00	1,439,200
ウイングアーク1st	11,300	2,479.00	28,012,700
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,000	1,510.00	4,530,000
サーバーワークス	2,300	3,305.00	7,601,500
東名	700	2,395.00	1,676,500
ヴィッツ	1,000	1,421.00	1,421,000
トピラシステムズ	2,300	1,084.00	2,493,200
S a n s a n	35,700	1,791.50	63,956,550
L i n k - U	2,200	1,159.00	2,549,800
ギフトィ	11,900	1,912.00	22,752,800
メドレー	14,700	5,180.00	76,146,000
ベース	3,700	5,310.00	19,647,000
J M D C	17,900	5,850.00	104,715,000
フォーカスシステムズ	8,100	1,088.00	8,812,800
クレスコ	8,500	2,008.00	17,068,000
フジ・メディア・ホールディングス	104,800	1,361.00	142,632,800
オービック	36,400	24,025.00	874,510,000
ジャストシステム	15,700	4,326.00	67,918,200
T D C ソフト	9,300	1,655.00	15,391,500
Zホールディングス	1,550,800	355.10	550,689,080
トレンドマイクロ	62,900	6,900.00	434,010,000
I Dホールディングス	7,500	1,179.00	8,842,500
日本オラクル	20,900	11,080.00	231,572,000
アルファシステムズ	3,500	3,555.00	12,442,500
フューチャー	27,200	1,788.00	48,633,600
C A C H o l d i n g s	6,800	1,748.00	11,886,400
S B テクノロジー	4,700	2,519.00	11,839,300
トーセ	2,600	760.00	1,976,000



オービックビジネスコンサルタント	21,500	5,470.00	117,605,000
伊藤忠テクノソリューションズ	58,500	3,668.00	214,578,000
アイティフォー	14,500	1,058.00	15,341,000
東計電算	1,500	6,500.00	9,750,000
エクスネット	1,300	1,048.00	1,362,400
大塚商会	61,800	5,584.00	345,091,200
サイボウズ	15,100	2,433.00	36,738,300
電通国際情報サービス	13,300	5,300.00	70,490,000
A C C E S S	13,100	1,012.00	13,257,200
デジタルガレージ	19,400	3,865.00	74,981,000
E Mシステムズ	18,400	831.00	15,290,400
ウェザーニューズ	3,400	6,720.00	22,848,000
C I J	18,400	647.00	11,904,800
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,510.00	6,318,000
日本エンタープライズ	9,900	134.00	1,326,600
WOWOW	8,300	1,131.00	9,387,300
スカラ	10,300	789.00	8,126,700
インテリジェント ウェイブ	4,700	811.00	3,811,700
I M A G I C A G R O U P	9,400	594.00	5,583,600
ネットワンシステムズ	40,600	3,367.00	136,700,200
システムソフト	39,900	78.00	3,112,200
アルゴグラフィックス	10,000	4,080.00	40,800,000
マーベラス	17,900	665.00	11,903,500
エイベックス	18,600	1,511.00	28,104,600
B I P R O G Y	40,100	3,429.00	137,502,900
都築電気	5,800	1,842.00	10,683,600
T B Sホールディングス	55,800	2,389.00	133,306,200
日本テレビホールディングス	96,600	1,314.50	126,980,700
朝日放送グループホールディングス	10,400	647.00	6,728,800
テレビ朝日ホールディングス	26,600	1,603.00	42,639,800
スカパーJ S A Tホールディングス	96,900	561.00	54,360,900
テレビ東京ホールディングス	7,900	2,956.00	23,352,400
日本BS放送	3,200	915.00	2,928,000
ビジョン	14,400	1,822.00	26,236,800
スマートバリュー	2,400	397.00	952,800
U S E N - N E X T H O L D I N G S	12,300	3,400.00	41,820,000
ワイヤレスゲート	4,300	229.00	984,700
日本通信	100,700	275.00	27,692,500
クロップス	1,500	1,041.00	1,561,500
日本電信電話	1,395,900	4,118.00	5,748,316,200
K D D I	841,800	4,474.00	3,766,213,200
ソフトバンク	1,750,100	1,517.00	2,654,901,700

光通信	12,800	21,425.00	274,240,000
エムティーアイ	7,700	637.00	4,904,900
GMOインターネットグループ	40,300	2,698.50	108,749,550
ファイバーゲート	6,000	1,567.00	9,402,000
アйдママーケティングコミュニケーション	2,400	274.00	657,600
KADOKAWA	57,600	3,345.00	192,672,000
学研ホールディングス	18,300	881.00	16,122,300
ゼンリン	18,800	903.00	16,976,400
昭文社ホールディングス	4,100	298.00	1,221,800
インプレスホールディングス	8,100	206.00	1,668,600
アイネット	6,700	1,554.00	10,411,800
松竹	6,200	11,625.00	72,075,000
東宝	68,200	5,576.00	380,283,200
東映	3,000	18,100.00	54,300,000
エヌ・ティ・ティ・データ	341,900	2,059.00	703,972,100
ピー・シー・エー	6,400	1,338.00	8,563,200
ビジネスブレイン太田昭和	4,700	2,355.00	11,068,500
DTS	23,200	3,505.00	81,316,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	54,800	6,619.00	362,721,200
シーイーシー	15,400	1,683.00	25,918,200
カブコン	108,300	5,695.00	616,768,500
アイ・エス・ビー	5,700	1,648.00	9,393,600
ジャステック	6,800	1,317.00	8,955,600
SCSK	89,000	2,285.00	203,365,000
NSW	4,300	2,466.00	10,603,800
アイネス	7,800	1,464.00	11,419,200
TKC	17,400	3,800.00	66,120,000
富士ソフト	12,300	9,060.00	111,438,000
NSD	38,900	2,843.00	110,592,700
コナミグループ	46,700	7,808.00	364,633,600
福井コンピュータホールディングス	7,600	2,969.00	22,564,400
JBCホールディングス	8,000	2,392.00	19,136,000
ミロク情報サービス	10,000	1,576.00	15,760,000
ソフトバンクグループ	537,400	5,995.00	3,221,713,000
高千穂交易	3,200	2,899.00	9,276,800
オルバヘルスケアホールディングス	1,300	1,928.00	2,506,400
伊藤忠食品	2,600	5,200.00	13,520,000
エレマテック	10,300	1,755.00	18,076,500
あらた	8,800	4,615.00	40,612,000
トーメンデバイス	1,700	5,720.00	9,724,000
東京エレクトロン デバイス	4,200	10,540.00	44,268,000
円谷フィールズホールディングス	19,700	2,614.00	51,495,800

双日	114,600	3,071.00	351,936,600
アルフレッサ ホールディングス	115,400	2,175.00	250,995,000
横浜冷凍	31,300	1,170.00	36,621,000
ラサ商事	4,100	1,397.00	5,727,700
アルコニックス	15,100	1,350.00	20,385,000
神戸物産	88,900	3,965.00	352,488,500
ハイパー	1,700	437.00	742,900
あい ホールディングス	18,400	2,344.00	43,129,600
ディーブイエックス	2,500	924.00	2,310,000
ダイワボウホールディングス	47,000	2,806.00	131,882,000
マクニカホールディングス	27,200	5,330.00	144,976,000
ラクト・ジャパン	4,400	1,992.00	8,764,800
グリムス	4,800	2,906.00	13,948,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	16,800	910.00	15,288,000
八洲電機	9,300	1,356.00	12,610,800
メディアスホールディングス	7,400	887.00	6,563,800
レスターホールディングス	11,000	2,432.00	26,752,000
ジューテックホールディングス	2,100	1,144.00	2,402,400
大光	3,800	578.00	2,196,400
OCHIホールディングス	2,000	1,239.00	2,478,000
TOKAIホールディングス	56,800	885.00	50,268,000
黒谷	2,500	593.00	1,482,500
Cominix	1,800	780.00	1,404,000
三洋貿易	13,000	1,361.00	17,693,000
ビューティガレージ	1,800	4,270.00	7,686,000
ウイン・パートナーズ	8,400	1,010.00	8,484,000
ミタチ産業	2,300	1,414.00	3,252,200
シップヘルスケアホールディングス	41,300	2,412.50	99,636,250
明治電機工業	4,300	1,340.00	5,762,000
デリカフーズホールディングス	3,500	594.00	2,079,000
スターティアホールディングス	1,800	1,208.00	2,174,400
コメダホールディングス	28,200	2,664.00	75,124,800
ピーバンドットコム	1,300	471.00	612,300
アセンテック	3,900	749.00	2,921,100
富士興産	2,000	1,408.00	2,816,000
協栄産業	800	2,090.00	1,672,000
フルサト・マルカホールディングス	11,400	2,403.00	27,394,200
ヤマエグループホールディングス	6,500	2,938.00	19,097,000
小野建	11,300	1,536.00	17,356,800
南陽	1,700	2,161.00	3,673,700
佐島電機	5,600	1,704.00	9,542,400
エコートレーディング	1,700	785.00	1,334,500

伯東	6,600	5,020.00	33,132,000
コンドーテック	8,800	1,111.00	9,776,800
中山福	4,800	350.00	1,680,000
ナガイレーベン	14,500	2,184.00	31,668,000
三菱食品	10,600	3,550.00	37,630,000
松田産業	8,800	2,153.00	18,946,400
第一興商	44,500	2,529.00	112,540,500
メディカルホールディングス	109,900	2,324.00	255,407,600
S P K	5,100	1,742.00	8,884,200
萩原電気ホールディングス	4,400	3,015.00	13,266,000
アズワン	16,400	5,772.00	94,660,800
スズデン	4,000	2,217.00	8,868,000
尾家産業	2,100	1,199.00	2,517,900
シモジマ	7,900	1,127.00	8,903,300
ドウシシャ	12,200	2,197.00	26,803,400
小津産業	2,000	1,613.00	3,226,000
高速	6,000	2,059.00	12,354,000
たけびし	4,400	1,699.00	7,475,600
リックス	1,900	2,941.00	5,587,900
丸文	10,300	1,248.00	12,854,400
ハピネット	9,800	2,070.00	20,286,000
橋本総業ホールディングス	4,600	1,178.00	5,418,800
日本ライフライン	33,700	1,064.00	35,856,800
タカショー	10,000	676.00	6,760,000
I D O M	34,800	864.00	30,067,200
進和	7,000	2,175.00	15,225,000
エスケイジャパン	2,200	566.00	1,245,200
ダイトロン	4,500	2,996.00	13,482,000
シークス	16,400	1,563.00	25,633,200
田中商事	2,500	623.00	1,557,500
オーハシテクニカ	5,600	1,565.00	8,764,000
白銅	4,200	2,327.00	9,773,400
ダイコー通産	900	1,111.00	999,900
伊藤忠商事	708,100	5,429.00	3,844,274,900
丸紅	896,800	2,243.50	2,011,970,800
高島	1,400	3,530.00	4,942,000
長瀬産業	52,700	2,386.50	125,768,550
蝶理	6,200	2,692.00	16,690,400
豊田通商	100,700	6,842.00	688,989,400
三共生興	16,500	555.00	9,157,500
兼松	44,600	1,947.00	86,836,200
ツカモトコーポレーション	1,300	1,326.00	1,723,800

三井物産	815,600	5,042.00	4,112,255,200
日本紙パルプ商事	6,100	5,020.00	30,622,000
カメイ	12,200	1,377.00	16,799,400
東都水産	500	6,500.00	3,250,000
OUGホールディングス	1,300	2,443.00	3,175,900
スターゼン	8,700	2,377.00	20,679,900
山善	31,000	1,098.00	34,038,000
椿本興業	1,900	3,935.00	7,476,500
住友商事	711,700	2,892.50	2,058,592,250
内田洋行	4,700	5,690.00	26,743,000
三菱商事	710,800	6,287.00	4,468,799,600
第一実業	4,100	5,800.00	23,780,000
キャノンマーケティングジャパン	26,600	3,550.00	94,430,000
西華産業	4,500	2,025.00	9,112,500
佐藤商事	8,000	1,406.00	11,248,000
菱洋エレクトロ	9,800	3,310.00	32,438,000
東京産業	10,500	856.00	8,988,000
ユアサ商事	10,400	4,450.00	46,280,000
神鋼商事	2,900	5,560.00	16,124,000
トルク	4,900	227.00	1,112,300
阪和興業	20,600	4,380.00	90,228,000
正栄食品工業	7,600	4,025.00	30,590,000
カナデン	7,700	1,259.00	9,694,300
RYODEN	9,300	2,080.00	19,344,000
岩谷産業	26,200	7,527.00	197,207,400
ナイス	2,400	1,451.00	3,482,400
ニチモウ	1,100	3,580.00	3,938,000
極東貿易	6,900	1,624.00	11,205,600
アステナホールディングス	19,900	456.00	9,074,400
三愛オブリ	30,400	1,481.00	45,022,400
稲畑産業	23,200	3,095.00	71,804,000
G S Iクレオス	6,700	1,907.00	12,776,900
明和産業	15,300	683.00	10,449,900
クワザワホールディングス	2,900	450.00	1,305,000
ワキタ	21,100	1,297.00	27,366,700
東邦ホールディングス	28,600	2,628.50	75,175,100
サンゲツ	28,900	2,442.00	70,573,800
ミツウロコグループホールディングス	14,700	1,345.00	19,771,500
シナネンホールディングス	3,700	3,815.00	14,115,500
伊藤忠エネクス	28,500	1,219.00	34,741,500
サンリオ	32,600	5,727.00	186,700,200
サンワテクノス	5,900	2,337.00	13,788,300

リョーサン	12,200	4,020.00	49,044,000
新光商事	15,500	1,182.00	18,321,000
トーホー	4,900	2,460.00	12,054,000
三信電気	4,600	2,095.00	9,637,000
東陽テクニカ	11,700	1,386.00	16,216,200
モスフードサービス	16,900	3,175.00	53,657,500
加賀電子	9,300	5,620.00	52,266,000
ソーダニッカ	6,600	792.00	5,227,200
立花エレテック	8,400	2,751.00	23,108,400
フォーバル	4,500	1,035.00	4,657,500
PALTAC	18,100	5,120.00	92,672,000
三谷産業	20,100	314.00	6,311,400
西本Wismettacホールディングス	2,900	4,510.00	13,079,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	700	2,071.00	1,449,700
コア商事ホールディングス	6,500	701.00	4,556,500
KPPグループホールディングス	26,800	614.00	16,455,200
ヤマタネ	5,100	1,627.00	8,297,700
丸紅建材リース	800	2,193.00	1,754,400
泉州電業	5,800	3,585.00	20,793,000
トラスコ中山	24,100	2,235.00	53,863,500
オートバックスセブン	40,000	1,533.00	61,320,000
モリト	8,200	1,030.00	8,446,000
加藤産業	14,200	3,965.00	56,303,000
北恵	2,000	735.00	1,470,000
イエローハット	20,300	1,848.00	37,514,400
JKホールディングス	8,800	961.00	8,456,800
日伝	6,800	2,239.00	15,225,200
北沢産業	4,800	379.00	1,819,200
杉本商事	5,100	2,046.00	10,434,600
因幡電機産業	29,800	3,290.00	98,042,000
東テク	3,800	4,305.00	16,359,000
ミスミグループ本社	173,500	3,013.00	522,755,500
アルテック	5,000	273.00	1,365,000
タキヒヨー	2,200	937.00	2,061,400
蔵王産業	1,500	2,222.00	3,333,000
スズケン	33,700	3,612.00	121,724,400
ジェコス	6,900	863.00	5,954,700
グローセル	10,800	410.00	4,428,000
ローソン	28,500	6,211.00	177,013,500
サンエー	8,800	4,555.00	40,084,000
カワチ薬品	9,100	2,192.00	19,947,200
エービーシー・マート	16,800	8,176.00	137,356,800

ハードオフコーポレーション	3,800	1,379.00	5,240,200
アスクル	23,900	1,875.00	44,812,500
ゲオホールディングス	11,400	1,672.00	19,060,800
アダストリア	14,000	2,970.00	41,580,000
くら寿司	13,600	3,090.00	42,024,000
キャンドウ	4,200	2,443.00	10,260,600
I Kホールディングス	3,700	374.00	1,383,800
パルグループホールディングス	11,400	3,755.00	42,807,000
エディオン	45,700	1,407.00	64,299,900
サーラコーポレーション	24,600	770.00	18,942,000
ワッツ	4,800	704.00	3,379,200
ハローズ	5,300	3,420.00	18,126,000
あみやき亭	2,900	3,515.00	10,193,500
大黒天物産	3,600	5,070.00	18,252,000
ハニーズホールディングス	9,300	1,507.00	14,015,100
ファーマライズホールディングス	2,500	617.00	1,542,500
アルペン	9,600	1,994.00	19,142,400
ハブ	3,300	771.00	2,544,300
クオールホールディングス	16,100	1,805.00	29,060,500
ジーンズホールディングス	6,900	3,145.00	21,700,500
ビックカメラ	61,400	1,070.00	65,698,000
D C Mホールディングス	70,400	1,245.00	87,648,000
Monotaro	163,100	2,039.50	332,642,450
東京一番フーズ	2,700	496.00	1,339,200
きちりホールディングス	2,100	911.00	1,913,100
アークランドサービスホールディングス	9,500	2,952.00	28,044,000
J . フロント リテイリング	143,100	1,410.00	201,771,000
ドトール・日レスホールディングス	20,500	2,047.00	41,963,500
マツキヨココカラ & カンパニー	69,700	7,886.00	549,654,200
ブロンコビリー	6,200	2,881.00	17,862,200
Z O Z O	76,100	2,955.00	224,875,500
トレジャー・ファクトリー	5,700	1,595.00	9,091,500
物語コーポレーション	19,300	3,340.00	64,462,000
三越伊勢丹ホールディングス	193,700	1,402.00	271,567,400
H a m e e	4,300	948.00	4,076,400
マーケットエンタープライズ	1,200	1,383.00	1,659,600
ウエルシアホールディングス	59,700	2,920.00	174,324,000
クリエイトSDホールディングス	19,100	3,490.00	66,659,000
丸善C H I ホールディングス	11,400	350.00	3,990,000
ミサワ	2,100	616.00	1,293,600
ティーライフ	1,400	1,399.00	1,958,600
チムニー	2,700	1,248.00	3,369,600

シュッピン	8,900	1,097.00	9,763,300
オイシックス・ラ・大地	15,600	2,262.00	35,287,200
ネクステージ	26,400	2,770.00	73,128,000
ジョイフル本田	34,300	1,759.00	60,333,700
鳥貴族ホールディングス	4,400	2,470.00	10,868,000
ホットランド	9,000	1,727.00	15,543,000
すかいらーくホールディングス	157,300	1,847.00	290,533,100
SFPホールディングス	6,300	2,017.00	12,707,100
綿半ホールディングス	9,100	1,364.00	12,412,400
ヨシックスホールディングス	1,900	2,250.00	4,275,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	37,700	1,112.00	41,922,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,600	868.00	4,860,800
B E E N O S	5,000	1,849.00	9,245,000
あさひ	9,800	1,276.00	12,504,800
日本調剤	8,100	1,170.00	9,477,000
コスモス薬品	11,400	13,740.00	156,636,000
トーエル	4,400	786.00	3,458,400
セブン&アイ・ホールディングス	396,100	6,156.00	2,438,391,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	86,400	1,002.00	86,572,800
ツルハホールディングス	24,200	9,902.00	239,628,400
サンマルクホールディングス	9,400	1,910.00	17,954,000
フェリシモ	2,300	1,011.00	2,325,300
トリドールホールディングス	28,700	2,960.00	84,952,000
T O K Y O B A S E	12,500	465.00	5,812,500
ウイルプラスホールディングス	1,700	1,168.00	1,985,600
J Mホールディングス	8,800	2,030.00	17,864,000
サツドラホールディングス	4,400	791.00	3,480,400
アレンザホールディングス	8,900	996.00	8,864,400
串カツ田中ホールディングス	3,300	1,690.00	5,577,000
パロックジャパンリミテッド	7,800	839.00	6,544,200
クスリのアオキホールディングス	10,300	7,597.00	78,249,100
力の源ホールディングス	5,100	1,401.00	7,145,100
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	61,400	3,130.00	192,182,000
メディカルシステムネットワーク	10,800	368.00	3,974,400
はるやまホールディングス	4,400	480.00	2,112,000
ノジマ	37,700	1,401.00	52,817,700
カップ・クリエイト	18,100	1,507.00	27,276,700
ライトオン	6,700	563.00	3,772,100
良品計画	125,700	1,388.50	174,534,450
パリミキホールディングス	12,100	325.00	3,932,500



アドヴァングループ	11,300	956.00	10,802,800
アルビス	3,900	2,393.00	9,332,700
コナカ	9,700	362.00	3,511,400
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,607.00	2,089,100
G - 7ホールディングス	14,600	1,293.00	18,877,800
イオン北海道	17,100	861.00	14,723,100
コジマ	19,600	566.00	11,093,600
ヒマラヤ	3,100	938.00	2,907,800
コーナン商事	15,600	3,525.00	54,990,000
エコス	4,400	1,881.00	8,276,400
ワタミ	13,900	906.00	12,593,400
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	232,000	2,521.00	584,872,000
西松屋チェーン	25,600	1,643.00	42,060,800
ゼンショーホールディングス	63,000	6,048.00	381,024,000
幸楽苑ホールディングス	7,500	1,003.00	7,522,500
ハークスレイ	3,600	622.00	2,239,200
サイゼリヤ	17,100	3,585.00	61,303,500
V Tホールディングス	44,300	524.00	23,213,200
魚力	3,700	2,165.00	8,010,500
フジ・コーポレーション	6,700	1,343.00	8,998,100
ユナイテッドアローズ	12,400	2,428.00	30,107,200
ハイデイ日高	17,200	2,359.00	40,574,800
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	7,000	195.00	1,365,000
コロワイド	52,900	2,000.00	105,800,000
ピーシーデポコーポレーション	13,700	479.00	6,562,300
壱番屋	9,100	5,370.00	48,867,000
P L A N T	2,500	693.00	1,732,500
スギホールディングス	23,200	5,905.00	136,996,000
薬王堂ホールディングス	6,500	2,607.00	16,945,500
スクロール	17,400	922.00	16,042,800
ヨンドシーホールディングス	10,100	1,778.00	17,957,800
木曽路	17,500	2,384.00	41,720,000
S R S ホールディングス	19,300	953.00	18,392,900
千趣会	21,900	415.00	9,088,500
リテールパートナーズ	17,300	1,686.00	29,167,800
ケーヨー	18,700	815.00	15,240,500
上新電機	10,400	1,968.00	20,467,200
日本瓦斯	61,700	1,948.00	120,191,600
ロイヤルホールディングス	22,300	2,690.00	59,987,000
いなげや	11,200	1,600.00	17,920,000
チヨダ	11,400	863.00	9,838,200

ライフコーポレーション	10,100	3,060.00	30,906,000
リンガーハット	14,800	2,437.00	36,067,600
MrMaxHD	16,600	617.00	10,242,200
AOKIホールディングス	21,700	831.00	18,032,700
オークワ	18,500	863.00	15,965,500
コメリ	17,800	2,963.00	52,741,400
青山商事	24,800	1,285.00	31,868,000
しまむら	13,500	13,100.00	176,850,000
はせがわ	5,100	343.00	1,749,300
高島屋	86,700	1,867.50	161,912,250
松屋	19,600	1,175.00	23,030,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	56,000	1,457.00	81,592,000
近鉄百貨店	5,100	2,531.00	12,908,100
丸井グループ	84,800	2,422.00	205,385,600
アクシアル リテイリング	7,900	3,385.00	26,741,500
イオン	389,600	2,796.50	1,089,516,400
イズミ	17,500	3,364.00	58,870,000
平和堂	19,300	2,119.00	40,896,700
フジ	17,700	1,824.00	32,284,800
ヤオコー	13,000	7,122.00	92,586,000
ゼビオホールディングス	15,800	1,123.00	17,743,400
ケーズホールディングス	81,500	1,257.50	102,486,250
Olympicグループ	3,900	552.00	2,152,800
日産東京販売ホールディングス	12,300	343.00	4,218,900
シルバーライフ	2,500	1,252.00	3,130,000
Genky DrugStores	5,100	4,130.00	21,063,000
ナルミヤ・インターナショナル	1,800	956.00	1,720,800
ブックオフグループホールディングス	6,100	1,260.00	7,686,000
ギフトホールディングス	2,500	5,200.00	13,000,000
アインホールディングス	15,900	5,200.00	82,680,000
元気寿司	3,300	3,270.00	10,791,000
ヤマダホールディングス	472,000	430.80	203,337,600
アーケランズ	17,000	1,581.00	26,877,000
ニトリホールディングス	46,500	17,395.00	808,867,500
グルメ杵屋	9,600	1,055.00	10,128,000
愛眼	6,600	192.00	1,267,200
ケーユーホールディングス	7,000	1,264.00	8,848,000
吉野家ホールディングス	45,100	2,575.00	116,132,500
松屋フーズホールディングス	5,500	4,110.00	22,605,000
サガミホールディングス	18,700	1,254.00	23,449,800
関西フードマーケット	10,600	1,523.00	16,143,800
王将フードサービス	7,600	6,440.00	48,944,000

ミニストップ	8,400	1,461.00	12,272,400
アークス	21,200	2,428.00	51,473,600
パローホールディングス	22,100	1,924.00	42,520,400
ベルク	5,800	6,090.00	35,322,000
大庄	5,100	1,109.00	5,655,900
ファーストリテイリング	51,700	34,790.00	1,798,643,000
サンドラッグ	43,700	4,184.00	182,840,800
サクスパー ホールディングス	11,200	969.00	10,852,800
ヤマザワ	1,900	1,246.00	2,367,400
やまや	2,000	2,660.00	5,320,000
ペルーナ	28,100	696.00	19,557,600
いよぎんホールディングス	127,300	746.50	95,029,450
しずおかフィナンシャルグループ	241,700	1,011.00	244,358,700
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	90,100	857.50	77,260,750
楽天銀行	36,300	1,885.00	68,425,500
島根銀行	2,900	480.00	1,392,000
じもとホールディングス	7,300	390.00	2,847,000
めぶきフィナンシャルグループ	530,800	338.40	179,622,720
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,700	3,115.00	42,675,500
九州フィナンシャルグループ	188,200	543.20	102,230,240
ゆうちょ銀行	299,800	1,087.00	325,882,600
富山第一銀行	35,500	683.00	24,246,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	574,100	548.90	315,123,490
西日本フィナンシャルホールディングス	66,400	1,186.00	78,750,400
三十三フィナンシャルグループ	9,600	1,541.00	14,793,600
第四北越フィナンシャルグループ	16,800	3,055.00	51,324,000
ひろぎんホールディングス	139,600	783.90	109,432,440
おきなわフィナンシャルグループ	10,200	2,121.00	21,634,200
十六フィナンシャルグループ	13,900	3,075.00	42,742,500
北國フィナンシャルホールディングス	12,000	4,405.00	52,860,000
プロクレアホールディングス	13,100	2,078.00	27,221,800
あいちフィナンシャルグループ	15,000	2,180.00	32,700,000
S B I 新生銀行	25,000	2,810.00	70,250,000
あおぞら銀行	67,300	2,600.00	174,980,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,699,700	961.00	6,438,411,700
りそなホールディングス	1,352,100	645.70	873,050,970
三井住友トラスト・ホールディングス	194,400	5,031.00	978,026,400
三井住友フィナンシャルグループ	781,700	5,749.00	4,493,993,300
千葉銀行	298,100	860.80	256,604,480
群馬銀行	207,600	513.70	106,644,120
武蔵野銀行	13,700	2,136.00	29,263,200
千葉興業銀行	19,500	546.00	10,647,000

筑波銀行	46,900	200.00	9,380,000
七十七銀行	34,300	2,425.00	83,177,500
秋田銀行	7,200	1,687.00	12,146,400
山形銀行	11,900	1,078.00	12,828,200
岩手銀行	7,300	2,052.00	14,979,600
東邦銀行	84,600	228.00	19,288,800
東北銀行	4,100	1,001.00	4,104,100
ふくおかフィナンシャルグループ	85,400	2,705.50	231,049,700
スルガ銀行	94,300	500.00	47,150,000
八十二銀行	226,004	602.00	136,054,408
山梨中央銀行	11,000	1,151.00	12,661,000
大垣共立銀行	20,400	1,833.00	37,393,200
福井銀行	9,600	1,430.00	13,728,000
清水銀行	4,300	1,428.00	6,140,400
富山銀行	1,300	1,655.00	2,151,500
滋賀銀行	17,800	2,731.00	48,611,800
南都銀行	16,100	2,405.00	38,720,500
百五銀行	100,600	409.00	41,145,400
京都銀行	33,900	6,908.00	234,181,200
紀陽銀行	38,300	1,484.00	56,837,200
ほくほくフィナンシャルグループ	68,000	1,122.50	76,330,000
山陰合同銀行	67,000	781.00	52,327,000
鳥取銀行	2,700	1,145.00	3,091,500
百十四銀行	9,800	1,757.00	17,218,600
四国銀行	17,000	844.00	14,348,000
阿波銀行	15,000	1,985.00	29,775,000
大分銀行	6,400	2,112.00	13,516,800
宮崎銀行	7,000	2,264.00	15,848,000
佐賀銀行	6,300	1,617.00	10,187,100
琉球銀行	24,500	905.00	22,172,500
セブン銀行	383,200	282.30	108,177,360
みずほフィナンシャルグループ	1,547,100	2,098.00	3,245,815,800
高知銀行	2,800	678.00	1,898,400
山口フィナンシャルグループ	118,100	901.10	106,419,910
名古屋銀行	7,000	3,295.00	23,065,000
北洋銀行	162,100	271.00	43,929,100
大光銀行	2,500	1,056.00	2,640,000
愛媛銀行	14,400	798.00	11,491,200
トマト銀行	2,700	1,014.00	2,737,800
京葉銀行	49,000	526.00	25,774,000
栃木銀行	49,000	250.00	12,250,000
北日本銀行	3,800	1,986.00	7,546,800

東和銀行	19,600	528.00	10,348,800
福島銀行	8,800	214.00	1,883,200
大東銀行	3,300	623.00	2,055,900
トモニホールディングス	86,500	361.00	31,226,500
フィデアホールディングス	11,100	1,315.00	14,596,500
池田泉州ホールディングス	137,000	237.00	32,469,000
F P G	36,300	1,169.00	42,434,700
ジャパンインベストメントアドバイザー	8,800	1,111.00	9,776,800
マーキュリアホールディングス	5,100	716.00	3,651,600
S B Iホールディングス	154,900	2,690.00	416,681,000
ジャフコ グループ	35,800	1,781.50	63,777,700
大和証券グループ本社	765,100	692.80	530,061,280
野村ホールディングス	1,970,400	515.20	1,015,150,080
岡三証券グループ	94,200	464.00	43,708,800
丸三証券	35,900	424.00	15,221,600
東洋証券	35,800	288.00	10,310,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	116,800	369.00	43,099,200
光世証券	2,200	430.00	946,000
水戸証券	29,100	303.00	8,817,300
いちよし証券	19,900	591.00	11,760,900
松井証券	63,300	786.00	49,753,800
マネックスグループ	115,500	498.00	57,519,000
極東証券	13,500	627.00	8,464,500
岩井コスモホールディングス	12,300	1,387.00	17,060,100
アイザワ証券グループ	15,600	800.00	12,480,000
マネーパートナーズグループ	9,100	259.00	2,356,900
スパークス・グループ	12,000	1,575.00	18,900,000
かんぽ生命保険	129,900	2,115.00	274,738,500
S O M P Oホールディングス	183,600	6,270.00	1,151,172,000
アニコム ホールディングス	36,300	626.00	22,723,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	217,700	5,172.00	1,125,944,400
第一生命ホールディングス	522,600	2,579.00	1,347,785,400
東京海上ホールディングス	1,057,400	3,232.00	3,417,516,800
T & Dホールディングス	287,100	2,007.00	576,209,700
アドバンスクリエイト	6,200	1,173.00	7,272,600
全国保証	28,000	5,125.00	143,500,000
あんしん保証	4,800	304.00	1,459,200
イントラスト	3,400	967.00	3,287,800
日本モーゲージサービス	5,000	582.00	2,910,000
C a s a	3,500	875.00	3,062,500
アルヒ	13,400	984.00	13,185,600
プレミアグループ	18,200	1,596.00	29,047,200

ネットプロテクションズホールディングス	35,900	345.00	12,385,500
クレディセゾン	67,900	2,016.00	136,886,400
芙蓉総合リース	9,900	10,450.00	103,455,000
みずほリース	16,000	4,420.00	70,720,000
東京センチュリー	20,000	5,195.00	103,900,000
日本証券金融	43,100	1,138.00	49,047,800
アイフル	177,800	341.00	60,629,800
リコーリース	10,200	3,930.00	40,086,000
イオンフィナンシャルサービス	61,600	1,262.00	77,739,200
アコム	191,600	332.90	63,783,640
ジャックス	11,400	4,590.00	52,326,000
オリエントコーポレーション	28,100	1,084.00	30,460,400
オリックス	702,300	2,456.00	1,724,848,800
三菱HCキャピタル	417,400	769.30	321,105,820
九州リースサービス	4,200	830.00	3,486,000
日本取引所グループ	300,700	2,409.50	724,536,650
イー・ギャランティ	17,500	1,940.00	33,950,000
アサックス	4,100	621.00	2,546,100
NECキャピタルソリューション	5,300	2,971.00	15,746,300
大東建託	39,200	13,910.00	545,272,000
いちご	124,700	268.00	33,419,600
日本駐車場開発	114,900	257.00	29,529,300
スター・マイカ・ホールディングス	10,300	641.00	6,602,300
SREホールディングス	5,400	3,460.00	18,684,000
ADワークスグループ	20,900	208.00	4,347,200
ヒューリック	249,900	1,214.00	303,378,600
三栄建築設計	5,400	1,530.00	8,262,000
野村不動産ホールディングス	67,000	3,436.00	230,212,000
三重交通グループホールディングス	23,600	574.00	13,546,400
サムティ	17,200	2,180.00	37,496,000
ディア・ライフ	18,800	777.00	14,607,600
地主	8,400	1,959.00	16,455,600
プレサンスコーポレーション	17,100	1,942.00	33,208,200
ハウスコム	1,800	910.00	1,638,000
JPMC	5,800	1,108.00	6,426,400
サンセイランディック	2,900	867.00	2,514,300
フージャースホールディングス	16,500	1,001.00	16,516,500
オープンハウスグループ	39,300	5,425.00	213,202,500
東急不動産ホールディングス	322,200	798.90	257,405,580
飯田グループホールディングス	93,900	2,401.50	225,500,850
イーランド	1,500	1,476.00	2,214,000
ムゲンエステート	6,200	772.00	4,786,400

And Doホールディングス	6,400	1,172.00	7,500,800
シーアールイー	6,200	1,310.00	8,122,000
ケイアイスター不動産	5,200	4,930.00	25,636,000
グッドコムアセット	10,400	871.00	9,058,400
ジェイ・エス・ビー	2,700	4,670.00	12,609,000
ロードスターキャピタル	6,400	1,596.00	10,214,400
テンポイノベーション	2,900	1,053.00	3,053,700
フェイスネットワーク	2,600	1,354.00	3,520,400
パーク24	83,600	2,168.00	181,244,800
パラカ	4,000	1,922.00	7,688,000
三井不動産	462,500	2,808.00	1,298,700,000
三菱地所	645,800	1,689.00	1,090,756,200
平和不動産	17,500	3,745.00	65,537,500
東京建物	102,200	1,866.00	190,705,200
京阪神ビルディング	18,300	1,196.00	21,886,800
住友不動産	193,500	3,645.00	705,307,500
テーオーシー	20,000	631.00	12,620,000
東京楽天地	1,900	4,285.00	8,141,500
レオパレス21	120,400	310.00	37,324,000
スターツコーポレーション	15,500	2,822.00	43,741,000
フジ住宅	15,600	686.00	10,701,600
空港施設	13,700	544.00	7,452,800
明和地所	4,500	925.00	4,162,500
ゴールドクレスト	10,400	1,798.00	18,699,200
エスリード	5,200	2,633.00	13,691,600
日神グループホールディングス	18,100	517.00	9,357,700
日本エスコン	24,000	802.00	19,248,000
MIRARTHホールディングス	54,100	440.00	23,804,000
AVANTIA	5,100	837.00	4,268,700
イオンモール	55,700	1,813.00	100,984,100
毎日コムネット	3,600	750.00	2,700,000
ファースト住建	3,700	1,085.00	4,014,500
カチタス	28,900	2,214.00	63,984,600
トーセイ	18,000	1,733.00	31,194,000
穴吹興産	1,800	2,252.00	4,053,600
サンフロンティア不動産	18,100	1,350.00	24,435,000
FJネクストホールディングス	11,700	1,009.00	11,805,300
インテリックス	2,000	557.00	1,114,000
ランドビジネス	3,000	242.00	726,000
サンネクスタグループ	2,800	1,003.00	2,808,400
グランディハウス	7,800	558.00	4,352,400
日本空港ビルデング	37,900	6,420.00	243,318,000

明豊ファシリティワークス	4,600	754.00	3,468,400
日本工営	6,800	3,720.00	25,296,000
L I F U L L	39,000	279.00	10,881,000
M I X I	25,500	2,781.00	70,915,500
ジェイエイシーリクルートメント	10,200	2,411.00	24,592,200
日本M&Aセンターホールディングス	191,800	1,020.00	195,636,000
メンバーズ	3,400	1,539.00	5,232,600
中広	1,700	405.00	688,500
UTグループ	16,500	2,938.00	48,477,000
アイティメディア	4,400	1,288.00	5,667,200
E・Jホールディングス	6,700	1,556.00	10,425,200
オープンアップグループ	33,600	2,024.00	68,006,400
コシダカホールディングス	33,600	1,182.00	39,715,200
アルトナー	2,200	1,700.00	3,740,000
パソナグループ	13,700	1,745.00	23,906,500
C D S	2,300	1,788.00	4,112,400
リンクアンドモチベーション	32,100	440.00	14,124,000
エス・エム・エス	42,500	2,909.00	123,632,500
サニーサイドアップグループ	2,900	685.00	1,986,500
パーソルホールディングス	125,100	2,665.50	333,454,050
リニカル	5,200	866.00	4,503,200
クックパッド	31,600	181.00	5,719,600
アイ・ケイ・ケイホールディングス	4,600	660.00	3,036,000
学情	5,200	1,895.00	9,854,000
スタジオアリス	5,700	2,176.00	12,403,200
シミックホールディングス	5,500	1,990.00	10,945,000
エプコ	2,100	761.00	1,598,100
N J S	2,500	2,680.00	6,700,000
総合警備保障	41,500	3,997.00	165,875,500
カカクコム	82,100	2,067.00	169,700,700
アイロムグループ	4,100	1,936.00	7,937,600
セントケア・ホールディング	7,400	749.00	5,542,600
サイネックス	1,800	618.00	1,112,400
ルネサンス	8,000	902.00	7,216,000
ディップ	19,600	3,495.00	68,502,000
デジタルホールディングス	8,900	1,044.00	9,291,600
新日本科学	11,900	2,231.00	26,548,900
キャリアデザインセンター	1,900	1,513.00	2,874,700
ベネフィット・ワン	51,800	1,655.50	85,754,900
エムスリー	220,700	3,245.00	716,171,500
ツカダ・グローバルホールディング	5,600	483.00	2,704,800
アウトソーシング	66,700	1,343.00	89,578,100



ウェルネット	6,900	621.00	4,284,900
ワールドホールディングス	5,100	2,800.00	14,280,000
ディー・エヌ・エー	44,800	1,879.50	84,201,600
博報堂DYホールディングス	142,500	1,513.50	215,673,750
ぐるなび	21,100	369.00	7,785,900
タカミヤ	15,600	511.00	7,971,600
ジャパンベストレスキューシステム	5,500	715.00	3,932,500
ファンコミュニケーションズ	22,400	401.00	8,982,400
ライク	4,300	1,660.00	7,138,000
ビジネス・ブレークスルー	3,700	437.00	1,616,900
エスプール	32,400	555.00	17,982,000
WDBホールディングス	5,800	2,206.00	12,794,800
ティア	5,600	438.00	2,452,800
CDG	1,100	1,391.00	1,530,100
アドウェイズ	15,600	680.00	10,608,000
バリューコマース	8,500	1,456.00	12,376,000
インフォマート	116,600	284.00	33,114,400
J Pホールディングス	32,700	396.00	12,949,200
エコナックホールディングス	16,800	96.00	1,612,800
CLホールディングス	3,300	888.00	2,930,400
プレステージ・インターナショナル	47,300	659.00	31,170,700
アミューズ	6,200	1,805.00	11,191,000
ドリームインキュベータ	3,500	2,890.00	10,115,000
クイック	8,600	2,067.00	17,776,200
TAC	5,200	200.00	1,040,000
電通グループ	109,800	4,613.00	506,507,400
イオンファンタジー	4,900	3,480.00	17,052,000
シーティーエス	12,600	728.00	9,172,800
ネクシィーズグループ	3,000	670.00	2,010,000
H.U.グループホールディングス	32,800	2,815.00	92,332,000
アルプス技研	9,800	2,895.00	28,371,000
日本空調サービス	12,300	749.00	9,212,700
オリエンタルランド	590,900	5,366.00	3,170,769,400
ダスキン	24,900	3,167.00	78,858,300
明光ネットワークジャパン	13,900	641.00	8,909,900
ファルコホールディングス	5,100	1,849.00	9,429,900
ラウンドワン	93,700	580.00	54,346,000
リゾートトラスト	44,200	2,146.50	94,875,300
ビー・エム・エル	13,900	3,200.00	44,480,000
りらいあコミュニケーションズ	18,600	1,462.00	27,193,200
リソー教育	51,500	292.00	15,038,000
早稲田アカデミー	6,300	1,365.00	8,599,500

ユー・エス・エス	114,900	2,364.00	271,623,600
東京個別指導学院	13,600	528.00	7,180,800
サイバーエージェント	246,800	1,046.00	258,152,800
楽天グループ	670,000	554.00	371,180,000
クリーク・アンド・リバー社	6,600	1,983.00	13,087,800
SBIグローバルアセットマネジメント	18,600	500.00	9,300,000
テー・オー・ダブリュー	22,500	322.00	7,245,000
山田コンサルティンググループ	5,800	1,694.00	9,825,200
セントラルスポーツ	4,300	2,426.00	10,431,800
フルキャストホールディングス	10,700	2,308.00	24,695,600
エン・ジャパン	20,300	2,480.00	50,344,000
リソルホールディングス	800	4,670.00	3,736,000
テクノプロ・ホールディングス	66,100	3,305.00	218,460,500
アトラグループ	2,000	179.00	358,000
インターワークス	2,800	339.00	949,200
アイ・アールジャパンホールディングス	5,900	1,643.00	9,693,700
Keeper 技研	6,900	5,230.00	36,087,000
ファーストロジック	1,200	933.00	1,119,600
三機サービス	1,500	1,082.00	1,623,000
Gunosy	9,200	642.00	5,906,400
デザインワン・ジャパン	3,200	172.00	550,400
イー・ガーディアン	4,300	2,015.00	8,664,500
リブセンス	4,700	262.00	1,231,400
ジャパンマテリアル	34,300	2,346.00	80,467,800
ベクトル	17,700	1,346.00	23,824,200
ウチヤマホールディングス	4,400	307.00	1,350,800
チャーム・ケア・コーポレーション	9,500	1,259.00	11,960,500
キャリアリンク	4,200	2,925.00	12,285,000
I B J	7,100	682.00	4,842,200
アサンテ	5,600	1,652.00	9,251,200
バリューHR	9,900	1,415.00	14,008,500
M&Aキャピタルパートナーズ	9,100	3,050.00	27,755,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,200	1,049.00	4,405,800
E R Iホールディングス	2,400	1,342.00	3,220,800
アピスト	1,400	3,110.00	4,354,000
シグマクシス・ホールディングス	17,100	1,226.00	20,964,600
ウィルグループ	9,500	1,091.00	10,364,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	10,500	141.00	1,480,500
メドピア	10,000	1,023.00	10,230,000
レアジョブ	1,800	1,004.00	1,807,200
リクルートホールディングス	826,700	4,629.00	3,826,794,300
エラン	15,000	823.00	12,345,000

土木管理総合試験所	4,200	335.00	1,407,000
日本郵政	1,343,900	1,002.50	1,347,259,750
ベルシステム24ホールディングス	15,100	1,381.00	20,853,100
鎌倉新書	12,900	823.00	10,616,700
S MN	2,500	453.00	1,132,500
グローバルキッズCOMPANY	1,900	743.00	1,411,700
エアトリ	8,200	2,579.00	21,147,800
アトラエ	6,800	705.00	4,794,000
ストライク	4,800	3,365.00	16,152,000
ソラスト	31,100	684.00	21,272,400
セラク	3,500	1,486.00	5,201,000
インソース	24,400	1,310.00	31,964,000
バイカレント・コンサルティング	88,400	5,402.00	477,536,800
Orchestra Holdings	2,500	1,341.00	3,352,500
アイモバイル	5,100	1,209.00	6,165,900
キャリアインデックス	3,600	291.00	1,047,600
MS - Japan	3,000	1,035.00	3,105,000
船場	1,700	725.00	1,232,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	39,900	1,879.00	74,972,100
フルテック	1,400	1,079.00	1,510,600
GameWith	3,200	390.00	1,248,000
MS&Consulting	1,400	603.00	844,200
ウェルビー	8,500	500.00	4,250,000
エル・ティー・エス	1,500	3,295.00	4,942,500
ミダックホールディングス	6,900	1,689.00	11,654,100
日総工産	8,600	916.00	7,877,600
キュービーネットホールディングス	5,400	1,493.00	8,062,200
RPAホールディングス	15,600	438.00	6,832,800
スプリックス	2,700	792.00	2,138,400
マネジメントソリューションズ	6,200	2,956.00	18,327,200
プロレド・パートナーズ	3,100	519.00	1,608,900
テノ・ホールディングス	1,300	787.00	1,023,100
フロンティア・マネジメント	3,900	1,206.00	4,703,400
ピアラ	1,800	512.00	921,600
コプロ・ホールディングス	1,500	2,128.00	3,192,000
ギークス	1,400	786.00	1,100,400
アンビスホールディングス	12,000	3,060.00	36,720,000
カーブスホールディングス	30,800	714.00	21,991,200
フォーラムエンジニアリング	6,700	1,148.00	7,691,600
Fast Fitness Japan	3,900	1,249.00	4,871,100
ダイレクトマーケティングミックス	13,500	941.00	12,703,500
ポピンズ	1,800	1,661.00	2,989,800

LITALICO	8,800	2,466.00	21,700,800
アドバンテッジリスクマネジメント	4,300	593.00	2,549,900
リログループ	62,300	1,990.50	124,008,150
東祥	7,900	1,142.00	9,021,800
ビーウィズ	2,900	2,000.00	5,800,000
TREホールディングス	23,700	1,162.00	27,539,400
人・夢・技術グループ	4,300	1,495.00	6,428,500
大栄環境	28,500	2,316.00	66,006,000
日本管財ホールディングス	11,800	2,616.00	30,868,800
エイチ・アイ・エス	29,300	1,907.00	55,875,100
ラックランド	4,700	3,355.00	15,768,500
共立メンテナンス	19,200	5,295.00	101,664,000
イチネンホールディングス	12,000	1,321.00	15,852,000
建設技術研究所	5,800	3,510.00	20,358,000
スペース	8,300	1,058.00	8,781,400
燦ホールディングス	4,800	2,241.00	10,756,800
スバル興業	600	9,460.00	5,676,000
東京テアトル	3,200	1,130.00	3,616,000
タナベコンサルティンググループ	3,600	901.00	3,243,600
ナガワ	3,000	6,660.00	19,980,000
東京都競馬	9,400	4,080.00	38,352,000
カナモト	20,500	2,148.00	44,034,000
ニシオホールディングス	10,400	3,265.00	33,956,000
トランス・コスモス	13,900	3,475.00	48,302,500
乃村工藝社	48,900	955.00	46,699,500
藤田観光	5,000	3,595.00	17,975,000
KNT-CTホールディングス	6,700	1,366.00	9,152,200
トーカイ	10,000	1,860.00	18,600,000
セコム	113,700	9,490.00	1,079,013,000
セントラル警備保障	6,100	2,879.00	17,561,900
丹青社	21,900	815.00	17,848,500
メイテック	43,700	2,421.00	105,797,700
応用地質	10,500	1,894.00	19,887,000
船井総研ホールディングス	23,300	2,602.00	60,626,600
進学会ホールディングス	3,500	292.00	1,022,000
オオバ	5,700	753.00	4,292,100
いであ	2,000	1,666.00	3,332,000
学究社	4,500	2,183.00	9,823,500
ベネッセホールディングス	41,800	1,823.50	76,222,300
イオンディライト	12,400	2,985.00	37,014,000
ナック	5,100	960.00	4,896,000
ダイセキ	22,800	3,770.00	85,956,000

ステップ	4,200	1,806.00	7,585,200	
合計	127,235,304		347,819,937,808	

## (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

	2023年 6月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,943,382,049
コール・ローン	1,168,393,533
株式	379,816,977,065
投資信託受益証券	116,291,974
投資証券	7,859,873,091
派生商品評価勘定	477,455,163
未収入金	5,954,486
未収配当金	551,808,202
差入委託証拠金	4,431,949,756
流動資産合計	398,372,085,319
資産合計	398,372,085,319
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,561,413
前受金	417,969,893
未払解約金	297,542,418
未払利息	2,377
流動負債合計	736,076,101
負債合計	736,076,101
純資産の部	
元本等	
元本	77,311,262,891
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	320,324,746,327
元本等合計	397,636,009,218
純資産合計	397,636,009,218
負債純資産合計	398,372,085,319

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 6月12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</p>

2023年 6月12日現在	
	<p>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> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買取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取場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 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 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)

2023年 6月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	77,311,262,891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 5.1433円 (1万口当たり純資産額) (51,433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

2023年 6月12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。

	2023年 6月12日現在
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

	2023年 6月12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	2023年 6月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月11日
期首元本額	74,104,729,838円
期中追加設定元本額	8,433,216,875円
期中一部解約元本額	5,226,683,822円
期末元本額	77,311,262,891円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,465,413,375円
DC外国株式インデックスファンド	5,062,641,380円
DC外国株式インデックスファンドL	28,235,914,338円
DCバランスファンド30	615,780,363円
DCバランスファンド50	1,209,110,085円
DCバランスファンド70	878,723,824円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	277,368,351円
外国株式インデックスe	4,511,315,416円
インデックスコレクション(外国株式)	17,273,434,127円
インデックスコレクション(バランス株式30)	3,225,635,045円
インデックスコレクション(バランス株式50)	1,211,414,856円
インデックスコレクション(バランス株式70)	1,256,215,074円
私募外国株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	5,058,835,614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)	1,425,976,160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)	335,554,709円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	15,336,607円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	198,988,704円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	24,836,186円

区分	2023年 6月12日現在
V Aバランスファンド（株50 / 100）（適格機関投資家専用）	58,383,377円
V Aバランスファンド（株60 / 100）（適格機関投資家専用）	98,065,400円
バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	178,645,488円
バランスV A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	156,593,208円
バランスV A 5 0 L（適格機関投資家専用）	3,082,189,190円
バランスV A 7 5（適格機関投資家専用）	343,097,762円
V Aバランスファンド（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	75,480,108円
V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	493,684,093円
V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	9,635,504円
バランスV A 4 0（適格機関投資家専用）	62,626,315円
V Aバランスファンド2（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	62,328,201円
V Aバランス50 - 50（適格機関投資家専用）	206,737,815円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	7,029,393円
バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用）	51,143,057円
V Aバランス20 - 80（適格機関投資家専用）	137,284,202円
私募外国株式インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	5,845,564円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 6月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	11,728,177,850
投資信託受益証券	13,175,037
投資証券	813,004,147
合計	10,901,998,666

(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

（2023年 6月12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	9,490,460,640	-	9,908,430,533	417,969,893
合計		9,490,460,640	-	9,908,430,533	417,969,893

## (注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

（2023年 6月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,080,008,310	-	1,118,895,522	38,887,212
	アメリカドル	852,995,460	-	886,592,322	33,596,862



	ユーロ	176,377,560	-	179,728,800	3,351,240
	イギリスポンド	50,635,290	-	52,574,400	1,939,110
	売建	112,514,259	-	112,477,614	36,645
	カナダドル	20,812,840	-	20,895,140	82,300
	ユーロ	44,983,170	-	44,941,410	41,760
	スイスフラン	26,594,949	-	26,533,064	61,885
	デンマーククローネ	20,123,300	-	20,108,000	15,300
	合計	1,192,522,569	-	1,231,373,136	38,923,857

## (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	33.41	592,659.99	
	BAKER HUGHES CO	52,525	30.01	1,576,275.25	
	CHENIERE ENERGY INC	13,711	147.14	2,017,436.54	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	5,333	79.90	426,106.70	
	CHEVRON CORP	96,572	158.86	15,341,427.92	
	CONOCOPHILLIPS	64,886	103.89	6,741,006.54	
	COTERRA ENERGY INC	41,058	24.57	1,008,795.06	
	DEVON ENERGY CORPORATION	36,666	49.87	1,828,533.42	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	8,771	132.28	1,160,227.88	
	EOG RESOURCES INC	31,440	116.25	3,654,900.00	
	EQT CORPORATION	17,321	38.55	667,724.55	
	EXXON MOBIL	218,746	107.39	23,491,132.94	
	HALLIBURTON CO	47,084	32.34	1,522,696.56	
	HESS CORP	14,466	136.39	1,973,017.74	
	HF SINCLAIR CORP	8,443	45.82	386,858.26	
	KINDER MORGAN INC	105,760	17.03	1,801,092.80	
	MARATHON OIL CORP	36,460	23.55	858,633.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	23,304	113.01	2,633,585.04	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	38,623	59.32	2,291,116.36	
	ONEOK INC	24,617	59.84	1,473,081.28	
OVINTIV INC	13,202	37.72	497,979.44		
PHILLIPS 66	24,974	98.76	2,466,432.24		

PIONEER NATURAL RESOURCES	12,982	204.80	2,658,713.60
SCHLUMBERGER	75,878	47.53	3,606,481.34
TARGA RESOURCES CORP	11,099	70.81	785,920.19
TEXAS PACIFIC LAND CORP	350	1,392.94	487,529.00
VALERO ENERGY CORP	20,196	113.39	2,290,024.44
WILLIAMS COS	63,260	30.39	1,922,471.40
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	12,269	278.59	3,418,020.71
ALBEMARLE CORP	6,375	220.50	1,405,687.50
ALCOA CORP	9,533	35.23	335,847.59
AMCOR PLC	82,838	10.01	829,208.38
AVERY DENNISON CORP	4,144	162.52	673,482.88
BALL CORP	17,147	52.58	901,589.26
CELANESE CORP-SERIES A	5,419	113.63	615,760.97
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	67.97	705,460.63
CLEVELAND-CLIFFS INC	27,048	16.00	432,768.00
CORTEVA INC	37,593	56.44	2,121,748.92
CROWN HOLDINGS INC	6,218	83.77	520,881.86
DOW INC	38,891	51.74	2,012,220.34
DUPONT DE NEMOURS INC	24,640	69.67	1,716,668.80
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,266	80.48	504,287.68
ECOLAB INC	13,900	177.48	2,466,972.00
FMC CORP	6,569	105.63	693,883.47
FREEMONT-MCMORAN INC	76,831	37.89	2,911,126.59
INT'L PAPER CO	17,345	31.68	549,489.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,928	78.24	1,089,726.72
LINDE PLC	26,181	360.76	9,445,057.56
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,234	89.02	1,178,090.68
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,168	427.26	1,353,559.68
MOSAIC CO/THE	18,682	35.08	655,364.56
NEWMONT CORPORATION	41,716	41.46	1,729,545.36
NUCOR CORP	13,322	145.55	1,939,017.10
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,174	130.80	676,759.20
PPG INDUSTRIES INC	12,407	139.67	1,732,885.69
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	3,200	246.62	789,184.00
RPM INTERNATIONAL INC	6,687	82.93	554,552.91
SEALED AIR CORP	7,368	38.62	284,552.16
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	13,583	240.76	3,270,243.08
STEEL DYNAMICS INC	9,667	99.22	959,159.74
VULCAN MATERIALS CO	7,535	206.64	1,557,032.40
WESTLAKE CORP	2,096	111.40	233,494.40
WESTROCK CO	14,176	29.61	419,751.36
3 M COMPANY	29,781	99.90	2,975,121.90

AECOM	7,200	83.57	601,704.00
AERCAP HOLDINGS NV	10,161	59.59	605,493.99
ALLEGION PLC	4,638	112.65	522,470.70
AMETEK INC	12,923	150.29	1,942,197.67
AXON ENTERPRISE INC	3,591	194.82	699,598.62
BOEING CO	31,050	217.31	6,747,475.50
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	8,000	122.08	976,640.00
CARLISLE COS INC	2,870	232.66	667,734.20
CARRIER GLOBAL CORP	45,054	45.30	2,040,946.20
CATERPILLAR	27,631	235.03	6,494,113.93
CUMMINS INC	7,320	226.63	1,658,931.60
DEERE&CO	15,208	378.87	5,761,854.96
DOVER CORP	7,491	141.14	1,057,279.74
EATON CORP	21,840	187.30	4,090,632.00
EMERSON ELECTRIC CO	30,697	84.20	2,584,687.40
FASTENAL CO	29,312	54.77	1,605,418.24
FERGUSON PLC	11,566	144.57	1,672,096.62
FORTIVE CORP	18,487	68.15	1,259,889.05
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,412	65.76	421,653.12
GENERAC HOLDINGS INC	2,918	116.77	340,734.86
GENERAL DYNAMICS CORP	12,920	212.27	2,742,528.40
GENERAL ELECTRIC CO	58,757	106.30	6,245,869.10
GRACO INC	8,952	82.55	738,987.60
GRAINGER (WW) INC	2,333	706.48	1,648,217.84
HEICO CORP	2,252	163.61	368,449.72
HEICO CORP-CLASS A	4,228	130.71	552,641.88
HONEYWELL INTL INC	35,975	197.89	7,119,092.75
HOWMET AEROSPACE INC	22,727	45.94	1,044,078.38
HUBBELL INC	2,787	306.86	855,218.82
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	215.31	429,112.83
IDEX CORP	3,918	206.86	810,477.48
ILLINOIS TOOL WORKS	16,624	237.51	3,948,366.24
INGERSOLL-RAND INC	20,847	62.46	1,302,103.62
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,600	50.17	481,632.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	36,781	63.51	2,335,961.31
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	10,469	188.59	1,974,348.71
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,584	303.38	480,553.92
LOCKHEED MARTIN CORP	12,180	462.69	5,635,564.20
MASCO CORP	12,110	53.96	653,455.60
NORDSON CORP	2,536	232.15	588,732.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,890	454.26	3,584,111.40
OTIS WORLDWIDE CORP	21,403	85.66	1,833,380.98

OWENS CORNING	4,965	118.15	586,614.75
PACCAR INC	28,288	76.83	2,173,367.04
PARKER HANNIFIN CORP	6,957	356.13	2,477,596.41
PENTAIR PLC	7,637	59.17	451,881.29
QUANTA SERVICES INC	7,500	182.83	1,371,225.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	78,822	99.34	7,830,177.48
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,432	305.50	1,964,976.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,602	43.82	333,119.64
SMITH (A.O.) CORP	6,846	68.79	470,936.34
SNAP-ON INC	2,772	267.58	741,731.76
STANLEY BLACK&DECKER	8,223	84.60	695,665.80
TEXTRON	10,911	65.29	712,379.19
TORO CO	5,600	96.74	541,744.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,377	176.23	2,181,198.71
TRANSDIGM GROUP INC	3,041	800.01	2,432,830.41
UNITED RENTALS INC	3,678	389.02	1,430,815.56
WABTEC CORP	9,109	99.05	902,246.45
WATSCO INC	2,000	351.83	703,660.00
XYLEM INC	12,709	109.71	1,394,304.39
AUTOMATIC DATA PROCESS	22,247	215.22	4,787,999.34
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,038	103.51	728,503.38
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	5,961	153.84	917,040.24
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,963	63.44	441,732.72
CINTAS CORP	4,794	480.43	2,303,181.42
CLARIVATE PLC	15,370	8.21	126,187.70
COPART INC	23,382	85.74	2,004,772.68
COSTAR GROUP INC	20,926	80.14	1,677,009.64
EQUIFAX INC	6,976	223.84	1,561,507.84
JACOBS SOLUTIONS INC	6,625	116.23	770,023.75
LEIDOS HOLDINGS	6,940	82.91	575,395.40
PAYCHEX INC	16,816	111.69	1,878,179.04
PAYCOM SOFTWARE INC	2,625	304.70	799,837.50
PAYLOCITY HOLDING CORP	2,200	182.44	401,368.00
REPUBLIC SERVICES INC	12,099	143.30	1,733,786.70
ROBERT HALF INTL INC	5,212	72.72	379,016.64
ROLLINS INC	15,210	40.80	620,568.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	12,962	56.50	732,353.00
TRANSUNION	10,758	73.30	788,561.40
VERISK ANALYTICS INC	8,140	219.36	1,785,590.40
WASTE CONNECTIONS INC	13,987	135.83	1,899,854.21
WASTE MANAGEMENT INC	21,458	162.68	3,490,787.44
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,274	89.73	562,966.02

CSX CORP	112,980	32.31	3,650,383.80
DELTA AIR LINES INC	7,841	39.28	307,994.48
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,512	115.31	981,518.72
FEDEX CORP	12,818	223.76	2,868,155.68
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	134,628	3.44	463,120.32
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,321	170.04	734,742.84
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,000	55.74	557,400.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,643	216.18	2,733,163.74
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,632	306.19	1,724,462.08
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,754	30.62	206,807.48
U-HAUL HOLDING CO	5,076	50.51	256,388.76
UBER TECHNOLOGIES INC	99,742	40.99	4,088,424.58
UNION PACIFIC CORP	32,640	199.67	6,517,228.80
UNITED PARCEL SERVICE B	39,101	170.49	6,666,329.49
APTIV PLC	14,148	97.99	1,386,362.52
BORGWARNER INC	11,533	45.85	528,788.05
FORD MOTOR COMPANY	205,843	13.74	2,828,282.82
GENERAL MOTORS CO	75,461	36.23	2,733,952.03
LEAR CORP	2,989	138.11	412,810.79
LUCID GROUP INC	45,820	6.21	284,542.20
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	40,190	13.87	557,435.30
TESLA INC	153,903	244.40	37,613,893.20
DECKERS OUTDOOR CORP	1,600	488.33	781,328.00
DR HORTON INC	17,138	114.01	1,953,903.38
GARMIN LTD	7,784	105.34	819,966.56
HASBRO INC	7,256	60.29	437,464.24
LENNAR CORP-CL A	12,818	114.20	1,463,815.60
LULULEMON ATHLETICA INC	6,033	360.40	2,174,293.20
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,830	95.35	269,840.50
NIKE B	65,934	105.86	6,979,773.24
NVR INC	164	5,817.96	954,145.44
PULTE GROUP INC	12,386	71.99	891,668.14
VF CORP	16,318	19.11	311,836.98
WHIRLPOOL CORP	3,060	142.06	434,703.60
AIRBNB INC-CLASS A	23,073	117.86	2,719,383.78
ARAMARK	11,643	40.30	469,212.90
BOOKING HOLDINGS INC	2,049	2,606.13	5,339,960.37
CAESARS ENTERTAINMENT INC	12,243	48.50	593,785.50
CARNIVAL CORPORATION	57,539	13.09	753,185.51
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,441	2,040.55	2,940,432.55
DARDEN RESTAURANTS INC	6,950	161.91	1,125,274.50
DOMINO'S PIZZA INC	1,797	298.07	535,631.79

DOORDASH INC - A	14,879	71.78	1,068,014.62
EXPEDIA GROUP INC	8,454	110.48	933,997.92
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	14,280	141.53	2,021,048.40
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,200	115.61	369,952.00
LAS VEGAS SANDS CORP	19,449	58.48	1,137,377.52
MARRIOTT INTL A	14,322	179.01	2,563,781.22
MCDONALD'S CORP	39,216	286.79	11,246,756.64
MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,799	41.33	652,972.67
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,881	91.22	1,175,004.82
STARBUCKS CORP	61,325	97.96	6,007,397.00
VAIL RESORTS INC	2,160	239.66	517,665.60
WYNN RESORTS LTD	5,210	102.21	532,514.10
YUM BRANDS INC	14,772	133.44	1,971,175.68
ACTIVISION BLIZZARD INC	39,597	80.38	3,182,806.86
ALPHABET INC-CL A	321,272	122.23	39,269,076.56
ALPHABET INC-CL C	288,636	122.87	35,464,705.32
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	5,239	328.48	1,720,906.72
COMCAST CORP-CL A	225,140	40.23	9,057,382.20
ELECTRONIC ARTS INC	14,435	125.94	1,817,943.90
FOX CORP - CLASS A	15,560	33.54	521,882.40
FOX CORP- CLASS B	6,975	31.40	219,015.00
INTERPUBLIC GROUP OF COS	22,646	39.63	897,460.98
LIBERTY BROADBAND-C	7,402	73.85	546,637.70
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,885	75.64	747,701.40
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,928	29.65	235,065.20
LIVE NATION ENTERTAINMENT	8,618	84.15	725,204.70
MATCH GROUP INC	14,456	41.59	601,225.04
META PLATFORMS INC-CLASS A	119,440	264.95	31,645,628.00
NETFLIX INC	23,727	420.02	9,965,814.54
NEWS CORP-CLASS A	22,307	19.21	428,517.47
OMNICOM GROUP	10,921	94.49	1,031,925.29
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	30,808	16.10	496,008.80
PINTEREST INC- CLASS A	30,404	23.87	725,743.48
ROBLOX CORP -CLASS A	24,726	38.69	956,648.94
ROKU INC	6,927	69.48	481,287.96
SEA LTD-ADR	19,867	63.38	1,259,170.46
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,096	3.81	179,435.76
SNAP INC - A	62,654	10.09	632,178.86
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,959	134.03	1,200,774.77
THE WALT DISNEY CO	99,094	91.93	9,109,711.42
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	23,690	74.58	1,766,800.20
WARNER BROS DISCOVERY INC	122,994	13.84	1,702,236.96

ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	14,227	26.15	372,036.05
ADVANCE AUTO PARTS	3,129	63.58	198,941.82
AMAZON.COM	497,664	123.43	61,426,667.52
AUTOZONE INC	975	2,363.19	2,304,110.25
BATH & BODY WORKS INC	13,789	42.23	582,309.47
BEST BUY COMPANY INC	10,832	75.24	814,999.68
BURLINGTON STORES INC	3,549	145.51	516,414.99
CARMAX INC	7,628	78.81	601,162.68
CHEWY INC - CLASS A	3,947	36.80	145,249.60
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,000	135.72	542,880.00
EBAY	29,667	45.81	1,359,045.27
ETSY INC	6,573	91.24	599,720.52
GENUINE PARTS CO	7,768	155.82	1,210,409.76
HOME DEPOT	54,734	297.35	16,275,154.90
LKQ CORP	13,325	54.30	723,547.50
LOWES COMPANIES	32,120	209.12	6,716,934.40
MERCADOLIBRE INC	2,390	1,208.55	2,888,434.50
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,383	906.99	3,068,347.17
POOL CORP	2,087	326.42	681,238.54
ROSS STORES INC	18,500	103.29	1,910,865.00
TJX COMPANIES INC	63,038	79.36	5,002,695.68
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,763	217.22	1,251,838.86
ULTA BEAUTY INC	2,749	423.62	1,164,531.38
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	19,000	20.81	395,390.00
COSTCO WHOLESALE CORP	24,006	517.28	12,417,823.68
DOLLAR GENERAL CORP	12,157	153.05	1,860,628.85
DOLLAR TREE INC	11,506	131.77	1,516,145.62
KROGER CO	35,291	46.17	1,629,385.47
SYSCO CORP	28,275	72.54	2,051,068.50
TARGET (DAYTON HUDSON)	24,705	126.99	3,137,287.95
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	40,229	31.42	1,263,995.18
WALMART INC	79,149	153.09	12,116,920.41
ALTRIA GROUP INC	96,590	45.22	4,367,799.80
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	30,271	72.54	2,195,858.34
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,737	64.34	1,012,518.58
BUNGE LIMITED	7,221	93.62	676,030.02
CAMPBELL SOUP CO (US)	10,059	46.05	463,216.95
COCA-COLA CO	222,327	60.47	13,444,113.69
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	12,052	63.73	768,073.96
CONAGRA BRANDS INC	26,163	34.38	899,483.94
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,857	241.61	2,139,939.77
DARLING INGREDIENTS INC	8,500	63.09	536,265.00

GENERAL MILLS INC	31,192	82.30	2,567,101.60
HERSHEY FOODS CORPORATION	7,990	255.82	2,044,001.80
HORMEL FOODS CORP	15,714	40.87	642,231.18
JM SMUCKER CO	5,275	153.57	810,081.75
KELLOGG CO	13,898	67.16	933,389.68
KEURIG DR PEPPER INC	51,374	31.31	1,608,519.94
KRAFT HEINZ CO/THE	45,077	36.88	1,662,439.76
LAMB WESTON HOLDINGS INC	8,000	113.62	908,960.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,652	90.67	1,237,826.84
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	10,122	66.46	672,708.12
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	73,446	72.97	5,359,354.62
MONSTER BEVERAGE CORP	41,030	57.25	2,348,967.50
PEPSICO INC	74,517	182.35	13,588,174.95
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	82,717	92.59	7,658,767.03
TYSON FOODS INC	14,778	50.37	744,367.86
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,611	94.10	1,186,695.10
CLOROX COMPANY	6,394	156.66	1,001,684.04
COLGATE-PALMOLIVE CO	41,461	75.84	3,144,402.24
ESTEE LAUDER CO-CL A	12,383	176.53	2,185,970.99
KIMBERLY-CLARK CORP	17,528	134.50	2,357,516.00
PROCTER & GAMBLE CO	127,453	146.56	18,679,511.68
ABBOTT LABORATORIES	93,365	101.69	9,494,286.85
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,193	304.44	1,276,516.92
AMERISOURCEBERGEN CORP	9,745	178.22	1,736,753.90
BAXTER INTERNATIONAL	26,594	41.97	1,116,150.18
BECTON DICKINSON & CO	15,316	251.50	3,851,974.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	78,829	51.28	4,042,351.12
CARDINAL HEALTH	14,569	86.77	1,264,152.13
CENTENE CORP	29,946	69.00	2,066,274.00
CVS HEALTH CORP	68,012	71.76	4,880,541.12
DAVITA INC	3,582	97.48	349,173.36
DENTSPLY SIRONA INC	10,094	38.42	387,811.48
DEXCOM INC	20,381	124.34	2,534,173.54
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	32,184	84.10	2,706,674.40
ELEVANCE HEALTH INC	12,828	470.17	6,031,340.76
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	19,005	77.10	1,465,285.50
HCA HEALTHCARE INC	11,263	271.79	3,061,170.77
HENRY SCHEIN INC	7,493	74.86	560,925.98
HOLOGIC INC	12,961	77.76	1,007,847.36
HUMANA INC	6,841	513.34	3,511,758.94
IDEXX LABORATORIES INC	4,442	450.87	2,002,764.54
INSULET CORP	3,546	283.09	1,003,837.14



INTUITIVE SURGICAL INC	18,641	312.76	5,830,159.16
LABORATORY CRP OF AMER	4,533	217.57	986,244.81
MASIMO CORP	2,735	156.34	427,589.90
MCKESSON CORP	7,488	393.91	2,949,598.08
MEDTRONIC PLC	71,130	83.73	5,955,714.90
MOLINA HEALTHCARE INC	3,016	284.34	857,569.44
NOVOCURE LTD	4,504	42.76	192,591.04
QUEST DIAGNOSTICS	6,246	134.55	840,399.30
RESMED INC	7,602	213.53	1,623,255.06
STERIS PLC	5,122	206.98	1,060,151.56
STRYKER CORP	18,246	280.64	5,120,557.44
TELEFLEX INC	2,672	237.06	633,424.32
THE CIGNA GROUP	16,011	265.88	4,257,004.68
THE COOPER COS INC	2,561	346.15	886,490.15
UNITEDHEALTH GROUP INC	50,390	493.62	24,873,511.80
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	136.38	531,609.24
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,693	187.61	1,443,283.73
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,864	136.01	1,613,622.64
ABBVIE INC	95,461	138.18	13,190,800.98
AGILENT TECHNOLOGIES	15,996	115.79	1,852,176.84
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,056	190.83	1,346,496.48
AMGEN	28,568	218.76	6,249,535.68
AVANTOR INC	34,993	19.63	686,912.59
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,302	361.03	470,061.06
BIO-TECHNE CORP	8,884	78.43	696,772.12
BIOGEN INC	8,034	308.88	2,481,541.92
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	10,231	91.37	934,806.47
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	113,962	64.80	7,384,737.60
CATALENT INC	8,308	38.81	322,433.48
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,641	197.68	522,072.88
DANAHER CORP	36,857	235.37	8,675,032.09
ELI LILLY & CO	43,649	446.04	19,469,199.96
EXACT SCIENCES CORP	9,063	87.81	795,822.03
GILEAD SCIENCES INC	67,061	78.12	5,238,805.32
HORIZON THERAPEUTICS PLC	11,362	99.25	1,127,678.50
ILLUMINA INC	8,558	200.53	1,716,135.74
INCYTE CORP	10,628	61.04	648,733.12
IQVIA HOLDINGS INC	10,091	206.59	2,084,699.69
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,254	127.10	413,583.40
JOHNSON & JOHNSON	140,334	160.01	22,454,843.34
MERCK & CO	137,195	110.71	15,188,858.45
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,168	1,292.06	1,509,126.08

MODERNA INC	17,875	123.26	2,203,272.50
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,708	93.39	439,680.12
PFIZER	305,735	38.97	11,914,492.95
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,745	746.52	4,288,757.40
REPLIGEN CORP	2,737	162.19	443,914.03
REVVITY INC	6,426	111.09	713,864.34
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,093	32.91	595,440.63
SEAGEN INC	8,007	196.60	1,574,176.20
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56,857	7.33	416,761.81
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,870	518.18	10,814,416.60
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,421	228.49	553,174.29
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,754	334.11	4,595,348.94
VIATRIS INC	63,857	9.38	598,978.66
WATERS CORP	3,306	249.28	824,119.68
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,764	348.28	1,310,925.92
ZOETIS INC	24,431	163.09	3,984,451.79
BANK OF AMERICA CORP	385,185	29.27	11,274,364.95
CITIGROUP	103,674	48.30	5,007,454.20
CITIZENS FINANCIAL GROUP	25,193	28.34	713,969.62
FIFTH THIRD BANCORP	37,082	26.41	979,335.62
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	573	1,284.97	736,287.81
FIRST HORIZON CORP	27,858	11.71	326,217.18
HUNTINGTON BANCSHARES INC	78,770	10.95	862,531.50
JPMORGAN CHASE & CO	158,395	141.01	22,335,278.95
KEY CORP	48,984	10.68	523,149.12
M & T BANK CORP	9,606	126.92	1,219,193.52
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	21,205	128.93	2,733,960.65
REGIONS FINL CORP	49,382	18.47	912,085.54
TRUIST FINANCIAL CORP	69,336	32.63	2,262,433.68
US BANCORP	85,114	32.86	2,796,846.04
WEBSTER FINANCIAL CORP	8,680	38.75	336,350.00
WELLS FARGO & CO	202,346	42.13	8,524,836.98
ALLY FINANCIAL INC	18,129	28.00	507,612.00
AMERICAN EXPRESS	34,115	171.72	5,858,227.80
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,866	314.35	1,843,977.10
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	20,242	72.98	1,477,261.16
ARES MANAGEMENT CORP - A	8,035	92.22	740,987.70
BANK NEW YORK CO	45,067	44.43	2,002,326.81
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	70,108	335.29	23,506,511.32
BLACKROCK INC	8,057	684.40	5,514,210.80
BLACKSTONE INC	37,747	88.19	3,328,907.93
BLOCK INC	30,502	64.94	1,980,799.88

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,406	111.49	2,275,064.94
CARLYLE GROUP INC/THE	10,351	30.05	311,047.55
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,992	138.43	829,472.56
CME GROUP INC	18,867	184.84	3,487,376.28
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	10,291	53.28	548,304.48
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,285	114.14	1,630,489.90
EQUITABLE HOLDINGS INC	18,461	26.56	490,324.16
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,972	397.58	784,027.76
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	31,029	54.66	1,696,045.14
FISERV INC	34,179	116.82	3,992,790.78
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,879	239.37	928,516.23
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	26.37	388,904.76
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,286	41.70	95,326.20
GLOBAL PAYMENTS INC	15,111	100.09	1,512,459.99
GOLDMAN SACHS GROUP INC	17,887	336.02	6,010,389.74
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	30,232	109.96	3,324,310.72
INVESCO LTD	19,405	16.14	313,196.70
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,514	157.89	554,825.46
KKR & CO INC	33,954	55.18	1,873,581.72
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,096	204.52	837,713.92
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,112	276.65	584,284.80
MASTERCARD INC-CLASS A	46,026	369.22	16,993,719.72
MOODY'S CORP	8,574	335.48	2,876,405.52
MORGAN STANLEY	67,267	86.21	5,799,088.07
MSCI INC	4,355	473.85	2,063,616.75
NASDAQ INC	17,953	57.83	1,038,221.99
NORTHERN TRUST CORP	10,018	74.83	749,646.94
PAYPAL HOLDINGS INC	57,102	63.49	3,625,405.98
PRICE T ROWE GROUP INC	11,505	114.47	1,316,977.35
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,135	95.68	969,716.80
S&P GLOBAL INC	17,688	384.00	6,792,192.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	82,257	55.00	4,524,135.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	58.84	370,044.76
STATE STREET CORP	17,821	73.91	1,317,150.11
SYNCHRONY FINANCIAL	23,931	33.69	806,235.39
TOAST INC-CLASS A	13,000	21.86	284,180.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	6,542	70.81	463,239.02
VISA INC-CLASS A SHARES	87,799	223.56	19,628,344.44
AFLAC	31,141	68.97	2,147,794.77
ALLSTATE CORP	14,193	111.96	1,589,048.28
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,803	116.10	441,528.30
AMERICAN INT'L GROUP	40,246	56.88	2,289,192.48

AON PLC	10,903	314.32	3,427,030.96
ARCH CAPITAL GROUP LTD	18,793	71.44	1,342,571.92
ARTHUR J GALLAGHER & CO	11,870	206.87	2,455,546.90
ASSURANT INC	2,684	125.52	336,895.68
BROWN & BROWN INC	13,365	64.03	855,760.95
CHUBB LTD	22,362	191.15	4,274,496.30
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,751	101.93	790,059.43
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,444	218.20	315,080.80
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	344.59	711,578.35
FNF GROUP	12,836	35.40	454,394.40
GLOBE LIFE INC	4,559	107.93	492,052.87
HARTFORD FINANCIAL SVCS	16,673	71.32	1,189,118.36
LOEWS CORP	10,482	59.34	622,001.88
MARKEL GROUP INC	702	1,342.27	942,273.54
MARSH & MCLENNAN COS	27,109	178.25	4,832,179.25
METLIFE INC	35,762	53.87	1,926,498.94
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,725	71.39	908,437.75
PROGRESSIVE CORP	31,370	130.90	4,106,333.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	19,312	84.55	1,632,829.60
TRAVELERS COS INC/THE	12,320	175.60	2,163,392.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,009	225.70	1,356,231.30
WR BERKLEY CORP	11,919	57.19	681,647.61
WEYERHAEUSER CO	40,664	29.66	1,206,094.24
ACCENTURE PLC-CL A	33,739	308.72	10,415,904.08
ADOBE INC	24,596	454.00	11,166,584.00
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	8,949	92.48	827,603.52
ANSYS INC	4,382	325.53	1,426,472.46
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,805	163.69	295,460.45
ATLASSIAN CORP-CL A	8,000	171.99	1,375,920.00
AUTODESK INC	11,280	201.39	2,271,679.20
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	11,819	50.64	598,514.16
BILL HOLDINGS, INC.	4,833	115.26	557,051.58
BLACK KNIGHT INC	8,009	56.12	449,465.08
CADENCE DESIGN SYSTEMS	14,780	229.30	3,389,054.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,676	126.14	715,970.64
CLOUDFLARE INC - CLASS A	16,221	63.82	1,035,224.22
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	26,353	62.05	1,635,203.65
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	12,526	149.53	1,873,012.78
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,100	150.22	315,462.00
DATADOG INC - CLASS A	12,954	95.63	1,238,791.02
DOCUSIGN INC	9,538	57.02	543,856.76
DROPBOX INC-CLASS A	16,505	24.00	396,120.00

DYNATRACE INC	10,480	50.96	534,060.80
EPAM SYSTEMS INC	3,061	211.33	646,881.13
FAIR ISAAC CORP	1,345	774.71	1,041,984.95
FORTINET INC	34,510	68.01	2,347,025.10
GARTNER INC	4,134	344.55	1,424,369.70
GEN DIGITAL INC	29,838	17.82	531,713.16
GODADDY INC - CLASS A	8,747	72.01	629,871.47
HUBSPOT INC	2,683	516.91	1,386,869.53
INTL BUSINESS MACHINES CORP	48,259	135.30	6,529,442.70
INTUIT INC	15,282	431.55	6,594,947.10
MICROSOFT CORP	380,818	326.79	124,447,514.22
MONDAY.COM LTD	1,500	174.72	262,080.00
MONGODB INC	4,115	374.51	1,541,108.65
OKTA INC	7,338	71.40	523,933.20
ORACLE CORP	87,980	109.85	9,664,603.00
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	93,706	15.02	1,407,464.12
PALO ALTO NETWORKS INC	16,697	220.10	3,675,009.70
PTC INC	5,381	138.57	745,645.17
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,903	451.80	2,666,975.40
SALESFORCE INC	53,365	215.31	11,490,018.15
SERVICENOW INC	10,817	534.03	5,776,602.51
SNOWFLAKE INC-CLASS A	14,431	170.65	2,462,650.15
SPLUNK INC	8,652	98.89	855,596.28
SYNOPSYS INC	8,405	438.78	3,687,945.90
TWILIO INC - A	7,960	63.89	508,564.40
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,478	388.67	963,124.26
UIPATH INC - CLASS A	24,000	17.17	412,080.00
UNITY SOFTWARE INC	13,116	36.30	476,110.80
VERISIGN INC	5,329	220.97	1,177,549.13
VMWARE INC-CLASS A	13,256	135.38	1,794,597.28
WIX.COM LTD	3,273	73.82	241,612.86
WORKDAY INC-CLASS A	11,335	204.38	2,316,647.30
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	12,443	67.14	835,423.02
ZSCALER INC	4,184	150.84	631,114.56
AMPHENOL CORPORATION	31,392	78.23	2,455,796.16
APPLE INC	851,971	180.96	154,172,672.16
ARISTA NETWORKS INC	13,408	162.52	2,179,068.16
ARROW ELECTRONICS INC	2,451	134.16	328,826.16
CDW CORP/DE	7,411	170.44	1,263,130.84
CISCO SYSTEMS	222,005	49.66	11,024,768.30
COGNEX CORP	8,069	55.30	446,215.70
CORNING	43,885	32.78	1,438,550.30

DELL TECHNOLOGIES -C	14,009	47.61	666,968.49
F5 INC	2,841	146.78	417,001.98
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	66,144	15.79	1,044,413.76
HP INC	44,913	29.80	1,338,407.40
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	30.19	492,338.52
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,238	161.57	1,492,583.66
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,289	277.99	2,582,249.11
NETAPP INC	10,843	69.71	755,865.53
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,880	60.89	601,593.20
TE CONNECTIVITY LTD	17,335	128.00	2,218,880.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,404	391.99	942,343.96
TRIMBLE IMS HOLDINGS	13,869	50.11	694,975.59
WESTERN DIGITAL CORP	17,228	39.78	685,329.84
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,892	274.66	794,316.72
AT&T INC	380,487	15.95	6,068,767.65
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,831	16.76	131,247.56
LIBERTY GLOBAL PLC-C	12,682	17.74	224,978.68
T-MOBILE US INC	32,388	131.36	4,254,487.68
VERIZON COMMUNICATIONS	224,058	35.47	7,947,337.26
AES CORP	34,338	20.09	689,850.42
ALLIANT ENERGY CORPORATION	12,663	53.23	674,051.49
AMEREN CORPORATION	13,199	83.36	1,100,268.64
AMERICAN ELECTRIC POWER	26,863	83.68	2,247,895.84
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,087	146.66	1,626,019.42
ATMOS ENERGY CORP	7,575	117.33	888,774.75
CENTERPOINT ENERGY INC	31,584	28.95	914,356.80
CMS ENERGY CORP	14,716	60.69	893,114.04
CONSOLIDATED EDISON INC	18,713	93.49	1,749,478.37
CONSTELLATION ENERGY	16,951	93.29	1,581,358.79
DOMINION ENERGY INC	44,910	53.09	2,384,271.90
DTE ENERGY COMPANY	10,982	111.43	1,223,724.26
DUKE ENERGY CORP	41,313	91.52	3,780,965.76
EDISON INTL	19,236	67.72	1,302,661.92
ENERGY CORP	12,274	101.44	1,245,074.56
ESSENTIAL UTILITIES INC	12,969	41.61	539,640.09
EVERGY INC	11,724	59.40	696,405.60
EVERSOURCE ENERGY	18,286	70.37	1,286,785.82
EXELON CORP	54,634	40.08	2,189,730.72
FIRSTENERGY CORP	30,792	38.61	1,188,879.12
NEXTERA ENERGY INC	109,882	74.07	8,138,959.74
NISOURCE INC	20,005	27.09	541,935.45
NRG ENERGY INC	12,298	34.08	419,115.84

	PG&E CORP	101,796	16.88	1,718,316.48	
	PPL CORPORATION	38,399	26.82	1,029,861.18	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	26,322	62.07	1,633,806.54	
	SEMPRA ENERGY	16,421	147.70	2,425,381.70	
	SOUTHERN CO	58,436	71.26	4,164,149.36	
	UGI CORP	11,512	29.38	338,222.56	
	VISTRA CORP	19,603	24.82	486,546.46	
	WEC ENERGY GROUP INC	16,657	89.93	1,497,964.01	
	XCEL ENERGY INC	28,707	63.45	1,821,459.15	
	ADVANCED MICRO DEVICES	86,289	124.92	10,779,221.88	
	ANALOG DEVICES	27,639	182.46	5,043,011.94	
	APPLIED MATERIALS	44,754	136.12	6,091,914.48	
	BROADCOM INC	22,554	804.62	18,147,399.48	
	ENPHASE ENERGY INC	7,104	174.58	1,240,216.32	
	ENTEGRIS INC	8,008	109.08	873,512.64	
	FIRST SOLAR INC	5,850	192.00	1,123,200.00	
	INTEL CORP	227,473	31.34	7,129,003.82	
	KLA CORP	7,545	465.65	3,513,329.25	
	LAM RESEARCH CORP	7,358	606.59	4,463,289.22	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	8,500	80.55	684,675.00	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	44,782	60.01	2,687,367.82	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	29,374	80.07	2,351,976.18	
	MICRON TECHNOLOGY	58,159	65.43	3,805,343.37	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,249	501.87	1,128,705.63	
	NVIDIA CORP	133,165	387.70	51,628,070.50	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	13,633	185.00	2,522,105.00	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	22,893	89.02	2,037,934.86	
	QORVO INC	5,297	98.36	521,012.92	
	QUALCOMM	59,951	119.11	7,140,763.61	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,922	104.49	932,259.78	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2,888	282.33	815,369.04	
	TERADYNE INC	7,707	105.02	809,389.14	
	TEXAS INSTRUMENTS	49,304	170.59	8,410,769.36	
	WOLFSPEED INC	7,000	53.13	371,910.00	
	CBRE GROUP INC-A	16,391	78.94	1,293,905.54	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	64,300	4.18	268,774.00	
	ZILLOW GROUP INC-C	7,537	44.83	337,883.71	
	アメリカドル 小計	18,336,973		2,003,779,781.10 (279,387,014,878)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	36,244	17.38	629,920.72	
	CAMECO CORP	22,453	41.05	921,695.65	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	58,177	75.27	4,378,982.79	

CENOVUS ENERGY INC	76,232	23.21	1,769,344.72
ENBRIDGE	108,593	50.62	5,496,977.66
IMPERIAL OIL	11,645	67.03	780,564.35
KEYERA CORP	10,963	31.10	340,949.30
PARKLAND CORP	8,544	34.09	291,264.96
PEMBINA PIPELINE CORP	28,103	42.30	1,188,756.90
SUNCOR ENERGY	73,948	40.43	2,989,717.64
TC ENERGY CORP	52,598	55.25	2,906,039.50
TOURMALINE OIL CORP	16,980	60.05	1,019,649.00
AGNICO EAGLE MINES	27,843	68.03	1,894,159.29
BARRICK GOLD CORP	93,249	22.67	2,113,954.83
CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	63.01	460,099.02
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	30,312	29.67	899,357.04
FRANCO-NEVADA CORP	10,313	194.64	2,007,322.32
IVANHOE MINES LTD-CL A	35,897	11.13	399,533.61
KINROSS GOLD CORP	74,937	6.47	484,842.39
LUNDIN MINING CORP	30,173	10.06	303,540.38
NUTRIEN LTD	27,026	78.45	2,120,189.70
PAN AMERICAN SILVER CORP	24,343	20.57	500,735.51
TECK RESOURCES LTD-CL B	24,191	56.72	1,372,113.52
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,575	101.14	361,575.50
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	26,120	59.87	1,563,804.40
CAE INC	16,864	27.83	469,325.12
TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,269	105.31	449,568.39
WSP GLOBAL INC	6,444	172.52	1,111,718.88
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	10,920	49.69	542,614.80
RB GLOBAL INC	9,865	73.76	727,642.40
THOMSON REUTERS CORP	8,783	164.11	1,441,378.13
AIR CANADA	6,737	22.37	150,706.69
CANADIAN NATL RAILWAY CO	30,425	152.41	4,637,074.25
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	49,943	102.04	5,096,183.72
TFI INTERNATIONAL INC	4,630	140.15	648,894.50
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,682	71.04	1,043,009.28
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,366	100.82	137,720.12
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	39.51	395,100.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,221	100.30	1,526,666.30
QUEBECOR INC -CL B	9,679	32.68	316,309.72
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,586	167.46	433,051.56
DOLLARAMA INC	14,800	83.03	1,228,844.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	42,716	64.58	2,758,599.28
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	33.91	248,560.30
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	116.46	1,056,059.28



METRO INC	13,489	70.16	946,388.24
WESTON (GEORGE) LTD	3,705	153.09	567,198.45
SAPUTO INC	11,041	30.93	341,498.13
BANK MONTREAL	39,095	116.34	4,548,312.30
BANK NOVA SCOTIA	64,360	66.13	4,256,126.80
CANADIAN IMPERIAL BANK	47,022	57.05	2,682,605.10
NATIONAL BANK OF CANADA	17,467	96.22	1,680,674.74
ROYAL BANK OF CANADA	74,323	123.89	9,207,876.47
TORONTO-DOMINION BANK	97,210	79.12	7,691,255.20
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	18,244	42.50	775,370.00
BROOKFIELD CORP	75,976	42.21	3,206,946.96
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	20,483	19.96	408,840.68
IGM FINANCIAL INC	3,890	39.86	155,055.40
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,153	39.75	85,581.75
ONEX CORP	3,361	67.62	227,270.82
TMX GROUP LTD	3,245	147.06	477,209.70
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,198	978.53	1,172,278.94
GREAT-WEST LIFECO INC	15,674	38.07	596,709.18
IA FINANCIAL CORP INC	5,415	88.75	480,581.25
INTACT FINANCIAL CORP	8,967	198.29	1,778,066.43
MANULIFE FINANCIAL CORP	100,823	25.72	2,593,167.56
POWER CORP OF CANADA	29,992	34.76	1,042,521.92
SUN LIFE FINANCIAL INC	32,024	67.40	2,158,417.60
CGI INC - CL A	11,043	138.65	1,531,111.95
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,063	2,702.64	2,872,906.32
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	4,402	98.29	432,672.58
OPEN TEXT CORP	15,045	56.20	845,529.00
SHOPIFY INC - CLASS A	65,609	81.88	5,372,064.92
BCE INC	3,102	61.37	190,369.74
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	18,199	57.51	1,046,624.49
TELUS CORP	23,120	25.30	584,936.00
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	37,267	11.54	430,061.18
ALTAGAS INCOME LTD	14,516	24.74	359,125.84
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,264	46.63	292,090.32
CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	36.12	215,925.36
EMERA INC	13,595	55.33	752,211.35
FORTIS INC	25,334	57.42	1,454,678.28
HYDRO ONE LTD	20,457	37.54	767,955.78
NORTHLAND POWER INC	13,044	28.56	372,536.64
FIRSTSERVICE CORP	2,028	194.78	395,013.84
カナダドル 小計	2,165,312		126,609,884.63 (13,229,466,844)

ユーロ	ENI	123,624	12.98	1,605,134.01
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	30,121	10.69	321,993.49
	NESTE OIL OYJ	21,882	38.91	851,428.62
	OMV AG	7,462	39.52	294,898.24
	REPSOL SA	71,632	13.49	966,315.68
	TENARIS SA	27,420	12.82	351,661.50
	TOTALENERGIES SE	126,984	54.95	6,977,770.80
	AIR LIQUIDE	28,052	156.60	4,392,943.20
	AKZO NOBEL	9,224	70.94	654,350.56
	ARCELORMITTAL	29,386	25.46	748,167.56
	ARKEMA	2,799	83.32	233,212.68
	BASF SE	48,561	46.02	2,235,020.02
	COVESTRO AG	10,438	39.05	407,603.90
	CRH PLC	39,369	45.26	1,781,840.94
	DSM-FIRMENICH AG	9,267	95.89	888,612.63
	EVONIK INDUSTRIES AG	9,603	17.99	172,757.97
	HEIDELBERG MATERIALS AG	8,131	71.90	584,618.90
	OCI NV	5,799	21.63	125,432.37
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	14,165	33.93	480,618.45
	SOLVAY SA	3,676	104.65	384,693.40
	STORA ENSO OYJ R	26,361	12.40	326,876.40
	SYMRISE AG	7,051	92.12	649,538.12
	UMICORE	12,057	27.46	331,085.22
	UPM KYMMENE OYJ	27,619	29.85	824,427.15
	VOESTALPINE AG	5,948	32.44	192,953.12
	WACKER CHEMIE AG	1,600	116.85	186,960.00
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	11,859	31.48	373,321.32
	AIRBUS SE	31,717	128.42	4,073,097.14
	ALSTOM	16,908	27.58	466,322.64
	BOUYGUES ORD	11,344	30.33	344,063.52
	BRENTAG SE	8,989	72.54	652,062.06
	CNH INDUSTRIAL NV	57,411	12.71	729,693.81
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	29,498	30.58	902,048.84
	DASSAULT AVIATION SA	1,210	166.20	201,102.00
EIFFAGE	4,432	98.76	437,704.32	
FERROVIAL SA	29,779	28.75	856,146.25	
GEA GROUP AG	7,649	39.24	300,146.76	
IMCD NV	3,050	135.10	412,055.00	
KINGSPAN GROUP PLC	7,694	62.32	479,490.08	
KNORR-BREMSE AG	3,221	64.76	208,591.96	
KONE OYJ-B	19,254	50.24	967,320.96	
LEGRAND SA	13,982	89.48	1,251,109.36	

METSO CORPORATION	35,225	10.84	382,015.12
MTU AERO ENGINES AG	2,774	225.10	624,427.40
PRYSMIAN SPA	15,275	35.70	545,317.50
RATIONAL AG	268	630.00	168,840.00
RHEINMETALL AG	2,442	240.50	587,301.00
SAFRAN SA	18,948	136.64	2,589,054.72
SAINT-GOBAIN	25,279	55.82	1,411,073.78
SCHNEIDER ELECTRIC SE	29,076	163.94	4,766,719.44
SIEMENS	40,895	158.14	6,467,135.30
SIEMENS ENERGY AG	24,753	23.72	587,141.16
THALES SA	5,540	130.45	722,693.00
VINCI S.A.	28,939	106.70	3,087,791.30
WARTSILA OYJ	30,397	11.12	338,014.64
BUREAU VERITAS SA	15,662	24.11	377,610.82
RANDSTAD NV	5,866	48.99	287,375.34
TELEPERFORMANCE	3,110	145.30	451,883.00
WOLTERS KLUWER	13,534	113.35	1,534,078.90
ADP	1,532	137.40	210,496.80
AENA SME SA	4,116	142.40	586,118.40
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	38,499	9.18	353,574.81
DEUTSCHE POST AG-REG	52,557	41.80	2,196,882.60
GETLINK	18,582	15.89	295,267.98
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,499	108.08	1,891,291.92
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,480	101.60	353,568.00
CONTINENTAL AG	6,262	68.88	431,326.56
DR ING HC F PORSCHE AG	5,800	116.70	676,860.00
FERRARI NV	6,834	276.40	1,888,917.60
MERCEDES-BENZ GROUP AG	47,099	72.60	3,419,387.40
MICHELIN	35,958	27.52	989,564.16
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	8,889	56.46	501,872.94
RENAULT SA	11,301	33.08	373,893.58
STELLANTIS NV	121,390	15.05	1,827,162.28
VALEO SA	10,032	20.68	207,461.76
VOLKSWAGEN AG-PFD	11,635	126.28	1,469,267.80
VOLKSWAGEN STAMM	1,657	155.90	258,326.30
ADIDAS AG	9,192	160.00	1,470,720.00
HERMES INTERNATIONAL	1,665	1,916.40	3,190,806.00
KERING	3,887	504.70	1,961,768.90
LVMH	14,940	820.00	12,250,800.00
MONCLER SPA	9,963	63.32	630,857.16
PUMA SE	6,274	49.25	308,994.50
SEB SA	1,310	86.00	112,660.00

ACCOR	7,911	32.70	258,689.70
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	25,319	66.82	1,691,815.58
DELIVERY HERO SE	8,935	35.75	319,426.25
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	9,149	178.00	1,628,522.00
JUST EAT TAKEAWAY	8,459	12.91	109,256.44
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,332	36.36	193,871.52
SODEXO	4,698	101.90	478,726.20
BOLLORE SE	51,405	5.70	293,008.50
PUBLICIS GROUPE	11,624	71.76	834,138.24
SCOUT24 SE	4,128	58.70	242,313.60
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	47,953	19.42	931,247.26
VIVENDI SE	41,539	8.14	338,127.46
D'IETEREN GROUP	1,617	170.20	275,213.40
INDITEX	57,568	33.25	1,914,136.00
PROSUS	42,422	66.18	2,807,487.96
ZALANDO SE	11,285	24.34	274,676.90
CARREFOUR	30,831	16.45	507,169.95
HELLOFRESH SE	7,756	18.15	140,810.18
JERONIMO MARTINS	13,062	24.16	315,577.92
KESKO OYJ-B SHS	14,326	18.13	259,802.01
KONINKLIJKE AHOLD NV	52,445	29.16	1,529,296.20
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	46,853	51.17	2,397,468.01
DANONE (GROUPE)	35,678	53.62	1,913,054.36
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	26,648	12.64	336,963.96
HEINEKEN HOLDING NV	7,127	79.00	563,033.00
HEINEKEN NV	14,200	93.10	1,322,020.00
JDE PEET'S BV	4,123	27.32	112,640.36
KERRY GROUP PLC-A	8,173	89.60	732,300.80
PERNOD-RICARD	10,784	198.90	2,144,937.60
REMY COINTREAU	1,020	142.40	145,248.00
BEIERSDORF AG	5,845	117.20	685,034.00
HENKEL AG & CO KGAA	6,247	66.38	414,675.86
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	10,083	74.76	753,805.08
LOREAL	12,929	402.20	5,200,043.80
AMPLIFON SPA	6,606	34.97	231,011.82
BIOMERIEUX	2,374	91.16	216,413.84
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,091	109.70	229,382.70
DIASORIN ITALIA SPA	1,418	96.72	137,148.96
ESSILORLUXOTTICA	15,295	167.82	2,566,806.90
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	9,705	42.34	410,909.70
FRESENIUS SE&CO KGAA	23,936	25.83	618,266.88
KONINKLIJKE PHILIPS	47,904	18.24	873,864.76

SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,577	52.34	762,960.18
ARGENX SE	2,857	364.50	1,041,376.50
BAYER	51,521	51.15	2,635,299.15
EUROFINS SCIENTIFIC	6,490	59.82	388,231.80
GRIFOLS SA	14,240	11.39	162,193.60
IPSEN	1,866	110.90	206,939.40
MERCK KGAA	6,723	168.55	1,133,161.65
ORION OYJ-CLASS B	5,393	39.96	215,504.28
QIAGEN N.V.	13,106	42.17	552,680.02
RECORDATI SPA	5,195	44.39	230,606.05
SANOFI	61,013	95.40	5,820,640.20
SARTORIUS AG-VORZUG	1,216	328.40	399,334.40
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,435	265.60	381,136.00
UCB (GROUPE)	6,718	85.66	575,463.88
ABN AMRO BANK NV-CVA	19,718	13.64	269,052.11
AIB GROUP PLC	55,516	3.80	211,293.89
BANCO BILBAO VIZCAYA	328,517	6.51	2,138,645.67
BANCO SANTANDER SA	904,812	3.20	2,896,755.61
BANK OF IRELAND GROUP PLC	52,138	9.19	479,565.32
BNP PARIBAS	61,159	56.07	3,429,185.13
CAIXABANK	240,435	3.59	865,085.13
COMMERZBANK AG	56,376	9.82	553,837.82
CREDIT AGRICOLE SA	64,475	10.83	698,393.20
ERSTE GROUP BANK AG	18,119	31.47	570,204.93
FINECOBANK SPA	27,362	12.50	342,025.00
ING GROEP NV-CVA	199,441	12.08	2,410,045.04
INTESA SANPAOLO	853,697	2.30	1,971,613.22
KBC GROEP NV	12,855	62.44	802,666.20
MEDIOBANCA	29,447	10.94	322,297.41
SOCIETE GENERALE	41,916	23.32	977,690.70
UNICREDIT SPA	97,949	18.35	1,797,364.15
ADYEN NV	1,178	1,577.80	1,858,648.40
AMUNDI SA	2,812	53.85	151,426.20
DEUTSCHE BANK NAMEN	111,998	9.84	1,102,396.31
DEUTSCHE BOERSE	10,526	164.80	1,734,684.80
EDENRED	12,673	61.34	777,361.82
EURAZEO SA	2,340	65.55	153,387.00
EURONEXT NV	4,500	63.30	284,850.00
EXOR NV	6,325	80.12	506,759.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,582	72.44	404,360.08
NEXI SPA	36,598	7.26	265,774.67
SOFINA	752	204.00	153,408.00

WENDEL	1,047	100.80	105,537.60
WORLDLINE SA	13,712	35.85	491,575.20
AEGON	95,201	4.53	431,260.53
AGEAS	8,621	37.63	324,408.23
ALLIANZ SE-REG	21,750	207.95	4,522,912.50
ASSICURAZIONI GENERALI	58,531	18.30	1,071,117.30
AXA SA	100,654	26.52	2,669,344.08
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,976	189.35	563,505.60
MUENCHENER RUECKVERSICH.	7,773	323.40	2,513,788.20
NN GROUP NV	13,557	33.35	452,125.95
POSTE ITALIANE SPA	25,777	9.90	255,295.40
SAMPO OYJ-A SHS	25,899	43.11	1,116,505.89
TALANX AG	5,000	52.60	263,000.00
BECHTLE AG	4,296	37.54	161,271.84
CAPGEMINI SA	9,097	168.40	1,531,934.80
DASSAULT SYSTEMES SA	35,217	40.17	1,414,842.97
NEMETSCHEK SE	3,320	72.08	239,305.60
SAP SE	55,816	123.20	6,876,531.20
NOKIA OYJ	300,315	3.78	1,135,340.85
CELLNEX TELECOM SA	30,696	37.01	1,136,058.96
DEUTSCHE TELEKOM	174,076	19.04	3,315,451.49
ELISA A	7,825	50.88	398,136.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,877	11.66	173,465.82
KPN (KON.)	173,861	3.13	544,532.65
ORANGE	104,881	10.52	1,104,187.16
TELECOM ITALIA ORD	489,749	0.25	122,780.07
TELEFONICA	280,413	3.88	1,089,684.91
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	2.62	107,225.61
ACCIONA SA	1,278	159.40	203,713.20
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	3,416	32.24	110,131.84
E.ON SE	123,229	11.40	1,404,810.60
EDP RENOVAVEIS SA	15,623	19.49	304,570.38
ELIA GROUP SA/NV	1,604	117.30	188,149.20
ENAGAS	11,944	18.24	217,858.56
ENDESA	17,138	21.06	360,926.28
ENEL	429,494	6.07	2,608,317.06
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	139,324	4.64	647,159.98
ENGIE	100,082	14.22	1,423,966.69
FORTUM OYJ	26,655	12.40	330,655.27
IBERDROLA SA	311,203	11.49	3,577,278.48
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,726	26.62	258,906.12
RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,296	16.15	376,230.40

	RWE STAMM	33,396	39.83	1,330,162.68
	SNAM SPA	115,930	4.97	576,635.82
	TERNA SPA	80,424	7.95	640,014.19
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,814	28.80	1,060,243.20
	VERBUND AG	3,916	71.50	279,994.00
	ASM INTERNATIONAL NV	2,534	389.30	986,486.20
	ASML HOLDING NV	21,802	666.60	14,533,213.20
	INFINEON TECHNOLOGIES	72,297	36.83	2,662,698.51
	STMICROELECTRONICS NV	37,319	44.10	1,645,767.90
	LEG IMMOBILIEN SE	3,774	54.40	205,305.60
	VONOVIA SE	36,313	18.68	678,326.84
	ユーロ 小計	9,687,280		253,136,807.01 (37,924,956,426)
イギリスポンド	BP PLC	965,605	4.68	4,527,721.84
	SHELL PLC-NEW	368,379	22.94	8,452,456.15
	ANGLO AMERICAN PLC	68,460	24.57	1,682,062.20
	ANTOFAGASTA PLC	22,358	14.67	328,103.65
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,013	52.74	422,605.62
	ENDEAVOUR MINING PLC	13,000	20.24	263,120.00
	GLENCORE PLC	587,098	4.35	2,553,876.30
	JOHNSON MATTHEY PLC	9,824	17.36	170,544.64
	MONDI PLC	25,878	12.43	321,663.54
	RIO TINTO PLC REG	61,891	51.25	3,171,913.75
	ASHTED GROUP PLC	22,405	53.68	1,202,700.40
	BAE SYSTEMS PLC	170,458	9.40	1,602,305.20
	BUNZL PLC	19,312	30.70	592,878.40
	DCC PLC	4,499	47.33	212,937.67
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	458,658	1.49	684,547.06
	SMITHS GROUP PLC	20,046	16.59	332,663.37
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,672	111.90	410,896.80
	EXPERIAN PLC	48,173	28.68	1,381,601.64
	INTERTEK GROUP PLC	7,435	42.87	318,738.45
	RELX PLC	101,318	25.31	2,564,358.58
	RENTOKIL INITIAL PLC	130,328	6.43	838,530.35
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	4.62	235,977.16
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,048	39.77	240,528.96
	BURBERRY GROUP PLC	22,327	22.25	496,775.75
	PERSIMMON PLC	14,327	12.13	173,786.51
	TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.13	189,128.67
	COMPASS GROUP PLC	95,637	21.72	2,077,235.64
	ENTAIN PLC	33,614	12.96	435,637.44
	INTERCONTINENTAL HOTELS	10,141	54.42	551,873.22

PEARSON	34,302	8.19	281,070.58
WHITBREAD PLC	10,170	33.72	342,932.40
AUTO TRADER GROUP PLC	43,890	6.17	271,152.42
INFORMA PLC	79,688	7.07	563,553.53
WPP PLC	56,693	8.62	488,807.04
JD SPORTS FASHION PLC	114,330	1.48	169,951.54
KINGFISHER PLC	96,593	2.37	229,601.56
NEXT PLC	7,235	64.34	465,499.90
OCADO GROUP PLC	36,500	3.86	141,109.00
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.67	218,988.06
TESCO PLC	393,967	2.61	1,031,799.57
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	20,881	18.59	388,282.19
BRITISH AMERICAN TOBACCO	114,644	25.90	2,969,852.82
COCA-COLA HBC AG-CDI	14,115	23.38	330,008.70
DIAGEO	121,861	33.20	4,046,394.50
IMPERIAL BRANDS PLC	45,617	17.25	786,893.25
HALEON PLC	254,427	3.20	816,329.02
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	37,576	60.34	2,267,335.84
UNILEVER PLC	136,012	39.70	5,399,676.40
SMITH & NEPHEW PLC	42,096	11.94	502,626.24
ASTRAZENECA	83,892	117.12	9,825,431.04
GSK PLC	224,792	13.78	3,097,633.76
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	8,586	18.90	162,318.33
BARCLAYS	873,251	1.56	1,365,240.61
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,066,083	6.07	6,476,454.22
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,573,042	0.45	1,617,337.46
NATWEST GROUP PLC	280,916	2.61	733,190.76
STANDARD CHARTERED PLC	135,187	6.60	893,315.69
3I GROUP PLC	55,147	19.91	1,098,252.50
ABRDN PLC	100,722	2.14	215,847.24
HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,246	8.61	157,207.53
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	22,399	86.50	1,937,513.50
M&G PLC	118,170	2.01	238,348.89
SCHRODERS PLC	42,161	4.58	193,476.82
ST JAMES'S PLACE PLC	26,728	11.60	310,044.80
WISE PLC - A	45,000	6.05	272,250.00
ADMIRAL GROUP PLC	9,872	22.94	226,463.68
AVIVA PLC	152,469	4.00	611,248.22
LEGAL & GENERAL GROUP	313,717	2.39	751,038.49
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	43,255	5.58	241,708.94
PRUDENTIAL	145,125	11.14	1,616,692.50
SAGE GROUP PLC	56,360	8.59	484,470.56



	HALMA PLC	20,296	24.15	490,148.40
	BT GROUP PLC	373,976	1.47	549,744.72
	VODAFONE GROUP PLC	1,194,547	0.74	894,476.79
	CENTRICA PLC	370,000	1.16	432,530.00
	NATIONAL GRID PLC	203,012	10.54	2,140,761.54
	SEVERN TRENT PLC	14,219	27.49	390,880.31
	SSE PLC	56,670	18.43	1,044,428.10
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	10.55	366,427.38
	イギリスポンド 小計	14,921,101		96,983,916.30 (17,003,220,205)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	13,161	12.78	168,197.58
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	310	696.00	215,760.00
	GIVAUDAN-REG	479	2,860.00	1,369,940.00
	HOLCIM LTD	30,195	58.06	1,753,121.70
	SIG GROUP AG	16,000	25.24	403,840.00
	SIKA AG-BR	7,610	247.60	1,884,236.00
	ABB LTD	84,750	34.50	2,923,875.00
	GEBERIT AG-REG	1,930	486.60	939,138.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,332	189.30	252,147.60
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,021	196.45	397,025.45
	VAT GROUP AG	1,440	368.80	531,072.00
	ADECCO GROUP AG-REG	9,959	28.64	285,225.76
	SGS SA	8,675	84.20	730,435.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,730	244.50	667,485.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	28,553	141.90	4,051,670.70
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,572	264.10	415,165.20
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	49.75	149,449.00
	DUFREY AG-REG	5,500	40.34	221,870.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	189	1,756.00	331,884.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	112,800.00	676,800.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	55	11,190.00	615,450.00
	NESTLE SA - REGISTERED	148,547	107.16	15,918,296.52
	ALCON INC	25,942	71.24	1,848,108.08
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,788	240.00	669,120.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,767	133.30	768,741.10
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,950	88.10	171,795.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,866	562.80	2,175,784.80
	NOVARTIS	109,820	90.17	9,902,469.40
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,944	306.40	595,641.60
	ROCHE HOLDING GENUSS	38,034	282.10	10,729,391.40
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,564	94.95	148,501.80
	JULIUS BAER GROUP LTD	11,775	56.62	666,700.50

	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,152	838.00	965,376.00	
	UBS GROUP AG	170,563	18.20	3,104,246.60	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	141.70	330,727.80	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,500	124.10	310,250.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,612	534.20	861,130.40	
	SWISS RE LTD	16,438	88.14	1,448,845.32	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,071	426.80	3,444,702.80	
	TEMENOS AG - REG	3,520	77.70	273,504.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,298	57.00	472,986.00	
	SWISSCOM	1,331	557.20	741,633.20	
	BKW AG	807	145.40	117,337.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,622	78.00	282,516.00	
	スイスフラン 小計	791,716		74,931,594.11 (11,559,697,023)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	13,081	361.80	4,732,705.80	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,106	417.60	2,132,265.60	
	SCA SV CELLULOSA B	34,632	149.15	5,165,362.80	
	ALFA LAVAL AB	14,260	395.30	5,636,978.00	
	ASSA ABLOY AB-B	57,678	255.90	14,759,800.20	
	ATLAS COPCO A	142,288	159.05	22,630,906.40	
	ATLAS COPCO B	85,638	137.90	11,809,480.20	
	BEIJER REF AB	23,000	158.80	3,652,400.00	
	EPIROC AB-A	37,140	198.75	7,381,575.00	
	EPIROC AB-B	22,442	170.00	3,815,140.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	84.28	1,840,759.48	
	INDUTRADE AB	14,669	261.30	3,833,009.70	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,081	221.90	1,793,173.90	
	LIFCO AB-B SHS	13,590	229.50	3,118,905.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	80,939	105.95	8,575,487.05	
	SAAB AB-B	5,800	584.40	3,389,520.00	
	SANDVIK AB	56,973	207.00	11,793,411.00	
	SKANSKA B	19,869	148.30	2,946,572.70	
	SKF AB-B	18,340	190.80	3,499,272.00	
	VOLVO AB-A SHS	8,748	220.20	1,926,309.60	
	VOLVO B	80,587	213.00	17,165,031.00	
	SECURITAS B	25,545	86.66	2,213,729.70	
	VOLVO CAR AB-B	35,544	42.25	1,501,734.00	
	EVOLUTION AB	9,622	1,415.20	13,617,054.40	
	EMBRACER GROUP AB	34,541	25.55	882,695.25	
	HENNES & MAURITZ B	33,524	143.22	4,801,307.28	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	31,655	283.50	8,974,192.50	
	GETINGE AB-B SHS	12,650	247.20	3,127,080.00	

	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	9,481	221.40	2,099,093.40	
	NORDEA BANK ABP	180,364	113.22	20,420,812.08	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	82,855	119.25	9,880,458.75	
	SVENSKA HANDELSBK A	81,670	92.48	7,552,841.60	
	SWEDBANK AB-A	50,623	179.30	9,076,703.90	
	EQT AB	22,258	222.20	4,945,727.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,848	294.00	2,013,312.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	292.80	2,527,156.80	
	INVESTOR AB-A SHS	23,000	217.50	5,002,500.00	
	INVESTOR AB-B SHS	95,842	217.20	20,816,882.40	
	KINNEVIK AB - B	10,757	158.70	1,707,135.90	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,093	465.00	1,903,245.00	
	ERICSSON (LM) B	160,922	56.61	9,109,794.42	
	HEXAGON AB-B SHS	108,582	127.55	13,849,634.10	
	TELE2 AB-B SHS	34,520	94.32	3,255,926.40	
	TELIA CO AB	138,487	24.60	3,406,780.20	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	32,478	43.12	1,400,451.36	
	SAGAX AB-B	9,400	232.50	2,185,500.00	
	スウェーデンクローナ 小計	2,008,594		297,869,814.47 (3,830,605,814)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	17,052	262.30	4,472,739.60	
	EQUINOR ASA	50,840	313.65	15,945,966.00	
	NORSK HYDRO	72,015	69.60	5,012,244.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,449	427.20	4,036,612.80	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,500	462.00	2,079,000.00	
	ADEVINTA ASA	16,857	77.50	1,306,417.50	
	MOWI ASA	23,314	182.70	4,259,467.80	
	ORKLA	39,803	77.80	3,096,673.40	
	SALMAR ASA	2,953	454.00	1,340,662.00	
	DNB BANK ASA	46,261	194.20	8,983,886.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	179.90	2,006,424.70	
	TELENOR ASA	38,789	109.70	4,255,153.30	
	ノルウェークローネ 小計	332,986		56,795,247.30 (734,930,500)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,314	502.20	2,668,690.80	
	NOVOZYMES A/S	10,786	331.50	3,575,559.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	428	1,780.50	762,054.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	55,152	198.66	10,956,496.32	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	152	12,190.00	1,852,880.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	251	12,315.00	3,091,065.00	
	DSV A/S	10,213	1,338.50	13,670,100.50	
	PANDORA A/S	4,249	552.00	2,345,448.00	

	CARLSBERG AS-B	5,476	1,051.50	5,758,014.00
	COLOPLAST-B	6,218	860.40	5,349,967.20
	DEMANT A/S	4,463	282.40	1,260,351.20
	GENMAB A/S	3,603	2,676.00	9,641,628.00
	NOVO NORDISK A/S-B	89,502	1,091.60	97,700,383.20
	DANSKE BANK A/S	38,806	160.65	6,234,183.90
	TRYG A/S	16,972	156.35	2,653,572.20
	ORSTED A/S	9,594	659.40	6,326,283.60
	デンマーククローネ 小計	261,179		173,846,676.92 (3,496,056,672)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	12,821	30.84	395,399.64
	SANTOS	176,138	7.39	1,301,659.82
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,345	32.38	334,971.10
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	99,749	34.73	3,464,282.77
	BHP GROUP LTD	270,212	44.72	12,083,880.64
	BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	19.84	427,532.16
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	97,584	20.79	2,028,771.36
	IGO LTD	35,382	14.58	515,869.56
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	25,493	37.87	965,419.91
	MINERAL RESOURCES LTD	10,000	69.78	697,800.00
	NEWCREST MINING LIMITED	45,440	26.41	1,200,070.40
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	58,122	13.35	775,928.70
	ORICA LTD	26,961	15.05	405,763.05
	PILBARA MINERALS LTD	131,710	4.75	625,622.50
	RIO TINTO LTD	20,196	114.58	2,314,057.68
	SOUTH32 LTD	246,137	3.89	957,472.93
	REECE LTD	12,870	18.66	240,154.20
	BRAMBLES LTD	82,936	13.54	1,122,953.44
	COMPUTERSHARE LIMITED	28,589	22.78	651,257.42
	AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	3.57	334,166.28
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	39,948	6.19	247,278.12
	TRANSURBAN GROUP	167,820	14.32	2,403,182.40
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	31,473	38.07	1,198,177.11
	IDP EDUCATION LTD	12,550	23.76	298,188.00
	LOTTERY CORP LTD/THE	123,601	5.01	619,241.01
	REA GROUP LTD	3,000	130.89	392,670.00
SEEK LTD	17,113	21.60	369,640.80	
WESFARMERS LTD	58,879	47.58	2,801,462.82	
COLES GROUP LTD	68,071	17.72	1,206,218.12	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	74,362	6.05	449,890.10	
WOOLWORTHS GROUP LTD	63,525	37.57	2,386,634.25	
TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	11.49	396,175.20	

	COCHLEAR LIMITED	3,460	239.48	828,600.80
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,641	57.70	556,285.70
	SONIC HEALTHCARE LTD	25,969	34.94	907,356.86
	CSL LIMITED	25,778	305.30	7,870,023.40
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	166,585	22.85	3,806,467.25
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	90,909	95.80	8,709,082.20
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	167,348	25.20	4,217,169.60
	WESTPAC BANKING	183,712	20.25	3,720,168.00
	ASX LTD	11,055	61.42	678,998.10
	MACQUARIE GROUP LIMITED	20,561	172.10	3,538,548.10
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	137,266	5.11	701,429.26
	MEDIBANK PRIVATE LTD	129,252	3.55	458,844.60
	QBE INSURANCE GROUP	78,253	14.99	1,173,012.47
	SUNCORP GROUP LIMITED	66,731	13.12	875,510.72
	WISETECH GLOBAL LTD	8,342	75.88	632,990.96
	XERO LTD	7,073	109.08	771,522.84
	TELSTRA GROUP LTD	199,810	4.31	861,181.10
	ORIGIN ENERGY LIMITED	87,883	8.40	738,217.20
	オーストラリアドル 小計	3,620,288		84,657,200.65 (7,965,396,009)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	64,661	8.75	565,783.75
	EBOS GROUP LTD	10,256	35.85	367,677.60
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	36,015	23.62	850,674.30
	SPARK NEW ZEALAND LTD	104,543	5.13	536,305.59
	MERCURY NZ LTD	40,719	6.22	253,272.18
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	5.36	343,222.24
	ニュージーランドドル 小計	320,228		2,916,935.66 (249,018,797)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	139,448	49.30	6,874,786.40
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	69,000	74.45	5,137,050.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	102,000	12.32	1,256,640.00
	MTR CORP	82,500	37.05	3,056,625.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	81,000	14.26	1,155,060.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	117,000	50.60	5,920,200.00
	SANDS CHINA LTD	127,000	27.30	3,467,100.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	83,000	21.05	1,747,150.00
	WH GROUP LTD	446,619	4.10	1,831,137.90
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	191,500	24.45	4,682,175.00
	HANG SENG BANK	39,600	112.80	4,466,880.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	64,800	308.80	20,010,240.00
	AIA GROUP LTD	627,400	80.75	50,662,550.00
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	42.55	1,361,600.00	

	CLP HOLDINGS	100,000	56.95	5,695,000.00
	HONG KONG & CHINA GAS	608,990	6.97	4,244,660.30
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	42.20	3,101,700.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	98,448	45.15	4,444,927.20
	ESR GROUP LTD	92,400	14.26	1,317,624.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	115,000	13.20	1,518,000.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	79,761	23.95	1,910,275.95
	NEW WORLD DEVELOPMENT	76,250	20.00	1,525,000.00
	SINO LAND CO	198,600	10.16	2,017,776.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	80,000	102.70	8,216,000.00
	SWIRE PACIFIC A	31,000	54.00	1,674,000.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,000	19.92	1,374,480.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	81,000	42.20	3,418,200.00
	香港ドル 小計	3,906,816		152,086,837.75 (2,705,624,843)
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,100	33.07	168,657.00
	KEPPEL CORP LTD	80,200	6.45	517,290.00
	SEATRIM LTD	1,530,619	0.12	186,735.51
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	3.66	273,768.00
	SINGAPORE AIRLINES	73,350	7.25	531,787.50
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	0.94	302,116.50
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	106,600	3.97	423,202.00
	DBS GROUP	95,900	30.91	2,964,269.00
	OCBC BANK	179,550	12.39	2,224,624.50
	UNITED OVERSEAS BANK	72,300	28.16	2,035,968.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.60	408,000.00
	VENTURE CORP LTD	14,300	14.70	210,210.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	420,880	2.43	1,022,738.40
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	153,900	3.33	512,487.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	6.88	151,360.00
	UOL GROUP LIMITED	24,800	6.56	162,688.00
	シンガポールドル 小計	3,216,499		12,095,901.41 (1,255,191,689)
イスラエルシェケル	ICL LTD	39,375	19.50	767,812.50
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,248	746.00	931,008.00
	BANK HAPUALIM BM	63,371	32.35	2,050,051.85
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	82,181	28.15	2,313,395.15
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,227	19.39	1,245,361.53
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,698	130.50	1,135,089.00
	NICE LTD	3,165	780.00	2,468,700.00
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	5,624	141.10	793,546.40
	AZRIELI GROUP	2,465	211.80	522,087.00

イスラエルシェケル 小計	270,354		12,227,051.43 (475,797,365)	
合 計	59,839,326		379,816,977,065 (379,816,977,065)	

## (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	643,560.75	
		LENDLEASE GROUP	36,448	256,958.40	
	オーストラリアドル 小計		99,853	900,519.15 (84,729,846)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	1,774,150.00	
	香港ドル 小計		185,000	1,774,150.00 (31,562,128)	
投資信託受益証券合計			284,853	116,291,974 (116,291,974)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,183	986,787.97	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	16,172	568,284.08	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	24,921	4,667,703.30	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	24,773	495,460.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,676	1,445,467.56	
		BOSTON PROPERTIES	7,893	427,090.23	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,093	576,731.32	
		CROWN CASTLE INC	23,289	2,654,014.44	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,921	1,555,514.25	
		EQUINIX INC	5,148	3,828,516.12	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,979	584,173.74	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	18,842	1,246,963.56	
		ESSEX PROPERTY TRUST	3,594	842,074.20	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,789	981,010.50	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	15,190	756,310.10	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	19,000	374,490.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	30,237	625,603.53	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	40,506	718,171.38	
		INVITATION HOMES INC	30,792	1,055,857.68	
		IRON MOUNTAIN INC	16,160	906,091.20	
		KIMCO REALTY CORP	31,093	603,204.20	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,856	903,405.12	
		PROLOGIS INC	49,348	5,986,405.88	
PUBLIC STORAGE	8,202	2,352,743.70			
REALTY INCOME CORP	36,949	2,250,563.59			
REGENCY CENTERS CORP	8,164	494,820.04			

	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,725	1,283,087.00
	SIMON PROPERTY GROUP	18,395	2,036,326.50
	SUN COMMUNITIES INC	6,650	867,426.00
	UDR INC	17,830	758,666.50
	VENTAS INC	20,307	928,436.04
	VICI PROPERTIES INC	51,241	1,655,084.30
	WELLTOWER INC	26,041	2,111,925.10
	WP CAREY INC	10,761	762,524.46
	アメリカドル 小計	624,720	48,290,933.59 (6,733,204,870)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,069	251,219.64
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	180,689.00
	カナダドル 小計	14,014	431,908.64 (45,130,133)
ユーロ	COVIVIO(FP)	3,076	144,633.52
	GECINA SA	2,719	268,909.10
	KLEPIERRE	11,603	262,691.92
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,185	289,890.95
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,235	193,753.30
	ユーロ 小計	30,818	1,159,878.79 (173,773,040)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	39,175	135,937.25
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	197,161.95
	SEGRO PLC	63,208	506,043.24
	イギリスポンド 小計	134,515	839,142.44 (147,118,452)
オーストラリアドル	DEXUS	74,283	604,663.62
	GOODMAN GROUP	90,044	1,765,762.84
	GPT GROUP	111,587	447,463.87
	MIRVAC GROUP	228,843	512,608.32
	SCENTRE GROUP	297,027	775,240.47
	STOCKLAND	121,481	498,072.10
	VICINITY CENTERS	221,263	412,655.49
	オーストラリアドル 小計	1,144,528	5,016,466.71 (471,999,352)
香港ドル	LINK REIT	147,800	6,990,940.00
	香港ドル 小計	147,800	6,990,940.00 (124,368,822)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	207,909	546,800.67
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	276,190	538,570.50
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	174,778	284,888.14
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	132,200	212,842.00



	シンガポールドル 小計	791,077	1,583,101.31 (164,278,422)	
	投資証券合計	2,887,472	7,859,873,091 (7,859,873,091)	
	合計		7,976,165,065 (7,976,165,065)	

(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

- 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。
- 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。
- 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。
- 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 605銘柄	97.6%			72.0%
	投資証券 34銘柄			2.4%	1.7%
カナダドル	株式 85銘柄	99.7%			3.4%
	投資証券 2銘柄			0.3%	0.0%
ユーロ	株式 221銘柄	99.5%			9.8%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 79銘柄	99.1%			4.4%
	投資証券 3銘柄			0.9%	0.0%
スイスフラン	株式 44銘柄	100.0%			3.0%
スウェーデンクローナ	株式 46銘柄	100.0%			1.0%
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 16銘柄	100.0%			0.9%
オーストラリアドル	株式 50銘柄	93.5%			2.1%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.0%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.5%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 6銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 27銘柄	94.6%			0.7%
	投資信託受益証券 1銘柄		1.1%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.3%	0.0%
シンガポールドル	株式 16銘柄	88.4%			0.3%
	投資証券 4銘柄			11.6%	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

項目	2023年 6月12日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	203,828,098
コール・ローン	824,920,170
国債証券	156,949,807,629
派生商品評価勘定	1,830,436
未収入金	16,257,901
未収利息	906,968,090
前払金	406,461
前払費用	79,218,050
差入委託証拠金	101,942,055
流動資産合計	159,085,178,890
資産合計	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,994,765
未払金	6,745,658
未払解約金	199,436,560
未払利息	1,678
流動負債合計	208,178,661
負債合計	
純資産の部	
元本等	
元本	57,835,795,349
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	101,041,204,880
元本等合計	158,877,000,229
純資産合計	158,877,000,229
負債純資産合計	159,085,178,890

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 6月12日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

2023年 6月12日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2023年 6月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	57,835,795,349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) 2.7470円 (27,470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

2023年 6月12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債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年 6月12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	2023年 6月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月11日
期首元本額	57,175,787,391円
期中追加設定元本額	6,443,787,544円
期中一部解約元本額	5,783,779,586円
期末元本額	57,835,795,349円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	1,952,747,122円
D C 外国債券インデックスファンド	1,868,861,626円
D C 外国債券インデックスファンド L	14,570,092,287円
D C バランスファンド 3 0	950,730,356円
D C バランスファンド 5 0	1,128,892,890円
D C バランスファンド 7 0	240,789,705円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	488,910,026円
外国債券インデックス e	1,028,452,293円
インデックスコレクション（外国債券）	9,508,907,943円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	5,016,797,317円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	995,467,818円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	345,263,036円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,091,794,911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）	2,996,564,427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）	325,191,144円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	65,411,366円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	338,337,771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）	218,465,232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）	171,204,453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）	89,815,481円
バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	1,049,983,269円
バランス V A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	494,168,540円
バランス V A 5 0 L（適格機関投資家専用）	5,321,603,312円
バランス V A 7 5（適格機関投資家専用）	295,128,233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）	161,366,959円
V A ポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	1,357,020,560円
V A ポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	70,622,618円
バランス V A 4 0（適格機関投資家専用）	162,182,320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）	76,123,583円
V A バランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	42,098,003円
V A ファンド 2 5（適格機関投資家専用）	51,524,597円
バランス V A 2 5 L（適格機関投資家専用）	195,349,916円
世界バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	60,792,715円
V A バランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	1,090,073,098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）	15,060,422円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 6月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,715,519,255
合計	1,715,519,255

(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

（2023年 6月12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	700,138,012	-	699,731,551	406,461
合計		700,138,012	-	699,731,551	406,461

## （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

（2023年 6月12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	646,565,889	-	646,808,021	242,132
	アメリカドル	330,618,541	-	330,292,680	325,861
	カナダドル	27,953,118	-	28,200,690	247,572
	ユーロ	221,465,539	-	221,665,520	199,981
	イギリスポンド	32,953,405	-	33,297,120	343,715
	オフショア人民元	33,575,286	-	33,352,011	223,275
合計		646,565,889	-	646,808,021	242,132

## （注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 05/31/25	1,180,000.00	1,083,986.71	
		T 0.25% 06/15/24	10,610,000.00	10,095,744.86	
		T 0.25% 06/30/25	4,310,000.00	3,952,067.94	
		T 0.25% 07/31/25	2,200,000.00	2,010,937.50	

T 0.25% 09/30/25	3,290,000.00	2,994,735.36	
T 0.375% 01/31/26	1,700,000.00	1,534,781.25	
T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,387,812.48	
T 0.375% 07/31/27	4,000,000.00	3,444,453.12	
T 0.375% 08/15/24	5,500,000.00	5,202,334.00	
T 0.375% 09/15/24	1,600,000.00	1,508,906.25	
T 0.375% 09/30/27	4,000,000.00	3,426,796.88	
T 0.375% 11/30/25	3,770,000.00	3,420,759.56	
T 0.5% 02/28/26	3,500,000.00	3,161,962.89	
T 0.5% 03/31/25	4,000,000.00	3,711,250.00	
T 0.5% 04/30/27	2,000,000.00	1,745,195.32	
T 0.5% 05/31/27	5,500,000.00	4,786,396.50	
T 0.5% 06/30/27	2,500,000.00	2,170,166.02	
T 0.5% 08/31/27	1,100,000.00	950,060.55	
T 0.5% 10/31/27	1,580,000.00	1,358,028.51	
T 0.625% 03/31/27	3,400,000.00	2,988,746.09	
T 0.625% 05/15/30	7,400,000.00	5,965,960.95	
T 0.625% 07/31/26	4,000,000.00	3,585,078.12	
T 0.625% 08/15/30	9,130,000.00	7,320,762.13	
T 0.625% 10/15/24	3,250,000.00	3,065,219.72	
T 0.625% 11/30/27	3,700,000.00	3,191,250.00	
T 0.625% 12/31/27	3,000,000.00	2,581,933.59	
T 0.75% 01/31/28	3,500,000.00	3,023,876.94	
T 0.75% 03/31/26	2,750,000.00	2,499,814.46	
T 0.75% 04/30/26	3,500,000.00	3,169,824.21	
T 0.75% 08/31/26	3,000,000.00	2,693,027.34	
T 0.75% 11/15/24	5,230,000.00	4,927,640.62	
T 0.875% 09/30/26	5,000,000.00	4,500,097.65	
T 0.875% 11/15/30	6,160,000.00	5,017,753.10	
T 1.125% 01/15/25	5,830,000.00	5,497,735.53	
T 1.125% 02/15/31	5,600,000.00	4,635,093.73	
T 1.125% 02/29/28	3,880,000.00	3,405,836.72	
T 1.125% 05/15/40	1,550,000.00	1,005,290.04	
T 1.125% 08/15/40	4,000,000.00	2,572,109.36	
T 1.125% 08/31/28	4,000,000.00	3,470,000.00	
T 1.125% 10/31/26	7,850,000.00	7,105,783.18	
T 1.25% 03/31/28	5,300,000.00	4,671,763.65	
T 1.25% 04/30/28	7,800,000.00	6,863,847.66	
T 1.25% 05/15/50	5,120,000.00	2,846,699.98	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,270,390.64	
T 1.25% 06/30/28	1,000,000.00	877,031.25	
T 1.25% 08/15/31	6,550,000.00	5,398,632.81	

T 1.25% 09/30/28	3,800,000.00	3,312,679.67	
T 1.25% 11/30/26	3,000,000.00	2,721,914.07	
T 1.25% 12/31/26	5,500,000.00	4,983,515.62	
T 1.375% 08/15/50	2,300,000.00	1,320,478.50	
T 1.375% 10/31/28	1,700,000.00	1,489,625.00	
T 1.375% 11/15/31	12,110,000.00	10,030,958.95	
T 1.375% 11/15/40	4,650,000.00	3,110,232.43	
T 1.5% 02/15/25	3,000,000.00	2,841,035.16	
T 1.5% 02/15/30	1,820,000.00	1,571,527.33	
T 1.5% 08/15/26	5,300,000.00	4,878,484.37	
T 1.5% 09/30/24	3,000,000.00	2,866,757.82	
T 1.5% 11/30/28	5,550,000.00	4,890,395.48	
T 1.625% 02/15/26	5,750,000.00	5,361,650.40	
T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	5,012,085.92	
T 1.625% 05/15/31	4,690,000.00	4,007,018.75	
T 1.625% 08/15/29	2,260,000.00	1,985,445.30	
T 1.625% 09/30/26	2,150,000.00	1,983,165.03	
T 1.625% 11/15/50	5,100,000.00	3,130,423.80	
T 1.625% 11/30/26	3,030,000.00	2,786,238.86	
T 1.75% 01/31/29	2,500,000.00	2,226,611.32	
T 1.75% 03/15/25	5,500,000.00	5,222,421.87	
T 1.75% 06/30/24	2,000,000.00	1,929,707.62	
T 1.75% 08/15/41	4,800,000.00	3,372,000.00	
T 1.75% 11/15/29	3,220,000.00	2,845,046.10	
T 1.75% 12/31/26	4,300,000.00	3,967,169.93	
T 1.875% 02/15/32	6,200,000.00	5,336,843.75	
T 1.875% 02/15/41	4,750,000.00	3,451,635.76	
T 1.875% 02/15/51	4,500,000.00	2,946,533.22	
T 1.875% 02/28/27	3,000,000.00	2,770,488.27	
T 1.875% 02/28/29	1,900,000.00	1,702,132.82	
T 1.875% 06/30/26	3,980,000.00	3,717,724.20	
T 1.875% 07/31/26	1,800,000.00	1,678,253.90	
T 1.875% 11/15/51	3,400,000.00	2,218,300.79	
T 1% 07/31/28	2,000,000.00	1,727,421.88	
T 1% 12/15/24	3,070,000.00	2,895,633.57	
T 2.125% 05/15/25	3,850,000.00	3,672,915.05	
T 2.125% 07/31/24	3,470,000.00	3,354,242.95	
T 2.125% 09/30/24	2,200,000.00	2,119,390.63	
T 2.125% 11/30/24	1,400,000.00	1,344,683.59	
T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	3,653,964.83	
T 2.25% 02/15/52	2,410,000.00	1,724,044.32	
T 2.25% 03/31/26	1,500,000.00	1,420,898.43	
T 2.25% 05/15/41	1,600,000.00	1,232,718.75	

T 2.25% 08/15/27	2,320,000.00	2,161,678.11	
T 2.25% 08/15/46	2,180,000.00	1,587,099.60	
T 2.25% 08/15/49	4,110,000.00	2,964,096.69	
T 2.25% 10/31/24	2,500,000.00	2,408,398.45	
T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	4,813,574.20	
T 2.25% 11/15/25	5,500,000.00	5,228,437.50	
T 2.25% 11/15/27	5,260,000.00	4,884,197.66	
T 2.25% 12/31/24	2,900,000.00	2,785,812.50	
T 2.375% 02/15/42	1,350,000.00	1,050,653.32	
T 2.375% 03/31/29	1,400,000.00	1,288,000.00	
T 2.375% 04/30/26	1,820,000.00	1,727,862.50	
T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,378,937.50	
T 2.375% 05/15/29	1,390,000.00	1,277,279.68	
T 2.375% 05/15/51	1,980,000.00	1,458,819.13	
T 2.375% 08/15/24	5,460,000.00	5,287,135.52	
T 2.375% 11/15/49	2,010,000.00	1,490,108.79	
T 2.5% 01/31/25	4,000,000.00	3,853,750.00	
T 2.5% 02/15/45	2,150,000.00	1,658,733.40	
T 2.5% 02/15/46	1,250,000.00	959,326.17	
T 2.5% 02/28/26	650,000.00	620,267.57	
T 2.5% 05/15/46	1,810,000.00	1,387,513.47	
T 2.625% 01/31/26	1,350,000.00	1,293,310.54	
T 2.625% 02/15/29	6,900,000.00	6,442,201.14	
T 2.625% 03/31/25	2,500,000.00	2,410,107.42	
T 2.625% 12/31/25	4,500,000.00	4,313,671.87	
T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	4,423,548.03	
T 2.75% 05/31/29	6,000,000.00	5,630,625.00	
T 2.75% 06/30/25	2,000,000.00	1,928,867.18	
T 2.75% 08/15/32	2,280,000.00	2,100,450.00	
T 2.75% 08/15/42	2,330,000.00	1,919,291.99	
T 2.75% 08/15/47	1,150,000.00	921,437.50	
T 2.75% 08/31/25	5,000,000.00	4,816,992.20	
T 2.75% 11/15/42	1,650,000.00	1,356,383.78	
T 2.75% 11/15/47	1,400,000.00	1,121,996.09	
T 2.875% 04/30/25	10,770,000.00	10,420,606.01	
T 2.875% 04/30/29	4,170,000.00	3,941,953.12	
T 2.875% 05/15/28	4,460,000.00	4,242,923.41	
T 2.875% 05/15/32	4,500,000.00	4,193,437.50	
T 2.875% 05/15/43	1,050,000.00	877,713.86	
T 2.875% 05/15/49	4,400,000.00	3,615,648.43	
T 2.875% 05/15/52	3,000,000.00	2,464,804.68	
T 2.875% 07/31/25	500,000.00	483,261.72	



T 2.875% 08/15/28	10,200,000.00	9,683,226.58
T 2.875% 08/15/45	1,480,000.00	1,218,427.34
T 2% 02/15/25	6,050,000.00	5,779,522.46
T 2% 02/15/50	3,370,000.00	2,288,506.44
T 2% 05/31/24	1,500,000.00	1,454,306.49
T 2% 06/30/24	1,000,000.00	967,471.10
T 2% 08/15/25	3,750,000.00	3,556,494.15
T 2% 08/15/51	6,940,000.00	4,679,755.88
T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,515,324.21
T 2% 11/15/41	4,140,000.00	3,028,183.58
T 3.125% 02/15/42	1,000,000.00	878,164.06
T 3.125% 02/15/43	3,600,000.00	3,138,679.68
T 3.125% 05/15/48	1,400,000.00	1,202,441.40
T 3.125% 08/15/25	2,500,000.00	2,428,808.60
T 3.125% 08/15/44	1,550,000.00	1,339,145.50
T 3.125% 08/31/29	4,300,000.00	4,117,753.91
T 3.125% 11/15/28	3,960,000.00	3,803,842.98
T 3.125% 11/15/41	870,000.00	766,670.50
T 3.25% 05/15/42	1,500,000.00	1,338,808.59
T 3.25% 06/30/27	4,850,000.00	4,702,889.65
T 3.375% 05/15/44	400,000.00	360,382.81
T 3.375% 08/15/42	1,200,000.00	1,089,375.00
T 3.375% 11/15/48	1,000,000.00	899,199.22
T 3.5% 02/15/33	6,000,000.00	5,873,437.49
T 3.5% 02/15/39	900,000.00	864,298.82
T 3.625% 02/15/44	1,600,000.00	1,499,906.25
T 3.625% 02/15/53	780,000.00	743,071.87
T 3.625% 08/15/43	1,600,000.00	1,504,093.74
T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,064,056.64
T 3.75% 11/15/43	900,000.00	861,064.45
T 3.875% 08/15/40	680,000.00	676,002.34
T 3.875% 09/30/29	1,050,000.00	1,048,441.40
T 3.875% 11/30/29	3,880,000.00	3,876,817.19
T 3% 02/15/47	2,400,000.00	2,014,359.38
T 3% 02/15/48	3,100,000.00	2,601,638.66
T 3% 02/15/49	1,940,000.00	1,631,380.86
T 3% 05/15/42	1,100,000.00	945,398.43
T 3% 05/15/45	600,000.00	505,488.28
T 3% 05/15/47	1,300,000.00	1,091,212.88
T 3% 08/15/48	3,060,000.00	2,568,786.33
T 3% 08/15/52	2,570,000.00	2,166,831.25
T 3% 09/30/25	3,660,000.00	3,543,766.41
T 3% 10/31/25	1,000,000.00	967,695.31

	T 3% 11/15/44	1,550,000.00	1,309,174.81	
	T 4.125% 11/15/32	2,170,000.00	2,229,505.47	
	T 4.25% 05/15/39	850,000.00	890,806.63	
	T 4.25% 11/15/40	900,000.00	937,107.42	
	T 4.375% 02/15/38	500,000.00	533,330.08	
	T 4.375% 05/15/40	750,000.00	794,458.00	
	T 4.375% 05/15/41	550,000.00	579,444.33	
	T 4.375% 11/15/39	650,000.00	689,558.59	
	T 4.5% 02/15/36	600,000.00	650,050.78	
	T 4.5% 05/15/38	250,000.00	269,799.80	
	T 4.5% 08/15/39	750,000.00	808,535.16	
	T 4.5% 11/15/25	4,350,000.00	4,358,326.16	
	T 4.625% 02/15/40	700,000.00	764,531.25	
	T 4.625% 03/15/26	2,170,000.00	2,189,157.02	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	828,940.43	
	T 4% 11/15/52	3,500,000.00	3,570,000.00	
	T 4% 12/15/25	5,000,000.00	4,957,421.90	
	T 5.0% 05/15/37	300,000.00	340,810.54	
	T 5.25% 11/15/28	900,000.00	954,914.05	
	T 5.375% 02/15/31	750,000.00	828,457.03	
	T 6.0% 02/15/26	600,000.00	625,218.75	
	T 6.125% 11/15/27	1,050,000.00	1,139,373.04	
	T 6.25% 05/15/30	720,000.00	824,287.50	
	アメリカドル 小計	627,210,000.00	556,461,241.26 (77,587,390,868)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	890,000.00	802,848.61	
	CAN 0.5% 09/01/25	1,590,000.00	1,462,653.72	
	CAN 0.5% 12/01/30	2,320,000.00	1,876,201.21	
	CAN 0.75% 10/01/24	300,000.00	284,932.49	
	CAN 1.25% 03/01/25	500,000.00	473,355.44	
	CAN 1.25% 03/01/27	640,000.00	583,317.12	
	CAN 1.25% 06/01/30	1,940,000.00	1,679,398.05	
	CAN 1.5% 04/01/25	1,210,000.00	1,147,166.84	
	CAN 1.5% 06/01/26	740,000.00	689,680.51	
	CAN 1.5% 06/01/31	2,010,000.00	1,742,912.06	
	CAN 1.5% 09/01/24	660,000.00	634,431.35	
	CAN 1.5% 12/01/31	1,230,000.00	1,058,364.87	
	CAN 1.75% 12/01/53	1,520,000.00	1,080,723.34	
	CAN 1% 06/01/27	640,000.00	577,362.49	
	CAN 1% 09/01/26	1,140,000.00	1,040,603.93	
	CAN 2.25% 06/01/25	670,000.00	643,385.69	
	CAN 2.25% 06/01/29	390,000.00	364,718.48	

	CAN 2.25% 12/01/29	240,000.00	223,354.32	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,780,000.00	1,739,827.25	
	CAN 2.5% 12/01/32	740,000.00	687,134.40	
	CAN 2.75% 06/01/33	510,000.00	483,194.18	
	CAN 2.75% 08/01/24	280,000.00	273,426.63	
	CAN 2.75% 09/01/27	710,000.00	682,202.08	
	CAN 2.75% 12/01/48	510,000.00	462,624.85	
	CAN 2.75% 12/01/55	150,000.00	134,363.66	
	CAN 2.75% 12/01/64	350,000.00	309,177.75	
	CAN 2% 06/01/28	500,000.00	465,250.22	
	CAN 2% 06/01/32	1,190,000.00	1,062,090.22	
	CAN 2% 12/01/51	2,510,000.00	1,920,357.02	
	CAN 3.5% 03/01/28	780,000.00	773,851.32	
	CAN 3.5% 12/01/45	590,000.00	605,049.97	
	CAN 3% 10/01/25	370,000.00	359,519.60	
	CAN 3% 11/01/24	1,790,000.00	1,747,870.98	
	CAN 4.0% 06/01/41	490,000.00	530,956.46	
	CAN 5.75% 06/01/29	480,000.00	537,780.15	
	CAN 5.75% 06/01/33	620,000.00	742,307.29	
	CAN 5% 06/01/37	500,000.00	589,264.30	
	<b>カナダドル 小計</b>	<b>33,480,000.00</b>	<b>30,471,658.85</b>	<b>(3,183,983,633)</b>
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	6,963,136.00	
	MBONO 10% 12/05/24	20,780,000.00	20,622,790.78	
	MBONO 5.5% 03/04/27	7,760,000.00	6,872,333.60	
	MBONO 5.75% 03/05/26	23,680,000.00	21,582,800.45	
	MBONO 5% 03/06/25	1,100,000.00	1,011,714.00	
	MBONO 7.5% 05/26/33	3,560,000.00	3,247,396.40	
	MBONO 7.5% 06/03/27	21,620,000.00	20,462,465.20	
	MBONO 7.75% 05/29/31	22,210,000.00	20,846,750.20	
	MBONO 7.75% 11/13/42	13,980,000.00	12,265,353.00	
	MBONO 7.75% 11/23/34	4,970,000.00	4,575,928.70	
	MBONO 8.5% 05/31/29	20,740,000.00	20,424,752.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	13,720,000.00	13,090,114.80	
	MBONO 8% 07/31/53	5,330,000.00	4,733,999.40	
	MBONO 8% 09/05/24	18,530,000.00	17,925,695.19	
	MBONO 8% 11/07/47	14,310,000.00	12,832,349.40	
	<b>メキシコペソ 小計</b>	<b>198,690,000.00</b>	<b>187,457,579.12</b>	<b>(1,512,314,019)</b>
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	660,000.00	547,454.16	
	BGB 0.35% 06/22/32	700,000.00	556,597.30	
	BGB 0.4% 06/22/40	400,000.00	247,109.20	
	BGB 0.5% 10/22/24	540,000.00	521,205.30	

BGB 0.65% 06/22/71	340,000.00	134,680.12
BGB 0.8% 06/22/25	1,100,000.00	1,053,768.10
BGB 0.8% 06/22/27	750,000.00	693,774.00
BGB 0.8% 06/22/28	810,000.00	737,863.02
BGB 0.9% 06/22/29	1,100,000.00	988,433.95
BGB 0% 10/22/27	600,000.00	532,926.30
BGB 0% 10/22/31	730,000.00	574,203.40
BGB 1.25% 04/22/33	550,000.00	472,373.00
BGB 1.4% 06/22/53	520,000.00	323,746.28
BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	319,651.20
BGB 1.6% 06/22/47	640,000.00	449,993.60
BGB 1.7% 06/22/50	660,000.00	459,825.30
BGB 1.9% 06/22/38	510,000.00	425,933.64
BGB 1% 06/22/26	1,000,000.00	947,242.00
BGB 1% 06/22/31	910,000.00	788,984.56
BGB 2.15% 06/22/66	450,000.00	326,515.50
BGB 2.25% 06/22/57	380,000.00	292,195.30
BGB 2.6% 06/22/24	1,000,000.00	992,892.20
BGB 2.75% 04/22/39	70,000.00	64,944.60
BGB 3.3% 06/22/54	310,000.00	296,814.46
BGB 3.45% 06/22/43	280,000.00	280,341.60
BGB 3.75% 06/22/45	520,000.00	546,946.40
BGB 3% 06/22/33	420,000.00	418,335.31
BGB 3% 06/22/34	350,000.00	346,896.20
BGB 4.25% 03/28/41	1,110,000.00	1,237,343.64
BGB 4.5% 03/28/26	750,000.00	782,233.50
BGB 4% 03/28/32	620,000.00	669,888.92
BGB 5.5% 03/28/28	1,170,000.00	1,314,575.73
BGB 5% 03/28/35	1,270,000.00	1,497,324.92
BKO 0.2% 06/14/24	1,850,000.00	1,796,984.55
BKO 0.4% 09/13/24	1,140,000.00	1,102,703.76
BKO 2.5% 03/13/25	400,000.00	396,919.20
BTPS 0.25% 03/15/28	1,250,000.00	1,074,282.50
BTPS 0.35% 02/01/25	1,440,000.00	1,370,865.55
BTPS 0.45% 02/15/29	1,710,000.00	1,436,369.22
BTPS 0.5% 02/01/26	500,000.00	463,422.66
BTPS 0.5% 07/15/28	730,000.00	628,367.21
BTPS 0.6% 08/01/31	1,300,000.00	1,011,486.45
BTPS 0.85% 01/15/27	1,600,000.00	1,462,707.20
BTPS 0.9% 04/01/31	1,300,000.00	1,050,163.28
BTPS 0.95% 03/01/37	600,000.00	400,302.00
BTPS 0.95% 06/01/32	880,000.00	687,463.04
BTPS 0.95% 08/01/30	1,330,000.00	1,100,596.28

BTPS 0.95% 09/15/27	1,000,000.00	902,581.00	
BTPS 0.95% 12/01/31	1,120,000.00	888,647.20	
BTPS 0% 04/01/26	2,700,000.00	2,455,145.10	
BTPS 0% 08/01/26	1,330,000.00	1,196,275.15	
BTPS 0% 08/15/24	1,010,000.00	970,989.85	
BTPS 1.1% 04/01/27	1,600,000.00	1,468,323.20	
BTPS 1.2% 08/15/25	540,000.00	515,109.24	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,170,000.00	1,088,509.50	
BTPS 1.35% 04/01/30	1,010,000.00	868,877.75	
BTPS 1.45% 03/01/36	830,000.00	608,039.74	
BTPS 1.45% 05/15/25	1,070,000.00	1,031,965.78	
BTPS 1.45% 11/15/24	1,520,000.00	1,479,682.00	
BTPS 1.5% 04/30/45	650,000.00	394,002.12	
BTPS 1.5% 06/01/25	1,500,000.00	1,446,275.47	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,281,113.55	
BTPS 1.65% 03/01/32	1,300,000.00	1,091,948.00	
BTPS 1.65% 12/01/30	1,450,000.00	1,252,372.25	
BTPS 1.7% 09/01/51	750,000.00	437,748.75	
BTPS 1.75% 07/01/24	1,230,000.00	1,208,366.76	
BTPS 1.8% 03/01/41	890,000.00	616,023.29	
BTPS 1.85% 07/01/25	820,000.00	795,329.48	
BTPS 2.05% 08/01/27	1,040,000.00	984,692.80	
BTPS 2.15% 03/01/72	340,000.00	194,335.11	
BTPS 2.15% 09/01/52	510,000.00	325,679.37	
BTPS 2.2% 06/01/27	1,110,000.00	1,059,961.20	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,190,000.00	956,361.35	
BTPS 2.45% 09/01/33	1,360,000.00	1,184,324.72	
BTPS 2.45% 09/01/50	970,000.00	676,802.95	
BTPS 2.5% 11/15/25	660,000.00	646,745.88	
BTPS 2.5% 12/01/24	1,300,000.00	1,283,657.70	
BTPS 2.5% 12/01/32	960,000.00	853,128.76	
BTPS 2.65% 12/01/27	770,000.00	743,966.30	
BTPS 2.7% 03/01/47	940,000.00	715,360.68	
BTPS 2.8% 03/01/67	500,000.00	347,000.00	
BTPS 2.8% 06/15/29	700,000.00	668,745.00	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,260,000.00	1,214,035.20	
BTPS 2.95% 09/01/38	850,000.00	724,288.40	
BTPS 2% 02/01/28	930,000.00	871,975.44	
BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,015,610.40	
BTPS 3.1% 03/01/40	670,000.00	572,307.30	
BTPS 3.25% 09/01/46	980,000.00	822,753.12	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,390,000.00	1,285,169.67	

BTPS 3.45% 03/01/48	1,040,000.00	895,687.52
BTPS 3.5% 01/15/26	1,490,000.00	1,492,510.65
BTPS 3.5% 03/01/30	1,950,000.00	1,932,489.00
BTPS 3.75% 09/01/24	1,040,000.00	1,044,196.40
BTPS 3.85% 09/01/49	840,000.00	765,950.64
BTPS 3.85% 12/15/29	250,000.00	252,078.50
BTPS 3% 08/01/29	1,210,000.00	1,169,763.87
BTPS 4.4% 05/01/33	540,000.00	558,366.26
BTPS 4.45% 09/01/43	440,000.00	440,020.68
BTPS 4.5% 03/01/26	930,000.00	956,015.82
BTPS 4.5% 10/01/53	280,000.00	279,776.00
BTPS 4.75% 09/01/28	1,260,000.00	1,332,777.60
BTPS 4.75% 09/01/44	1,030,000.00	1,074,666.98
BTPS 4% 02/01/37	1,800,000.00	1,758,290.40
BTPS 4% 04/30/35	620,000.00	610,023.36
BTPS 4% 10/30/31	440,000.00	445,683.48
BTPS 5.0% 08/01/39	1,440,000.00	1,548,498.24
BTPS 5.25% 11/01/29	1,770,000.00	1,935,438.36
BTPS 5.75% 02/01/33	1,810,000.00	2,064,449.80
BTPS 5% 03/01/25	1,290,000.00	1,323,834.12
BTPS 5% 08/01/34	1,260,000.00	1,356,372.36
BTPS 5% 09/01/40	1,220,000.00	1,314,331.62
BTPS 6.5% 11/01/27	2,070,000.00	2,327,708.79
BTPS 6% 05/01/31	1,600,000.00	1,844,534.40
BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	392,584.15
DBR 0.25% 02/15/27	230,000.00	212,020.21
DBR 0.25% 02/15/29	1,750,000.00	1,557,417.17
DBR 0.25% 08/15/28	1,300,000.00	1,167,435.10
DBR 0.5% 02/15/25	2,090,000.00	2,007,322.10
DBR 0.5% 02/15/26	2,300,000.00	2,172,179.80
DBR 0.5% 02/15/28	1,510,000.00	1,385,495.97
DBR 0.5% 08/15/27	940,000.00	868,671.86
DBR 0% 02/15/30	1,660,000.00	1,424,796.26
DBR 0% 02/15/31	1,240,000.00	1,040,660.08
DBR 0% 02/15/32	2,080,000.00	1,706,076.32
DBR 0% 05/15/35	1,280,000.00	957,648.64
DBR 0% 05/15/36	1,320,000.00	958,968.12
DBR 0% 08/15/26	1,620,000.00	1,494,365.76
DBR 0% 08/15/29	2,430,000.00	2,107,947.24
DBR 0% 08/15/30	1,250,000.00	1,061,558.75
DBR 0% 08/15/30	400,000.00	340,202.80
DBR 0% 08/15/31	2,310,000.00	1,917,514.83
DBR 0% 08/15/50	2,740,000.00	1,429,518.28

DBR 0% 08/15/52	1,140,000.00	564,140.40
DBR 0% 11/15/27	1,230,000.00	1,107,046.74
DBR 0% 11/15/28	1,250,000.00	1,102,068.75
DBR 1.25% 08/15/48	1,880,000.00	1,461,564.64
DBR 1.7% 08/15/32	1,310,000.00	1,242,107.94
DBR 1.8% 08/15/53	700,000.00	595,438.90
DBR 1% 05/15/38	980,000.00	792,873.90
DBR 1% 08/15/24	1,610,000.00	1,571,482.36
DBR 1% 08/15/25	1,130,000.00	1,087,250.97
DBR 2.3% 02/15/33	2,120,000.00	2,106,722.44
DBR 2.5% 07/04/44	1,620,000.00	1,612,546.38
DBR 2.5% 08/15/46	1,770,000.00	1,774,520.58
DBR 3.25% 07/04/42	930,000.00	1,025,390.10
DBR 4.0% 01/04/37	1,570,000.00	1,836,593.85
DBR 4.25% 07/04/39	1,090,000.00	1,329,492.62
DBR 4.75% 07/04/28	1,180,000.00	1,312,628.46
DBR 4.75% 07/04/34	1,240,000.00	1,518,711.08
DBR 4.75% 07/04/40	1,220,000.00	1,585,027.66
DBR 5.5% 01/04/31	1,640,000.00	1,995,746.34
DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	1,707,561.75
DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	753,875.57
DBR 6.5% 07/04/27	1,270,000.00	1,464,716.40
FRTR 0.25% 11/25/26	1,590,000.00	1,457,530.74
FRTR 0.5% 05/25/25	2,500,000.00	2,381,575.00
FRTR 0.5% 05/25/26	2,930,000.00	2,735,571.06
FRTR 0.5% 05/25/29	2,830,000.00	2,487,349.26
FRTR 0.5% 05/25/40	1,460,000.00	941,362.74
FRTR 0.5% 05/25/72	620,000.00	232,166.78
FRTR 0.5% 06/25/44	700,000.00	408,048.20
FRTR 0.75% 02/25/28	1,970,000.00	1,797,914.59
FRTR 0.75% 05/25/28	2,960,000.00	2,689,900.00
FRTR 0.75% 05/25/52	1,930,000.00	1,025,080.90
FRTR 0.75% 05/25/53	1,440,000.00	745,679.52
FRTR 0.75% 11/25/28	3,190,000.00	2,871,641.19
FRTR 0% 02/25/25	880,000.00	835,393.50
FRTR 0% 02/25/26	2,790,000.00	2,582,703.00
FRTR 0% 02/25/27	2,320,000.00	2,094,718.13
FRTR 0% 03/25/25	3,280,000.00	3,108,205.07
FRTR 0% 05/25/32	2,150,000.00	1,674,493.10
FRTR 0% 11/25/29	2,460,000.00	2,067,530.37
FRTR 0% 11/25/30	3,330,000.00	2,717,989.29
FRTR 0% 11/25/31	3,590,000.00	2,843,190.25

FRTR 1.25% 05/25/34	2,230,000.00	1,870,263.09
FRTR 1.25% 05/25/36	2,660,000.00	2,135,663.46
FRTR 1.25% 05/25/38	600,000.00	461,319.00
FRTR 1.5% 05/25/31	2,410,000.00	2,197,799.50
FRTR 1.5% 05/25/50	1,960,000.00	1,334,907.00
FRTR 1.75% 05/25/66	850,000.00	564,043.00
FRTR 1.75% 06/25/39	1,660,000.00	1,364,611.30
FRTR 1.75% 11/25/24	2,020,000.00	1,980,690.80
FRTR 1% 05/25/27	2,850,000.00	2,662,729.35
FRTR 1% 11/25/25	1,340,000.00	1,280,065.15
FRTR 2.5% 05/25/30	3,090,000.00	3,045,314.55
FRTR 2.5% 05/25/43	250,000.00	220,123.25
FRTR 2.5% 09/24/26	1,000,000.00	987,901.00
FRTR 2.75% 10/25/27	3,280,000.00	3,279,042.24
FRTR 2% 05/25/48	1,790,000.00	1,393,615.24
FRTR 2% 11/25/32	2,060,000.00	1,913,871.84
FRTR 3.25% 05/25/45	1,800,000.00	1,783,382.40
FRTR 3.5% 04/25/26	3,120,000.00	3,172,830.96
FRTR 3% 05/25/33	350,000.00	352,533.30
FRTR 3% 05/25/54	500,000.00	462,283.00
FRTR 4.5% 04/25/41	2,090,000.00	2,439,305.88
FRTR 4.75% 04/25/35	1,590,000.00	1,854,083.10
FRTR 4% 04/25/55	1,070,000.00	1,202,638.27
FRTR 4% 04/25/60	1,020,000.00	1,159,843.02
FRTR 4% 10/25/38	1,600,000.00	1,755,513.60
FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	2,865,380.00
FRTR 5.75% 10/25/32	2,150,000.00	2,653,663.30
FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	1,549,945.60
IRISH 0.2% 05/15/27	410,000.00	371,907.10
IRISH 0.2% 10/18/30	470,000.00	392,821.30
IRISH 0.35% 10/18/32	170,000.00	136,743.58
IRISH 0.4% 05/15/35	280,000.00	209,646.92
IRISH 0.55% 04/22/41	220,000.00	141,926.87
IRISH 0.9% 05/15/28	440,000.00	403,950.80
IRISH 0% 10/18/31	340,000.00	272,080.24
IRISH 1.1% 05/15/29	550,000.00	502,837.50
IRISH 1.3% 05/15/33	310,000.00	269,107.90
IRISH 1.35% 03/18/31	240,000.00	218,707.20
IRISH 1.5% 05/15/50	460,000.00	316,539.80
IRISH 1.7% 05/15/37	440,000.00	371,637.20
IRISH 1% 05/15/26	670,000.00	637,072.58
IRISH 2.4% 05/15/30	660,000.00	648,390.60
IRISH 2% 02/18/45	620,000.00	499,530.28



IRISH 3% 10/18/43	170,000.00	166,116.69
IRISH 5.4% 03/13/25	620,000.00	646,309.57
NETHER 0.25% 07/15/25	760,000.00	719,799.80
NETHER 0.25% 07/15/29	760,000.00	660,184.64
NETHER 0.5% 01/15/40	910,000.00	632,296.21
NETHER 0.5% 07/15/26	1,050,000.00	981,101.62
NETHER 0.5% 07/15/32	720,000.00	595,614.96
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	834,208.20
NETHER 0.75% 07/15/28	1,090,000.00	994,030.07
NETHER 0% 01/15/26	870,000.00	809,441.04
NETHER 0% 01/15/27	750,000.00	681,317.25
NETHER 0% 01/15/29	1,040,000.00	898,890.81
NETHER 0% 01/15/38	530,000.00	352,484.98
NETHER 0% 01/15/52	1,010,000.00	476,115.40
NETHER 0% 07/15/30	850,000.00	707,662.40
NETHER 0% 07/15/31	700,000.00	567,562.23
NETHER 2.5% 01/15/33	820,000.00	806,976.76
NETHER 2.5% 07/15/33	90,000.00	88,569.00
NETHER 2.75% 01/15/47	1,140,000.00	1,138,283.73
NETHER 2% 01/15/54	330,000.00	278,480.73
NETHER 2% 07/15/24	1,110,000.00	1,096,791.00
NETHER 3.75% 01/15/42	1,010,000.00	1,144,270.41
NETHER 4% 01/15/37	1,070,000.00	1,209,605.68
NETHER 5.5% 01/15/28	650,000.00	728,158.60
OBL 0% 04/10/26	1,500,000.00	1,392,438.00
OBL 0% 04/11/25	1,050,000.00	996,411.15
OBL 0% 04/16/27	1,510,000.00	1,373,647.00
OBL 0% 10/09/26	1,050,000.00	964,884.90
OBL 0% 10/10/25	1,970,000.00	1,848,060.94
OBL 0% 10/18/24	1,390,000.00	1,334,262.90
OBL 1.3% 10/15/27	2,620,000.00	2,498,275.13
OBL 2.2% 04/13/28	1,100,000.00	1,089,201.30
RAGB 0.25% 10/20/36	360,000.00	246,160.08
RAGB 0.5% 02/20/29	810,000.00	711,011.52
RAGB 0.5% 04/20/27	650,000.00	595,661.95
RAGB 0.7% 04/20/71	200,000.00	87,226.20
RAGB 0.75% 02/20/28	830,000.00	755,021.95
RAGB 0.75% 03/20/51	440,000.00	248,017.88
RAGB 0.75% 10/20/26	900,000.00	840,867.30
RAGB 0.85% 06/30/20	200,000.00	80,408.80
RAGB 0.9% 02/20/32	800,000.00	674,439.20
RAGB 0% 02/20/30	660,000.00	545,220.72

RAGB 0% 02/20/31	720,000.00	576,603.36	
RAGB 0% 04/20/25	370,000.00	350,220.91	
RAGB 0% 07/15/24	660,000.00	638,031.90	
RAGB 0% 10/20/28	380,000.00	327,132.50	
RAGB 0% 10/20/40	330,000.00	190,577.64	
RAGB 1.2% 10/20/25	830,000.00	798,188.17	
RAGB 1.5% 02/20/47	570,000.00	412,592.22	
RAGB 1.5% 11/02/86	200,000.00	116,392.40	
RAGB 1.65% 10/21/24	560,000.00	549,504.48	
RAGB 1.85% 05/23/49	220,000.00	168,883.88	
RAGB 2.1% 09/20/17	360,000.00	255,768.86	
RAGB 2.4% 05/23/34	530,000.00	497,542.80	
RAGB 2.9% 02/20/33	410,000.00	405,582.66	
RAGB 2% 07/15/26	260,000.00	253,526.78	
RAGB 3.15% 06/20/44	420,000.00	415,697.94	
RAGB 3.8% 01/26/62	210,000.00	239,286.60	
RAGB 4.15% 03/15/37	840,000.00	925,411.20	
RAGB 4.85% 03/15/26	540,000.00	567,374.22	
RAGB 6.25% 07/15/27	540,000.00	609,876.00	
RFGB 0.125% 04/15/36	270,000.00	183,710.16	
RFGB 0.125% 04/15/52	240,000.00	108,737.04	
RFGB 0.125% 09/15/31	370,000.00	295,621.12	
RFGB 0.25% 09/15/40	210,000.00	129,082.80	
RFGB 0.5% 04/15/26	600,000.00	562,533.00	
RFGB 0.5% 04/15/43	180,000.00	109,737.54	
RFGB 0.5% 09/15/27	380,000.00	345,497.90	
RFGB 0.5% 09/15/28	290,000.00	257,901.35	
RFGB 0.5% 09/15/29	290,000.00	251,954.90	
RFGB 0.75% 04/15/31	270,000.00	230,039.19	
RFGB 0.875% 09/15/25	410,000.00	391,869.30	
RFGB 0% 09/15/30	330,000.00	268,947.03	
RFGB 1.125% 04/15/34	270,000.00	222,822.14	
RFGB 1.375% 04/15/27	380,000.00	360,450.90	
RFGB 1.375% 04/15/47	270,000.00	193,868.37	
RFGB 1.5% 09/15/32	220,000.00	194,677.34	
RFGB 2.625% 07/04/42	380,000.00	351,904.01	
RFGB 2.75% 04/15/38	170,000.00	160,689.10	
RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	380,032.30	
RFGB 3% 09/15/33	190,000.00	190,125.97	
RFGB 4% 07/04/25	240,000.00	245,022.48	
SPGB 0.1% 04/30/31	1,570,000.00	1,237,682.35	
SPGB 0.5% 04/30/30	1,560,000.00	1,311,482.64	
SPGB 0.5% 10/31/31	1,180,000.00	948,008.07	

SPGB 0.6% 10/31/29	970,000.00	832,745.00
SPGB 0.7% 04/30/32	930,000.00	749,807.85
SPGB 0.8% 07/30/27	1,190,000.00	1,088,106.25
SPGB 0.8% 07/30/29	680,000.00	593,594.44
SPGB 0.85% 07/30/37	640,000.00	443,365.00
SPGB 0% 01/31/25	1,390,000.00	1,322,027.61
SPGB 0% 01/31/26	1,070,000.00	988,255.74
SPGB 0% 01/31/27	1,080,000.00	968,235.12
SPGB 0% 01/31/28	1,280,000.00	1,113,907.20
SPGB 0% 05/31/24	1,480,000.00	1,433,378.78
SPGB 0% 05/31/25	570,000.00	536,132.88
SPGB 1.2% 10/31/40	950,000.00	642,421.35
SPGB 1.25% 10/31/30	1,200,000.00	1,051,688.40
SPGB 1.3% 10/31/26	1,460,000.00	1,380,238.36
SPGB 1.4% 04/30/28	1,920,000.00	1,780,108.80
SPGB 1.4% 07/30/28	780,000.00	720,197.40
SPGB 1.45% 04/30/29	750,000.00	685,992.75
SPGB 1.45% 10/31/27	1,330,000.00	1,244,449.08
SPGB 1.45% 10/31/71	260,000.00	122,391.59
SPGB 1.5% 04/30/27	1,460,000.00	1,379,930.68
SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,215,884.71
SPGB 1.85% 07/30/35	1,290,000.00	1,081,699.83
SPGB 1.9% 10/31/52	650,000.00	420,731.35
SPGB 1.95% 04/30/26	1,340,000.00	1,299,438.20
SPGB 1.95% 07/30/30	1,520,000.00	1,406,797.17
SPGB 1% 07/30/42	340,000.00	212,259.62
SPGB 1% 10/31/50	1,130,000.00	591,693.99
SPGB 2.15% 10/31/25	1,650,000.00	1,616,861.40
SPGB 2.35% 07/30/33	1,030,000.00	941,604.81
SPGB 2.55% 10/31/32	1,480,000.00	1,391,426.44
SPGB 2.7% 10/31/48	1,020,000.00	828,377.13
SPGB 2.75% 10/31/24	1,560,000.00	1,553,864.52
SPGB 2.8% 05/31/26	220,000.00	218,091.28
SPGB 2.9% 10/31/46	1,120,000.00	959,507.36
SPGB 3.15% 04/30/33	980,000.00	963,533.06
SPGB 3.45% 07/30/43	420,000.00	395,572.80
SPGB 3.45% 07/30/66	900,000.00	800,208.00
SPGB 3.9% 07/30/39	320,000.00	324,912.12
SPGB 4.2% 01/31/37	1,310,000.00	1,393,781.05
SPGB 4.65% 07/30/25	1,410,000.00	1,454,242.98
SPGB 4.7% 07/30/41	1,300,000.00	1,456,231.40
SPGB 4.9% 07/30/40	1,080,000.00	1,237,502.12

	SPGB 5.15% 10/31/28	1,100,000.00	1,212,242.90
	SPGB 5.15% 10/31/44	850,000.00	1,011,068.20
	SPGB 5.75% 07/30/32	1,450,000.00	1,734,365.30
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,360,000.00	1,472,991.52
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	2,704,384.70
	ユーロ 小計	376,280,000.00	346,179,861.48 (51,864,666,846)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	780,000.00	697,359.00
	UKT 0.125% 01/31/28	880,000.00	727,142.53
	UKT 0.25% 01/31/25	1,540,000.00	1,428,778.12
	UKT 0.25% 07/31/31	1,730,000.00	1,267,484.50
	UKT 0.375% 10/22/26	1,170,000.00	1,019,362.50
	UKT 0.375% 10/22/30	1,090,000.00	831,037.80
	UKT 0.5% 01/31/29	1,180,000.00	957,640.80
	UKT 0.5% 10/22/61	1,050,000.00	314,895.00
	UKT 0.625% 06/07/25	1,160,000.00	1,075,378.00
	UKT 0.625% 07/31/35	1,280,000.00	836,164.74
	UKT 0.625% 10/22/50	640,000.00	257,061.88
	UKT 0.875% 01/31/46	400,000.00	196,412.80
	UKT 0.875% 07/31/33	980,000.00	710,745.00
	UKT 0.875% 10/22/29	820,000.00	670,744.25
	UKT 1.125% 01/31/39	1,320,000.00	829,488.00
	UKT 1.125% 10/22/73	480,000.00	178,248.96
	UKT 1.25% 07/22/27	740,000.00	654,814.16
	UKT 1.25% 07/31/51	1,050,000.00	516,005.48
	UKT 1.25% 10/22/41	1,400,000.00	841,650.47
	UKT 1.5% 07/22/26	1,180,000.00	1,080,223.92
	UKT 1.5% 07/22/47	1,010,000.00	569,110.76
	UKT 1.5% 07/31/53	630,000.00	325,017.00
	UKT 1.625% 10/22/28	480,000.00	420,652.80
	UKT 1.625% 10/22/54	720,000.00	381,463.20
	UKT 1.625% 10/22/71	710,000.00	336,730.42
	UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	353,239.20
	UKT 1.75% 07/22/57	1,050,000.00	570,024.00
	UKT 1.75% 09/07/37	1,110,000.00	800,592.38
	UKT 1% 01/31/32	1,680,000.00	1,295,868.00
	UKT 2.5% 07/22/65	860,000.00	563,136.60
	UKT 2.75% 09/07/24	440,000.00	429,249.38
	UKT 2% 09/07/25	1,090,000.00	1,029,500.57
UKT 3.25% 01/22/44	1,240,000.00	1,034,213.56	
UKT 3.25% 01/31/33	1,190,000.00	1,098,965.00	
UKT 3.5% 01/22/45	1,230,000.00	1,061,130.84	
UKT 3.5% 07/22/68	920,000.00	776,700.80	

	UKT 3.75% 01/29/38	370,000.00	342,257.40
	UKT 3.75% 07/22/52	900,000.00	797,129.10
	UKT 3.75% 10/22/53	400,000.00	352,444.00
	UKT 4.125% 01/29/27	1,180,000.00	1,159,951.80
	UKT 4.25% 03/07/36	950,000.00	942,553.14
	UKT 4.25% 06/07/32	1,070,000.00	1,079,683.50
	UKT 4.25% 09/07/39	670,000.00	654,255.00
	UKT 4.25% 12/07/27	1,100,000.00	1,095,028.66
	UKT 4.25% 12/07/40	920,000.00	896,413.77
	UKT 4.25% 12/07/46	1,060,000.00	1,022,338.20
	UKT 4.25% 12/07/49	810,000.00	780,491.70
	UKT 4.25% 12/07/55	1,100,000.00	1,068,788.60
	UKT 4.5% 09/07/34	840,000.00	857,087.28
	UKT 4.5% 12/07/42	770,000.00	772,761.52
	UKT 4.75% 12/07/30	850,000.00	883,302.66
	UKT 4.75% 12/07/38	810,000.00	838,912.95
	UKT 4% 01/22/60	710,000.00	665,442.53
	UKT 4% 10/22/63	320,000.00	299,525.74
	UKT 5% 03/07/25	1,080,000.00	1,083,883.35
	UKT 6.0% 12/07/28	1,070,000.00	1,158,416.77
	イギリスポンド 小計	52,810,000.00	42,886,900.09 (7,518,931,323)
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	3,010,000.00	2,522,843.54
	SGB 0.75% 05/12/28	3,240,000.00	2,980,767.60
	SGB 0.75% 11/12/29	3,840,000.00	3,463,785.52
	SGB 1.75% 11/11/33	1,570,000.00	1,482,845.24
	SGB 1% 11/12/26	4,650,000.00	4,392,483.79
	SGB 2.25% 06/01/32	2,560,000.00	2,533,066.00
	SGB 2.5% 05/12/25	4,430,000.00	4,386,191.10
	SGB 3.5% 03/30/39	2,440,000.00	2,742,120.80
	スウェーデンクローナ 小計	25,740,000.00	24,504,103.59 (315,122,772)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	2,370,000.00	1,981,402.95
	NGB 1.375% 08/19/30	3,280,000.00	2,828,477.16
	NGB 1.5% 02/19/26	2,470,000.00	2,333,517.68
	NGB 1.75% 02/17/27	2,650,000.00	2,481,910.50
	NGB 1.75% 03/13/25	2,870,000.00	2,770,827.15
	NGB 1.75% 09/06/29	2,470,000.00	2,224,840.15
	NGB 2.125% 05/18/32	1,520,000.00	1,352,967.20
	NGB 2% 04/26/28	2,510,000.00	2,335,304.00
	NGB 3% 08/15/33	1,270,000.00	1,210,153.28
	ノルウェークローネ 小計	21,410,000.00	19,519,400.07

			(252,581,036)	
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	2,880,000.00	1,503,979.20	
	DGB 0.5% 11/15/27	4,470,000.00	4,078,904.50	
	DGB 0.5% 11/15/29	5,110,000.00	4,488,619.40	
	DGB 0% 11/15/24	2,420,000.00	2,314,488.07	
	DGB 0% 11/15/31	2,580,000.00	2,081,035.21	
	DGB 1.75% 11/15/25	2,610,000.00	2,540,090.62	
	DGB 4.5% 11/15/39	6,130,000.00	7,561,164.35	
デンマーククローネ 小計		26,200,000.00	24,568,281.35	(494,068,137)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,430,000.00	1,194,407.50	
	POLGB 0.75% 04/25/25	1,830,000.00	1,668,411.00	
	POLGB 0% 07/25/24	180,000.00	168,921.99	
	POLGB 1.25% 10/25/30	1,760,000.00	1,291,206.40	
	POLGB 1.75% 04/25/32	2,310,000.00	1,665,048.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	2,470,000.00	2,350,452.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	3,600,000.00	3,273,840.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	2,010,000.00	1,777,945.50	
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,330,000.00	2,043,876.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	3,650,000.00	3,082,242.50	
	POLGB 3.25% 07/25/25	2,940,000.00	2,790,592.14	
	POLGB 3.75% 05/25/27	300,000.00	279,414.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	900,000.00	900,270.00	
	ポーランドズロチ 小計		25,710,000.00	22,486,627.03
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	1,460,000.00	1,382,305.55	
	ACGB 0.25% 11/21/25	1,190,000.00	1,090,665.09	
	ACGB 0.5% 09/21/26	900,000.00	809,023.62	
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,140,000.00	910,601.69	
	ACGB 1.5% 06/21/31	1,190,000.00	993,697.12	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,010,000.00	591,931.93	
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,380,000.00	1,142,881.25	
	ACGB 1% 11/21/31	1,990,000.00	1,574,804.96	
	ACGB 1% 12/21/30	1,480,000.00	1,202,885.24	
	ACGB 2.25% 05/21/28	630,000.00	586,590.06	
	ACGB 2.5% 05/21/30	1,220,000.00	1,119,153.89	
	ACGB 2.75% 05/21/41	810,000.00	656,535.01	
	ACGB 2.75% 06/21/35	630,000.00	553,689.88	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,160,000.00	1,110,949.70	
	ACGB 2.75% 11/21/28	770,000.00	730,516.24	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,230,000.00	1,153,704.60	
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,250,000.00	1,233,513.45	
ACGB 3.25% 04/21/29	1,180,000.00	1,144,929.19		

	ACGB 3.25% 06/21/39	650,000.00	577,394.55	
	ACGB 3.5% 12/21/34	820,000.00	781,949.11	
	ACGB 3.75% 04/21/37	780,000.00	749,269.63	
	ACGB 3.75% 05/21/34	670,000.00	656,504.29	
	ACGB 3% 03/21/47	780,000.00	629,997.46	
	ACGB 3% 11/21/33	950,000.00	872,094.79	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,200,000.00	1,213,598.76	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,210,000.00	1,264,009.92	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,080,000.00	1,116,493.52	
	オーストラリアドル 小計	28,760,000.00	25,849,690.50 (2,432,197,379)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	370,000.00	302,212.55	
	NZGB 0.5% 05/15/26	360,000.00	319,975.96	
	NZGB 1.5% 05/15/31	390,000.00	313,628.12	
	NZGB 1.75% 05/15/41	260,000.00	167,482.36	
	NZGB 2.75% 04/15/25	490,000.00	470,683.80	
	NZGB 2.75% 04/15/37	350,000.00	282,975.60	
	NZGB 2.75% 05/15/51	300,000.00	213,249.48	
	NZGB 2% 05/15/32	320,000.00	261,836.64	
	NZGB 3.5% 04/14/33	340,000.00	312,803.16	
	NZGB 3% 04/20/29	450,000.00	416,780.21	
	NZGB 4.25% 05/15/34	170,000.00	165,702.40	
	NZGB 4.5% 04/15/27	430,000.00	429,904.94	
	NZGB 4.5% 05/15/30	260,000.00	260,808.88	
	ニュージーランドドル 小計	4,490,000.00	3,918,044.10 (334,483,424)	
シンガポールドドル	SIGB 0.5% 11/01/25	320,000.00	299,680.00	
	SIGB 1.25% 11/01/26	90,000.00	84,384.00	
	SIGB 1.625% 07/01/31	500,000.00	452,000.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	360,000.00	317,844.00	
	SIGB 1.875% 10/01/51	240,000.00	215,719.20	
	SIGB 2.125% 06/01/26	670,000.00	648,560.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	330,000.00	308,385.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	480,000.00	470,700.00	
	SIGB 2.375% 07/01/39	230,000.00	218,866.85	
	SIGB 2.625% 05/01/28	280,000.00	275,569.00	
	SIGB 2.625% 08/01/32	100,000.00	97,294.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	420,000.00	435,036.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	300,000.00	305,980.50	
	SIGB 2.875% 07/01/29	530,000.00	526,290.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	460,000.00	456,780.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	460,000.00	477,710.00	
SIGB 3.5% 03/01/27	580,000.00	587,250.00		

	SIGB 3% 08/01/72	140,000.00	165,130.00	
	SIGB 3% 09/01/24	510,000.00	506,022.00	
	シンガポールドル 小計	7,000,000.00	6,849,200.55 (710,741,541)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	370,000.00	341,023.88	
	MGS 3.478% 06/14/24	100,000.00	100,222.29	
	MGS 3.502% 05/31/27	920,000.00	917,801.89	
	MGS 3.582% 07/15/32	150,000.00	148,240.37	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,180,000.00	1,186,860.63	
	MGS 3.757% 05/22/40	1,110,000.00	1,059,394.03	
	MGS 3.828% 07/05/34	250,000.00	248,286.77	
	MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	862,266.70	
	MGS 3.882% 03/14/25	690,000.00	696,582.60	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,890,000.00	1,914,109.78	
	MGS 3.892% 03/15/27	300,000.00	303,336.75	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,960,000.00	1,986,382.58	
	MGS 3.9% 11/30/26	1,140,000.00	1,154,984.84	
	MGS 3.906% 07/15/26	750,000.00	759,819.60	
	MGS 3.955% 09/15/25	1,100,000.00	1,112,013.32	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,060,000.00	1,069,782.21	
	MGS 4.065% 06/15/50	740,000.00	729,580.82	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,180,000.00	1,189,895.24	
	MGS 4.232% 06/30/31	850,000.00	877,496.14	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,480,000.00	1,519,774.85	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,160,000.00	1,190,224.96	
	MGS 4.457% 03/31/53	390,000.00	410,346.84	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,260,000.00	1,325,291.43	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,160,000.00	1,243,025.72	
	MGS 4.696% 10/15/42	90,000.00	97,236.43	
	MGS 4.736% 03/15/46	640,000.00	693,742.65	
	MGS 4.762% 04/07/37	1,160,000.00	1,253,359.93	
MGS 4.893% 06/08/38	1,490,000.00	1,638,905.98		
MGS 4.921% 07/06/48	1,450,000.00	1,627,599.48		
MGS 4.935% 09/30/43	820,000.00	909,471.92		
	マレーシアリンギット 小計	27,700,000.00	28,567,060.63 (862,416,706)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	750,000.00	711,071.40	
	ILGOV 0.5% 02/27/26	350,000.00	319,226.35	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	1,240,000.00	1,155,631.64	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	310,000.00	251,880.73	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	930,000.00	683,184.32	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,040,000.00	985,281.02	



	ILGOV 1% 03/31/30	1,570,000.00	1,306,632.50
	ILGOV 2.25% 09/28/28	1,320,000.00	1,224,670.65
	ILGOV 2.8% 11/29/52	260,000.00	196,382.62
	ILGOV 2% 03/31/27	1,210,000.00	1,127,901.50
	ILGOV 3.75% 03/31/47	1,440,000.00	1,343,592.00
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,060,000.00	1,254,520.17
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,550,000.00	1,657,172.89
	イスラエルシェケル 小計	13,030,000.00	12,217,147.79 (475,411,980)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	63,260,000.00	63,086,717.57
	CGB 2.24% 05/25/25	24,400,000.00	24,448,902.48
	CGB 2.28% 11/25/25	11,000,000.00	11,024,361.70
	CGB 2.37% 01/20/27	19,900,000.00	19,897,594.48
	CGB 2.44% 10/15/27	7,000,000.00	7,003,985.10
	CGB 2.47% 09/02/24	18,290,000.00	18,385,872.52
	CGB 2.48% 04/15/27	18,380,000.00	18,446,421.64
	CGB 2.5% 07/25/27	10,000,000.00	10,030,643.00
	CGB 2.6% 09/01/32	7,750,000.00	7,667,778.00
	CGB 2.62% 09/25/29	21,000,000.00	20,982,365.25
	CGB 2.68% 05/21/30	11,650,000.00	11,661,105.94
	CGB 2.69% 08/12/26	11,720,000.00	11,858,419.06
	CGB 2.69% 08/15/32	13,500,000.00	13,458,650.58
	CGB 2.75% 06/15/29	5,000,000.00	5,040,011.50
	CGB 2.79% 12/15/29	1,000,000.00	1,008,539.50
	CGB 2.8% 03/24/29	15,770,000.00	15,974,260.92
	CGB 2.8% 03/25/30	5,000,000.00	5,047,780.50
	CGB 2.8% 11/15/32	6,000,000.00	6,041,382.60
	CGB 2.85% 06/04/27	11,760,000.00	11,966,392.70
	CGB 2.88% 02/25/33	5,100,000.00	5,183,094.81
	CGB 2.89% 11/18/31	22,500,000.00	22,801,727.25
	CGB 2.91% 10/14/28	18,300,000.00	18,668,776.11
	CGB 3.01% 05/13/28	15,960,000.00	16,392,910.21
	CGB 3.02% 05/27/31	7,400,000.00	7,578,387.36
	CGB 3.03% 03/11/26	22,150,000.00	22,653,584.68
	CGB 3.12% 10/25/52	2,500,000.00	2,517,894.75
	CGB 3.27% 11/19/30	3,430,000.00	3,584,466.27
	CGB 3.28% 12/03/27	11,140,000.00	11,572,034.81
	CGB 3.32% 04/15/52	4,790,000.00	4,978,890.29
	CGB 3.39% 03/16/50	7,360,000.00	7,704,002.72
	CGB 3.53% 10/18/51	7,010,000.00	7,552,046.14
	CGB 3.72% 04/12/51	6,850,000.00	7,609,841.73
CGB 3.81% 09/14/50	8,230,000.00	9,262,938.24	
CGB 3.86% 07/22/49	5,810,000.00	6,571,172.16	

	CGB 4.08% 10/22/48	4,780,000.00	5,582,879.39	
	オフショア人民元 小計	435,690,000.00	443,245,831.96 (8,647,149,961)	
	合計		156,949,807,629 (156,949,807,629)	

## 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 197銘柄	100.0%	49.4%
カナダドル	国債証券 37銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 349銘柄	100.0%	33.0%
イギリスポンド	国債証券 56銘柄	100.0%	4.8%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.5%
ニュージーランドドル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリングgit	国債証券 30銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券 35銘柄	100.0%	5.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

**【中間財務諸表】**

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期中間計算期間(2023年6月13日から2023年12月12日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位：円 )

	第16期 ( 2023年 6月12日現在 )	第17期中間計算期間 ( 2023年12月12日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	17,254,883	17,633,459
親投資信託受益証券	4,232,527,808	4,419,606,154
未収入金	13,269,778	20,942,154
流動資産合計	4,263,052,469	4,458,181,767
資産合計	4,263,052,469	4,458,181,767
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	270,066	5,828,311
未払受託者報酬	1,092,981	1,204,981
未払委託者報酬	12,022,724	13,254,745
未払利息	35	5
その他未払費用	109,235	120,438
流動負債合計	13,495,041	20,408,480
負債合計	13,495,041	20,408,480
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,794,883,011	1,741,256,712
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	2,454,674,417	2,696,516,575
( 分配準備積立金 )	1,929,863,034	1,839,750,832
元本等合計	4,249,557,428	4,437,773,287
純資産合計	4,249,557,428	4,437,773,287
負債純資産合計	4,263,052,469	4,458,181,767

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期中間計算期間 自 2022年 6月11日 至 2022年12月10日	第17期中間計算期間 自 2023年 6月13日 至 2023年12月12日
<b>営業収益</b>		
受取利息	30	44
有価証券売買等損益	44,439,155	336,406,859
<b>営業収益合計</b>	<b>44,439,185</b>	<b>336,406,903</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	4,282	3,511
受託者報酬	1,069,680	1,204,981
委託者報酬	11,766,380	13,254,745
その他費用	106,908	120,438
<b>営業費用合計</b>	<b>12,947,250</b>	<b>14,583,675</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>31,491,935</b>	<b>321,823,228</b>
経常利益又は経常損失（ ）	31,491,935	321,823,228
<b>中間純利益又は中間純損失（ ）</b>	<b>31,491,935</b>	<b>321,823,228</b>
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	418,081	10,870,208
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>2,075,896,207</b>	<b>2,454,674,417</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	45,527,045	46,653,033
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	45,527,045	46,653,033
剰余金減少額又は欠損金増加額	30,000,411	115,763,895
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	30,000,411	115,763,895
分配金	-	-
<b>中間剰余金又は中間欠損金（ ）</b>	<b>2,122,496,695</b>	<b>2,696,516,575</b>

## (3)【中間注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月11日から翌年6月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第17期中間計算期間は2023年6月13日から2023年12月12日までとなっております。

## (中間貸借対照表に関する注記)

	第16期 (2023年6月12日現在)	第17期中間計算期間 (2023年12月12日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,794,883,011口	1,741,256,712口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.3676円 (23,676円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.5486円 (25,486円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	第17期中間計算期間 (2023年12月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	第16期 自 2022年 6月11日 至 2023年 6月12日	第17期中間計算期間 自 2023年 6月13日 至 2023年12月12日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,791,192,162円	1,794,883,011円
期中追加設定元本額	76,767,682円	31,226,581円
期中一部解約元本額	73,076,833円	84,852,880円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年12月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,488,058,132
株式	366,571,517,600
派生商品評価勘定	10,030,000
未収入金	7,302,100
未収配当金	158,777,538
差入委託証拠金	218,902,205
流動資産合計	371,454,587,575
資産合計	371,454,587,575
負債の部	
流動負債	
前受金	10,030,000
未払金	1,866,839,953
未払解約金	147,577,022
未払利息	1,476
流動負債合計	2,024,448,451
負債合計	2,024,448,451
純資産の部	
元本等	
元本	131,923,903,000
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	237,506,236,124
元本等合計	369,430,139,124
純資産合計	369,430,139,124
負債純資産合計	371,454,587,575

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年12月12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）

	2023年12月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	131,923,903,000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 2.8003円 (1万口当たり純資産額) (28,003円)

（金融商品に関する注記）  
金融商品の時価等に関する事項

	2023年12月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年12月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 6月13日
期首元本額	134,033,097,855円
期中追加設定元本額	4,036,736,740円
期中一部解約元本額	6,145,931,595円
期末元本額	131,923,903,000円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	579,706,872円
D C 日本株式インデックスファンド	267,800,257円
D C 日本株式インデックスファンド L	54,342,537,980円
D C 日本株式インデックスファンド A	652,181,695円
D C バランスファンド 3 0	2,088,283,629円
D C バランスファンド 5 0	3,508,708,492円
D C バランスファンド 7 0	2,338,455,967円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	516,252,646円
日本株式インデックス e	1,381,749,467円
インデックスコレクション（国内株式）	23,351,897,887円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	11,175,520,172円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	3,425,018,760円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	3,437,597,267円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,987,742,074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）	2,647,625,107円
日本株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	619,073,793円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	24,741,727円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	338,245,964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）	45,095,635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）	107,149,419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）	30,791,756円
バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	425,921,538円
バランス V A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	306,047,627円
バランス V A 5 0 L（適格機関投資家専用）	5,471,671,720円
バランス V A 7 5（適格機関投資家専用）	572,001,041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）	42,585,821円



区分	2023年12月12日現在
V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	865,624,817円
V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	15,373,466円
バランスV A40（適格機関投資家専用）	112,654,335円
バランスファンドV A（適格機関投資家専用）	1,449,058,918円
V Aバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	35,600,864円
V Aバランス50-50（適格機関投資家専用）	39,634,085円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	11,832,575円
バランスファンドV A2（適格機関投資家専用）	385,465,353円
バランスV A25L（適格機関投資家専用）	187,976,412円
バランスファンドV A3（適格機関投資家専用）	2,965,790,668円
世界バランスV A25（適格機関投資家専用）	63,086,421円
国内バランスV A30（適格機関投資家専用）	21,636,878円
国内バランスV A25（適格機関投資家専用）	6,235,385円
V Aバランス20-80（適格機関投資家専用）	76,789,012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）	2,739,498円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2023年12月12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	2,761,200,000	-	2,771,230,000	10,030,000
合計		2,761,200,000	-	2,771,230,000	10,030,000

## （注）1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国株式マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年12月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,322,522,209
コール・ローン	1,324,245,021
株式	436,623,168,733
投資信託受益証券	82,507,008
投資証券	8,811,797,701
派生商品評価勘定	529,716,835
未収入金	12,045,820
未収配当金	587,993,637
差入委託証拠金	2,516,459,832
流動資産合計	455,810,456,796
資産合計	455,810,456,796
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	35,859,564
前受金	525,567,137
未払解約金	416,022,492
未払利息	435

	2023年12月12日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	977,449,628
負債合計	977,449,628
純資産の部	
元本等	
元本	78,820,095,828
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	376,012,911,340
元本等合計	454,833,007,168
純資産合計	454,833,007,168
負債純資産合計	455,810,456,796

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年12月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金

2023年12月12日現在	
	株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2023年12月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	78,820,095,828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 5.7705円 (1万口当たり純資産額) (57,705円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2023年12月12日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2023年12月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 6月13日
期首元本額	77,311,262,891円
期中追加設定元本額	4,320,732,597円
期中一部解約元本額	2,811,899,660円
期末元本額	78,820,095,828円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,438,337,219円
DC外国株式インデックスファンド	5,107,191,328円
DC外国株式インデックスファンドL	29,283,338,163円
DCバランスファンド30	528,413,770円
DCバランスファンド50	1,178,413,187円
DCバランスファンド70	871,523,635円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	262,231,599円
外国株式インデックスe	4,400,010,295円

区分	2023年12月12日現在
インデックスコレクション（外国株式）	18,441,711,063円
インデックスコレクション（バランス株式30）	2,843,853,781円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,173,061,353円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,286,226,073円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,538,305,871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）	1,580,695,314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）	304,862,692円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	12,068,936円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	164,624,016円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	22,131,903円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	52,587,514円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	75,556,939円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	141,975,961円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	134,315,221円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	2,717,805,069円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	318,842,540円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	62,698,301円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	424,831,644円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	7,544,811円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	54,827,480円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	52,414,026円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	175,061,131円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	5,807,088円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	39,724,784円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	113,049,822円
私募外国株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	6,053,299円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2023年12月12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	8,747,348,569	-	9,272,915,706	525,567,137
合計		8,747,348,569	-	9,272,915,706	525,567,137

## （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

（2023年12月12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	999,411,584	-	968,025,238	31,386,346
	アメリカドル	750,313,064	-	724,745,788	25,567,276
	ユーロ	193,734,600	-	188,330,280	5,404,320
	イギリスポンド	55,363,920	-	54,949,170	414,750
	売建	93,024,000	-	93,347,520	323,520
	アメリカドル	93,024,000	-	93,347,520	323,520

合計	1,092,435,584	-	1,061,372,758	31,709,866
----	---------------	---	---------------	------------

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国債券マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2023年12月12日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金	501,154,472	
コール・ローン	488,566,270	
国債証券	168,446,505,200	
派生商品評価勘定	927,145	
未収入金	606,397,907	
未収利息	1,101,642,552	
前払費用	56,762,688	
差入委託証拠金	88,972,400	
流動資産合計	171,290,928,634	
資産合計	171,290,928,634	
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,844,777	
前受金	603,779	
未払金	13,636,442	
未払解約金	153,296,084	
未払利息	160	
流動負債合計	171,381,242	
負債合計	171,381,242	
純資産の部		
元本等		
元本	59,017,354,268	
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	112,102,193,124	
元本等合計	171,119,547,392	
純資産合計	171,119,547,392	
負債純資産合計	171,290,928,634	

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2023年12月12日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(1) 先物取引</p>

2023年12月12日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。  (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2023年12月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	59,017,354,268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) 2.8995円 (28,995円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2023年12月12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る場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2023年12月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 6月13日
期首元本額	57,835,795,349円

区分	2023年12月12日現在
期中追加設定元本額	4,322,649,028円
期中一部解約元本額	3,141,090,109円
期末元本額	59,017,354,268円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	1,883,818,490円
DC外国債券インデックスファンド	1,845,959,419円
DC外国債券インデックスファンドL	14,361,968,611円
DCバランスファンド30	1,009,737,770円
DCバランスファンド50	1,107,085,271円
DCバランスファンド70	239,539,318円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	503,789,077円
外国債券インデックスe	997,401,650円
インデックスコレクション（外国債券）	9,794,445,771円
インデックスコレクション（バランス株式30）	5,402,139,427円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,118,489,977円
インデックスコレクション（バランス株式70）	358,964,473円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,936,393,488円
外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	3,433,728,179円
外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	293,760,304円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	55,359,307円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	324,250,985円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	209,518,102円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	165,934,263円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	74,499,568円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	921,410,619円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	484,373,988円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	5,190,920,445円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	312,072,742円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	144,259,650円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,256,763,487円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	59,525,761円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	155,311,417円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	68,913,948円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	38,360,294円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	45,812,434円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	181,227,507円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	59,212,553円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	966,265,132円
私募外国債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	16,140,841円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2023年12月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引 買建	738,936,956	-		739,540,735	603,779
	合計	738,936,956	-		739,540,735	603,779

## （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

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	809,018,116	-	805,500,506	3,517,610
	アメリカドル	394,809,319	-	393,677,550	1,131,769
	カナダドル	32,353,584	-	32,235,180	118,404
	ユーロ	266,785,922	-	265,231,811	1,554,111
	イギリスポンド	46,058,296	-	45,790,975	267,321
	オフショア人民元	69,010,995	-	68,564,990	446,005
	売建	692,897,892	-	692,901,693	3,801
	アメリカドル	343,575,480	-	343,577,836	2,356
	カナダドル	12,895,920	-	12,896,052	132
	ユーロ	238,416,164	-	238,424,214	8,050
	イギリスポンド	36,455,208	-	36,455,327	119
	オーストラリアドル	8,624,250	-	8,623,395	855
	オフショア人民元	52,930,870	-	52,924,869	6,001
	合計		1,501,916,008	-	1,498,402,199

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。



## 2【ファンドの現況】

## 【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

## 【純資産額計算書】

(2023年12月29日現在)

資産総額	4,424,999,065円
負債総額	1,862,843円
純資産総額( - )	4,423,136,222円
発行済口数	1,719,948,464口
1口当たり純資産額( / )	2.5717円
(1万口当たり純資産額)	(25,717円)

(参考)

## 日本株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2023年12月29日現在)

資産総額	373,030,905,074円
負債総額	186,552,762円
純資産総額( - )	372,844,352,312円
発行済口数	132,210,930,903口
1口当たり純資産額( / )	2.8201円
(1万口当たり純資産額)	(28,201円)

## 外国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2023年12月29日現在)

資産総額	461,768,257,563円
負債総額	700,544,230円
純資産総額( - )	461,067,713,333円
発行済口数	79,071,063,392口
1口当たり純資産額( / )	5.8311円
(1万口当たり純資産額)	(58,311円)

## 外国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

(2023年12月29日現在)

資産総額	173,169,059,757円
負債総額	332,979,080円
純資産総額( - )	172,836,080,677円
発行済口数	58,990,297,394口

1口当たり純資産額（ / ）	2.9299円
（1万口当たり純資産額）	（29,299円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

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

###### 受益権の譲渡

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

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

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

###### 受益権の譲渡の対抗要件

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

###### 受益権の再分割

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

###### 償還金

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

###### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2023年12月29日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 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2024年 3月12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。

2023年12月29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	529	14,219,692
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	63	218,373
単体型公社債投資信託	51	177,896
合計	643	14,615,960

## 3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第37期事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。  
また、第38期事業年度の中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,675	23,067
金銭の信託	14,913	14,693
前払費用	166	198
未収委託者報酬	9,067	9,147
未収運用受託報酬	6,252	5,815
未収収益	179	176
短期差入証拠金	2,528	3,541
その他	2,363	1,566
流動資産合計	57,146	58,207
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 289	1 255
器具備品	1 687	1 560
有形固定資産合計	976	816
無形固定資産		
ソフトウェア	6,292	7,203
その他	31	40
無形固定資産合計	6,324	7,244
投資その他の資産		
投資有価証券	6,607	4,063
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	907	1,181
その他	31	31
投資その他の資産合計	13,182	10,911
固定資産合計	20,482	18,972
資産合計	77,629	77,179

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	47	49

未払金	8,285	7,174
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,561	4,586
その他未払金	3,723	2,588
未払費用	1,049	1,089
未払法人税等	504	726
賞与引当金	578	613
その他	1,958	303
流動負債合計	12,423	9,958
固定負債		
退職給付引当金	820	904
資産除去債務	153	153
その他	12	27
固定負債合計	986	1,086
負債合計	13,410	11,044
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	41,948	44,755
利益剰余金合計	44,548	47,355
株主資本合計	63,788	66,595
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	941	49
繰延ヘッジ損益	509	510
評価・換算差額等合計	431	460
純資産合計	64,219	66,134
負債・純資産合計	77,629	77,179

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	41,730	40,724
運用受託報酬	11,883	10,918

その他営業収益	390	351
営業収益合計	54,004	51,993
営業費用		
支払手数料	20,567	20,123
広告宣伝費	286	307
公告費	-	2
調査費	5,567	5,309
調査費	1,062	1,104
委託調査費	4,487	4,191
図書費	17	13
営業雑経費	5,201	5,842
通信費	68	77
印刷費	454	419
協会費	55	58
諸会費	35	38
情報機器関連費	4,473	5,153
その他営業雑経費	112	94
営業費用合計	31,622	31,585
一般管理費		
給料	6,295	6,451
役員報酬	249	318
給料・手当	5,072	5,144
賞与	972	987
退職給付費用	254	252
福利費	632	671
交際費	3	7
旅費交通費	20	122
租税公課	327	289
不動産賃借料	323	327
寄付金	5	-
減価償却費	989	1,698
業務委託費	1,081	1,277
諸経費	1,301	1,454
一般管理費合計	11,234	12,553
営業利益	11,147	7,854

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2	57
収益分配金	16	4
投資有価証券売却益	0	738
投資有価証券償還益	219	121
デリバティブ利益	-	565
その他	8	11

営業外収益合計	247	1,499
営業外費用		
金銭の信託運用損	332	158
投資有価証券売却損	0	16
為替差損	291	1,227
デリバティブ費用	1,191	-
その他	33	32
営業外費用合計	1,848	1,435
経常利益	9,545	7,918
特別損失		
退職給付費用	120	-
特別損失合計	120	-
税引前当期純利益	9,425	7,918
法人税、住民税及び事業税	3,403	2,350
法人税等調整額	465	119
法人税等合計	2,937	2,470
当期純利益	6,487	5,448

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本
--	------



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

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

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

## 注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

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

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

7. 収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の

内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

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

## 8. ヘッジ会計の会計処理

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

## 9. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

### （会計方針の変更）

#### 「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-21項に定める経過措置に従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる財務諸表への影響はありません。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-3項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

### （表示方法の変更）

#### （貸借対照表関係）

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額の重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた4,891百万円は、「短期差入証拠金」2,528百万円、「その他」2,363百万円として組み替えております。

### （貸借対照表関係）

#### 1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)	
建物	146	百万円	184	百万円
器具備品	535	"	681	"
計	681	"	866	"

### （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

#### 1. 発行済株式に関する事項

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

#### 2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

#### 3. 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
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

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

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

### 1. 発行済株式に関する事項

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

### 2. 自己株式に関する事項 該当事項はありません。

### 3. 配当に関する事項

#### (1) 配当金支払額

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

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

2023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
2023年6月22日 定時株主総会	普通株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

#### (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・カテゴリ毎に管理しております。

##### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

##### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

## (1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（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
資産計	-	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。

当事業年度（2023年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	-	13,733
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,844	-	3,844
資産計	1,029	16,547	-	17,577
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(10)	(48)	-	(58)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(88)	-	(88)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	-	(147)

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額は960百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,693百万円であります。

(\*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額218百万円）は上記に含めておりません。

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

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

## 投資有価証券

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

## デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約の時価は、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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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(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

当事業年度(2023年3月31日)

(単位:百万円)

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

(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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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(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

当事業年度(2023年3月31日)

(単位:百万円)

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

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 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023年3月31日）
非上場株式	0	0
組合出資金等	133	218

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

（デリバティブ取引関係）

#### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

前事業年度（2022年3月31日）

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

当事業年度（2023年3月31日）

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

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,923	-	21	21
	英ポンド	256	-	6	6
	カナダドル	109	-	1	1
	スイスフラン	163	-	2	2
	香港ドル	202	-	0	0
	ユーロ	651	-	19	19
	買建 米ドル	152	-	3	3
合計	7,458	-	48	48	

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## （2）株式関連

前事業年度（2022年3月31日）

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

当事業年度（2023年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	12,195	-	9	9
	債券先物取引 売建	182	-	0	0
合計		12,378	-	10	10

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

### （1）通貨関連

前事業年度（2022年3月31日）

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				
	米ドル	投資有価証券 関係会社株式	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

当事業年度（2023年3月31日）

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		1,729	-	6
	英ポンド		3,228	-	81
	スイスフラン		20	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		21	-	0
	合計		5,082	-	88

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	626	820
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
数理計算上の差異の発生額	-	6
退職給付の支払額	81	57
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
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	820	911

## (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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	820	911
未認識数理計算上の差異	-	6
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904
退職給付引当金	820	904
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904

## (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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
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	274	142

## (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	当事業年度
	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.4%	0.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度100百万円、当事業年度109百万円であります。

(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		当事業年度	
	(2022年3月31日)		(2023年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	112	百万円	58	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	177	"	187	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	251	"	277	"
税務上の収益認識差額	74	"	-	"
税務上の費用認識差額	439	"	412	"
繰延ヘッジ損益	224	"	225	"
その他	76	"	75	"
繰延税金資産 合計	1,357	"	1,236	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	415	"	21	"
その他	34	"	32	"
繰延税金負債 合計	450	"	54	"
繰延税金資産の純額	907	"	1,181	"

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

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

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

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

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 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あります。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887百万円

## [ 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 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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。  
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

- (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（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）

当事業年度（2023年3月31日）

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

### (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	21,406,512円22銭	22,044,962円63銭
1株当たり当期純利益金額	2,162,405円20銭	1,816,227円49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いません。

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

### 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第38期中間会計期間末

(2023年9月30日)

#### 資産の部

##### 流動資産

現金及び預金		19,075
金銭の信託		16,243
未収委託者報酬		10,120
未収運用受託報酬		5,852
短期差入証拠金		4,241
その他		2,069
流動資産合計		57,601

##### 固定資産

有形固定資産	1	727
無形固定資産		
ソフトウェア		7,456
その他		45
無形固定資産合計		7,502

##### 投資その他の資産

投資有価証券		4,409
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,136
その他		31
投資その他の資産合計		11,213

固定資産合計		19,443
--------	--	--------

資産合計		77,045
------	--	--------

## 負債の部

## 流動負債

未払金		8,680
未払法人税等		441
賞与引当金		377
その他	2	1,624

流動負債合計		11,124
--------	--	--------

## 固定負債

退職給付引当金		932
資産除去債務		154
その他		35

固定負債合計		1,121
--------	--	-------

負債合計		12,246
------	--	--------

(単位:百万円)

第38期中間会計期間末

(2023年9月30日)

## 純資産の部

## 株主資本

資本金		2,000
-----	--	-------

## 資本剰余金

その他資本剰余金		17,239
----------	--	--------

資本剰余金合計		17,239
---------	--	--------

## 利益剰余金

利益準備金		500
-------	--	-----

## その他利益剰余金

別途積立金		2,100
-------	--	-------

繰越利益剰余金		43,700
---------	--	--------

利益剰余金合計		46,300
---------	--	--------

株主資本合計		65,540
--------	--	--------

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		164
--------------	--	-----

繰延ヘッジ損益		906
---------	--	-----

評価・換算差額等合計		741
------------	--	-----

純資産合計		64,798
-------	--	--------

負債・純資産合計		77,045
----------	--	--------

## 中間損益計算書

(単位:百万円)

第38期中間会計期間

(自 2023年4月1日

至 2023年9月30日)

## 営業収益

委託者報酬		21,671
-------	--	--------

運用受託報酬		5,502
--------	--	-------

その他営業収益		178
---------	--	-----

営業収益合計		27,352
--------	--	--------

営業費用		16,664
------	--	--------

一般管理費	1	6,965
-------	---	-------

営業利益		3,722
営業外収益	2	1,680
営業外費用	3	2,074
経常利益		3,327
税引前中間純利益		3,327
法人税、住民税及び事業税		846
法人税等調整額		169
法人税等合計		1,015
中間純利益		2,312

## 中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当中間期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
中間純利益			2,312	2,312	2,312
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	1,055	1,055	1,055
当中間期末残高	500	2,100	43,700	46,300	65,540

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額 等 合計	
当期首残高	49	510	460	66,134
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,367
中間純利益				2,312
株主資本以外の項目 の 当中間期変動額（純額）	114	395	280	280
当中間期変動額合計	114	395	280	1,335
当中間期末残高	164	906	741	64,798

## 注記事項

（重要な会計方針）

第38期中間会計期間  
（自 2023年4月1日  
至 2023年9月30日）

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

(2) デリバティブ

時価法によっております。

(3) 金銭の信託

時価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

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

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

(1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

## （表示方法の変更）

第38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
従来「無形固定資産」に含めていた「ソフトウェア」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。

## （中間貸借対照表関係）

第38期中間会計期間末 （2023年9月30日）	
1 有形固定資産の減価償却累計額	957百万円
2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

## （中間損益計算書関係）

第38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	91百万円
無形固定資産	972百万円
2 営業外収益の主要項目	
金銭の信託運用益	1,589百万円
3 営業外費用の主要項目	
デリバティブ費用	1,269百万円
為替差損	784百万円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

## 1. 発行済株式に関する事項

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

## 2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

## (リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (金融商品関係)

第38期中間会計期間末（2023年9月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

## (1) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区分	中間貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,206	13,995	-	15,201
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	4,137	-	4,137
資産計	1,206	18,133	-	19,339
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	226	113	-	339
通貨関連取引	-	(134)	-	(134)
デリバティブ取引計	226	(20)	-	205

(\*1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2)金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額1,041百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は16,243百万円であります。

(\*3)投資有価証券のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額271百万円）は上記に含めておりません。

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

## (2) 時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

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

## 金銭の信託

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

## 投資有価証券

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

## デリバティブ取引

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

(注2) 市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

## (有価証券関係)

第38期中間会計期間末（2023年9月30日）

## 1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

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

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

## 2. その他有価証券

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	2,711	2,131	580
小計	2,711	2,131	580
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,426	1,769	343
小計	1,426	1,769	343
合計	4,137	3,900	237

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額0百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額271百万円）は、市場価格のない株式等のため、上表の「其他有価証券」には含めておりません。

## (デリバティブ取引関係)

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引



## (1)通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,944	-	76	76
	英ポンド	267	-	1	1
	カナダドル	126	-	1	1
	スイスフラン	176	-	0	0
	香港ドル	214	-	2	2
	ユーロ	719	-	3	3
合計		7,449	-	84	84

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

## (2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	9,373	-	226	226
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	3,866	-	113	113
合計		13,239	-	339	339

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,935	-	24
	英ポンド		3,612	-	23
	スイスフラン		22	-	0
	香港ドル		90	-	1
	ユーロ		51	-	0
合計			5,713	-	49

(資産除去債務関係)  
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)  
第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

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4. 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中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報  
重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

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

[関連情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

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中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,057百万円

## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）  
該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）  
該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）  
該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

	第38期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
1株当たり純資産額	21,599,648円64銭
1株当たり中間純利益	770,782円86銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

## (注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第38期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
中間純利益	2,312百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,312百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

## 4 【利害関係人との取引制限】

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

## (1) 自己又はその役員との取引

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

## (2) 運用財産相互間の取引

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

## (3) 通常の実行条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

と。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2024年3月12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（2023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） （2023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（2023年3月末日現在）

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

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

## 第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

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

**独立監査人の監査報告書**

2023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2022年4月1日から2023年3月31日までの第37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2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

2023年8月24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 公認会計士 後藤知弘  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル・インデックス・バランス・ファンドの2022年6月11日から2023年6月12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2023年6月12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。



**独立監査人の中間監査報告書**

2023年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

三上和彦

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

田中洋一

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2024年2月21日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル・インデックス・バランス・ファンドの2023年6月13日から2023年12月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、グローバル・インデックス・バランス・ファンドの2023年12月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年6月13日から2023年12月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。