

【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】	2021年4月27日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	インデックスコレクション（バランス株式30） インデックスコレクション（バランス株式50） インデックスコレクション（バランス株式70）
【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】	インデックスコレクション（バランス株式30） 10兆円を上限とします。 インデックスコレクション（バランス株式50） 10兆円を上限とします。 インデックスコレクション（バランス株式70） 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】

インデックスコレクション（バランス株式３０）

インデックスコレクション（バランス株式５０）

インデックスコレクション（バランス株式７０）

（以下、上記ファンドを総称して「当ファンド」という場合があります。また、インデックスコレクション（バランス株式３０）を「バランス株式３０」、インデックスコレクション（バランス株式５０）を「バランス株式５０」、インデックスコレクション（バランス株式７０）を「バランス株式７０」という場合があります。）

（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】

各ファンドについて、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】

1円以上1円単位とします。

(7) 【申込期間】

2021年 4月28日から2021年10月26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 >

当ファンドは「分配金再投資コース」（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）専用ファンドです。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

< 受付不可日 >

分配金再投資コースの収益分配金の再投資の場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

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

<信託金限度額>

各ファンドについて、1兆円を上限とします。

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

(4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とす

る旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

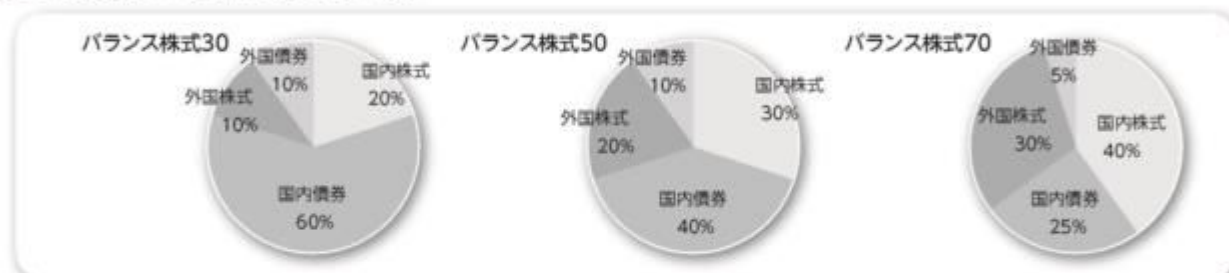
< ファンドの特色 >

資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

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

国内外の株式・公社債へ分散投資します。

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



基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設けます。

<投資対象とするマザーファンド>

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

ポートフォリオ構築プロセス

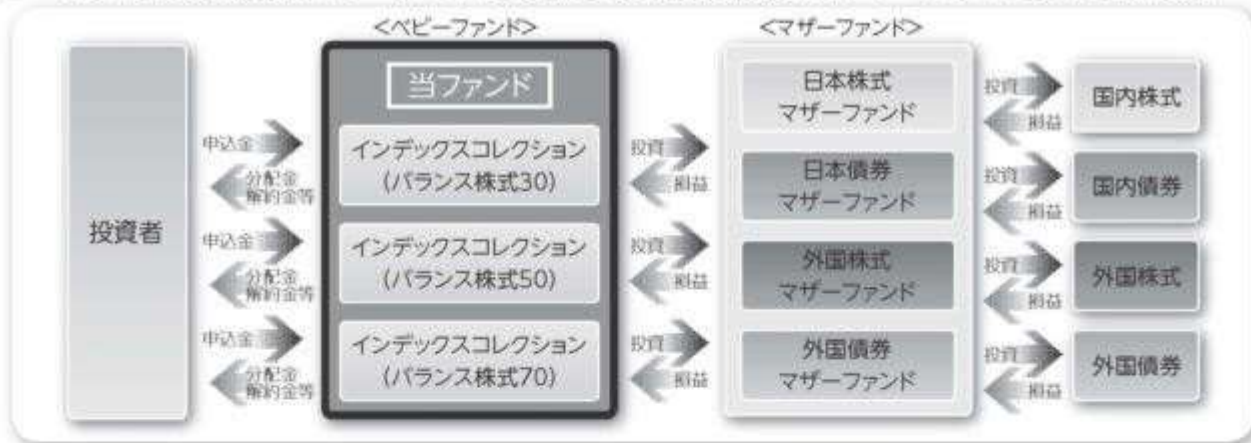
ファンドマネジャーは各ファンドの基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

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



分配方針

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

主な投資制限

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

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

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

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

- ◆各マザーファンドが対象とする指数は次のとおりです。

日本株式マザーファンド(TOPIX(東証株価指数、配当込み))

「TOPIX(東証株価指数、配当込み)」とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

日本債券マザーファンド(NOMURA-BPI総合)

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

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

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

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

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

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

(2)【ファンドの沿革】

2010年10月20日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

2012年4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継

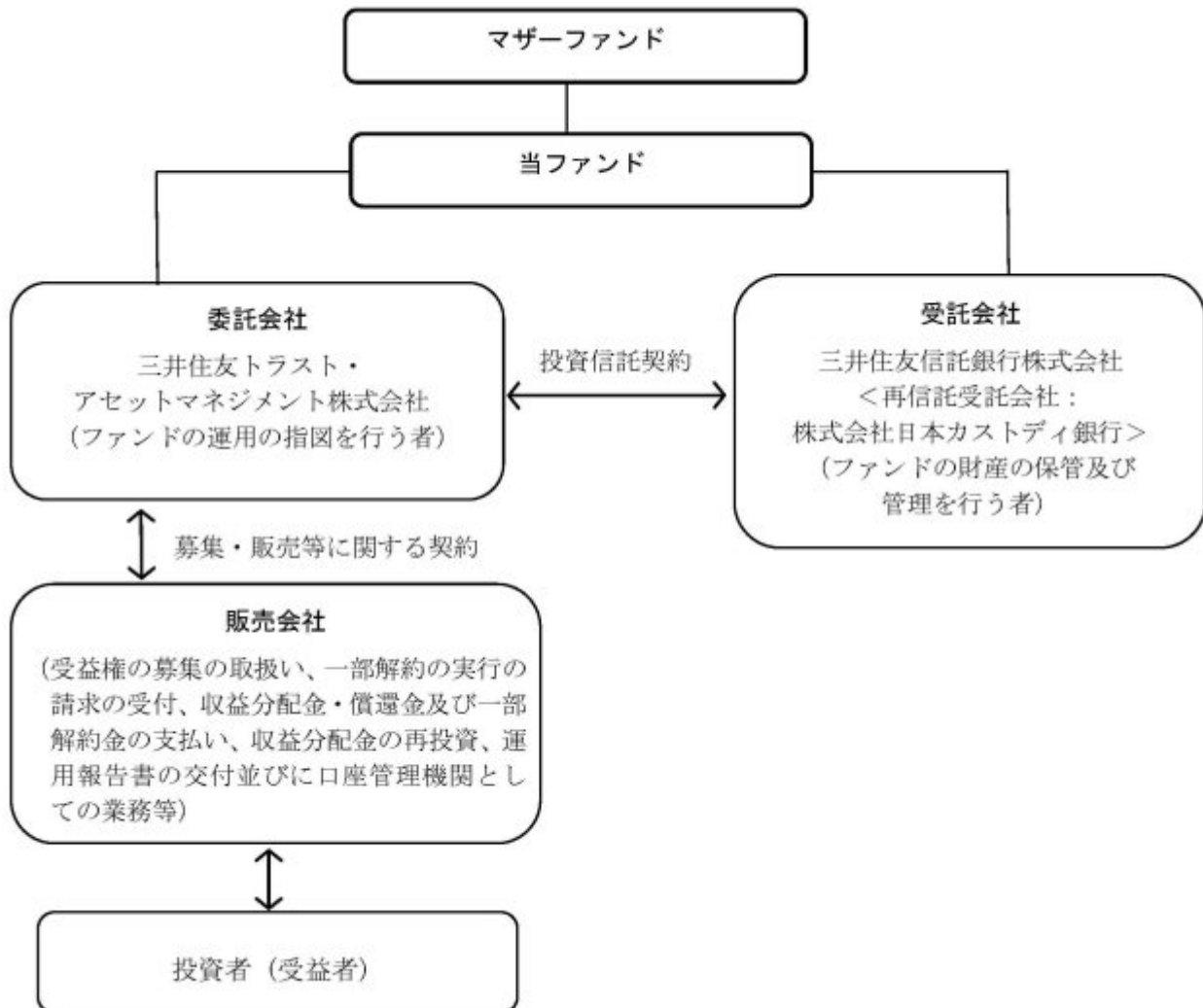
ファンドの名称を中央三井インデックスコレクション(バランス株式30)からインデックスコレクション(バランス株式30)、中央三井インデックスコレクション(バランス株式50)からインデックスコレクション(バランス株式50)に変更

0)、中央三井インデックスコレクション(バランス株式70)からインデックスコレクション(バランス株式70)に変更

当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンドの名称を日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンドの名称を外国株式マザーファンド、中央三井外国債券マザーファンドの名称を外国債券マザーファンドに変更

(3)【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況(2021年2月26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、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンドを主要投資対象とし、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。なお、国内外の株式・公社債等に直接投資することもあります。

投資態度

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

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

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

C．上記B．の基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設けます。

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

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

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

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

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

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- １．有価証券
- ２．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。）
- ３．金銭債権（上記１．、２．及び下記４．に掲げるものに該当するものを除きます。）
- ４．約束手形（上記１．に掲げるものに該当するものを除きます。）

B．次に掲げる特定資産以外の資産

- １．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

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

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

証券に限ります。）

20． 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

21． 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22． 外国の者に対する権利で上記21．の有価証券の性質を有するもの

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

運用指図できる金融商品

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

1． 預金

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

3． コール・ローン

4． 手形割引市場において売買される手形

5． 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6． 外国の者に対する権利で上記5．の権利の性質を有するもの

B． 金融商品による運用の特例

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

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1． 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2． 運用方法

（1） 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場され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、原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

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

3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「日本債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

わが国の公社債に投資を行い、NOMURA - B P I 総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

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

3. 投資制限

株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（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。）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は、行いません。

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。

「外国株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

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

3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の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。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

「外国債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

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

3. 投資制限

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

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。

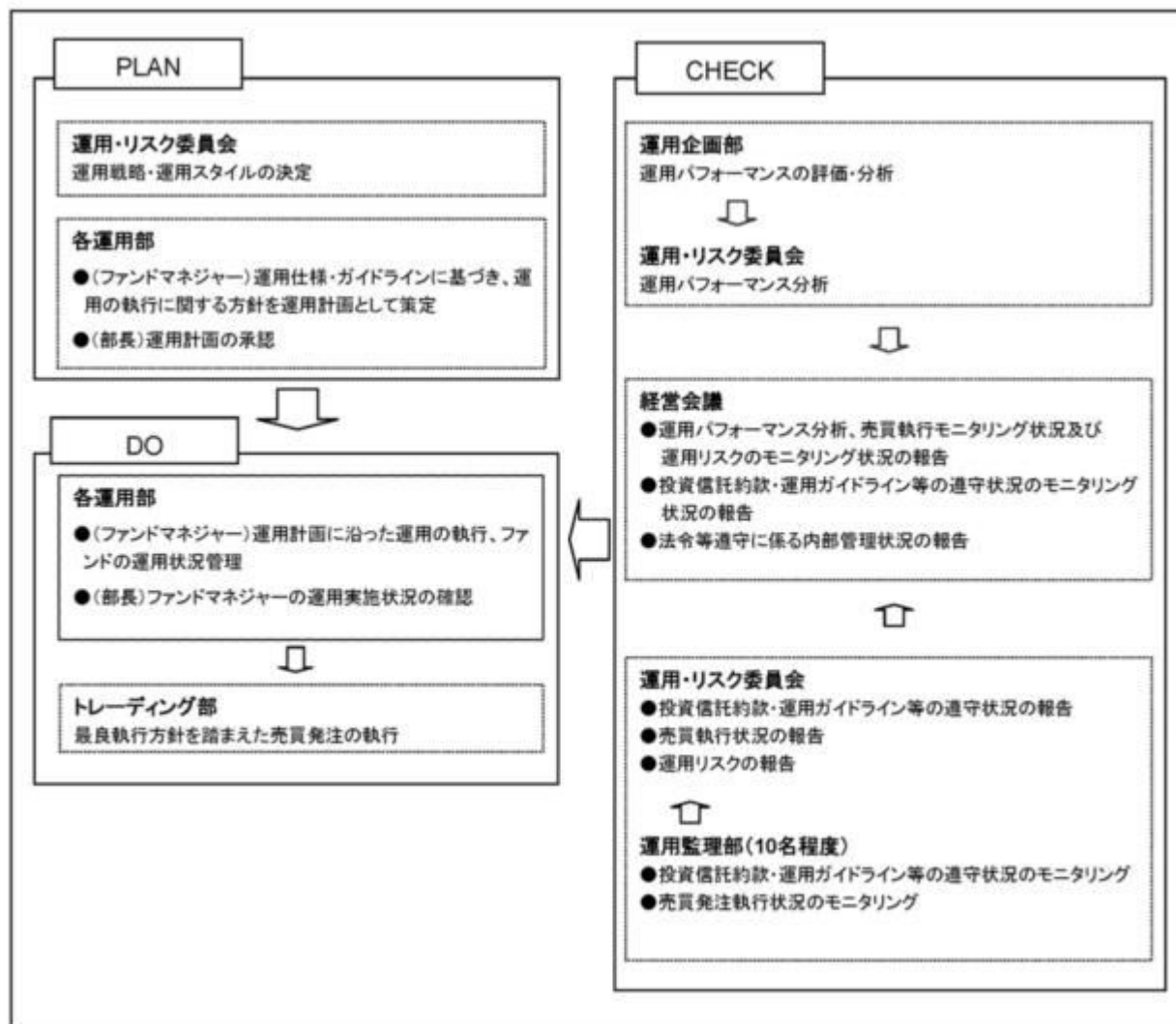
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

約款に定める投資制限

A．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

バランス株式 30 ……信託財産の純資産総額の40%以下

バランス株式 50 ……信託財産の純資産総額の60%以下

バランス株式 70 ……信託財産の純資産総額の80%以下

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

バランス株式 30 ……信託財産の純資産総額の30%以下

バランス株式 50 ……信託財産の純資産総額の40%以下

バランス株式 70 ……信託財産の純資産総額の45%以下

C．新株引受権証券等への投資割合

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

D．同一銘柄の株式への投資割合

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

E．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

G．投資信託証券への投資割合

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

H．投資する株式等の範囲

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

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

資することを指図することができるものとします。

I．信用取引の指図範囲

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

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

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

J．先物取引等の運用指図

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

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

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

K．スワップ取引の運用指図

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

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

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

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

L．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

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

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

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

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

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

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

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

合計額を超えないものとします。

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

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

ハ. 委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めたときは、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ロ. の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

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

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

O. 公社債の借入れの指図及び範囲

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

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

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

ニ. 上記イ. の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

P. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

Q. 外国為替予約取引の指図

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

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

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

R. 一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

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

S. 再投資の指図

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

T. 資金の借入れ

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

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

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

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、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

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

V. 利害関係人等との取引等

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

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

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

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

及び同法第32条第3項の通知は行いません。

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

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

金利変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

（２）リスクの管理体制

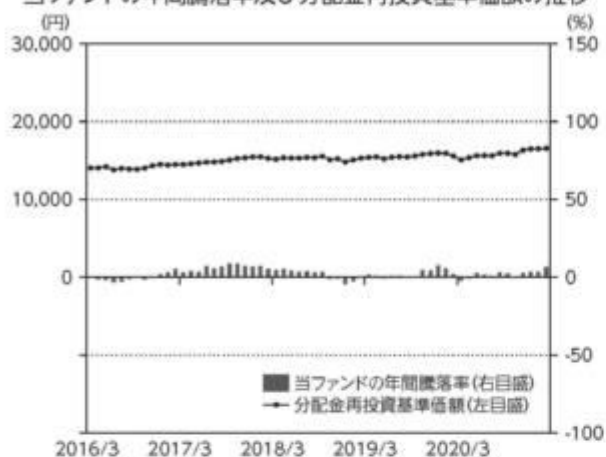
委託会社におけるリスク管理体制

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

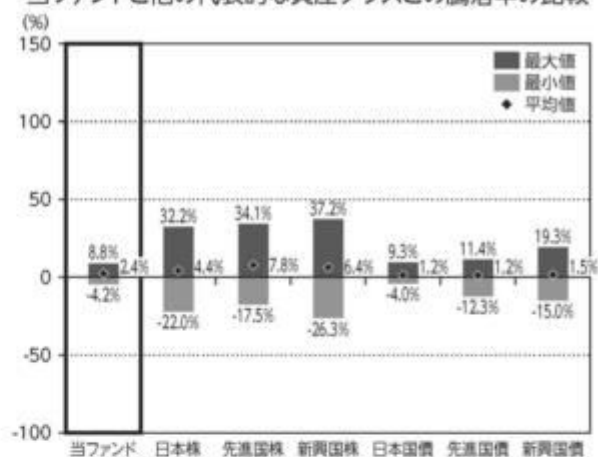
〔参考情報〕

インデックスコレクション(バランス株式30)

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

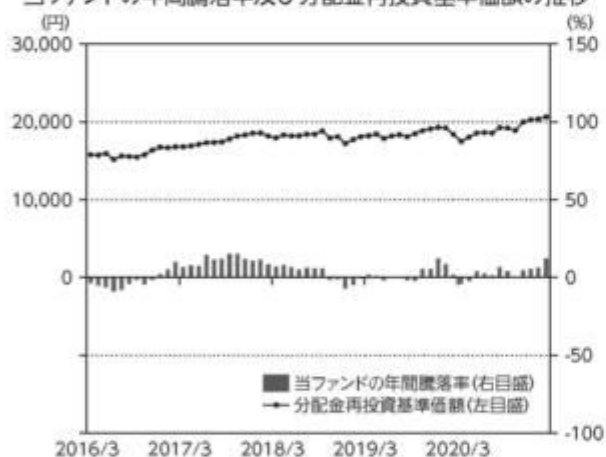


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

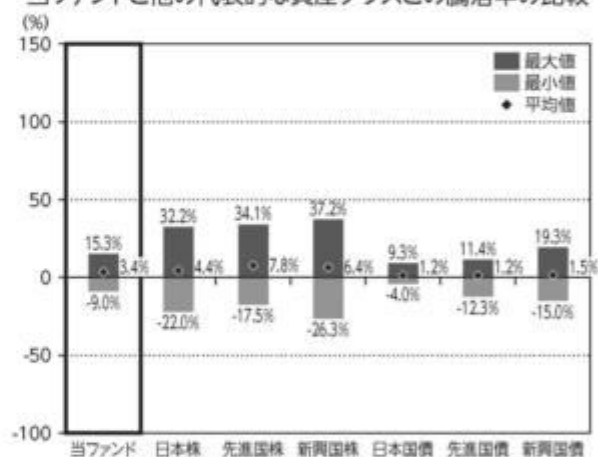


インデックスコレクション(バランス株式50)

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

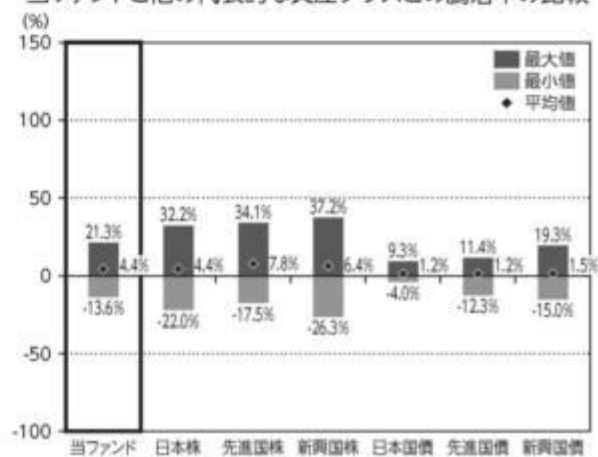


インデックスコレクション(バランス株式70)

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



【参考情報】

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

- *2016年3月～2021年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- *当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケットインデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPMorgan Global Bond Index-EM Markets(グローバル・チャイナ・ハイブリッド円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

(3)【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率

0.154% (税抜 0.14%) () を乗じて得た額とします (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。

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

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

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。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

適用されます。

上記は、2021年 2月26日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2021年2月26日現在の状況について記載してあります。

【インデックスコレクション（バランス株式30）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	121,510,033,945	99.47
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		644,292,648	0.53
合計（純資産総額）		122,154,326,593	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	日本債券マザーファンド	52,827,547,040	1.3768	72,738,058,661	1.3630	72,003,946,615	58.95
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	12,039,553,005	1.7309	20,839,262,297	2.0657	24,870,104,642	20.36
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	3,632,292,527	2.9168	10,594,670,843	3.5348	12,839,427,624	10.51
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	4,608,749,439	2.5680	11,835,268,560	2.5596	11,796,555,064	9.66

(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	99.47
合計	99.47

(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1期計算期間末 (2011年 7月25日)	1,646,934,722	1,646,934,722	10,215	10,215
第2期計算期間末 (2012年 7月25日)	1,826,441,025	1,826,441,025	10,014	10,014
第3期計算期間末 (2013年 7月25日)	3,055,855,651	3,055,855,651	12,198	12,198
第4期計算期間末 (2014年 7月25日)	4,778,573,004	4,778,573,004	12,984	12,984
第5期計算期間末 (2015年 7月27日)	7,218,074,538	7,218,074,538	14,344	14,344
第6期計算期間末 (2016年 7月25日)	26,094,390,333	26,094,390,333	14,066	14,066
第7期計算期間末 (2017年 7月25日)	36,940,752,492	36,940,752,492	14,836	14,836
第8期計算期間末 (2018年 7月25日)	47,046,612,483	47,046,612,483	15,400	15,400
第9期計算期間末 (2019年 7月25日)	58,853,542,284	58,853,542,284	15,526	15,526
第10期計算期間末 (2020年 7月27日)	112,284,528,451	112,284,528,451	15,765	15,765
2020年 2月末日	109,887,198,740		15,570	
3月末日	105,525,230,328		15,077	
4月末日	107,974,788,286		15,362	
5月末日	110,809,610,939		15,628	
6月末日	111,645,704,969		15,643	
7月末日	112,083,478,658		15,617	
8月末日	114,936,710,978		15,937	
9月末日	115,825,095,822		15,944	
10月末日	115,243,980,210		15,767	
11月末日	118,680,363,519		16,328	
12月末日	120,575,117,545		16,484	
2021年 1月末日	122,073,510,505		16,500	
2月末日	122,154,326,593		16,561	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	0
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	0
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	0
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	0
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	0
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	2.2
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	2.0
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	21.8
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	6.4
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	10.5
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	1.9
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	5.5
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	3.8
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0.8
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	1.5
第11期中間計算期間	2020年 7月28日～2021年 1月27日	5.4

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	1,616,687,950	4,495,116	1,612,192,834
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	297,421,058	85,659,240	1,823,954,652
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	946,841,759	265,501,127	2,505,295,284
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	1,384,516,621	209,546,149	3,680,265,756
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	1,662,961,851	310,939,646	5,032,287,961
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	14,070,621,585	551,965,479	18,550,944,067
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	7,358,731,907	1,010,990,195	24,898,685,779
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	7,713,381,660	2,062,382,166	30,549,685,273

第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	8,500,605,703	1,144,421,624	37,905,869,352
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	40,477,320,641	7,158,886,380	71,224,303,613
第11期中間計算期間	2020年 7月28日～2021年 1月27日	4,960,311,110	2,727,644,555	73,456,970,168

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

【インデックスコレクション（バランス株式50）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	16,220,768,573	99.49
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		82,841,788	0.51
合計(純資産総額)		16,303,610,361	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	日本債券マザーファンド	4,803,630,685	1.3766	6,613,098,241	1.3630	6,547,348,623	40.16
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,299,280,667	1.7311	3,980,322,314	2.0657	4,749,624,073	29.13
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	926,100,113	2.9168	2,701,334,782	3.5348	3,273,578,679	20.08
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	644,716,830	2.5701	1,656,991,636	2.5596	1,650,217,198	10.12

(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	99.49
合計	99.49

(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1期計算期間末 (2011年 7月25日)	2,376,072,910	2,376,072,910	10,376	10,376
第2期計算期間末 (2012年 7月25日)	2,308,448,560	2,308,448,560	9,855	9,855
第3期計算期間末 (2013年 7月25日)	3,298,797,421	3,298,797,421	13,348	13,348
第4期計算期間末 (2014年 7月25日)	4,273,661,874	4,273,661,874	14,552	14,552
第5期計算期間末 (2015年 7月27日)	5,112,201,159	5,112,201,159	16,776	16,776
第6期計算期間末 (2016年 7月25日)	5,810,707,419	5,810,707,419	15,725	15,725
第7期計算期間末 (2017年 7月25日)	6,724,648,904	6,724,648,904	17,405	17,405
第8期計算期間末 (2018年 7月25日)	8,658,183,416	8,658,183,416	18,451	18,451
第9期計算期間末 (2019年 7月25日)	11,669,771,032	11,669,771,032	18,409	18,409
第10期計算期間末 (2020年 7月27日)	13,923,564,557	13,923,564,557	18,866	18,866
2020年 2月末日	12,850,748,440		18,387	
3月末日	12,209,692,967		17,482	
4月末日	12,717,871,093		18,048	
5月末日	13,464,721,775		18,574	
6月末日	13,733,359,749		18,633	
7月末日	13,866,190,800		18,581	
8月末日	14,484,794,553		19,271	
9月末日	14,628,041,615		19,213	
10月末日	14,583,493,413		18,900	
11月末日	15,365,886,073		19,987	
12月末日	15,828,809,779		20,301	
2021年 1月末日	16,148,014,154		20,381	
2月末日	16,303,610,361		20,648	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	0
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	0
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	0

第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	0
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	0
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	3.8
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	5.0
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	35.4
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	9.0
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	15.3
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	6.3
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	10.7
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	6.0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0.2
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	2.5
第11期中間計算期間	2020年 7月28日～2021年 1月27日	9.2

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	2,297,761,646	7,893,955	2,289,867,691
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	190,420,353	137,880,635	2,342,407,409
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	416,815,707	287,930,717	2,471,292,399
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	658,340,834	192,744,346	2,936,888,887
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	449,877,581	339,477,441	3,047,289,027
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	961,565,392	313,575,798	3,695,278,621
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	603,139,592	434,776,876	3,863,641,337
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	1,120,338,164	291,368,383	4,692,611,118
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	2,005,968,696	359,477,733	6,339,102,081
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	1,649,045,263	607,727,034	7,380,420,310
第11期中間計算期間	2020年 7月28日～2021年 1月27日	771,337,228	286,748,645	7,865,008,893

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

【インデックスコレクション（バランス株式70）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	9,732,740,527	99.61
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		37,847,363	0.39
合計（純資産総額）		9,770,587,890	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	日本株式マザーファンド	1,907,441,108	1.7384	3,315,895,623	2.0657	3,940,201,096	40.33
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	861,363,115	2.9295	2,523,363,246	3.5348	3,044,746,338	31.16
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	1,726,486,552	1.3766	2,376,745,575	1.3630	2,353,201,170	24.08
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	154,161,558	2.5677	395,850,890	2.5596	394,591,923	4.04

(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	99.61
合計	99.61

(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1期計算期間末 (2011年 7月25日)	1,465,295,824	1,465,295,824	10,550	10,550
第2期計算期間末 (2012年 7月25日)	1,392,591,169	1,392,591,169	9,716	9,716
第3期計算期間末 (2013年 7月25日)	2,374,954,327	2,374,954,327	14,377	14,377
第4期計算期間末 (2014年 7月25日)	3,063,861,342	3,063,861,342	15,968	15,968
第5期計算期間末 (2015年 7月27日)	3,890,683,336	3,890,683,336	19,106	19,106
第6期計算期間末 (2016年 7月25日)	3,517,186,547	3,517,186,547	17,198	17,198
第7期計算期間末 (2017年 7月25日)	4,084,827,402	4,084,827,402	19,885	19,885
第8期計算期間末 (2018年 7月25日)	5,289,106,724	5,289,106,724	21,519	21,519
第9期計算期間末 (2019年 7月25日)	6,627,304,937	6,627,304,937	21,241	21,241
第10期計算期間末 (2020年 7月27日)	7,965,836,155	7,965,836,155	21,868	21,868
2020年 2月末日	7,285,607,201		21,095	
3月末日	6,670,085,271		19,669	
4月末日	7,060,855,058		20,584	
5月末日	7,652,639,954		21,399	
6月末日	7,825,773,917		21,507	
7月末日	7,893,630,378		21,408	
8月末日	8,339,374,272		22,563	
9月末日	8,428,921,263		22,422	
10月末日	8,338,989,981		21,953	
11月末日	8,921,018,893		23,700	
12月末日	9,298,437,916		24,199	
2021年 1月末日	9,600,602,383		24,355	
2月末日	9,770,587,890		24,856	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	0
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	0
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	0
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	0
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	0

第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	0
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	5.5
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	7.9
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	48.0
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	11.1
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	19.7
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	10.0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	15.6
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	8.2
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	1.3
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	3.0
第11期中間計算期間	2020年 7月28日～2021年 1月27日	13.0

(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1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	1,395,188,638	6,298,452	1,388,890,186
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	201,368,030	156,966,363	1,433,291,853
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	664,273,333	445,609,632	1,651,955,554
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	635,433,541	368,605,971	1,918,783,124
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	672,066,846	554,506,519	2,036,343,451
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	442,910,032	434,101,250	2,045,152,233
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	508,202,695	499,147,088	2,054,207,840
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	778,728,051	375,069,629	2,457,866,262
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	1,031,236,687	369,101,257	3,120,001,692
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	1,230,292,042	707,559,121	3,642,734,613
第11期中間計算期間	2020年 7月28日～2021年 1月27日	560,320,198	294,577,293	3,908,477,518

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)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	274,723,349,170	99.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,631,221,253	0.95
合計(純資産総額)		277,354,570,423	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	2,569,435,000	0.93

(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	1,088,600	7,660.00	8,338,676,000	7,873.00	8,570,547,800	3.09
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	836,700	8,793.84	7,357,805,928	9,895.00	8,279,146,500	2.99
日本	株式	ソニー	電気機器	673,100	10,474.69	7,050,513,839	11,120.00	7,484,872,000	2.70
日本	株式	キーエンス	電気機器	105,500	57,606.74	6,077,511,070	50,560.00	5,334,080,000	1.92
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,249,900	482.94	3,501,266,706	558.00	4,045,444,200	1.46
日本	株式	任天堂	その他製品	61,500	63,920.00	3,931,080,000	64,750.00	3,982,125,000	1.44
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	735,600	4,669.08	3,434,575,248	5,281.00	3,884,703,600	1.40
日本	株式	日本電産	電気機器	258,700	14,202.54	3,674,197,098	13,520.00	3,497,624,000	1.26
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,233,400	2,699.50	3,329,563,300	2,758.00	3,401,717,200	1.23
日本	株式	信越化学工業	化学	194,600	19,274.66	3,750,848,836	17,350.00	3,376,310,000	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	894,100	3,588.57	3,208,540,437	3,582.00	3,202,666,200	1.15
日本	株式	村田製作所	電気機器	315,700	10,493.80	3,312,892,660	9,081.00	2,866,871,700	1.03

日本	株式	ダイキン工業	機械	136,900	23,129.67	3,166,451,823	20,720.00	2,836,568,000	1.02
日本	株式	KDDI	情報・通信業	845,600	3,239.52	2,739,338,112	3,290.00	2,782,024,000	1.00
日本	株式	第一三共	医薬品	922,500	3,578.64	3,301,295,400	3,010.00	2,776,725,000	1.00
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	733,400	3,338.36	2,448,353,224	3,742.00	2,744,382,800	0.99
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	62,900	43,510.00	2,736,779,000	43,550.00	2,739,295,000	0.99
日本	株式	HOYA	精密機器	213,200	13,616.85	2,903,112,420	12,100.00	2,579,720,000	0.93
日本	株式	日立製作所	電気機器	516,700	4,358.46	2,252,016,282	4,876.00	2,519,429,200	0.91
日本	株式	ファナック	電気機器	94,300	27,070.00	2,552,701,000	26,340.00	2,483,862,000	0.90
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	846,100	2,850.80	2,412,061,880	2,911.50	2,463,420,150	0.89
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	740,200	3,142.19	2,325,849,038	3,168.00	2,344,953,600	0.85
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,440,100	1,407.41	2,026,811,141	1,559.00	2,245,115,900	0.81
日本	株式	S M C	機械	31,500	68,240.00	2,149,560,000	62,900.00	1,981,350,000	0.71
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	109,200	16,001.58	1,747,372,536	17,840.00	1,948,128,000	0.70
日本	株式	三井物産	卸売業	859,300	2,059.50	1,769,728,350	2,263.50	1,945,025,550	0.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	644,400	2,683.50	1,729,247,400	3,003.00	1,935,133,200	0.70
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	351,300	5,423.00	1,905,099,900	5,253.00	1,845,378,900	0.67
日本	株式	花王	化学	257,300	7,685.05	1,977,363,365	7,144.00	1,838,151,200	0.66
日本	株式	資生堂	化学	213,500	7,072.66	1,510,012,910	7,913.00	1,689,425,500	0.61

(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	0.09
		鉱業	0.18
		建設業	2.26
		食料品	3.30
		繊維製品	0.49
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.23
		医薬品	5.40
		石油・石炭製品	0.44
		ゴム製品	0.59
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.69
		非鉄金属	0.78
		金属製品	0.62
		機械	5.52
電気機器	17.49		
輸送用機器	6.92		

精密機器	2.53
その他製品	2.47
電気・ガス業	1.27
陸運業	3.59
海運業	0.20
空運業	0.48
倉庫・運輸関連業	0.17
情報・通信業	9.51
卸売業	4.66
小売業	4.69
銀行業	5.01
証券、商品先物取引業	0.81
保険業	1.88
その他金融業	1.08
不動産業	1.98
サービス業	5.68
小計	99.05
合計	99.05

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	137円		2,563,013,150	2,569,435,000	0.93

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

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

日本債券マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	310,958,380,300	83.17
地方債証券	日本	20,649,286,332	5.52
特殊債券	日本	24,715,584,256	6.61

社債券	日本	15,253,556,000	4.08
	フランス	899,779,000	0.24
	オーストラリア	199,812,000	0.05
	スペイン	99,985,000	0.03
	小計	16,453,132,000	4.40
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,109,669,451	0.30
合計(純資産総額)		373,886,052,339	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	日本	451,860,000	0.12

(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	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	6,600,000,000	100.84	6,655,638,000	100.67	6,644,682,000	0.100	2024/9/20	1.78
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	5,980,000,000	101.05	6,042,909,600	100.75	6,025,089,200	0.100	2025/9/20	1.61
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	4,300,000,000	100.72	4,331,046,000	99.52	4,279,704,000	0.100	2030/9/20	1.14
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	4,250,000,000	100.68	4,279,070,000	100.61	4,276,307,500	0.100	2023/12/20	1.14
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	4,035,000,000	100.96	4,074,055,000	100.71	4,063,930,950	0.100	2026/6/20	1.09
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	3,850,000,000	102.45	3,944,325,000	102.12	3,931,774,000	0.400	2025/9/20	1.05
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	3,900,000,000	101.30	3,950,895,000	100.55	3,921,684,000	0.100	2027/9/20	1.05
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	3,880,000,000	101.19	3,926,327,200	100.69	3,906,966,000	0.100	2026/9/20	1.04
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	3,700,000,000	100.44	3,716,539,000	100.38	3,714,356,000	0.100	2022/12/20	0.99
日本	国債証券	第416回利付国債(2年)	3,700,000,000	100.36	3,713,662,400	100.33	3,712,543,000	0.100	2022/9/1	0.99
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	3,560,000,000	102.18	3,637,928,400	101.90	3,627,960,400	0.400	2025/3/20	0.97

日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	3,600,000,000	101.23	3,644,280,000	100.23	3,608,352,000	0.100	2028/12/20	0.97
日本	国債証券	第347回利付国債（10年）	3,415,000,000	101.28	3,458,985,200	100.59	3,435,421,700	0.100	2027/6/20	0.92
日本	国債証券	第135回利付国債（5年）	3,200,000,000	100.49	3,215,840,000	100.43	3,213,792,000	0.100	2023/3/20	0.86
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	3,190,000,000	101.11	3,225,504,700	100.73	3,213,414,600	0.100	2026/3/20	0.86
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	3,140,000,000	102.47	3,217,715,000	102.28	3,211,780,400	0.600	2024/6/20	0.86
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	3,130,000,000	101.18	3,166,934,000	100.16	3,135,008,000	0.100	2029/3/20	0.84
日本	国債証券	第358回利付国債（10年）	3,090,000,000	100.91	3,118,242,600	99.77	3,083,078,400	0.100	2030/3/20	0.82
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	3,050,000,000	101.05	3,082,307,000	100.45	3,063,938,500	0.100	2028/3/20	0.82
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	2,940,000,000	101.08	2,971,840,200	99.95	2,938,735,800	0.100	2029/9/20	0.79
日本	国債証券	第153回利付国債（20年）	2,510,000,000	114.99	2,886,349,400	113.09	2,838,684,500	1.300	2035/6/20	0.76
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	2,775,000,000	102.34	2,840,073,750	102.02	2,831,304,750	0.400	2025/6/20	0.76
日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	2,720,000,000	100.71	2,739,486,100	100.62	2,737,054,400	0.100	2024/3/20	0.73
日本	国債証券	第357回利付国債（10年）	2,620,000,000	100.98	2,645,676,000	99.86	2,616,567,800	0.100	2029/12/20	0.70
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	2,580,000,000	101.24	2,612,172,600	100.66	2,597,234,400	0.100	2026/12/20	0.69
日本	国債証券	第137回利付国債（5年）	2,580,000,000	100.62	2,596,125,000	100.53	2,593,880,400	0.100	2023/9/20	0.69
日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	2,580,000,000	101.13	2,609,334,600	100.08	2,582,115,600	0.100	2029/6/20	0.69
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	2,495,000,000	101.26	2,526,636,600	100.63	2,510,843,250	0.100	2027/3/20	0.67
日本	国債証券	第149回利付国債（20年）	2,120,000,000	117.27	2,486,145,200	115.42	2,447,031,200	1.500	2034/6/20	0.65
日本	国債証券	第359回利付国債（10年）	2,430,000,000	100.84	2,450,533,500	99.67	2,422,175,400	0.100	2030/6/20	0.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.17
地方債証券	5.52
特殊債券	6.61
社債券	4.40
合計	99.70

(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	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 (%)
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建		3円	451,770,990	451,860,000	0.12

(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	179,873,364,749	65.57
	イギリス	12,426,032,674	4.53
	カナダ	9,454,270,219	3.45
	フランス	9,074,990,829	3.31
	スイス	8,989,165,320	3.28
	ドイツ	8,223,804,400	3.00
	オーストラリア	5,907,281,897	2.15
	オランダ	5,171,193,973	1.89
	アイルランド	4,891,703,613	1.78
	スウェーデン	3,007,453,583	1.10
	香港	2,323,497,150	0.85
	スペイン	2,189,729,222	0.80
	デンマーク	2,157,452,949	0.79
	イタリア	1,685,400,504	0.61
	フィンランド	1,135,744,019	0.41
	バミューダ	860,003,715	0.31
	ジャージー	849,409,725	0.31
	シンガポール	833,756,518	0.30
	ベルギー	768,760,976	0.28
	ノルウェー	560,184,511	0.20
イスラエル	531,026,059	0.19	
ケイマン	522,681,779	0.19	
ニュージーランド	310,827,779	0.11	
ルクセンブルク	231,710,466	0.08	

	キュラソー	210,498,239	0.08
	オーストリア	163,632,249	0.06
	ポルトガル	138,348,470	0.05
	リベリア	93,005,023	0.03
	パナマ	72,385,103	0.03
	マン島	70,951,910	0.03
	パプアニューギニア	39,746,928	0.01
	小計	262,768,014,551	95.79
投資信託受益証券	オーストラリア	122,851,172	0.04
	香港	40,815,040	0.01
	小計	163,666,212	0.06
投資証券	アメリカ	4,749,953,285	1.73
	オーストラリア	384,544,379	0.14
	イギリス	154,366,136	0.06
	フランス	148,644,590	0.05
	シンガポール	139,094,981	0.05
	香港	110,775,802	0.04
	カナダ	35,866,142	0.01
	小計	5,723,245,315	2.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,657,765,513	2.06
合計(純資産総額)		274,312,691,591	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	4,026,577,500	1.47
	買建	カナダ	309,064,386	0.11
	買建	ドイツ	860,727,357	0.31
	買建	イギリス	265,693,824	0.10
	買建	オーストラリア	169,777,449	0.06

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建		1,072,244,720	0.39

(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	892,563	14,530.75	12,969,609,813	12,855.18	11,474,064,721	4.18
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	375,183	25,733.74	9,654,865,526	24,330.18	9,128,272,737	3.33
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	22,205	356,165.93	7,908,664,642	324,823.24	7,212,700,266	2.63
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	125,157	28,485.62	3,565,175,368	27,060.81	3,386,850,110	1.23
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	15,628	222,912.50	3,483,676,550	215,832.00	3,373,022,496	1.23
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	15,642	221,938.18	3,471,557,129	214,194.68	3,350,433,302	1.22
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	39,287	90,549.43	3,557,415,751	72,485.87	2,847,752,571	1.04
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	158,455	14,660.37	2,323,009,720	16,062.87	2,545,242,858	0.93
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	136,903	17,472.81	2,392,080,450	17,293.25	2,367,497,805	0.86
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	87,768	22,181.81	1,946,853,319	22,710.93	1,993,293,562	0.73
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	93,874	19,248.24	1,806,910,220	20,291.62	1,904,856,005	0.69
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	72,789	24,985.74	1,818,687,756	25,892.06	1,884,657,337	0.69

アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	32,130	57,761.75	1,855,885,028	56,556.87	1,817,172,394	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	46,381	35,992.18	1,669,353,649	37,673.06	1,747,314,312	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	129,289	13,766.81	1,779,897,421	13,449.12	1,738,823,922	0.63
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	49,350	34,479.18	1,701,547,903	34,942.43	1,724,409,291	0.63
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	149,633	11,762.16	1,760,007,526	11,288.10	1,689,073,464	0.62
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	57,921	28,628.00	1,658,162,388	26,981.12	1,562,773,741	0.57
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	404,496	3,439.31	1,391,188,149	3,817.56	1,544,188,761	0.56
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	55,880	29,628.87	1,655,661,536	27,120.31	1,515,483,063	0.55
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	220,628	6,181.62	1,363,839,560	6,417.50	1,415,880,190	0.52
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	22,073	59,409.00	1,311,334,857	61,339.79	1,353,953,240	0.49
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	22,869	58,521.43	1,338,326,754	58,086.87	1,328,388,744	0.48
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	236,400	5,430.43	1,283,755,425	5,550.50	1,312,138,200	0.48
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	219,052	5,307.18	1,162,550,036	5,924.50	1,297,773,574	0.47
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	214,484	5,877.75	1,260,683,331	6,003.12	1,287,574,263	0.47
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	36,436	36,216.99	1,319,602,284	34,855.84	1,270,007,641	0.46
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	24,871	52,287.74	1,300,448,630	48,785.74	1,213,350,388	0.44
アメリカ	株式	ABBOTT LABORATORIES	ヘルスケア機器・サービス	91,765	13,178.18	1,209,296,376	12,917.87	1,185,408,799	0.43
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	47,159	25,382.06	1,196,992,686	24,552.25	1,157,859,558	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	3.38
		素材	4.52
		資本財	6.44
		商業・専門サービス	1.05
		運輸	1.97
		自動車・自動車部品	2.01
		耐久消費財・アパレル	1.89

	消費者サービス	1.62
	メディア・娯楽	7.06
	小売	5.59
	食品・生活必需品小売り	1.29
	食品・飲料・タバコ	3.83
	家庭用品・パーソナル用品	1.78
	ヘルスケア機器・サービス	5.06
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.43
	銀行	6.15
	各種金融	4.49
	保険	3.21
	不動産	0.48
	ソフトウェア・サービス	11.69
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.68
	電気通信サービス	1.76
	公益事業	2.96
	半導体・半導体製造装置	4.45
	小計	95.79
投資信託受益証券		0.06
投資証券		2.09
合計		97.94

(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	198	アメリカドル	38,611,813	4,102,505,131	37,897,200	4,026,577,500	1.47
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	17	カナダドル	3,678,096.5	309,291,135	3,675,400	309,064,386	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	21	スイスフラン	2,251,870	264,234,426	2,220,750	260,582,805	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	126	ユーロ	4,635,295.5	598,648,414	4,646,880	600,144,552	0.22
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	12	オーストラリアドル	2,042,735	170,180,253	2,037,900	169,777,449	0.06
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	27	イギリスポンド	1,767,795	262,482,202	1,789,425	265,693,824	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。

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	8,216,000.00	860,278,013	872,714,720	0.32
	ユーロ	買建	1,200,000.00	152,160,000	154,992,000	0.06
	イギリスポンド	買建	300,000.00	43,344,150	44,538,000	0.02

(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	59,886,652,645	42.11
	フランス	14,993,572,258	10.54
	イタリア	13,464,437,251	9.47
	ドイツ	10,688,036,600	7.52
	イギリス	9,320,748,569	6.55
	スペイン	8,584,771,751	6.04
	オーストラリア	3,810,383,502	2.68
	ベルギー	3,528,034,113	2.48
	カナダ	2,766,593,954	1.95
	オランダ	2,629,342,831	1.85
	オーストリア	2,132,886,291	1.50
	アイルランド	1,221,994,014	0.86
	メキシコ	1,093,953,441	0.77
	ポーランド	923,089,089	0.65
	フィンランド	897,927,388	0.63
	デンマーク	718,766,241	0.51
	マレーシア	688,298,361	0.48
	イスラエル	639,875,854	0.45
	シンガポール	612,712,651	0.43
	スウェーデン	477,560,912	0.34
ノルウェー	327,569,624	0.23	
	小計	139,407,207,340	98.03

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,795,751,432	1.97
合計(純資産総額)		142,202,958,772	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	607,766,617	0.43
	買建	ドイツ	874,627,692	0.62

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		1,347,077,300	0.95

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	9,130,000	10,118.65	923,832,958	9,809.86	895,640,517	0.625	2030/8/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/30/24	8,000,000	11,097.72	887,818,362	11,007.66	880,613,286	1.500	2024/9/30	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	7,250,000	11,423.12	828,176,210	11,284.49	818,126,035	2.125	2025/5/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	6,700,000	11,421.04	765,210,012	11,331.39	759,203,567	2.375	2024/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	7,400,000	10,154.34	751,421,585	9,848.87	728,816,898	0.625	2030/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/25	7,000,000	10,542.82	737,997,563	10,392.57	727,480,469	0.250	2025/9/30	0.51
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	6,500,000	11,028.83	716,874,143	11,004.96	715,322,938	2.000	2023/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/30/23	6,000,000	11,430.59	685,835,447	11,375.80	682,548,338	2.875	2023/11/30	0.48
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	11,339.69	686,051,688	11,220.58	678,845,155	2.000	2025/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	5,750,000	11,230.54	645,756,166	11,050.00	635,375,000	1.625	2026/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.625% 04/30/23	5,800,000	10,978.61	636,759,570	10,952.05	635,218,945	1.625	2023/4/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	5,390,000	11,984.66	645,973,603	11,670.89	629,061,425	2.625	2029/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	5,800,000	10,852.44	629,441,602	10,835.83	628,478,711	1.500	2022/8/15	0.44

アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	5,500,000	11,538.50	634,617,552	11,365.01	625,075,807	2.250	2025/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.5% 06/30/27	6,000,000	10,476.83	628,609,865	10,232.37	613,942,386	0.500	2027/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 2% 11/30/22	5,500,000	10,988.78	604,382,995	10,967.40	603,207,396	2.000	2022/11/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 3% 08/15/48	4,910,000	13,058.78	641,186,542	12,213.76	599,696,083	3.000	2048/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	5,260,000	11,655.95	613,103,339	11,376.22	598,389,211	2.250	2027/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	5,400,000	11,233.86	606,628,565	11,040.86	596,206,936	1.625	2026/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/22	5,400,000	10,898.30	588,508,376	10,882.53	587,656,713	2.125	2022/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 07/31/25	5,000,000	11,798.73	589,936,524	11,641.84	582,092,288	2.875	2025/7/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	5,300,000	11,163.30	591,655,198	10,954.95	580,612,672	1.500	2026/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/31/25	5,000,000	11,751.00	587,550,048	11,588.72	579,436,038	2.750	2025/8/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.25% 01/31/24	5,090,000	11,277.44	574,021,768	11,219.33	571,064,199	2.250	2024/1/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	5,000,000	11,409.00	570,450,438	11,306.07	565,303,954	2.250	2024/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.375% 01/31/23	5,000,000	11,100.01	555,000,610	11,074.90	553,745,117	2.375	2023/1/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.875% 03/31/22	5,100,000	10,842.06	552,945,337	10,830.02	552,331,496	1.875	2022/3/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.125% 10/15/23	5,200,000	10,614.62	551,960,450	10,580.59	550,190,721	0.125	2023/10/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/28	4,670,000	12,027.83	561,699,755	11,734.81	548,015,837	2.750	2028/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 3% 02/15/48	4,400,000	13,037.20	573,637,109	12,200.48	536,821,484	3.000	2048/2/15	0.38

(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	98.03
合計	98.03

(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	18	アメリカドル	2,249,769.24	239,037,982	2,230,593.84	237,000,595	0.17
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	12	アメリカドル	1,611,971.16	171,271,936	1,590,937.56	169,037,116	0.12
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	12	アメリカドル	1,927,346.16	204,780,529	1,898,625	201,728,906	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	9	ユーロ	1,010,307.1	130,481,161	1,009,305	130,351,740	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	12	ユーロ	1,619,280	209,130,012	1,609,440	207,859,176	0.15

ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-BUND	買建	24	ユーロ	4,225,932.1	545,779,131	4,153,440	536,416,776	0.38
-----	-----------------------	-----------	----	----	-----	-------------	-------------	-----------	-------------	------

(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	5,610,000.00	588,408,720	595,894,200	0.42
	カナダドル	買建	930,000.00	76,748,131	78,185,100	0.05
	ユーロ	買建	4,360,000.00	554,347,681	563,137,600	0.40
	イギリスポンド	買建	740,000.00	107,131,844	109,860,400	0.08

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

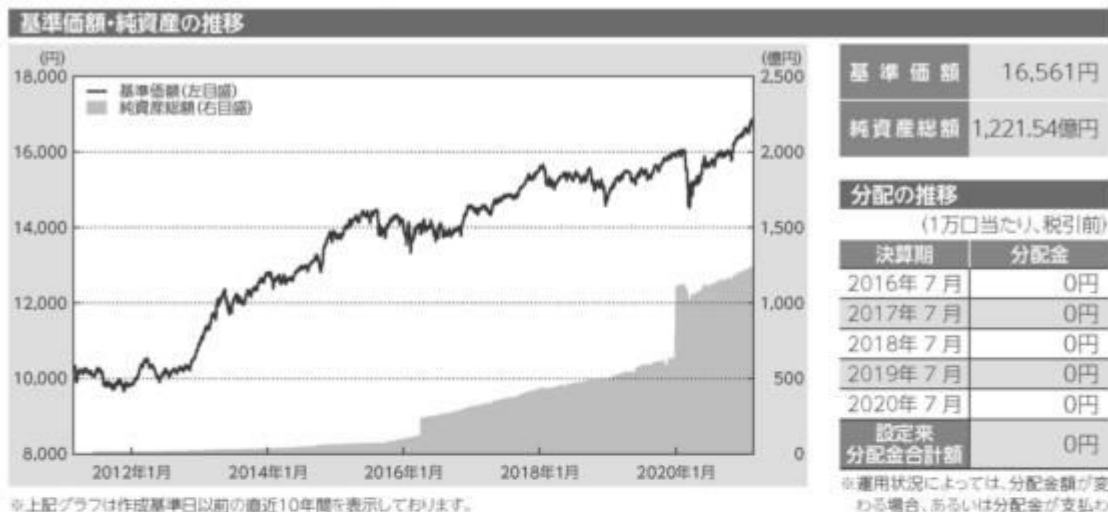
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

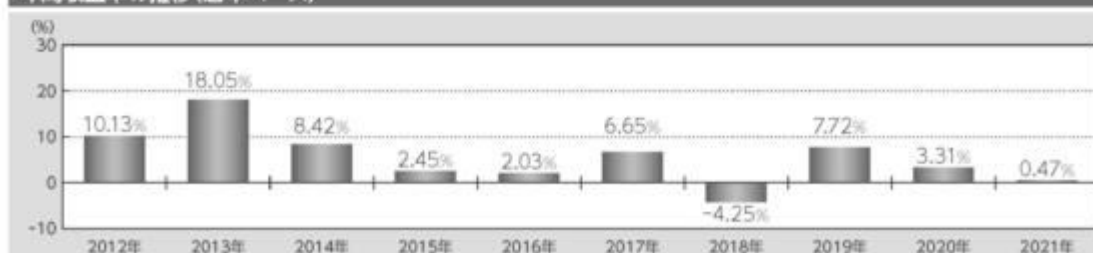

運用実績

当初設定日：2010年10月20日
作成基準日：2021年2月26日

インデックスコレクション(バランス株式30)

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	償還期間	実質投資比率
日本債券 マザーファンド	58.9%	第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/09/20	1.0%
		第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2025/09/20	1.0%
		第360回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2030/09/20	0.7%
日本株式 マザーファンド	20.4%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.6%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.6%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.5%
外国株式 マザーファンド	10.5%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ソフトウェア	-	-	0.4%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.3%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.3%
外国債券 マザーファンド	9.7%	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.1%
		T 1.5% 09/30/24	アメリカ	国債	-	1.500%	2024/09/30	0.1%
		T 2.125% 05/15/25	アメリカ	国債	-	2.125%	2025/05/15	0.1%


※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)


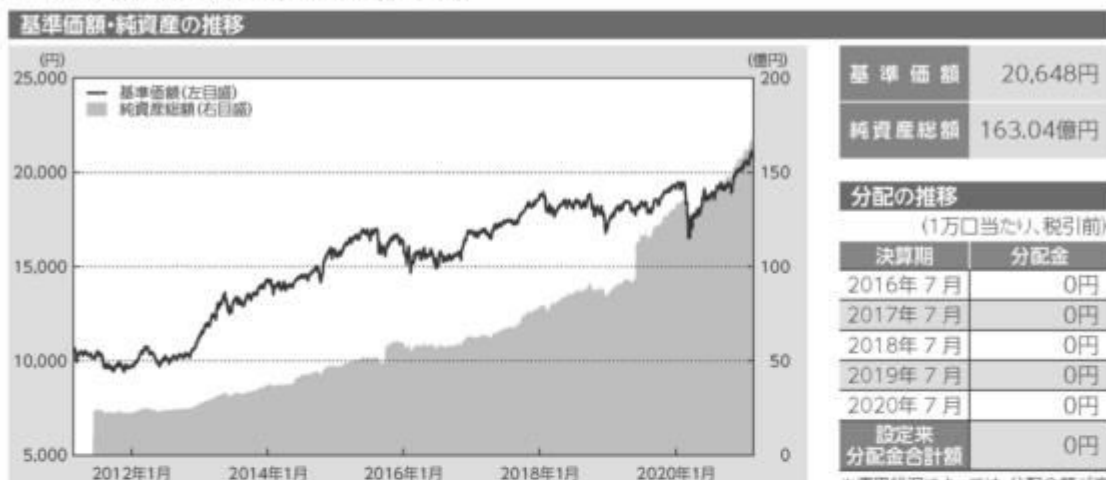
※2021年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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


運用実績

当初設定日：2010年10月20日
作成基準日：2021年2月26日

インデックスコレクション(バランス株式50)


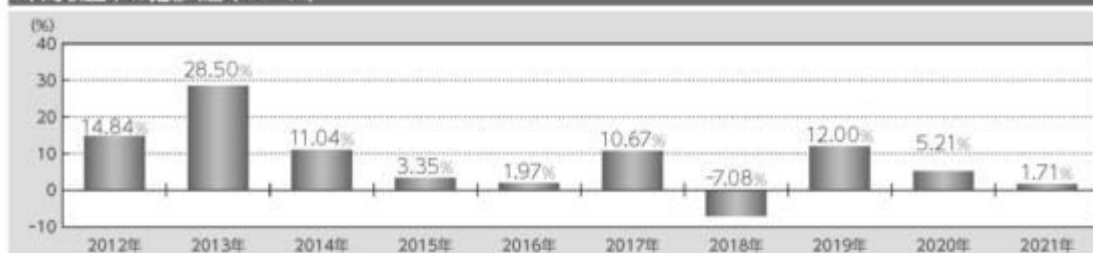
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券 マザーファンド	40.2%	第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/09/20	0.7%
		第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2025/09/20	0.6%
		第360回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2030/09/20	0.5%
日本株式 マザーファンド	29.1%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.9%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.9%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.8%
外国株式 マザーファンド	20.1%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア	-	-	0.8%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.7%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.5%
外国債券 マザーファンド	10.1%	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.1%
		T 1.5% 09/30/24	アメリカ	国債	-	1.500%	2024/09/30	0.1%
		T 2.125% 05/15/25	アメリカ	国債	-	2.125%	2025/05/15	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)


※2021年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

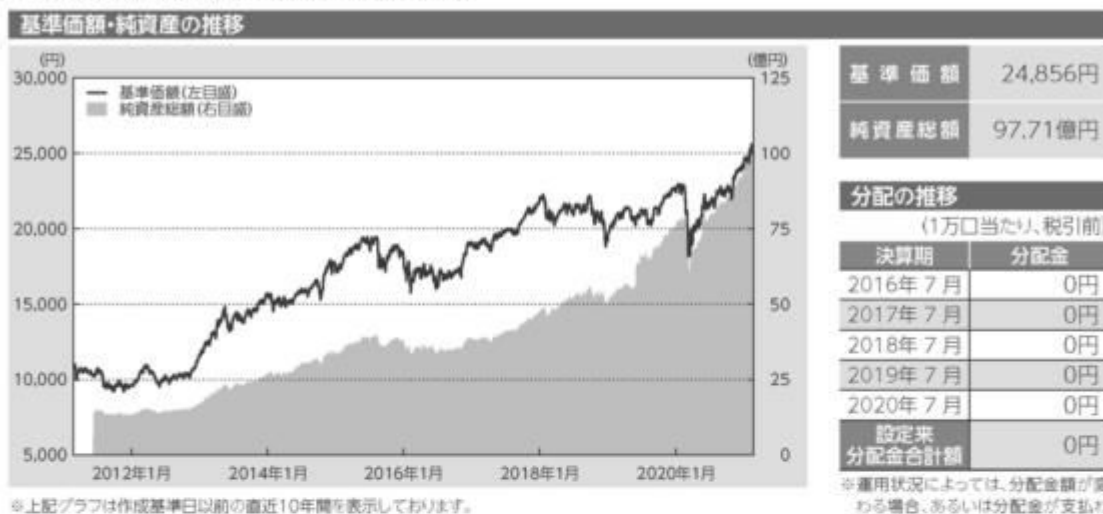
記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

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

当初設定日：2010年10月20日

作成基準日：2021年2月26日

インデックスコレクション(バランス株式70)



主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本株式 マザーファンド	40.3%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.2%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	1.2%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	1.1%
外国株式 マザーファンド	31.2%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェア及びサービス	-	-	1.3%
		MICROSOFT CORP.	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.0%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.8%
日本債券 マザーファンド	24.1%	第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/09/20	0.4%
		第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2025/09/20	0.4%
		第360回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2030/09/20	0.3%
外国債券 マザーファンド	4.0%	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.0%
		T 1.5% 09/30/24	アメリカ	国債	-	1.500%	2024/09/30	0.0%
		T 2.125% 05/15/25	アメリカ	国債	-	2.125%	2025/05/15	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に

規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

< 申込受付の中止等 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより、支払は翌営業日となります。

< 受付不可日 >

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

<一部解約受付の中止等>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことができます。

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

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

計算日の基準価額で評価します。

B．国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

D．公社債等

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

イ．日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

ロ．金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

ハ．価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2010年10月20日設定）

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

（4）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年7月26日から翌年7月25日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は2010年10月20日から2011年7月25日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期

間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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

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

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びそ

の内容を監督官庁に届け出ます。

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

(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ものを除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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【財務諸表】

【インデックスコレクション（バランス株式30）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2019年7月26日から2020年7月27日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (2019年 7月25日現在)	第10期 (2020年 7月27日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	210,113,901	635,727,697
親投資信託受益証券	58,665,789,982	111,665,613,936
未収入金	55,938,508	110,390,988
流動資産合計	58,931,842,391	112,411,732,621
負債の部		
流動負債		
未払解約金	27,700,015	41,763,279
未払受託者報酬	5,850,634	12,056,062
未払委託者報酬	43,879,730	72,336,325
未払利息	486	640
その他未払費用	869,242	1,047,864
流動負債合計	78,300,107	127,204,170
負債合計	78,300,107	127,204,170
純資産の部		
元本等		
元本	37,905,869,352	71,224,303,613
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	20,947,672,932	41,060,224,838
(分配準備積立金)	4,547,594,885	5,062,621,653
元本等合計	58,853,542,284	112,284,528,451
純資産合計	58,853,542,284	112,284,528,451
負債純資産合計	58,931,842,391	112,411,732,621

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期		第10期	
	自	2018年 7月26日	自	2019年 7月26日
	至	2019年 7月25日	至	2020年 7月27日
営業収益				
受取利息		93		1,981
有価証券売買等損益		676,907,107		476,009,399
営業収益合計		676,907,200		476,011,380
営業費用				
支払利息		139,753		202,865
受託者報酬		11,177,013		19,325,422
委託者報酬		83,827,440		120,876,131
その他費用		1,745,619		1,972,325
営業費用合計		96,889,825		142,376,743
営業利益又は営業損失（ ）		580,017,375		333,634,637
経常利益又は経常損失（ ）		580,017,375		333,634,637
当期純利益又は当期純損失（ ）		580,017,375		333,634,637
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（ ）		11,356,500		69,465,747
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		16,496,927,210		20,947,672,932
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,475,423,518		23,740,842,748
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,475,423,518		23,740,842,748
剰余金減少額又は欠損金増加額		616,051,671		4,031,391,226
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		616,051,671		4,031,391,226
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		20,947,672,932		41,060,224,838

(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7月26日から翌年7月25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10期計算期間は2019年 7月26日から2020年 7月27日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第9期 (2019年 7月25日現在)	第10期 (2020年 7月27日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	37,905,869,352口	71,224,303,613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) 1.5526円 (15,526円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5765円 (15,765円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期 自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日			第10期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27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	674,815,560円	費用控除後の配当等収益額	A	1,110,754,872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	- 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	- 円
収益調整金額	C	16,400,078,047円	収益調整金額	C	35,997,603,185円
分配準備積立金額	D	3,872,779,325円	分配準備積立金額	D	3,951,866,781円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	20,947,672,932円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	41,060,224,838円
当ファンドの期末残存口数	F	37,905,869,352口	当ファンドの期末残存口数	F	71,224,303,613口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,526円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,764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
収益分配金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金額	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10期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第10期 (2020年 7月27日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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9期	第10期
	自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日	自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	30,549,685,273円	37,905,869,352円
期中追加設定元本額	8,500,605,703円	40,477,320,641円
期中一部解約元本額	1,144,421,624円	7,158,886,380円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第9期 (2019年 7月25日現在)	第10期 (2020年 7月27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	736,471,552	518,597,203
合計	736,471,552	518,597,203

（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	13,085,065,639	22,614,918,943	
	日本債券マザーファンド	47,943,227,126	66,046,589,688	
	外国株式マザーファンド	4,002,232,951	11,658,504,586	
	外国債券マザーファンド	4,417,036,798	11,345,600,719	
合計		69,447,562,514	111,665,613,936	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【インデックスコレクション（バランス株式50）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2019年7月26日から2020年7月27日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (2019年 7月25日現在)	第10期 (2020年 7月27日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	41,614,289	79,638,793
親投資信託受益証券	11,630,883,047	13,848,096,851
未収入金	30,642,730	7,596,906
流動資産合計	11,703,140,066	13,935,332,550
資産合計	11,703,140,066	13,935,332,550
負債の部		
流動負債		
未払解約金	23,716,942	1,353,173
未払受託者報酬	1,043,473	1,436,534
未払委託者報酬	8,347,710	8,619,127
未払利息	96	80
その他未払費用	260,813	359,079
流動負債合計	33,369,034	11,767,993
負債合計	33,369,034	11,767,993
純資産の部		
元本等		
元本	6,339,102,081	7,380,420,310
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	5,330,668,951	6,543,144,247
(分配準備積立金)	1,880,510,728	1,964,640,384
元本等合計	11,669,771,032	13,923,564,557
純資産合計	11,669,771,032	13,923,564,557
負債純資産合計	11,703,140,066	13,935,332,550

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期		第10期	
	自	2018年 7月26日 至 2019年 7月25日	自	2019年 7月26日 至 2020年 7月27日
営業収益				
受取利息		15		270
有価証券売買等損益		64,622,871		338,258,885
営業収益合計		64,622,886		338,259,155
営業費用				
支払利息		26,408		29,961
受託者報酬		1,993,048		2,799,239
委託者報酬		15,944,249		18,093,790
その他費用		499,775		699,844
営業費用合計		18,463,480		21,622,834
営業利益又は営業損失（ ）		46,159,406		316,636,321
経常利益又は経常損失（ ）		46,159,406		316,636,321
当期純利益又は当期純損失（ ）		46,159,406		316,636,321
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（ ）		12,860,824		3,268,237
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,965,572,298		5,330,668,951
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,608,393,762		1,405,146,161
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,608,393,762		1,405,146,161
剰余金減少額又は欠損金増加額		302,317,339		512,575,423
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		302,317,339		512,575,423
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,330,668,951		6,543,144,247

(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7月26日から翌年7月25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10期計算期間は2019年7月26日から2020年7月27日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第9期 (2019年7月25日現在)	第10期 (2020年7月27日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	6,339,102,081口	7,380,420,310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) 1.8409円 (18,409円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8866円 (18,866円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期 自 2018年7月26日 至 2019年7月25日			第10期 自 2019年7月26日 至 2020年7月27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	143,138,228円	費用控除後の配当等収益額	A	200,782,479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	- 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	42,105,581円
収益調整金額	C	3,450,158,223円	収益調整金額	C	4,578,503,863円
分配準備積立金額	D	1,737,372,500円	分配準備積立金額	D	1,721,752,324円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,330,668,951円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,543,144,247円
当ファンドの期末残存口数	F	6,339,102,081口	当ファンドの期末残存口数	F	7,380,420,310口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,409円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,865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10期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第10期 (2020年 7月27日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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9期	第10期
	自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日	自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,692,611,118円	6,339,102,081円
期中追加設定元本額	2,005,968,696円	1,649,045,263円
期中一部解約元本額	359,477,733円	607,727,034円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第9期 (2019年 7月25日現在)	第10期 (2020年 7月27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	82,641,416	345,251,931
合計	82,641,416	345,251,931

（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	2,383,317,353	4,119,087,381	
	日本債券マザーファンド	3,941,676,301	5,430,053,272	
	外国株式マザーファンド	993,324,574	2,893,554,484	
	外国債券マザーファンド	547,146,973	1,405,401,714	
合計		7,865,465,201	13,848,096,851	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【インデックスコレクション（バランス株式70）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2019年7月26日から2020年7月27日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (2019年 7月25日現在)	第10期 (2020年 7月27日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	27,032,067	39,629,773
親投資信託受益証券	6,606,504,116	7,927,234,485
未収入金	779,213	9,106,729
流動資産合計	6,634,315,396	7,975,970,987
資産合計	6,634,315,396	7,975,970,987
負債の部		
流動負債		
未払解約金	994,022	4,263,269
未払受託者報酬	617,076	809,883
未払委託者報酬	5,245,088	4,859,231
未払利息	62	39
その他未払費用	154,211	202,410
流動負債合計	7,010,459	10,134,832
負債合計	7,010,459	10,134,832
純資産の部		
元本等		
元本	3,120,001,692	3,642,734,613
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,507,303,245	4,323,101,542
(分配準備積立金)	1,009,233,149	955,934,005
元本等合計	6,627,304,937	7,965,836,155
純資産合計	6,627,304,937	7,965,836,155
負債純資産合計	6,634,315,396	7,975,970,987

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期		第10期	
	自	2018年 7月26日	自	2019年 7月26日
	至	2019年 7月25日	至	2020年 7月27日
営業収益				
受取利息		10		155
有価証券売買等損益		21,215,652		220,698,990
営業収益合計		21,215,642		220,699,145
営業費用				
支払利息		17,410		17,595
受託者報酬		1,193,124		1,587,978
委託者報酬		10,141,487		10,445,426
その他費用		299,263		396,956
営業費用合計		11,651,284		12,447,955
営業利益又は営業損失（ ）		32,866,926		208,251,190
経常利益又は経常損失（ ）		32,866,926		208,251,190
当期純利益又は当期純損失（ ）		32,866,926		208,251,190
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（ ）		21,837,008		16,083,589
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,831,240,462		3,507,303,245
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,109,346,256		1,390,615,450
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,109,346,256		1,390,615,450
剰余金減少額又は欠損金増加額		422,253,555		799,151,932
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		422,253,555		799,151,932
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,507,303,245		4,323,101,542

(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7月26日から翌年7月25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10期計算期間は2019年7月26日から2020年7月27日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第9期 (2019年7月25日現在)	第10期 (2020年7月27日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,120,001,692口	3,642,734,613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) 2.1241円 (21,241円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.1868円 (21,868円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期 自 2018年7月26日 至 2019年7月25日			第10期 自 2019年7月26日 至 2020年7月27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	96,553,106円	費用控除後の配当等収益額	A	127,774,497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	- 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	9,267,378円
収益調整金額	C	2,498,070,096円	収益調整金額	C	3,367,167,537円
分配準備積立金額	D	912,680,043円	分配準備積立金額	D	818,892,130円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,507,303,245円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,323,101,542円
当ファンドの期末残存口数	F	3,120,001,692口	当ファンドの期末残存口数	F	3,642,734,613口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	11,241円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	11,867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10期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第10期 (2020年 7月27日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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9期	第10期
	自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日	自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,457,866,262円	3,120,001,692円
期中追加設定元本額	1,031,236,687円	1,230,292,042円
期中一部解約元本額	369,101,257円	707,559,121円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第9期	第10期
	(2019年 7月25日現在)	(2020年 7月27日現在)
	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	10,239,504	251,862,104
合計	10,239,504	251,862,104

（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	1,834,147,653	3,169,957,388	
	日本債券マザーファンド	1,393,269,304	1,919,367,793	
	外国株式マザーファンド	847,229,378	2,467,979,178	
	外国債券マザーファンド	144,020,138	369,930,126	
合計		4,218,666,473	7,927,234,485	

(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

	2020年 7月27日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,685,622,764
株式	242,055,356,100
派生商品評価勘定	14,659,800
未収入金	29,729,500
未収配当金	367,626,198
前払金	7,450,900
差入委託証拠金	66,884,300
流動資産合計	244,227,329,562
資産合計	244,227,329,562
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,118,400
未払解約金	194,068,400
未払利息	1,699
流動負債合計	216,188,499
負債合計	216,188,499
純資産の部	

	2020年 7月27日現在
項目	金額（円）
元本等	
元本	141,188,957,091
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	102,822,183,972
元本等合計	244,011,141,063
純資産合計	244,011,141,063
負債純資産合計	244,227,329,562

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 7月27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）

	2020年 7月27日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	141,188,957,091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 1.7283円 (1万口当たり純資産額) (17,283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

	2020年 7月27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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2020年 7月27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。

	2020年 7月27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	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 7月27日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	132,121,145,523円
期中追加設定元本額	30,005,424,209円
期中一部解約元本額	20,937,612,641円
期末元本額	141,188,957,091円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	685,120,870円
D C 日本株式インデックスファンド	316,226,306円
D C 日本株式インデックスファンド L	53,828,032,728円
D C 日本株式インデックスファンド A	1,046,394,666円
D C バランスファンド 3 0	2,356,797,991円
D C バランスファンド 5 0	3,591,387,758円
D C バランスファンド 7 0	1,908,058,711円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	609,680,554円
日本株式インデックス e	1,639,873,322円
インデックスコレクション（国内株式）	18,779,665,103円

区分	2020年 7月27日現在
インデックスコレクション（バランス株式30）	13,085,065,639円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,383,317,353円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,834,147,653円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,561,299,634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）	2,687,745,204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）	1,364,532,003円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	79,868,931円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	907,297,792円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	109,087,666円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	385,096,402円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	3,538,484円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	761,543,953円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,111,559,493円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	588,732,400円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	9,731,258,805円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	850,404,996円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	130,746,682円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,636,302,663円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	43,472,978円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	194,239,331円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,503,042,391円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	76,498,383円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	78,986,563円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	39,948,949円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	900,548,362円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	394,847,426円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	6,621,219,697円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	123,878,361円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	53,114,218円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	11,864,808円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	172,518,631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）	1,993,231円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 7月27日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	22,207,367,164
合計	22,207,367,164

(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

（2020年 7月27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	2,122,640,900	-	2,115,190,000	7,450,900
合計		2,122,640,900	-	2,115,190,000	7,450,900

（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。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,200	2,720.00	14,144,000	
日本水産	148,800	468.00	69,638,400	
マルハニチロ	21,500	2,142.00	46,053,000	
カネコ種苗	4,500	1,450.00	6,525,000	
サカタのタネ	17,700	3,335.00	59,029,500	
ホクト	11,300	2,100.00	23,730,000	
ホクリヨウ	2,300	641.00	1,474,300	
住石ホールディングス	30,000	126.00	3,780,000	
日鉄鉱業	3,400	4,365.00	14,841,000	
三井松島ホールディングス	5,800	772.00	4,477,600	
国際石油開発帝石	596,800	668.00	398,662,400	
石油資源開発	19,400	1,859.00	36,064,600	
K & O エナジーグループ	7,200	1,527.00	10,994,400	
ヒノキヤグループ	3,700	1,560.00	5,772,000	
ショーボンドホールディングス	23,200	4,790.00	111,128,000	
ミライト・ホールディングス	44,200	1,598.00	70,631,600	
タマホーム	8,000	1,189.00	9,512,000	
サンヨーホームズ	1,300	612.00	795,600	
日本アクア	5,900	638.00	3,764,200	

ファーストコーポレーション	4,500	600.00	2,700,000	
ベストエラ	2,600	1,009.00	2,623,400	
TATERU	30,700	164.00	5,034,800	
キャンディル	2,500	562.00	1,405,000	
スペースバリューホールディングス	18,100	365.00	6,606,500	
ダイセキ環境ソリューション	2,900	706.00	2,047,400	
第一カッター興業	1,800	2,511.00	4,519,800	
明豊ファシリティワークス	4,800	595.00	2,856,000	
安藤・間	88,600	601.00	53,248,600	
東急建設	43,600	542.00	23,631,200	
コムシスホールディングス	52,700	3,235.00	170,484,500	
ビーアールホールディングス	16,200	604.00	9,784,800	
高松コンストラクショングループ	9,300	2,322.00	21,594,600	
東建コーポレーション	4,600	7,130.00	32,798,000	
ソネック	1,500	821.00	1,231,500	
ヤマウラ	6,500	835.00	5,427,500	
大成建設	114,500	3,845.00	440,252,500	
大林組	343,500	998.00	342,813,000	
清水建設	348,600	843.00	293,869,800	
飛鳥建設	9,900	1,100.00	10,890,000	
長谷工コーポレーション	133,000	1,307.00	173,831,000	
松井建設	13,500	671.00	9,058,500	
銭高組	1,500	3,980.00	5,970,000	
鹿島建設	269,700	1,239.00	334,158,300	
不動テトラ	9,000	1,428.00	12,852,000	
大末建設	4,000	822.00	3,288,000	
鉄建建設	7,500	2,029.00	15,217,500	
西松建設	26,500	2,102.00	55,703,000	
三井住友建設	83,000	458.00	38,014,000	
大豊建設	7,700	2,418.00	18,618,600	
前田建設工業	86,000	760.00	65,360,000	
佐田建設	7,400	415.00	3,071,000	
ナカノフドー建設	9,400	399.00	3,750,600	
奥村組	18,600	2,589.00	48,155,400	
東鉄工業	14,700	2,711.00	39,851,700	
イチケン	2,500	1,541.00	3,852,500	
富士ピー・エス	5,100	598.00	3,049,800	
浅沼組	3,800	4,210.00	15,998,000	
戸田建設	142,600	705.00	100,533,000	
熊谷組	15,900	2,590.00	41,181,000	
北野建設	2,100	2,671.00	5,609,100	
植木組	1,500	2,444.00	3,666,000	

矢作建設工業	15,200	809.00	12,296,800	
ピーエス三菱	11,300	520.00	5,876,000	
日本ハウスホールディングス	23,400	268.00	6,271,200	
大東建託	37,500	10,135.00	380,062,500	
新日本建設	14,600	877.00	12,804,200	
N I P P O	28,400	2,867.00	81,422,800	
東亜道路工業	2,100	3,210.00	6,741,000	
前田道路	30,300	2,009.00	60,872,700	
日本道路	3,300	7,540.00	24,882,000	
東亜建設工業	10,700	1,585.00	16,959,500	
日本国土開発	33,400	560.00	18,704,000	
若築建設	6,200	1,232.00	7,638,400	
東洋建設	38,500	399.00	15,361,500	
五洋建設	136,200	574.00	78,178,800	
世紀東急工業	16,500	748.00	12,342,000	
福田組	4,000	4,915.00	19,660,000	
住友林業	87,000	1,317.00	114,579,000	
日本基礎技術	11,500	403.00	4,634,500	
巴コーポレーション	15,200	343.00	5,213,600	
大和ハウス工業	339,900	2,540.00	863,346,000	
ライト工業	19,700	1,528.00	30,101,600	
積水ハウス	372,600	2,103.50	783,764,100	
日特建設	9,000	788.00	7,092,000	
北陸電気工事	5,900	1,002.00	5,911,800	
ユアテック	19,600	658.00	12,896,800	
日本リーテック	7,200	3,200.00	23,040,000	
四電工	1,900	2,414.00	4,586,600	
中電工	13,800	2,289.00	31,588,200	
関電工	48,900	894.00	43,716,600	
きんでん	81,600	1,716.00	140,025,600	
東京エネシス	11,400	785.00	8,949,000	
トーエネック	3,500	3,695.00	12,932,500	
住友電設	9,700	2,389.00	23,173,300	
日本電設工業	18,800	2,381.00	44,762,800	
協和エクシオ	52,100	2,625.00	136,762,500	
新日本空調	9,100	2,389.00	21,739,900	
九電工	24,100	3,205.00	77,240,500	
三機工業	24,800	1,263.00	31,322,400	
日揮ホールディングス	105,700	1,144.00	120,920,800	
中外炉工業	3,700	1,647.00	6,093,900	
ヤマト	11,000	657.00	7,227,000	
太平電業	8,300	2,169.00	18,002,700	

高砂熱学工業	29,800	1,525.00	45,445,000
三晃金属工業	1,500	2,097.00	3,145,500
朝日工業社	2,300	3,170.00	7,291,000
明星工業	22,200	891.00	19,780,200
大気社	16,700	3,240.00	54,108,000
ダイダン	8,200	2,807.00	23,017,400
日比谷総合設備	11,100	1,913.00	21,234,300
フィル・カンパニー	2,000	1,837.00	3,674,000
OSJBホールディングス	54,200	244.00	13,224,800
東洋エンジニアリング	14,400	353.00	5,083,200
レイズネクスト	18,400	1,237.00	22,760,800
日本製粉	32,200	1,697.00	54,643,400
日清製粉グループ本社	124,200	1,576.00	195,739,200
日東富士製粉	800	6,050.00	4,840,000
昭和産業	10,100	3,450.00	34,845,000
鳥越製粉	9,700	932.00	9,040,400
中部飼料	13,400	1,674.00	22,431,600
フィード・ワン	73,800	202.00	14,907,600
東洋精糖	1,900	1,194.00	2,268,600
日本甜菜製糖	5,700	1,814.00	10,339,800
三井製糖	9,600	2,032.00	19,507,200
塩水港精糖	11,900	216.00	2,570,400
日新製糖	5,200	1,864.00	9,692,800
森永製菓	25,800	3,965.00	102,297,000
中村屋	2,800	4,100.00	11,480,000
江崎グリコ	32,600	5,030.00	163,978,000
名糖産業	5,300	1,381.00	7,319,300
井村屋グループ	6,200	2,350.00	14,570,000
不二家	6,100	2,188.00	13,346,800
山崎製パン	82,400	1,817.00	149,720,800
第一屋製パン	1,900	983.00	1,867,700
モロゾフ	1,900	5,450.00	10,355,000
亀田製菓	6,300	5,550.00	34,965,000
寿スピリッツ	10,600	4,060.00	43,036,000
カルビー	50,100	3,090.00	154,809,000
森永乳業	20,300	4,835.00	98,150,500
六甲バター	7,300	1,596.00	11,650,800
ヤクルト本社	75,600	6,410.00	484,596,000
明治ホールディングス	72,700	8,440.00	613,588,000
雪印メグミルク	26,500	2,538.00	67,257,000
プリマハム	17,200	2,752.00	47,334,400
日本ハム	42,000	4,325.00	181,650,000

林兼産業	3,600	572.00	2,059,200
丸大食品	11,700	1,943.00	22,733,100
S Foods	8,800	2,564.00	22,563,200
柿安本店	3,800	2,609.00	9,914,200
伊藤ハム米久ホールディングス	70,800	643.00	45,524,400
サッポロホールディングス	37,500	1,935.00	72,562,500
アサヒグループホールディングス	230,200	3,610.00	831,022,000
キリンホールディングス	466,300	2,083.00	971,302,900
宝ホールディングス	81,500	942.00	76,773,000
オエノンホールディングス	29,000	419.00	12,151,000
養命酒製造	3,400	1,828.00	6,215,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	77,200	1,749.00	135,022,800
サントリー食品インターナショナル	73,600	4,135.00	304,336,000
ダイトーグループホールディングス	5,600	4,685.00	26,236,000
伊藤園	33,400	6,290.00	210,086,000
キーコーヒー	10,800	2,216.00	23,932,800
ユニカフェ	2,800	1,015.00	2,842,000
ジャパンフーズ	1,600	1,218.00	1,948,800
日清オイリオグループ	14,100	3,345.00	47,164,500
不二製油グループ本社	26,800	2,849.00	76,353,200
かどや製油	1,200	3,765.00	4,518,000
J - オイルミルズ	5,700	4,080.00	23,256,000
キッコーマン	79,100	4,895.00	387,194,500
味の素	242,800	1,731.50	420,408,200
キューピー	61,200	1,946.00	119,095,200
ハウス食品グループ本社	41,100	3,355.00	137,890,500
カゴメ	41,700	3,140.00	130,938,000
焼津水産化学工業	5,300	900.00	4,770,000
アリアケジャパン	10,000	6,670.00	66,700,000
ピエトロ	1,400	1,650.00	2,310,000
エバラ食品工業	2,700	2,190.00	5,913,000
やまみ	900	2,227.00	2,004,300
ニチレイ	52,400	2,916.00	152,798,400
東洋水産	56,600	6,330.00	358,278,000
イトアンド	3,800	1,800.00	6,840,000
大冷	1,400	2,073.00	2,902,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,100	903.00	5,508,300
日清食品ホールディングス	46,700	9,510.00	444,117,000
永谷園ホールディングス	5,400	2,196.00	11,858,400
一正蒲鉾	4,300	1,003.00	4,312,900
フジッコ	11,900	2,081.00	24,763,900
ロック・フィールド	11,800	1,291.00	15,233,800

日本たばこ産業	634,800	1,897.50	1,204,533,000
ケンコーマヨネーズ	6,200	1,902.00	11,792,400
わらべや日洋ホールディングス	7,200	1,576.00	11,347,200
なとり	6,100	1,820.00	11,102,000
イフジ産業	1,900	834.00	1,584,600
ピククルスコーポレーション	2,400	2,809.00	6,741,600
北の達人コーポレーション	38,400	528.00	20,275,200
ユーグレナ	47,400	766.00	36,308,400
ミヨシ油脂	4,200	1,131.00	4,750,200
理研ビタミン	10,400	2,359.00	24,533,600
片倉工業	15,900	1,137.00	18,078,300
ゲンゼ	8,000	4,055.00	32,440,000
東洋紡	42,600	1,531.00	65,220,600
ユニチカ	32,400	358.00	11,599,200
富士紡ホールディングス	5,300	3,040.00	16,112,000
倉敷紡績	10,800	2,139.00	23,101,200
シキボウ	5,600	1,051.00	5,885,600
日本毛織	35,600	957.00	34,069,200
トーア紡コーポレーション	4,300	482.00	2,072,600
帝国繊維	12,200	2,443.00	29,804,600
帝人	87,700	1,660.00	145,582,000
東レ	777,500	499.30	388,205,750
サカイオーベックス	3,000	2,225.00	6,675,000
住江織物	2,400	1,978.00	4,747,200
日本フェルト	6,800	485.00	3,298,000
イチカワ	1,800	1,300.00	2,340,000
日東製網	1,200	1,397.00	1,676,400
アツギ	9,000	583.00	5,247,000
ダイニック	4,000	787.00	3,148,000
セーレン	26,600	1,328.00	35,324,800
ソトー	4,300	958.00	4,119,400
東海染工	1,500	1,125.00	1,687,500
小松マテーレ	17,700	748.00	13,239,600
ワコールホールディングス	27,600	1,961.00	54,123,600
ホギメディカル	12,300	3,275.00	40,282,500
クラウディアホールディングス	2,800	332.00	929,600
T S Iホールディングス	36,100	322.00	11,624,200
マツオカコーポレーション	3,100	1,853.00	5,744,300
ワールド	15,300	1,398.00	21,389,400
三陽商会	5,600	628.00	3,516,800
ナイガイ	4,100	354.00	1,451,400
オンワードホールディングス	64,700	311.00	20,121,700

ルックホールディングス	3,800	734.00	2,789,200
ゴールドウイン	19,500	6,610.00	128,895,000
デサント	21,000	1,807.00	37,947,000
キング	5,200	535.00	2,782,000
ヤマトインターナショナル	9,600	340.00	3,264,000
特種東海製紙	6,800	4,765.00	32,402,000
王子ホールディングス	448,500	477.00	213,934,500
日本製紙	47,400	1,434.00	67,971,600
三菱製紙	12,200	349.00	4,257,800
北越コーポレーション	64,000	373.00	23,872,000
中越パルプ工業	4,500	1,561.00	7,024,500
巴川製紙所	3,200	879.00	2,812,800
大王製紙	47,300	1,437.00	67,970,100
阿波製紙	2,800	486.00	1,360,800
レンゴー	101,400	833.00	84,466,200
トモク	6,600	1,819.00	12,005,400
ザ・パック	8,100	2,858.00	23,149,800
クラレ	169,000	1,100.00	185,900,000
旭化成	711,100	812.00	577,413,200
共和レザー	5,800	642.00	3,723,600
昭和電工	76,400	2,366.00	180,762,400
住友化学	788,200	332.00	261,682,400
住友精化	4,800	3,430.00	16,464,000
日産化学	59,600	5,700.00	339,720,000
ラサ工業	3,800	1,584.00	6,019,200
クレハ	9,200	4,640.00	42,688,000
多木化学	4,200	7,100.00	29,820,000
テイカ	7,900	1,369.00	10,815,100
石原産業	19,200	731.00	14,035,200
片倉コープアグリ	2,800	1,242.00	3,477,600
日本曹達	15,900	2,846.00	45,251,400
東ソー	165,800	1,479.00	245,218,200
トクヤマ	30,900	2,621.00	80,988,900
セントラル硝子	21,900	2,037.00	44,610,300
東亜合成	67,300	1,087.00	73,155,100
大阪ソーダ	10,900	2,378.00	25,920,200
関東電化工業	25,400	857.00	21,767,800
デンカ	39,200	2,701.00	105,879,200
信越化学工業	184,200	13,525.00	2,491,305,000
日本カーバイド工業	3,700	1,231.00	4,554,700
堺化学工業	6,900	2,140.00	14,766,000
第一稀元素化学工業	11,600	788.00	9,140,800

エア・ウォーター	99,800	1,466.00	146,306,800
大陽日酸	103,100	1,887.00	194,549,700
日本化学工業	3,300	2,228.00	7,352,400
東邦アセチレン	1,600	1,232.00	1,971,200
日本パーカラライジング	54,100	1,124.00	60,808,400
高压ガス工業	17,000	850.00	14,450,000
チタン工業	1,300	1,770.00	2,301,000
四国化成工業	16,500	1,142.00	18,843,000
戸田工業	2,500	1,794.00	4,485,000
ステラ ケミファ	5,800	2,827.00	16,396,600
保土谷化学工業	4,000	4,705.00	18,820,000
日本触媒	16,700	5,580.00	93,186,000
大日精化工業	9,500	2,479.00	23,550,500
カネカ	27,800	2,683.00	74,587,400
三菱瓦斯化学	99,800	1,676.00	167,264,800
三井化学	97,400	2,200.00	214,280,000
J S R	100,000	2,273.00	227,300,000
東京応化工業	18,400	5,720.00	105,248,000
大阪有機化学工業	9,900	2,822.00	27,937,800
三菱ケミカルホールディングス	717,200	622.10	446,170,120
K Hネオケム	18,900	2,127.00	40,200,300
ダイセル	139,700	797.00	111,340,900
住友ベークライト	16,900	2,903.00	49,060,700
積水化学工業	226,900	1,526.00	346,249,400
日本ゼオン	96,800	1,046.00	101,252,800
アイカ工業	32,200	3,620.00	116,564,000
宇部興産	54,200	1,806.00	97,885,200
積水樹脂	19,300	2,234.00	43,116,200
タキロンシーアイ	23,200	707.00	16,402,400
旭有機材	6,100	1,409.00	8,594,900
ニチバン	5,600	1,558.00	8,724,800
リケンテクノス	27,000	421.00	11,367,000
大倉工業	5,100	1,550.00	7,905,000
積水化成成品工業	14,400	573.00	8,251,200
群栄化学工業	2,400	2,437.00	5,848,800
タイガースポリマー	5,600	474.00	2,654,400
ミライアル	3,800	1,114.00	4,233,200
ダイキアクシス	3,800	791.00	3,005,800
ダイキョーニシカワ	22,600	502.00	11,345,200
竹本容器	3,800	705.00	2,679,000
森六ホールディングス	5,800	1,669.00	9,680,200
日本化薬	66,400	1,079.00	71,645,600

カーリットホールディングス	11,500	520.00	5,980,000	
日本精化	8,600	1,459.00	12,547,400	
扶桑化学工業	10,900	4,220.00	45,998,000	
トリケミカル研究所	2,400	11,150.00	26,760,000	
A D E K A	49,400	1,492.00	73,704,800	
日油	40,400	4,000.00	161,600,000	
新日本理化	17,800	164.00	2,919,200	
ハリマ化成グループ	8,900	987.00	8,784,300	
花王	262,300	8,544.00	2,241,091,200	
第一工業製薬	4,000	4,950.00	19,800,000	
石原ケミカル	2,900	2,023.00	5,866,700	
日華化学	3,600	876.00	3,153,600	
ニイタカ	2,200	3,245.00	7,139,000	
三洋化成工業	6,400	4,815.00	30,816,000	
有機合成薬品工業	8,200	358.00	2,935,600	
大日本塗料	12,100	996.00	12,051,600	
日本ペイントホールディングス	88,500	7,640.00	676,140,000	
関西ペイント	120,500	2,156.00	259,798,000	
神東塗料	8,400	167.00	1,402,800	
中国塗料	30,500	866.00	26,413,000	
日本特殊塗料	8,000	1,037.00	8,296,000	
藤倉化成	14,500	554.00	8,033,000	
太陽ホールディングス	7,900	5,160.00	40,764,000	
D I C	45,300	2,728.00	123,578,400	
サカタインクス	23,400	1,063.00	24,874,200	
東洋インキＳＣホールディングス	22,700	2,059.00	46,739,300	
T & K T O K A	8,300	841.00	6,980,300	
富士フイルムホールディングス	210,000	4,777.00	1,003,170,000	
資生堂	217,700	6,615.00	1,440,085,500	
ライオン	142,400	2,771.00	394,590,400	
高砂香料工業	6,900	2,167.00	14,952,300	
マンダム	24,600	1,861.00	45,780,600	
ミルボン	14,600	5,080.00	74,168,000	
ファンケル	44,300	3,195.00	141,538,500	
コーセー	20,600	12,030.00	247,818,000	
コタ	6,300	1,210.00	7,623,000	
シーボン	1,400	1,913.00	2,678,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	46,800	1,752.00	81,993,600	
ノエビアホールディングス	9,300	4,570.00	42,501,000	
アジュバンコスメジャパン	2,400	939.00	2,253,600	
エステー	7,000	1,850.00	12,950,000	
アグロ カネショウ	4,600	1,433.00	6,591,800	

コニシ	18,000	1,513.00	27,234,000
長谷川香料	18,900	2,291.00	43,299,900
星光P M C	6,300	735.00	4,630,500
小林製薬	30,700	9,100.00	279,370,000
荒川化学工業	9,800	1,258.00	12,328,400
メック	7,500	2,023.00	15,172,500
日本高純度化学	3,000	2,585.00	7,755,000
タカラバイオ	28,700	2,914.00	83,631,800
J C U	13,300	3,270.00	43,491,000
新田ゼラチン	6,900	667.00	4,602,300
O A T アグリオ	1,900	1,082.00	2,055,800
デクセリアルズ	28,300	878.00	24,847,400
アース製薬	8,300	7,370.00	61,171,000
北興化学工業	11,200	602.00	6,742,400
大成ラミック	3,600	2,790.00	10,044,000
クミアイ化学工業	45,300	1,079.00	48,878,700
日本農薬	19,500	537.00	10,471,500
アキレス	7,600	1,942.00	14,759,200
有沢製作所	17,300	796.00	13,770,800
日東電工	75,600	6,290.00	475,524,000
レック	11,700	1,621.00	18,965,700
三光合成	12,500	277.00	3,462,500
きもと	18,600	180.00	3,348,000
藤森工業	9,800	3,585.00	35,133,000
前澤化成工業	7,000	1,002.00	7,014,000
未来工業	5,900	1,926.00	11,363,400
ウェーブロックホールディングス	3,800	825.00	3,135,000
J S P	6,400	1,485.00	9,504,000
エフピコ	12,000	8,520.00	102,240,000
天馬	7,300	1,682.00	12,278,600
信越ポリマー	19,700	1,002.00	19,739,400
東リ	27,300	272.00	7,425,600
ニフコ	40,200	2,518.00	101,223,600
バルカー	8,900	1,917.00	17,061,300
ユニ・チャーム	211,100	4,779.00	1,008,846,900
ショーエイコーポレーション	1,600	959.00	1,534,400
協和キリン	110,200	2,686.00	295,997,200
武田薬品工業	911,400	3,807.00	3,469,699,800
アステラス製薬	949,700	1,739.50	1,652,003,150
大日本住友製薬	81,200	1,376.00	111,731,200
塩野義製薬	137,800	6,374.00	878,337,200
わかもと製薬	13,000	267.00	3,471,000

あすか製薬	12,500	1,200.00	15,000,000
日本新薬	28,700	8,430.00	241,941,000
ピオフェルミン製薬	1,900	2,415.00	4,588,500
中外製薬	342,600	5,095.00	1,745,547,000
科研製薬	18,700	4,985.00	93,219,500
エーザイ	131,100	8,746.00	1,146,600,600
ロート製薬	56,200	3,355.00	188,551,000
小野薬品工業	251,600	3,039.00	764,612,400
久光製薬	29,000	4,780.00	138,620,000
持田製薬	15,200	3,965.00	60,268,000
参天製薬	204,100	1,872.00	382,075,200
扶桑薬品工業	3,900	2,490.00	9,711,000
日本ケミファ	1,400	2,549.00	3,568,600
ツムラ	33,900	2,754.00	93,360,600
日医工	31,000	1,292.00	40,052,000
キッセイ薬品工業	19,400	2,306.00	44,736,400
生化学工業	21,300	1,092.00	23,259,600
栄研化学	19,300	1,677.00	32,366,100
日水製薬	4,600	1,137.00	5,230,200
鳥居薬品	6,900	3,500.00	24,150,000
JCRファーマ	7,700	10,380.00	79,926,000
東和薬品	14,000	1,987.00	27,818,000
富士製薬工業	7,400	1,155.00	8,547,000
沢井製薬	22,500	5,330.00	119,925,000
ゼリア新薬工業	19,900	1,932.00	38,446,800
第一三共	313,500	8,666.00	2,716,791,000
キョーリン製薬ホールディングス	24,200	2,010.00	48,642,000
大幸薬品	13,400	2,170.00	29,078,000
ダイト	6,700	3,145.00	21,071,500
大塚ホールディングス	208,700	4,508.00	940,819,600
大正製薬ホールディングス	23,200	6,350.00	147,320,000
ペプチドリーム	55,700	4,520.00	251,764,000
日本コークス工業	92,500	65.00	6,012,500
ニチレキ	12,900	1,681.00	21,684,900
ユシロ化学工業	6,100	1,330.00	8,113,000
ビーピー・カストロール	3,900	1,153.00	4,496,700
富士石油	29,200	164.00	4,788,800
MORESCO	4,000	1,021.00	4,084,000
出光興産	121,600	2,307.00	280,531,200
ENEOSホールディングス	1,647,800	392.80	647,255,840
コスモエネルギーホールディングス	31,700	1,640.00	51,988,000
横浜ゴム	63,400	1,520.00	96,368,000

TOYO TIRE	62,900	1,497.00	94,161,300
ブリヂストン	315,500	3,428.00	1,081,534,000
住友ゴム工業	98,400	980.00	96,432,000
藤倉コンポジット	9,600	382.00	3,667,200
オカモト	6,700	4,210.00	28,207,000
フコク	4,800	630.00	3,024,000
ニッタ	12,400	2,337.00	28,978,800
住友理工	21,200	585.00	12,402,000
三ツ星ベルト	14,400	1,867.00	26,884,800
バンドー化学	19,300	666.00	12,853,800
日東紡績	16,300	5,050.00	82,315,000
A G C	108,300	3,095.00	335,188,500
日本板硝子	52,400	402.00	21,064,800
石塚硝子	2,000	1,837.00	3,674,000
日本山村硝子	4,600	879.00	4,043,400
日本電気硝子	44,000	1,724.00	75,856,000
オハラ	4,400	1,037.00	4,562,800
住友大阪セメント	20,700	3,740.00	77,418,000
太平洋セメント	69,200	2,433.00	168,363,600
日本ヒューム	11,000	802.00	8,822,000
日本コンクリート工業	23,700	278.00	6,588,600
三谷セキサン	5,100	5,700.00	29,070,000
アジアパイルホールディングス	15,600	490.00	7,644,000
東海カーボン	114,800	970.00	111,356,000
日本カーボン	5,600	3,480.00	19,488,000
東洋炭素	6,400	1,759.00	11,257,600
ノリタケカンパニーリミテド	6,100	3,340.00	20,374,000
T O T O	78,300	4,200.00	328,860,000
日本碍子	131,500	1,460.00	191,990,000
日本特殊陶業	83,300	1,550.00	129,115,000
M A R U W A	4,200	8,610.00	36,162,000
品川リフラクトリーズ	2,900	2,241.00	6,498,900
黒崎播磨	2,200	3,540.00	7,788,000
ヨータイ	8,700	730.00	6,351,000
イソライト工業	5,700	434.00	2,473,800
東京窯業	14,000	311.00	4,354,000
ニッカトー	5,000	730.00	3,650,000
フジミインコーポレーテッド	9,800	3,630.00	35,574,000
クニミネ工業	4,400	988.00	4,347,200
エーアンドエーマテリアル	1,900	1,036.00	1,968,400
ニチアス	30,000	2,432.00	72,960,000
ニチハ	15,200	2,360.00	35,872,000

日本製鉄	484,800	985.50	477,770,400
神戸製鋼所	198,400	383.00	75,987,200
中山製鋼所	15,200	369.00	5,608,800
合同製鐵	5,900	1,813.00	10,696,700
ジェイ エフ イー ホールディングス	292,600	786.00	229,983,600
東京製鐵	52,800	640.00	33,792,000
共英製鋼	12,300	1,281.00	15,756,300
大和工業	23,000	2,231.00	51,313,000
東京鐵鋼	4,500	1,532.00	6,894,000
大阪製鐵	5,800	1,232.00	7,145,600
淀川製鋼所	14,700	1,920.00	28,224,000
丸一鋼管	35,200	2,675.00	94,160,000
モリ工業	3,300	2,254.00	7,438,200
大同特殊鋼	17,700	3,495.00	61,861,500
日本高周波鋼業	4,100	337.00	1,381,700
日本冶金工業	9,000	1,596.00	14,364,000
山陽特殊製鋼	7,500	879.00	6,592,500
愛知製鋼	6,100	2,896.00	17,665,600
日立金属	116,700	1,353.00	157,895,100
日本金属	2,500	597.00	1,492,500
大平洋金属	7,400	1,601.00	11,847,400
新日本電工	70,100	153.00	10,725,300
栗本鐵工所	5,400	1,646.00	8,888,400
虹技	1,600	1,278.00	2,044,800
三菱製鋼	8,100	612.00	4,957,200
日亜鋼業	16,000	303.00	4,848,000
日本精線	1,800	3,545.00	6,381,000
エンビプロ・ホールディングス	4,700	528.00	2,481,600
シンニッタン	17,000	233.00	3,961,000
新家工業	2,500	1,186.00	2,965,000
大紀アルミニウム工業所	18,000	549.00	9,882,000
日本軽金属ホールディングス	274,700	186.00	51,094,200
三井金属鋳業	29,300	2,377.00	69,646,100
東邦亜鉛	5,600	1,626.00	9,105,600
三菱マテリアル	71,600	2,283.00	163,462,800
住友金属鋳山	138,500	3,309.00	458,296,500
D O W A ホールディングス	27,400	3,255.00	89,187,000
古河機械金属	19,400	1,108.00	21,495,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,400	916.00	10,442,400
東邦チタニウム	19,600	676.00	13,249,600
U A C J	16,500	1,878.00	30,987,000
C K サンエツ	2,300	3,095.00	7,118,500

古河電気工業	33,700	2,628.00	88,563,600
住友電気工業	405,100	1,258.50	509,818,350
フジクラ	130,800	314.00	41,071,200
昭和電線ホールディングス	12,600	1,313.00	16,543,800
東京特殊電線	1,700	2,290.00	3,893,000
タツタ電線	21,700	567.00	12,303,900
カナレ電気	1,900	1,698.00	3,226,200
平河ヒューテック	5,500	964.00	5,302,000
リョービ	13,400	1,160.00	15,544,000
アーレスティ	14,500	360.00	5,220,000
アサヒホールディングス	19,000	3,145.00	59,755,000
稲葉製作所	6,100	1,426.00	8,698,600
宮地エンジニアリンググループ	3,300	1,643.00	5,421,900
トーカロ	30,100	1,211.00	36,451,100
アルファC o	3,800	952.00	3,617,600
SUMCO	128,700	1,669.00	214,800,300
川田テクノロジーズ	2,200	4,650.00	10,230,000
RS Technologies	3,100	3,950.00	12,245,000
信和	6,200	707.00	4,383,400
東洋製罐グループホールディングス	69,000	1,216.00	83,904,000
ホッカンホールディングス	6,000	1,853.00	11,118,000
コロナ	6,000	1,023.00	6,138,000
横河ブリッジホールディングス	20,100	2,083.00	41,868,300
駒井ハルテック	2,000	1,378.00	2,756,000
高田機工	1,000	2,417.00	2,417,000
三和ホールディングス	102,100	923.00	94,238,300
文化シャッター	31,900	719.00	22,936,100
三協立山	14,000	924.00	12,936,000
アルインコ	7,900	922.00	7,283,800
東洋シャッター	2,600	700.00	1,820,000
LIXILグループ	159,800	1,533.00	244,973,400
日本フィルコン	8,300	484.00	4,017,200
ノーリツ	22,500	1,356.00	30,510,000
長府製作所	11,000	2,270.00	24,970,000
リンナイ	21,100	8,980.00	189,478,000
ダイニチ工業	5,800	674.00	3,909,200
日東精工	15,000	452.00	6,780,000
三洋工業	1,400	1,962.00	2,746,800
岡部	22,000	826.00	18,172,000
ジーテクト	13,400	970.00	12,998,000
東プレ	20,200	1,148.00	23,189,600
高周波熱錬	20,800	520.00	10,816,000

東京製綱	7,700	571.00	4,396,700	
サンコール	8,100	415.00	3,361,500	
モリテック スチール	8,400	308.00	2,587,200	
パイオラックス	16,000	1,620.00	25,920,000	
エイチワン	10,600	558.00	5,914,800	
日本発條	116,200	667.00	77,505,400	
中央発條	1,300	2,722.00	3,538,600	
アドバネクス	1,600	1,385.00	2,216,000	
立川ブラインド工業	4,800	1,200.00	5,760,000	
三益半導体工業	8,500	2,359.00	20,051,500	
日本ドライケミカル	2,700	1,637.00	4,419,900	
日本製鋼所	32,900	1,590.00	52,311,000	
三浦工業	46,900	4,195.00	196,745,500	
タクマ	36,800	1,506.00	55,420,800	
ツガミ	22,600	941.00	21,266,600	
オークマ	12,700	4,600.00	58,420,000	
芝浦機械	12,300	2,114.00	26,002,200	
アマダ	134,500	780.00	104,910,000	
アイダエンジニアリング	28,500	720.00	20,520,000	
滝澤鉄工所	3,400	1,035.00	3,519,000	
F U J I	46,600	1,990.00	92,734,000	
牧野フライス製作所	12,700	3,505.00	44,513,500	
オーエスジー	50,100	1,620.00	81,162,000	
ダイジェット工業	1,300	1,472.00	1,913,600	
旭ダイヤモンド工業	28,600	483.00	13,813,800	
D M G 森精機	68,600	1,257.00	86,230,200	
ソディック	25,500	867.00	22,108,500	
ディスコ	14,700	26,810.00	394,107,000	
日東工器	6,000	2,079.00	12,474,000	
日進工具	4,300	2,717.00	11,683,100	
パンチ工業	9,900	429.00	4,247,100	
富士ダイス	4,900	708.00	3,469,200	
豊和工業	6,100	824.00	5,026,400	
O K K	4,400	373.00	1,641,200	
東洋機械金属	7,900	408.00	3,223,200	
津田駒工業	2,200	860.00	1,892,000	
エンシュウ	2,700	936.00	2,527,200	
島精機製作所	17,100	1,410.00	24,111,000	
オプトラン	12,100	2,473.00	29,923,300	
N C ホールディングス	3,400	579.00	1,968,600	
イワキポンプ	6,900	969.00	6,686,100	
フリュー	10,600	975.00	10,335,000	

ヤマシンフィルタ	23,600	1,033.00	24,378,800
日阪製作所	13,400	789.00	10,572,600
やまびこ	21,100	970.00	20,467,000
平田機工	5,100	6,230.00	31,773,000
ペガサスミシン製造	11,200	310.00	3,472,000
マルマエ	4,100	1,020.00	4,182,000
タツモ	5,100	1,652.00	8,425,200
ナブテスコ	63,900	3,495.00	223,330,500
三井海洋開発	11,500	1,570.00	18,055,000
レオン自動機	10,700	1,324.00	14,166,800
S M C	34,400	58,420.00	2,009,648,000
ホソカワミクロン	3,800	6,080.00	23,104,000
ユニオンツール	4,100	2,743.00	11,246,300
オイレス工業	14,000	1,485.00	20,790,000
日精エー・エス・ビー機械	3,200	2,939.00	9,404,800
サトーホールディングス	15,500	2,345.00	36,347,500
技研製作所	9,500	4,290.00	40,755,000
日本エアージェット	3,900	1,401.00	5,463,900
カワタ	3,300	751.00	2,478,300
日精樹脂工業	9,200	825.00	7,590,000
オカダアイヨン	3,500	932.00	3,262,000
ワイエイシイホールディングス	4,600	707.00	3,252,200
小松製作所	496,200	2,344.50	1,163,340,900
住友重機械工業	62,700	2,350.00	147,345,000
日立建機	43,900	3,290.00	144,431,000
日工	15,100	634.00	9,573,400
巴工業	4,700	1,887.00	8,868,900
井関農機	11,000	1,221.00	13,431,000
T O W A	11,100	1,382.00	15,340,200
丸山製作所	2,300	1,236.00	2,842,800
北川鉄工所	5,000	1,625.00	8,125,000
ローツェ	4,800	5,900.00	28,320,000
タカキタ	3,900	648.00	2,527,200
クボタ	581,200	1,611.00	936,313,200
荏原実業	2,800	2,907.00	8,139,600
三菱化工機	3,800	1,875.00	7,125,000
月島機械	20,300	1,224.00	24,847,200
帝国電機製作所	9,100	1,226.00	11,156,600
新東工業	26,100	761.00	19,862,100
澁谷工業	9,600	2,940.00	28,224,000
アイチ コーポレーション	19,100	805.00	15,375,500
小森コーポレーション	27,900	733.00	20,450,700

鶴見製作所	8,500	1,894.00	16,099,000
住友精密工業	1,700	2,272.00	3,862,400
日本ギア工業	4,600	281.00	1,292,600
酒井重工業	2,100	2,240.00	4,704,000
荏原製作所	45,400	2,706.00	122,852,400
石井鐵工所	1,500	2,515.00	3,772,500
西島製作所	11,200	896.00	10,035,200
北越工業	11,300	1,195.00	13,503,500
ダイキン工業	139,600	19,365.00	2,703,354,000
オルガノ	4,000	5,590.00	22,360,000
トーヨーカネツ	4,800	2,125.00	10,200,000
栗田工業	59,300	3,020.00	179,086,000
椿本チエイン	15,700	2,666.00	41,856,200
大同工業	5,400	635.00	3,429,000
木村化工機	9,400	443.00	4,164,200
アネスト岩田	17,100	847.00	14,483,700
ダイフク	56,000	9,960.00	557,760,000
サムコ	2,800	2,935.00	8,218,000
加藤製作所	6,100	1,281.00	7,814,100
油研工業	1,900	1,562.00	2,967,800
タダノ	53,000	912.00	48,336,000
フジテック	39,800	1,827.00	72,714,600
C K D	30,100	2,184.00	65,738,400
キトー	8,300	1,211.00	10,051,300
平和	30,600	1,850.00	56,610,000
理想科学工業	9,700	1,431.00	13,880,700
S A N K Y O	24,400	2,738.00	66,807,200
日本金銭機械	12,200	572.00	6,978,400
マースグループホールディングス	7,000	1,687.00	11,809,000
フクシマガリレイ	6,800	3,345.00	22,746,000
オーイズミ	4,700	378.00	1,776,600
ダイコク電機	5,100	1,289.00	6,573,900
竹内製作所	18,400	1,918.00	35,291,200
アマノ	28,700	2,191.00	62,881,700
J U K I	15,200	500.00	7,600,000
蛇の目マシン工業	10,100	463.00	4,676,300
マックス	16,800	1,551.00	26,056,800
グローリー	28,200	2,498.00	70,443,600
新晃工業	10,200	1,459.00	14,881,800
大和冷機工業	15,900	975.00	15,502,500
セガサミーホールディングス	108,700	1,302.00	141,527,400
日本ピストンリング	4,000	1,241.00	4,964,000

リケン	5,100	2,809.00	14,325,900
T P R	14,800	1,421.00	21,030,800
ツバキ・ナカシマ	22,400	823.00	18,435,200
ホシザキ	32,000	8,510.00	272,320,000
大豊工業	9,000	565.00	5,085,000
日本精工	206,300	788.00	162,564,400
N T N	253,800	213.00	54,059,400
ジェイテクト	105,100	818.00	85,971,800
不二越	10,200	3,320.00	33,864,000
日本トムソン	32,700	346.00	11,314,200
T H K	63,800	2,694.00	171,877,200
ユーシン精機	8,600	710.00	6,106,000
前澤給装工業	4,000	2,037.00	8,148,000
イーグル工業	13,600	705.00	9,588,000
前澤工業	7,400	398.00	2,945,200
日本ピラー工業	11,100	1,534.00	17,027,400
キッツ	44,500	710.00	31,595,000
マキタ	142,900	4,120.00	588,748,000
日立造船	87,100	385.00	33,533,500
三菱重工業	183,600	2,668.50	489,936,600
I H I	79,000	1,565.00	123,635,000
スター精密	16,900	1,277.00	21,581,300
日清紡ホールディングス	73,100	760.00	55,556,000
イビデン	67,200	2,980.00	200,256,000
コニカミノルタ	240,600	369.00	88,781,400
ブラザー工業	134,000	1,880.00	251,920,000
ミネベアミツミ	203,600	1,876.00	381,953,600
日立製作所	526,400	3,340.00	1,758,176,000
三菱電機	1,095,400	1,427.00	1,563,135,800
富士電機	66,000	2,914.00	192,324,000
東洋電機製造	4,100	1,164.00	4,772,400
安川電機	117,900	3,745.00	441,535,500
シンフォニアテクノロジー	14,300	1,108.00	15,844,400
明電舎	20,200	1,732.00	34,986,400
オリジン	3,000	1,308.00	3,924,000
山洋電気	5,400	5,000.00	27,000,000
デンヨー	9,400	2,075.00	19,505,000
東芝テック	13,700	4,435.00	60,759,500
芝浦メカトロニクス	2,100	2,805.00	5,890,500
マブチモーター	30,400	3,405.00	103,512,000
日本電産	263,700	8,395.00	2,213,761,500
トレックス・セミコンダクター	6,600	1,199.00	7,913,400

東光高岳	6,500	1,029.00	6,688,500
ダイヘン	12,000	4,055.00	48,660,000
ヤーマン	18,300	1,019.00	18,647,700
JVCケンウッド	92,100	157.00	14,459,700
ミマキエンジニアリング	11,100	388.00	4,306,800
第一精工	4,700	1,984.00	9,324,800
日新電機	25,800	1,043.00	26,909,400
大崎電気工業	22,000	521.00	11,462,000
オムロン	98,200	7,490.00	735,518,000
日東工業	16,100	1,821.00	29,318,100
I D E C	15,900	1,735.00	27,586,500
正興電機製作所	3,000	1,014.00	3,042,000
不二電機工業	2,200	1,327.00	2,919,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,800	1,817.00	66,865,600
サクサホールディングス	2,600	1,513.00	3,933,800
メルコホールディングス	3,900	3,200.00	12,480,000
テクノメディカ	2,700	1,857.00	5,013,900
日本電気	132,900	5,930.00	788,097,000
富士通	105,600	14,010.00	1,479,456,000
沖電気工業	44,600	1,086.00	48,435,600
岩崎通信機	4,800	843.00	4,046,400
電気興業	5,300	2,488.00	13,186,400
サンケン電気	12,000	2,160.00	25,920,000
ナカヨ	2,200	1,481.00	3,258,200
アイホン	6,300	1,532.00	9,651,600
ルネサスエレクトロニクス	525,700	574.00	301,751,800
セイコーエプソン	136,000	1,245.00	169,320,000
ワコム	74,500	593.00	44,178,500
アルバック	20,200	3,350.00	67,670,000
アクセル	5,200	865.00	4,498,000
E I Z O	8,500	4,160.00	35,360,000
日本信号	28,000	1,070.00	29,960,000
京三製作所	25,800	556.00	14,344,800
能美防災	14,700	2,163.00	31,796,100
ホーチキ	8,300	1,199.00	9,951,700
星和電機	6,100	611.00	3,727,100
エレコム	12,300	5,440.00	66,912,000
パナソニック	1,251,600	1,039.00	1,300,412,400
シャープ	126,800	1,171.00	148,482,800
アンリツ	70,600	2,459.00	173,605,400
富士通ゼネラル	29,800	2,603.00	77,569,400
ソニー	686,200	8,196.00	5,624,095,200

TDK	52,900	10,700.00	566,030,000
帝国通信工業	5,200	1,215.00	6,318,000
タムラ製作所	36,800	463.00	17,038,400
アルプスアルパイン	97,300	1,422.00	138,360,600
池上通信機	3,500	879.00	3,076,500
鈴木	6,000	685.00	4,110,000
日本トリム	1,600	3,190.00	5,104,000
ローランド ディー・ジー・	6,400	1,224.00	7,833,600
フォスター電機	11,600	1,122.00	13,015,200
SMK	2,800	2,658.00	7,442,400
ヨコオ	7,300	2,687.00	19,615,100
ホシデン	30,400	943.00	28,667,200
ヒロセ電機	17,000	11,670.00	198,390,000
日本航空電子工業	25,200	1,429.00	36,010,800
TOA	11,900	759.00	9,032,100
マクセルホールディングス	24,000	926.00	22,224,000
古野電気	14,600	1,019.00	14,877,400
ユニデンホールディングス	3,100	1,759.00	5,452,900
スミダコーポレーション	9,000	712.00	6,408,000
アイコム	6,100	3,020.00	18,422,000
リオン	4,800	2,069.00	9,931,200
本多通信工業	10,400	430.00	4,472,000
横河電機	100,500	1,692.00	170,046,000
新電元工業	3,900	2,142.00	8,353,800
アズビル	69,200	3,530.00	244,276,000
東亜ディーケーケー	6,000	862.00	5,172,000
日本光電工業	45,400	3,700.00	167,980,000
チノー	3,800	1,409.00	5,354,200
共和電業	11,700	428.00	5,007,600
日本電子材料	4,400	1,266.00	5,570,400
堀場製作所	21,700	5,730.00	124,341,000
アドバンテスト	81,500	6,650.00	541,975,000
小野測器	5,500	508.00	2,794,000
エスペック	10,000	1,888.00	18,880,000
キーエンス	99,300	46,140.00	4,581,702,000
日置電機	5,900	3,340.00	19,706,000
シスメックス	78,400	8,177.00	641,076,800
日本マイクロニクス	19,500	1,095.00	21,352,500
メガチップス	10,400	2,124.00	22,089,600
OBARA GROUP	6,500	3,580.00	23,270,000
澤藤電機	1,600	1,638.00	2,620,800
原田工業	5,700	898.00	5,118,600

コーセル	15,100	880.00	13,288,000
イリソ電子工業	9,300	3,405.00	31,666,500
オブテックスグループ	18,300	1,228.00	22,472,400
千代田インテグレ	5,300	1,664.00	8,819,200
アイ・オー・データ機器	4,000	1,016.00	4,064,000
レーザーテック	48,100	9,760.00	469,456,000
スタンレー電気	77,000	2,669.00	205,513,000
岩崎電気	4,500	1,850.00	8,325,000
ウシオ電機	60,800	1,329.00	80,803,200
岡谷電機産業	10,000	302.00	3,020,000
ハリオス テクノ ホールディング	11,500	309.00	3,553,500
エノモト	3,700	1,073.00	3,970,100
日本セラミック	11,300	2,158.00	24,385,400
遠藤照明	6,300	629.00	3,962,700
古河電池	8,200	1,155.00	9,471,000
双信電機	6,400	403.00	2,579,200
山一電機	8,300	1,339.00	11,113,700
図研	7,300	3,100.00	22,630,000
日本電子	21,800	2,919.00	63,634,200
カシオ計算機	96,900	1,834.00	177,714,600
ファナック	103,000	20,745.00	2,136,735,000
日本シイエムケイ	26,900	434.00	11,674,600
エンプラス	5,800	2,279.00	13,218,200
大真空	4,200	2,209.00	9,277,800
ローム	48,700	7,040.00	342,848,000
浜松ホトニクス	78,700	4,835.00	380,514,500
三井ハイテック	12,400	1,617.00	20,050,800
新光電気工業	37,100	1,708.00	63,366,800
京セラ	154,200	5,917.00	912,401,400
太陽誘電	48,900	3,245.00	158,680,500
村田製作所	321,800	6,712.00	2,159,921,600
双葉電子工業	17,800	968.00	17,230,400
北陸電気工業	4,900	897.00	4,395,300
ニチコン	37,800	718.00	27,140,400
日本ケミコン	8,300	1,891.00	15,695,300
K O A	17,000	994.00	16,898,000
市光工業	17,300	506.00	8,753,800
小糸製作所	65,700	4,585.00	301,234,500
ミツバ	21,200	395.00	8,374,000
S C R E E Nホールディングス	19,000	5,430.00	103,170,000
キヤノン電子	11,800	1,540.00	18,172,000
キヤノン	589,700	2,098.50	1,237,485,450

リコー	278,800	798.00	222,482,400
象印マホービン	32,400	1,376.00	44,582,400
MUTOHホールディングス	1,700	1,532.00	2,604,400
東京エレクトロン	69,500	28,870.00	2,006,465,000
トヨタ紡織	32,000	1,427.00	45,664,000
芦森工業	2,300	989.00	2,274,700
ユニプレス	21,300	935.00	19,915,500
豊田自動織機	88,700	5,790.00	513,573,000
モリタホールディングス	19,200	1,908.00	36,633,600
三櫻工業	14,000	675.00	9,450,000
デンソー	241,200	4,150.00	1,000,980,000
東海理化電機製作所	28,900	1,520.00	43,928,000
三井E & Sホールディングス	39,600	461.00	18,255,600
川崎重工業	85,200	1,621.00	138,109,200
名村造船所	35,200	172.00	6,054,400
日本車輛製造	4,000	2,625.00	10,500,000
三菱ロジスネクスト	14,500	1,029.00	14,920,500
近畿車輛	1,600	1,228.00	1,964,800
日産自動車	1,291,900	429.40	554,741,860
いすゞ自動車	317,400	936.60	297,276,840
トヨタ自動車	1,222,200	6,737.00	8,233,961,400
日野自動車	136,800	719.00	98,359,200
三菱自動車工業	405,500	269.00	109,079,500
エフテック	7,800	497.00	3,876,600
レシップホールディングス	4,300	563.00	2,420,900
G M B	2,000	607.00	1,214,000
ファルテック	2,000	639.00	1,278,000
武蔵精密工業	24,400	909.00	22,179,600
日産車体	21,400	938.00	20,073,200
新明和工業	29,500	1,025.00	30,237,500
極東開発工業	20,300	1,499.00	30,429,700
日信工業	22,300	2,200.00	49,060,000
トピー工業	9,100	1,210.00	11,011,000
ティラド	4,000	1,347.00	5,388,000
曙ブレーキ工業	60,100	175.00	10,517,500
タチエス	18,000	932.00	16,776,000
N O K	58,900	1,280.00	75,392,000
フタバ産業	30,600	457.00	13,984,200
K Y B	12,300	1,945.00	23,923,500
大同メタル工業	21,100	552.00	11,647,200
プレス工業	54,500	314.00	17,113,000
ミクニ	14,100	271.00	3,821,100

太平洋工業	23,000	916.00	21,068,000
ケーヒン	25,200	2,544.00	64,108,800
河西工業	14,900	444.00	6,615,600
アイシン精機	90,200	3,180.00	286,836,000
マツダ	322,300	699.00	225,287,700
今仙電機製作所	10,200	738.00	7,527,600
本田技研工業	862,500	2,758.00	2,378,775,000
スズキ	217,100	3,702.00	803,704,200
S U B A R U	340,100	2,246.00	763,864,600
安永	5,300	1,042.00	5,522,600
ヤマハ発動機	142,800	1,666.00	237,904,800
ショーワ	25,900	2,250.00	58,275,000
T B K	13,100	455.00	5,960,500
エクセディ	14,900	1,599.00	23,825,100
豊田合成	35,400	2,138.00	75,685,200
愛三工業	17,300	510.00	8,823,000
盟和産業	1,700	897.00	1,524,900
日本プラスト	8,700	434.00	3,775,800
ヨロズ	10,300	1,107.00	11,402,100
エフ・シー・シー	17,900	1,890.00	33,831,000
シマノ	41,000	21,720.00	890,520,000
テイ・エス テック	25,500	2,939.00	74,944,500
ジャムコ	5,600	726.00	4,065,600
テルモ	310,000	4,012.00	1,243,720,000
クリエートメディック	3,600	996.00	3,585,600
日機装	32,900	973.00	32,011,700
日本エム・ディ・エム	6,300	1,672.00	10,533,600
島津製作所	130,900	2,810.00	367,829,000
J M S	9,300	813.00	7,560,900
長野計器	8,000	986.00	7,888,000
ブイ・テクノロジー	5,100	3,675.00	18,742,500
東京計器	7,000	1,003.00	7,021,000
愛知時計電機	1,400	4,460.00	6,244,000
インターアクション	5,900	1,681.00	9,917,900
オーバル	9,900	224.00	2,217,600
東京精密	19,900	3,465.00	68,953,500
マニー	43,600	2,838.00	123,736,800
ニコン	167,300	844.00	141,201,200
トプコン	55,200	806.00	44,491,200
オリンパス	606,100	1,973.00	1,195,835,300
理研計器	9,700	2,513.00	24,376,100
タムロン	8,800	1,787.00	15,725,600

HOYA	217,300	10,490.00	2,279,477,000
シード	4,700	684.00	3,214,800
ノーリツ鋼機	7,400	1,525.00	11,285,000
エー・アンド・デイ	10,000	682.00	6,820,000
朝日インテック	124,100	2,986.00	370,562,600
シチズン時計	128,400	327.00	41,986,800
リズム時計工業	3,500	615.00	2,152,500
大研医器	7,600	565.00	4,294,000
メニコン	15,500	5,090.00	78,895,000
シンシア	1,200	362.00	434,400
松風	5,000	1,418.00	7,090,000
セイコーホールディングス	15,500	1,615.00	25,032,500
ニプロ	75,800	1,178.00	89,292,400
中本パックス	2,800	1,505.00	4,214,000
スノーピーク	5,800	1,123.00	6,513,400
パラマウントベッドホールディングス	11,600	4,530.00	52,548,000
トランザクション	6,000	1,092.00	6,552,000
粧美堂	3,200	353.00	1,129,600
ニホンフラッシュ	10,200	1,515.00	15,453,000
前田工織	12,100	2,549.00	30,842,900
永大産業	14,300	290.00	4,147,000
アートネイチャー	11,700	630.00	7,371,000
バンダイナムコホールディングス	113,200	6,100.00	690,520,000
アイフィスジャパン	2,800	731.00	2,046,800
共立印刷	18,300	137.00	2,507,100
SHOEI	9,600	2,820.00	27,072,000
フランスベッドホールディングス	15,500	846.00	13,113,000
パイロットコーポレーション	17,900	3,260.00	58,354,000
萩原工業	6,100	1,423.00	8,680,300
トッパン・フォームズ	23,500	1,079.00	25,356,500
フジシールインターナショナル	24,600	1,977.00	48,634,200
タカラトミー	49,100	866.00	42,520,600
廣濟堂	7,600	804.00	6,110,400
エステールホールディングス	2,900	646.00	1,873,400
アーク	41,800	112.00	4,681,600
タカノ	4,300	714.00	3,070,200
プロネクサス	9,400	1,196.00	11,242,400
ホクシン	6,800	118.00	802,400
ウッドワン	3,700	1,178.00	4,358,600
大建工業	7,400	1,896.00	14,030,400
凸版印刷	154,600	1,695.00	262,047,000
大日本印刷	143,300	2,422.00	347,072,600

共同印刷	3,400	2,734.00	9,295,600
N I S S H A	22,500	1,094.00	24,615,000
光村印刷	900	1,524.00	1,371,600
T A K A R A & C O M P A N Y	5,300	2,328.00	12,338,400
アシックス	90,400	1,266.00	114,446,400
ツツミ	3,400	1,920.00	6,528,000
小松ウオール工業	3,300	1,733.00	5,718,900
ヤマハ	65,100	4,990.00	324,849,000
河合楽器製作所	3,400	2,734.00	9,295,600
クリナップ	10,200	577.00	5,885,400
ピジョン	66,200	4,345.00	287,639,000
オリバー	2,300	2,520.00	5,796,000
兼松サステック	700	1,478.00	1,034,600
キングジム	9,100	866.00	7,880,600
リンテック	26,100	2,573.00	67,155,300
イトーキ	23,300	338.00	7,875,400
任天堂	67,200	47,500.00	3,192,000,000
三菱鉛筆	18,000	1,326.00	23,868,000
タカラスタンド	22,600	1,542.00	34,849,200
コクヨ	52,500	1,226.00	64,365,000
ナカバヤシ	10,800	602.00	6,501,600
グローブライド	4,900	2,094.00	10,260,600
オカムラ	38,200	761.00	29,070,200
美津濃	9,900	2,008.00	19,879,200
東京電力ホールディングス	874,400	323.00	282,431,200
中部電力	335,100	1,344.50	450,541,950
関西電力	415,000	1,063.50	441,352,500
中国電力	158,000	1,345.00	212,510,000
北陸電力	100,100	672.00	67,267,200
東北電力	273,600	1,034.00	282,902,400
四国電力	98,600	779.00	76,809,400
九州電力	225,800	931.00	210,219,800
北海道電力	102,500	414.00	42,435,000
沖縄電力	21,300	1,737.00	36,998,100
電源開発	87,200	1,688.00	147,193,600
エフオン	5,900	604.00	3,563,600
イーレックス	15,600	1,545.00	24,102,000
レノバ	18,300	1,061.00	19,416,300
東京瓦斯	210,700	2,695.00	567,836,500
大阪瓦斯	212,600	2,160.00	459,216,000
東邦瓦斯	53,900	5,220.00	281,358,000
北海道瓦斯	5,900	1,560.00	9,204,000

広島ガス	22,500	362.00	8,145,000
西部瓦斯	12,300	2,627.00	32,312,100
静岡ガス	31,100	875.00	27,212,500
メタウォーター	5,300	4,680.00	24,804,000
SBSホールディングス	9,500	2,345.00	22,277,500
東武鉄道	114,200	3,395.00	387,709,000
相鉄ホールディングス	35,000	2,815.00	98,525,000
東急	276,300	1,332.00	368,031,600
京浜急行電鉄	140,700	1,585.00	223,009,500
小田急電鉄	162,900	2,562.00	417,349,800
京王電鉄	56,800	5,940.00	337,392,000
京成電鉄	76,200	2,984.00	227,380,800
富士急行	14,900	3,300.00	49,170,000
新京成電鉄	2,800	2,243.00	6,280,400
東日本旅客鉄道	192,800	6,976.00	1,344,972,800
西日本旅客鉄道	97,600	5,168.00	504,396,800
東海旅客鉄道	91,100	14,455.00	1,316,850,500
西武ホールディングス	143,000	1,038.00	148,434,000
鴻池運輸	17,400	1,125.00	19,575,000
西日本鉄道	30,400	2,849.00	86,609,600
ハマキョウレックス	8,400	3,215.00	27,006,000
サカイ引越センター	5,800	4,935.00	28,623,000
近鉄グループホールディングス	103,700	4,600.00	477,020,000
阪急阪神ホールディングス	138,400	3,390.00	469,176,000
南海電気鉄道	49,200	2,420.00	119,064,000
京阪ホールディングス	46,200	4,665.00	215,523,000
神戸電鉄	2,500	3,595.00	8,987,500
名古屋鉄道	85,300	2,893.00	246,772,900
山陽電気鉄道	7,400	2,235.00	16,539,000
日本通運	35,900	5,560.00	199,604,000
ヤマトホールディングス	181,900	2,735.00	497,496,500
山九	28,800	3,895.00	112,176,000
丸運	5,900	225.00	1,327,500
丸全昭和運輸	8,400	3,175.00	26,670,000
センコーグループホールディングス	57,200	812.00	46,446,400
トナミホールディングス	2,500	6,000.00	15,000,000
ニッコンホールディングス	37,100	2,065.00	76,611,500
日本石油輸送	1,100	3,070.00	3,377,000
福山通運	13,300	3,810.00	50,673,000
セイノーホールディングス	77,700	1,364.00	105,982,800
エスライン	3,100	946.00	2,932,600
神奈川中央交通	2,600	3,910.00	10,166,000

日立物流	19,000	3,015.00	57,285,000
丸和運輸機関	10,900	3,290.00	35,861,000
C & F ロジホールディングス	10,500	1,679.00	17,629,500
九州旅客鉄道	90,900	2,358.00	214,342,200
S Gホールディングス	108,900	3,705.00	403,474,500
日本郵船	87,200	1,408.00	122,777,600
商船三井	66,000	1,871.00	123,486,000
川崎汽船	31,900	1,031.00	32,888,900
N S ユナイテッド海運	6,200	1,552.00	9,622,400
飯野海運	51,200	326.00	16,691,200
共栄タンカー	2,700	795.00	2,146,500
乾汽船	6,000	807.00	4,842,000
日本航空	183,500	1,894.50	347,640,750
A N Aホールディングス	189,600	2,373.00	449,920,800
パスコ	2,000	1,421.00	2,842,000
ランコム	2,900	7,270.00	21,083,000
日新	9,000	1,539.00	13,851,000
三菱倉庫	32,900	2,735.00	89,981,500
三井倉庫ホールディングス	11,800	1,550.00	18,290,000
住友倉庫	37,300	1,268.00	47,296,400
澁澤倉庫	5,700	1,961.00	11,177,700
東陽倉庫	18,700	331.00	6,189,700
日本トランスシティ	22,800	499.00	11,377,200
ケイヒン	2,000	1,269.00	2,538,000
中央倉庫	6,300	1,000.00	6,300,000
川西倉庫	1,900	1,032.00	1,960,800
安田倉庫	8,500	921.00	7,828,500
ファイズホールディングス	2,200	1,071.00	2,356,200
東洋埠頭	3,200	1,437.00	4,598,400
宇徳	8,900	482.00	4,289,800
上組	57,900	2,038.00	118,000,200
サンリツ	2,500	578.00	1,445,000
キムラユニティー	2,800	1,033.00	2,892,400
キューソー流通システム	2,600	1,506.00	3,915,600
近鉄エクスプレス	22,000	1,907.00	41,954,000
東海運	5,900	275.00	1,622,500
エーアイティー	7,300	946.00	6,905,800
内外トランスライン	3,600	1,052.00	3,787,200
日本コンセプト	3,300	1,254.00	4,138,200
N E C ネットエスアイ	30,600	2,212.00	67,687,200
クロスキャット	3,000	1,128.00	3,384,000
システナ	38,500	1,440.00	55,440,000

デジタルアーツ	5,300	9,360.00	49,608,000
日鉄ソリューションズ	16,200	3,065.00	49,653,000
キューブシステム	6,000	1,066.00	6,396,000
エイジア	2,100	1,418.00	2,977,800
コア	4,800	1,257.00	6,033,600
ラクーンホールディングス	5,100	1,099.00	5,604,900
ソリトンシステムズ	4,900	1,545.00	7,570,500
ソフトクリエイティブホールディングス	4,800	2,379.00	11,419,200
T I S	107,600	2,273.00	244,574,800
ネオス	4,300	626.00	2,691,800
電算システム	4,200	4,795.00	20,139,000
グリー	66,500	453.00	30,124,500
コーエーテクモホールディングス	22,100	3,420.00	75,582,000
三菱総合研究所	4,700	4,300.00	20,210,000
電算	1,300	2,238.00	2,909,400
A G S	6,400	860.00	5,504,000
ファインデックス	9,300	975.00	9,067,500
ブレインパッド	2,800	4,190.00	11,732,000
K L a b	20,800	714.00	14,851,200
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	13,300	861.00	11,451,300
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	3,315.00	5,304,000
ネクソン	300,300	2,482.00	745,344,600
アイスタイル	31,100	274.00	8,521,400
エムアップホールディングス	3,200	2,332.00	7,462,400
エイチーム	7,700	889.00	6,845,300
エニグモ	10,300	1,322.00	13,616,600
テクノスジャパン	8,700	813.00	7,073,100
コロプラ	35,500	968.00	34,364,000
ブロードリーフ	53,800	563.00	30,289,400
クロス・マーケティンググループ	5,400	331.00	1,787,400
デジタルハーツホールディングス	6,000	869.00	5,214,000
システム情報	8,200	1,462.00	11,988,400
メディアドゥ	3,400	5,400.00	18,360,000
じげん	27,400	303.00	8,302,200
エンカレッジ・テクノロジー	2,700	787.00	2,124,900
サイバーリンクス	1,800	2,253.00	4,055,400
フィックスターズ	11,600	1,181.00	13,699,600
C A R T A H O L D I N G S	5,400	1,336.00	7,214,400
オブティム	5,700	3,395.00	19,351,500
セレス	3,700	1,200.00	4,440,000
S H I F T	4,400	11,770.00	51,788,000
ティーガイア	9,700	1,936.00	18,779,200

セック	1,700	3,025.00	5,142,500
日本アジアグループ	11,300	291.00	3,288,300
テクマトリックス	15,300	1,781.00	27,249,300
プロシップ	3,300	1,499.00	4,946,700
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	26,000	1,953.00	50,778,000
GMOペイメントゲートウェイ	22,800	11,190.00	255,132,000
ザッパラス	5,300	402.00	2,130,600
システムリサーチ	3,000	2,086.00	6,258,000
インターネットイニシアティブ	16,000	3,690.00	59,040,000
さくらインターネット	11,900	625.00	7,437,500
ヴィンクス	3,200	1,258.00	4,025,600
GMOクラウド	2,000	7,740.00	15,480,000
SRAホールディングス	5,800	2,349.00	13,624,200
システムインテグレータ	3,700	816.00	3,019,200
朝日ネット	7,800	1,162.00	9,063,600
eBASE	13,000	1,536.00	19,968,000
アバント	10,500	1,054.00	11,067,000
アドソル日進	3,900	2,346.00	9,149,400
フリービット	5,900	803.00	4,737,700
コムチュア	12,200	2,715.00	33,123,000
サイバーコム	2,100	1,836.00	3,855,600
アステリア	7,100	486.00	3,450,600
アイル	6,100	1,577.00	9,619,700
マークライنز	5,500	2,138.00	11,759,000
メディカル・データ・ビジョン	8,400	1,417.00	11,902,800
ショーケース	2,900	696.00	2,018,400
モバイルファクトリー	2,600	1,055.00	2,743,000
テラスカイ	4,000	4,860.00	19,440,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,400	1,379.00	6,067,600
PCIホールディングス	4,300	1,166.00	5,013,800
パイプドHD	1,600	1,415.00	2,264,000
アイビーシー	2,000	939.00	1,878,000
ネオジャパン	2,100	2,258.00	4,741,800
PR TIMES	1,000	3,985.00	3,985,000
ランドコンピュータ	1,900	990.00	1,881,000
ダブルスタンダード	1,400	5,590.00	7,826,000
オープンドア	5,500	1,055.00	5,802,500
マイネット	3,500	1,378.00	4,823,000
アカツキ	3,900	3,875.00	15,112,500
ベネフィットジャパン	1,000	1,625.00	1,625,000
Ubicomホールディングス	2,500	2,259.00	5,647,500
LINE	24,700	5,550.00	137,085,000

カナミックネットワーク	10,100	917.00	9,261,700
ノムラシステムコーポレーション	5,500	462.00	2,541,000
チェンジ	3,800	8,470.00	32,186,000
シンクロ・フード	5,400	339.00	1,830,600
オークネット	6,900	1,088.00	7,507,200
セグエグループ	2,600	913.00	2,373,800
エイトレッド	1,900	2,000.00	3,800,000
AOI TYO Holdings	11,500	411.00	4,726,500
マクロミル	22,300	754.00	16,814,200
ビーグリー	2,200	2,145.00	4,719,000
オロ	2,900	3,030.00	8,787,000
ユーザーローカル	1,100	3,835.00	4,218,500
テモナ	2,600	968.00	2,516,800
ニーズウェル	2,400	709.00	1,701,600
サインポスト	2,400	1,385.00	3,324,000
ソルクシーズ	4,900	755.00	3,699,500
フェイス	4,200	698.00	2,931,600
プロトコーポレーション	9,900	930.00	9,207,000
ハイマックス	1,400	2,010.00	2,814,000
野村総合研究所	152,400	2,804.00	427,329,600
サイバネットシステム	8,000	666.00	5,328,000
CEホールディングス	6,100	585.00	3,568,500
日本システム技術	1,900	1,770.00	3,363,000
インテージホールディングス	13,700	900.00	12,330,000
東邦システムサイエンス	3,100	964.00	2,988,400
ソースネクスト	51,900	273.00	14,168,700
インフォコム	11,800	3,295.00	38,881,000
HEROZ	1,600	3,195.00	5,112,000
ラクスル	8,700	3,175.00	27,622,500
FIG	12,600	250.00	3,150,000
システムサポート	2,500	1,934.00	4,835,000
イーソル	5,300	1,106.00	5,861,800
アルテリア・ネットワークス	12,000	2,000.00	24,000,000
東海ソフト	900	1,221.00	1,098,900
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,100	1,050.00	2,205,000
トビラシステムズ	1,400	1,898.00	2,657,200
フォーカスシステムズ	7,000	806.00	5,642,000
クレスコ	6,700	1,382.00	9,259,400
フジ・メディア・ホールディングス	103,800	1,024.00	106,291,200
オービック	37,300	19,060.00	710,938,000
ジャストシステム	17,500	8,120.00	142,100,000
TDCソフト	9,700	916.00	8,885,200

Zホールディングス	1,476,600	532.00	785,551,200
トレンドマイクロ	47,800	6,200.00	296,360,000
IDホールディングス	4,300	1,562.00	6,716,600
日本オラクル	21,800	12,690.00	276,642,000
アルファシステムズ	3,400	4,180.00	14,212,000
フューチャー	13,100	1,791.00	23,462,100
CAC Holdings	7,200	1,235.00	8,892,000
SBテクノロジー	3,900	3,980.00	15,522,000
トーセ	3,200	859.00	2,748,800
オービックビジネスコンサルタント	11,000	6,130.00	67,430,000
伊藤忠テクノソリューションズ	49,000	4,220.00	206,780,000
アイティフォー	13,400	745.00	9,983,000
東計電算	1,600	4,000.00	6,400,000
エクスネット	2,000	975.00	1,950,000
大塚商会	58,200	5,540.00	322,428,000
サイボウズ	12,600	3,300.00	41,580,000
ソフトブレーン	6,900	431.00	2,973,900
電通国際情報サービス	6,700	5,630.00	37,721,000
ACCESS	10,300	847.00	8,724,100
デジタルガレージ	19,400	3,750.00	72,750,000
EMシステムズ	15,400	921.00	14,183,400
ウェザーニューズ	3,700	4,010.00	14,837,000
CIJ	7,600	800.00	6,080,000
ビジネスエンジニアリング	1,300	2,695.00	3,503,500
日本エンタープライズ	11,900	361.00	4,295,900
WOWOW	5,300	2,478.00	13,133,400
スカラ	7,500	637.00	4,777,500
インテリジェント ウェイブ	6,600	807.00	5,326,200
IMAGICA GROUP	9,800	380.00	3,724,000
ネットワンシステムズ	41,000	4,105.00	168,305,000
システムソフト	25,900	99.00	2,564,100
アルゴグラフィックス	9,200	3,385.00	31,142,000
マーベラス	16,800	680.00	11,424,000
エイベックス	18,800	906.00	17,032,800
日本ユニシス	33,600	3,355.00	112,728,000
兼松エレクトロニクス	5,900	4,315.00	25,458,500
東京放送ホールディングス	65,500	1,648.00	107,944,000
日本テレビホールディングス	89,900	1,208.00	108,599,200
朝日放送グループホールディングス	11,000	745.00	8,195,000
テレビ朝日ホールディングス	29,700	1,559.00	46,302,300
スカパーJSATホールディングス	71,400	420.00	29,988,000
テレビ東京ホールディングス	8,900	2,318.00	20,630,200

日本BS放送	3,900	1,098.00	4,282,200
ビジョン	10,400	666.00	6,926,400
スマートバリュー	3,000	1,141.00	3,423,000
ワイヤレスゲート	5,400	851.00	4,595,400
コネクシオ	6,300	1,403.00	8,838,900
クロップス	2,300	731.00	1,681,300
日本電信電話	1,436,900	2,552.50	3,667,687,250
KDDI	783,700	3,364.00	2,636,366,800
ソフトバンク	977,000	1,429.00	1,396,133,000
光通信	11,100	23,260.00	258,186,000
NTTドコモ	768,700	3,000.00	2,306,100,000
エムティーアイ	10,800	809.00	8,737,200
GMOインターネット	42,500	3,065.00	130,262,500
ファイバーゲート	3,600	1,991.00	7,167,600
アйдママーケティングコミュニケーション	3,800	436.00	1,656,800
KADOKAWA	29,100	2,280.00	66,348,000
学研ホールディングス	14,600	1,432.00	20,907,200
ゼンリン	21,700	1,178.00	25,562,600
昭文社ホールディングス	5,600	447.00	2,503,200
インプレスホールディングス	8,900	149.00	1,326,100
アイネット	5,700	1,657.00	9,444,900
松竹	7,100	12,890.00	91,519,000
東宝	63,500	3,345.00	212,407,500
東映	4,000	14,640.00	58,560,000
エヌ・ティ・ティ・データ	286,400	1,246.00	356,854,400
ピー・シー・エー	1,900	3,910.00	7,429,000
ビジネスブレイン太田昭和	3,900	1,266.00	4,937,400
DTS	24,100	2,412.00	58,129,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	45,900	5,820.00	267,138,000
シーイーシー	11,700	1,596.00	18,673,200
カブコン	50,700	4,005.00	203,053,500
アイ・エス・ビー	2,200	2,417.00	5,317,400
ジャステック	7,000	1,202.00	8,414,000
SCSK	24,900	5,370.00	133,713,000
日本システムウエア	3,700	2,190.00	8,103,000
アイネス	10,800	1,533.00	16,556,400
TKC	9,100	5,950.00	54,145,000
富士ソフト	13,800	4,640.00	64,032,000
NSD	34,700	2,048.00	71,065,600
コナミホールディングス	39,100	3,440.00	134,504,000
福井コンピュータホールディングス	4,300	2,602.00	11,188,600
JBCホールディングス	7,400	1,510.00	11,174,000

ミロク情報サービス	9,600	2,204.00	21,158,400
ソフトバンクグループ	852,900	6,499.00	5,542,997,100
ハウスイ	900	885.00	796,500
高千穂交易	4,200	923.00	3,876,600
カワニシホールディングス	1,300	1,315.00	1,709,500
伊藤忠食品	2,700	4,785.00	12,919,500
エレマテック	10,100	919.00	9,281,900
JALUX	3,100	1,731.00	5,366,100
あらた	8,600	4,855.00	41,753,000
トーメンデバイス	1,600	4,020.00	6,432,000
東京エレクトロン デバイス	3,900	3,810.00	14,859,000
フィールズ	8,300	350.00	2,905,000
双日	595,900	237.00	141,228,300
アルフレッサ ホールディングス	119,900	2,250.00	269,775,000
横浜冷凍	28,200	899.00	25,351,800
ラサ商事	5,700	949.00	5,409,300
アルコニックス	11,500	1,312.00	15,088,000
神戸物産	37,200	6,660.00	247,752,000
ハイパー	1,700	563.00	957,100
あい ホールディングス	15,400	1,524.00	23,469,600
ディーブイエックス	3,900	911.00	3,552,900
ダイワボウホールディングス	9,200	7,990.00	73,508,000
マクニカ・富士エレホールディングス	25,700	1,661.00	42,687,700
ラクト・ジャパン	4,000	3,705.00	14,820,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,300	1,061.00	21,538,300
八洲電機	8,400	958.00	8,047,200
メディアスホールディングス	6,100	893.00	5,447,300
レスターホールディングス	11,200	2,009.00	22,500,800
ジュテックホールディングス	2,500	1,025.00	2,562,500
大光	4,600	676.00	3,109,600
OCHIホールディングス	3,100	1,532.00	4,749,200
TOKAIホールディングス	57,000	997.00	56,829,000
黒谷	3,000	518.00	1,554,000
Cominix	1,900	683.00	1,297,700
三洋貿易	10,900	979.00	10,671,100
ビューティガレージ	1,700	1,911.00	3,248,700
ウイン・パートナーズ	7,800	960.00	7,488,000
ミタチ産業	3,300	566.00	1,867,800
シップヘルスケアホールディングス	17,300	4,570.00	79,061,000
明治電機工業	3,400	1,392.00	4,732,800
デリカフーズホールディングス	3,800	628.00	2,386,400
スターティアホールディングス	2,500	620.00	1,550,000

コメダホールディングス	23,500	1,813.00	42,605,500
ピーバンドットコム	1,100	938.00	1,031,800
アセンテック	1,200	3,800.00	4,560,000
富士興産	3,300	446.00	1,471,800
協栄産業	1,200	1,228.00	1,473,600
小野建	9,700	1,229.00	11,921,300
南陽	2,400	1,566.00	3,758,400
佐島電機	7,300	835.00	6,095,500
エコートレーディング	2,500	530.00	1,325,000
伯東	6,600	957.00	6,316,200
コンドーテック	8,400	1,150.00	9,660,000
中山福	6,200	455.00	2,821,000
ナガイレーベン	14,300	2,783.00	39,796,900
三菱食品	11,900	2,661.00	31,665,900
松田産業	7,900	1,582.00	12,497,800
第一興商	16,100	3,140.00	50,554,000
メディパルホールディングス	116,400	2,014.00	234,429,600
S P K	4,600	1,335.00	6,141,000
萩原電気ホールディングス	4,000	2,038.00	8,152,000
アズワン	7,000	11,350.00	79,450,000
スズデン	3,800	1,217.00	4,624,600
尾家産業	3,200	1,500.00	4,800,000
シモジマ	6,600	1,236.00	8,157,600
ドウシシャ	10,200	1,698.00	17,319,600
小津産業	2,400	1,759.00	4,221,600
高速	6,400	1,435.00	9,184,000
たけびし	3,800	1,513.00	5,749,400
リックス	2,400	1,663.00	3,991,200
丸文	9,600	509.00	4,886,400
ハビネット	9,000	1,175.00	10,575,000
橋本総業ホールディングス	2,200	1,970.00	4,334,000
日本ライフライン	32,000	1,365.00	43,680,000
タカショー	7,000	499.00	3,493,000
マルカ	3,800	1,817.00	6,904,600
I D O M	29,100	505.00	14,695,500
進和	6,400	1,951.00	12,486,400
エスケイジャパン	2,400	297.00	712,800
ダイトロン	4,600	1,502.00	6,909,200
シークス	13,700	949.00	13,001,300
田中商事	3,300	708.00	2,336,400
オーハシテクニカ	6,000	1,660.00	9,960,000
白銅	3,900	1,450.00	5,655,000

ダイコー通産	700	1,212.00	848,400
伊藤忠商事	754,600	2,371.00	1,789,156,600
丸紅	1,123,000	515.10	578,457,300
高島	1,700	1,839.00	3,126,300
長瀬産業	60,700	1,326.00	80,488,200
蝶理	6,900	1,747.00	12,054,300
豊田通商	120,400	2,830.00	340,732,000
三共生興	16,400	435.00	7,134,000
兼松	40,200	1,292.00	51,938,400
ツカモトコーポレーション	1,900	1,164.00	2,211,600
三井物産	934,100	1,645.50	1,537,061,550
日本紙パルプ商事	6,100	3,840.00	23,424,000
カメイ	14,100	1,050.00	14,805,000
東都水産	1,400	3,230.00	4,522,000
OUGホールディングス	1,700	2,666.00	4,532,200
スターゼン	4,000	4,180.00	16,720,000
山善	42,200	1,018.00	42,959,600
椿本興業	2,000	3,360.00	6,720,000
住友商事	680,700	1,252.50	852,576,750
内田洋行	4,300	6,800.00	29,240,000
三菱商事	707,400	2,253.00	1,593,772,200
第一実業	5,300	3,680.00	19,504,000
キャノンマーケティングジャパン	26,800	2,192.00	58,745,600
西華産業	6,100	1,259.00	7,679,900
佐藤商事	8,900	938.00	8,348,200
菱洋エレクトロ	10,900	3,190.00	34,771,000
東京産業	9,800	522.00	5,115,600
ユアサ商事	10,200	2,956.00	30,151,200
神鋼商事	2,700	1,929.00	5,208,300
トルク	6,500	301.00	1,956,500
阪和興業	20,200	2,157.00	43,571,400
正栄食品工業	7,000	3,880.00	27,160,000
カナデン	8,800	1,360.00	11,968,000
菱電商事	7,800	1,486.00	11,590,800
フルサト工業	6,000	1,430.00	8,580,000
岩谷産業	23,900	3,805.00	90,939,500
ナイス	4,600	1,017.00	4,678,200
昭光通商	3,400	609.00	2,070,600
ニチモウ	1,700	1,903.00	3,235,100
極東貿易	3,100	1,358.00	4,209,800
イワキ	14,200	491.00	6,972,200
三愛石油	26,600	907.00	24,126,200

稲畑産業	23,800	1,255.00	29,869,000
G S Iクレオス	2,700	1,188.00	3,207,600
明和産業	10,000	461.00	4,610,000
クワザワ	3,900	532.00	2,074,800
ヤマエ久野	7,900	1,244.00	9,827,600
ワキタ	23,000	976.00	22,448,000
東邦ホールディングス	34,600	1,892.00	65,463,200
サンゲツ	29,400	1,543.00	45,364,200
ミツウロコグループホールディングス	15,900	1,164.00	18,507,600
シナネンホールディングス	4,400	2,941.00	12,940,400
伊藤忠エネクス	23,900	843.00	20,147,700
サンリオ	30,300	1,655.00	50,146,500
サンワテクノス	7,700	855.00	6,583,500
リョーサン	11,900	2,148.00	25,561,200
新光商事	16,900	875.00	14,787,500
トーホー	4,900	1,901.00	9,314,900
三信電気	5,800	1,839.00	10,666,200
東陽テクニカ	11,600	995.00	11,542,000
モスフードサービス	14,200	2,886.00	40,981,200
加賀電子	10,700	2,111.00	22,587,700
ソーダニッカ	11,200	533.00	5,969,600
立花エレテック	8,000	1,765.00	14,120,000
フォーバル	4,700	1,010.00	4,747,000
P A L T A C	17,300	5,240.00	90,652,000
三谷産業	14,200	339.00	4,813,800
西本Wismettacホールディングス	2,000	2,119.00	4,238,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,513.00	1,513,000
国際紙パルプ商事	25,600	279.00	7,142,400
ヤマタネ	5,400	1,312.00	7,084,800
丸紅建材リース	1,100	1,582.00	1,740,200
日鉄物産	7,700	3,445.00	26,526,500
泉州電業	3,300	2,937.00	9,692,100
トラスコ中山	22,500	2,600.00	58,500,000
オートバックスセブン	40,000	1,339.00	53,560,000
モリト	7,900	609.00	4,811,100
加藤産業	15,600	3,420.00	53,352,000
北恵	2,700	960.00	2,592,000
イノテック	5,600	1,024.00	5,734,400
イエローハット	20,400	1,507.00	30,742,800
J Kホールディングス	9,800	803.00	7,869,400
日伝	9,800	2,414.00	23,657,200
北沢産業	8,200	287.00	2,353,400

杉本商事	5,800	1,920.00	11,136,000
因幡電機産業	30,700	2,480.00	76,136,000
東テク	3,600	2,288.00	8,236,800
ミスミグループ本社	135,200	2,744.00	370,988,800
アルテック	8,600	255.00	2,193,000
タキヒヨー	3,300	1,911.00	6,306,300
蔵王産業	2,100	1,470.00	3,087,000
スズケン	45,700	3,880.00	177,316,000
ジェコス	7,500	973.00	7,297,500
グローセル	10,800	435.00	4,698,000
ローソン	27,300	5,580.00	152,334,000
サンエー	9,000	4,165.00	37,485,000
カワチ薬品	8,400	3,190.00	26,796,000
エービーシー・マート	16,900	6,100.00	103,090,000
ハードオフコーポレーション	4,500	710.00	3,195,000
アスクル	11,300	3,100.00	35,030,000
ゲオホールディングス	19,500	1,501.00	29,269,500
アダストリア	15,000	1,500.00	22,500,000
ジーフット	6,500	525.00	3,412,500
くら寿司	5,700	4,810.00	27,417,000
キャンドウ	5,200	2,439.00	12,682,800
パルグループホールディングス	11,100	1,213.00	13,464,300
エディオン	49,700	1,078.00	53,576,600
サーラコーポレーション	22,200	584.00	12,964,800
ワッツ	4,900	1,000.00	4,900,000
ハローズ	4,100	3,655.00	14,985,500
フジオフードグループ本社	9,200	1,326.00	12,199,200
あみやき亭	2,400	2,783.00	6,679,200
ひらまつ	19,800	177.00	3,504,600
大黒天物産	2,600	6,020.00	15,652,000
ハニーズホールディングス	9,600	1,137.00	10,915,200
ファーマライズホールディングス	2,800	716.00	2,004,800
アルペン	8,400	1,633.00	13,717,200
ハブ	3,300	616.00	2,032,800
クオールホールディングス	16,000	1,135.00	18,160,000
ジズホールディングス	5,700	7,590.00	43,263,000
ビックカメラ	64,100	1,141.00	73,138,100
D C Mホールディングス	59,900	1,321.00	79,127,900
Monotaro	76,700	4,390.00	336,713,000
東京一番フーズ	3,000	515.00	1,545,000
D Dホールディングス	4,300	704.00	3,027,200
きちりホールディングス	3,100	566.00	1,754,600

アークランドサービスホールディングス	8,000	1,975.00	15,800,000
J.フロント リテイリング	129,000	697.00	89,913,000
ドトール・日レスホールディングス	15,600	1,552.00	24,211,200
マツモトキヨシホールディングス	44,600	3,785.00	168,811,000
ブロンコピリー	5,700	2,119.00	12,078,300
Z O Z O	74,300	2,498.00	185,601,400
トレジャー・ファクトリー	3,400	679.00	2,308,600
物語コーポレーション	2,900	8,720.00	25,288,000
ココカラファイン	11,300	6,180.00	69,834,000
三越伊勢丹ホールディングス	188,900	588.00	111,073,200
H a m e e	3,900	1,792.00	6,988,800
ウエルシアホールディングス	32,100	9,630.00	309,123,000
クリエイティブSDホールディングス	18,200	3,735.00	67,977,000
丸善C H Iホールディングス	12,600	394.00	4,964,400
ティーライフ	1,700	1,060.00	1,802,000
チムニー	3,400	1,346.00	4,576,400
シュッピン	7,500	686.00	5,145,000
オイシックス・ラ・大地	10,700	2,200.00	23,540,000
ネクステージ	15,600	1,074.00	16,754,400
ジョイフル本田	31,700	1,502.00	47,613,400
鳥貴族	3,300	1,466.00	4,837,800
キリン堂ホールディングス	4,300	2,853.00	12,267,900
ホットランド	7,300	1,111.00	8,110,300
すかいらーくホールディングス	121,000	1,620.00	196,020,000
S F Pホールディングス	6,200	1,372.00	8,506,400
綿半ホールディングス	4,100	2,050.00	8,405,000
ヨシックス	1,800	1,854.00	3,337,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	31,500	1,276.00	40,194,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,300	501.00	2,655,300
B E E N O S	5,100	1,196.00	6,099,600
あさひ	8,100	1,649.00	13,356,900
日本調剤	6,600	1,664.00	10,982,400
コスモス薬品	9,500	19,270.00	183,065,000
トーエル	5,400	699.00	3,774,600
オンリー	2,100	559.00	1,173,900
セブン&アイ・ホールディングス	422,100	3,463.00	1,461,732,300
クリエイティブ・レストラン・ホールディングス	58,200	560.00	32,592,000
ツルハホールディングス	23,500	14,980.00	352,030,000
サンマルクホールディングス	8,600	1,615.00	13,889,000
フェリシモ	2,500	1,076.00	2,690,000
トリドールホールディングス	26,800	1,227.00	32,883,600

TOKYO BASE	10,200	296.00	3,019,200
ウイルプラスホールディングス	1,600	571.00	913,600
JMホールディングス	8,200	3,525.00	28,905,000
サツドラホールディングス	1,700	1,974.00	3,355,800
アレンザホールディングス	5,500	1,346.00	7,403,000
串カツ田中ホールディングス	2,300	1,720.00	3,956,000
パロックジャパンリミテッド	7,700	623.00	4,797,100
クスリのアオキホールディングス	9,700	9,900.00	96,030,000
力の源ホールディングス	5,100	666.00	3,396,600
スシローグローバルホールディングス	59,300	2,450.00	145,285,000
メディカルシステムネットワーク	10,700	506.00	5,414,200
はるやまホールディングス	5,300	766.00	4,059,800
ノジマ	19,200	2,671.00	51,283,200
カッパ・クリエイト	15,100	1,393.00	21,034,300
ライトオン	8,100	597.00	4,835,700
良品計画	143,300	1,371.00	196,464,300
三城ホールディングス	12,000	270.00	3,240,000
アドヴァン	16,600	1,370.00	22,742,000
アルビス	4,200	2,639.00	11,083,800
コナカ	13,200	299.00	3,946,800
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,599.00	2,238,600
G-7ホールディングス	6,400	2,487.00	15,916,800
イオン北海道	14,400	779.00	11,217,600
コジマ	18,800	559.00	10,509,200
ヒマラヤ	4,000	805.00	3,220,000
コーナン商事	15,400	3,770.00	58,058,000
エコス	4,000	2,325.00	9,300,000
ワタミ	12,900	914.00	11,790,600
マルシェ	3,100	505.00	1,565,500
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	237,200	2,382.00	565,010,400
西松屋チェーン	23,800	1,110.00	26,418,000
ゼンショーホールディングス	51,800	2,108.00	109,194,400
幸楽苑ホールディングス	6,900	1,609.00	11,102,100
ハークスレイ	2,400	997.00	2,392,800
サイゼリヤ	16,100	1,818.00	29,269,800
VTホールディングス	45,100	339.00	15,288,900
魚力	3,100	1,576.00	4,885,600
フジ・コーポレーション	2,900	2,001.00	5,802,900
ユナイテッドアローズ	11,400	1,605.00	18,297,000
ハイデイ日高	15,700	1,642.00	25,779,400
京都きもの友禅	7,400	243.00	1,798,200
コロワイド	35,800	1,399.00	50,084,200

ピーシーデポコーポレーション	14,500	656.00	9,512,000	
壱番屋	7,600	5,150.00	39,140,000	
P L A N T	3,000	781.00	2,343,000	
スギホールディングス	21,600	7,730.00	166,968,000	
薬王堂ホールディングス	4,800	2,797.00	13,425,600	
スクロール	16,900	583.00	9,852,700	
ヨンドシーホールディングス	11,100	1,914.00	21,245,400	
ファミリーマート	86,300	2,360.00	203,668,000	
木曽路	14,200	2,375.00	33,725,000	
S R S ホールディングス	12,900	903.00	11,648,700	
タカキュー	8,300	125.00	1,037,500	
リテールパートナーズ	14,400	2,190.00	31,536,000	
ケーヨー	22,300	870.00	19,401,000	
上新電機	12,800	2,240.00	28,672,000	
日本瓦斯	17,100	5,070.00	86,697,000	
ロイヤルホールディングス	18,900	1,742.00	32,923,800	
いなげや	13,400	1,887.00	25,285,800	
島忠	20,300	2,946.00	59,803,800	
チヨダ	11,500	1,074.00	12,351,000	
ライフコーポレーション	8,200	4,845.00	39,729,000	
リンガーハット	13,400	2,302.00	30,846,800	
M r M a x H D	15,100	835.00	12,608,500	
テンアライド	9,900	369.00	3,653,100	
A O K I ホールディングス	21,800	615.00	13,407,000	
オークワ	17,000	1,562.00	26,554,000	
コメリ	16,700	2,900.00	48,430,000	
青山商事	22,500	646.00	14,535,000	
しまむら	12,600	7,720.00	97,272,000	
はせがわ	6,200	284.00	1,760,800	
高島屋	78,700	802.00	63,117,400	
松屋	21,900	673.00	14,738,700	
エイチ・ツー・オー リテイリング	51,300	712.00	36,525,600	
近鉄百貨店	4,200	2,785.00	11,697,000	
丸井グループ	98,900	1,715.00	169,613,500	
アクシアル リテイリング	9,000	4,680.00	42,120,000	
イオン	415,200	2,552.00	1,059,590,400	
イズミ	22,000	4,185.00	92,070,000	
平和堂	22,000	2,017.00	44,374,000	
フジ	13,100	1,900.00	24,890,000	
ヤオコー	12,300	8,340.00	102,582,000	
ゼビオホールディングス	13,200	768.00	10,137,600	
ケーブホールディングス	104,200	1,413.00	147,234,600	

Olympicグループ	5,700	953.00	5,432,100
日産東京販売ホールディングス	16,500	254.00	4,191,000
シルバーライフ	1,500	1,999.00	2,998,500
一家ダイニングプロジェクト	1,100	589.00	647,900
Genky DrugStores	4,800	3,940.00	18,912,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,600	565.00	1,469,000
ブックオフグループホールディングス	6,300	799.00	5,033,700
アインホールディングス	13,300	6,910.00	91,903,000
元気寿司	2,800	2,270.00	6,356,000
ヤマダ電機	329,000	485.00	159,565,000
アークランドサカモト	17,000	1,920.00	32,640,000
ニトリホールディングス	46,700	22,590.00	1,054,953,000
グルメ杵屋	7,800	972.00	7,581,600
愛眼	8,600	224.00	1,926,400
ケーユーホールディングス	5,800	892.00	5,173,600
吉野家ホールディングス	35,500	2,089.00	74,159,500
松屋フーズホールディングス	5,200	3,630.00	18,876,000
サガミホールディングス	14,500	1,226.00	17,777,000
関西スーパーマーケット	9,100	1,300.00	11,830,000
王将フードサービス	7,900	5,810.00	45,899,000
プレナス	12,200	1,730.00	21,106,000
ミニストップ	8,100	1,550.00	12,555,000
アークス	22,100	2,531.00	55,935,100
パローホールディングス	23,900	2,299.00	54,946,100
ベルク	5,300	7,710.00	40,863,000
大庄	5,900	1,160.00	6,844,000
ファーストリテイリング	14,400	58,650.00	844,560,000
サンドラッグ	40,600	3,640.00	147,784,000
サックスパーホールディングス	9,400	555.00	5,217,000
ヤマザワ	2,600	1,730.00	4,498,000
やまや	2,300	2,030.00	4,669,000
ベルーナ	23,400	768.00	17,971,200
島根銀行	2,800	536.00	1,500,800
じもとホールディングス	73,000	96.00	7,008,000
めぶきフィナンシャルグループ	561,400	255.00	143,157,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,600	1,166.00	17,023,600
九州フィナンシャルグループ	236,400	454.00	107,325,600
ゆうちょ銀行	306,100	829.00	253,756,900
富山第一銀行	25,800	265.00	6,837,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	617,100	343.00	211,665,300
西日本フィナンシャルホールディングス	71,900	727.00	52,271,300
関西みらいフィナンシャルグループ	63,400	428.00	27,135,200

三十三フィナンシャルグループ	10,000	1,357.00	13,570,000
第四北越フィナンシャルグループ	18,700	2,137.00	39,961,900
新生銀行	79,300	1,303.00	103,327,900
あおぞら銀行	64,400	1,914.00	123,261,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,390,400	415.80	3,072,928,320
りそなホールディングス	1,185,600	376.30	446,141,280
三井住友トラスト・ホールディングス	204,200	2,939.00	600,143,800
三井住友フィナンシャルグループ	747,200	3,027.00	2,261,774,400
千葉銀行	360,500	513.00	184,936,500
群馬銀行	207,500	350.00	72,625,000
武蔵野銀行	16,100	1,539.00	24,777,900
千葉興業銀行	29,600	241.00	7,133,600
筑波銀行	44,900	172.00	7,722,800
七十七銀行	36,500	1,530.00	55,845,000
青森銀行	8,400	2,288.00	19,219,200
秋田銀行	6,900	1,508.00	10,405,200
山形銀行	12,100	1,372.00	16,601,200
岩手銀行	7,100	2,627.00	18,651,700
東邦銀行	96,600	237.00	22,894,200
東北銀行	5,200	970.00	5,044,000
みちのく銀行	6,900	1,015.00	7,003,500
ふくおかフィナンシャルグループ	91,000	1,655.00	150,605,000
静岡銀行	263,800	699.00	184,396,200
十六銀行	13,500	1,894.00	25,569,000
スルガ銀行	110,500	377.00	41,658,500
八十二銀行	260,700	417.00	108,711,900
山梨中央銀行	12,500	841.00	10,512,500
大垣共立銀行	21,300	2,227.00	47,435,100
福井銀行	9,200	1,688.00	15,529,600
北國銀行	10,800	2,989.00	32,281,200
清水銀行	4,500	1,611.00	7,249,500
富山銀行	2,100	2,359.00	4,953,900
滋賀銀行	21,700	2,512.00	54,510,400
南都銀行	18,000	2,058.00	37,044,000
百五銀行	97,200	325.00	31,590,000
京都銀行	38,700	4,050.00	156,735,000
紀陽銀行	38,300	1,630.00	62,429,000
ほくほくフィナンシャルグループ	71,900	964.00	69,311,600
広島銀行	159,500	522.00	83,259,000
山陰合同銀行	64,100	526.00	33,716,600
中国銀行	93,000	957.00	89,001,000
鳥取銀行	3,700	1,163.00	4,303,100

伊予銀行	154,200	647.00	99,767,400
百十四銀行	11,500	1,858.00	21,367,000
四国銀行	16,400	803.00	13,169,200
阿波銀行	17,600	2,420.00	42,592,000
大分銀行	6,200	2,421.00	15,010,200
宮崎銀行	7,200	2,467.00	17,762,400
佐賀銀行	6,600	1,249.00	8,243,400
沖縄銀行	9,900	3,120.00	30,888,000
琉球銀行	24,900	954.00	23,754,600
セブン銀行	360,900	271.00	97,803,900
みずほフィナンシャルグループ	14,680,500	139.60	2,049,397,800
高知銀行	3,900	682.00	2,659,800
山口フィナンシャルグループ	134,900	668.00	90,113,200
長野銀行	3,500	1,119.00	3,916,500
名古屋銀行	8,100	2,430.00	19,683,000
北洋銀行	162,900	218.00	35,512,200
愛知銀行	3,900	2,830.00	11,037,000
中京銀行	4,400	2,099.00	9,235,600
大光銀行	3,700	1,382.00	5,113,400
愛媛銀行	15,100	1,179.00	17,802,900
トマト銀行	4,200	1,020.00	4,284,000
京葉銀行	46,100	525.00	24,202,500
栃木銀行	52,200	169.00	8,821,800
北日本銀行	3,400	1,759.00	5,980,600
東和銀行	19,000	692.00	13,148,000
福島銀行	10,200	164.00	1,672,800
大東銀行	5,600	617.00	3,455,200
トモニホールディングス	83,500	353.00	29,475,500
フィデアホールディングス	104,900	101.00	10,594,900
池田泉州ホールディングス	124,200	165.00	20,493,000
F P G	33,600	539.00	18,110,400
マーキュリアインベストメント	5,000	595.00	2,975,000
S B I ホールディングス	120,700	2,232.00	269,402,400
ジャフコ	16,600	3,955.00	65,653,000
大和証券グループ本社	867,200	478.80	415,215,360
野村ホールディングス	1,901,300	485.60	923,271,280
岡三証券グループ	92,500	349.00	32,282,500
丸三証券	32,400	435.00	14,094,000
東洋証券	39,800	112.00	4,457,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	124,700	250.00	31,175,000
光世証券	2,900	575.00	1,667,500
水戸証券	32,000	208.00	6,656,000

いちよし証券	20,500	424.00	8,692,000
松井証券	61,900	906.00	56,081,400
マネックスグループ	79,900	240.00	19,176,000
極東証券	14,800	576.00	8,524,800
岩井コスモホールディングス	10,300	1,279.00	13,173,700
藍澤証券	19,600	703.00	13,778,800
マネーパートナーズグループ	12,200	213.00	2,598,600
スパークス・グループ	50,600	206.00	10,423,600
かんぽ生命保険	38,300	1,478.00	56,607,400
S O M P Oホールディングス	203,100	3,691.00	749,642,100
アニコム ホールディングス	8,900	4,460.00	39,694,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	282,500	2,844.00	803,430,000
第一生命ホールディングス	611,400	1,309.50	800,628,300
東京海上ホールディングス	382,000	4,762.00	1,819,084,000
T & Dホールディングス	322,900	934.00	301,588,600
アドバンスクリエイト	2,200	2,032.00	4,470,400
全国保証	30,400	4,015.00	122,056,000
イントラスト	3,800	825.00	3,135,000
日本モーゲージサービス	2,200	2,059.00	4,529,800
C a s a	3,800	1,136.00	4,316,800
アルヒ	17,200	1,509.00	25,954,800
プレミアグループ	5,900	1,820.00	10,738,000
クレディセゾン	75,700	1,099.00	83,194,300
芙蓉総合リース	11,300	5,950.00	67,235,000
みずほリース	16,700	2,389.00	39,896,300
東京センチュリー	21,800	5,920.00	129,056,000
日本証券金融	47,600	491.00	23,371,600
アイフル	164,800	226.00	37,244,800
リコーリース	8,500	2,907.00	24,709,500
イオンフィナンシャルサービス	66,100	901.00	59,556,100
アコム	217,100	391.00	84,886,100
ジャックス	11,900	1,676.00	19,944,400
オリエントコーポレーション	292,200	110.00	32,142,000
日立キャピタル	25,500	2,552.00	65,076,000
アプラスフィナンシャル	51,800	64.00	3,315,200
オリックス	670,300	1,210.50	811,398,150
三菱U F Jリース	274,200	475.00	130,245,000
九州リースサービス	5,300	563.00	2,983,900
日本取引所グループ	310,100	2,850.00	883,785,000
イー・ギャランティ	11,600	2,638.00	30,600,800
アサックス	5,600	671.00	3,757,600
N E Cキャピタルソリューション	4,400	1,969.00	8,663,600

いちご	142,900	272.00	38,868,800
日本駐車場開発	117,200	140.00	16,408,000
スター・マイカ・ホールディングス	6,700	1,339.00	8,971,300
A Dワークスグループ	20,000	169.00	3,380,000
ヒューリック	232,100	981.00	227,690,100
三栄建築設計	5,500	1,295.00	7,122,500
野村不動産ホールディングス	66,300	1,907.00	126,434,100
三重交通グループホールディングス	25,000	473.00	11,825,000
サムティ	16,400	1,244.00	20,401,600
ディア・ライフ	18,200	506.00	9,209,200
日本商業開発	7,800	1,524.00	11,887,200
ハウスコム	3,000	1,320.00	3,960,000
日本管理センター	8,300	1,224.00	10,159,200
サンセイランディック	4,900	785.00	3,846,500
フージャースホールディングス	21,500	549.00	11,803,500
オープンハウス	32,200	3,120.00	100,464,000
東急不動産ホールディングス	296,600	444.00	131,690,400
飯田グループホールディングス	91,000	1,770.00	161,070,000
イーランド	3,900	711.00	2,772,900
ムゲンエステート	10,300	497.00	5,119,100
ハウズドゥ	5,300	835.00	4,425,500
シーアールイー	3,800	1,588.00	6,034,400
グッドコムアセット	3,500	1,630.00	5,705,000
ジェイ・エス・ビー	2,900	2,821.00	8,180,900
テンポイノベーション	4,700	635.00	2,984,500
パーク24	58,800	1,740.00	102,312,000
パラカ	3,700	1,648.00	6,097,600
三井不動産	533,600	1,813.50	967,683,600
三菱地所	757,900	1,586.00	1,202,029,400
平和不動産	20,300	2,844.00	57,733,200
東京建物	115,000	1,209.00	139,035,000
ダイビル	29,300	1,010.00	29,593,000
京阪神ビルディング	18,300	1,323.00	24,210,900
住友不動産	243,400	2,820.50	686,509,700
テーオーシー	23,300	700.00	16,310,000
東京楽天地	2,100	4,050.00	8,505,000
スターツコーポレーション	15,300	2,165.00	33,124,500
フジ住宅	15,300	530.00	8,109,000
空港施設	14,300	422.00	6,034,600
明和地所	9,500	407.00	3,866,500
ゴールドクレスト	9,500	1,463.00	13,898,500
エスリード	5,300	1,373.00	7,276,900

日神グループホールディングス	19,900	372.00	7,402,800	
日本エスコン	19,500	829.00	16,165,500	
タカラレーベン	49,400	355.00	17,537,000	
A V A N T I A	8,000	872.00	6,976,000	
イオンモール	55,200	1,348.00	74,409,600	
毎日コムネット	4,600	764.00	3,514,400	
ファースト住建	6,200	992.00	6,150,400	
カチタス	27,300	2,509.00	68,495,700	
トーセイ	16,200	877.00	14,207,400	
穴吹興産	3,300	1,509.00	4,979,700	
サンフロンティア不動産	16,600	858.00	14,242,800	
エフ・ジェー・ネクスト	11,100	858.00	9,523,800	
インテリックス	3,000	489.00	1,467,000	
ランドビジネス	3,600	347.00	1,249,200	
サンネクスタグループ	4,700	1,076.00	5,057,200	
グランディハウス	12,300	374.00	4,600,200	
日本空港ビルデング	34,800	4,070.00	141,636,000	
日本工営	7,100	2,942.00	20,888,200	
L I F U L L	36,800	426.00	15,676,800	
ジェイエシーリクルートメント	7,100	1,094.00	7,767,400	
日本M&Aセンター	79,100	4,880.00	386,008,000	
メンバーズ	3,200	1,446.00	4,627,200	
中広	1,600	500.00	800,000	
UTグループ	16,500	2,529.00	41,728,500	
アイティメディア	4,300	1,764.00	7,585,200	
タケエイ	10,100	1,073.00	10,837,300	
E・Jホールディングス	1,900	2,154.00	4,092,600	
ビーネックスグループ	13,200	1,085.00	14,322,000	
コシダカホールディングス	25,500	404.00	10,302,000	
アルトナー	2,700	859.00	2,319,300	
パソナグループ	11,400	1,304.00	14,865,600	
C D S	2,700	1,252.00	3,380,400	
リンクアンドモチベーション	23,400	352.00	8,236,800	
G C A	12,900	617.00	7,959,300	
エス・エム・エス	32,600	2,489.00	81,141,400	
サニーサイドアップグループ	3,800	663.00	2,519,400	
パーソルホールディングス	104,700	1,438.00	150,558,600	
リニカル	5,200	847.00	4,404,400	
クックパッド	36,900	328.00	12,103,200	
エスクリ	3,600	360.00	1,296,000	
アイ・ケイ・ケイ	5,300	530.00	2,809,000	
学情	3,800	1,009.00	3,834,200	

スタジオアリス	5,300	1,557.00	8,252,100
シミックホールディングス	5,200	1,321.00	6,869,200
エプロ	2,300	1,304.00	2,999,200
N J S	2,400	1,741.00	4,178,400
総合警備保障	41,700	5,030.00	209,751,000
カカクコム	77,400	2,758.00	213,469,200
アイロムグループ	3,800	2,327.00	8,842,600
セントケア・ホールディング	7,000	436.00	3,052,000
サイネックス	1,900	684.00	1,299,600
ルネサンス	5,900	903.00	5,327,700
ディップ	14,800	2,200.00	32,560,000
デジタルホールディングス	5,700	1,422.00	8,105,400
ツクイ	24,900	492.00	12,250,800
キャリアデザインセンター	2,500	855.00	2,137,500
ベネフィット・ワン	38,100	2,158.00	82,219,800
エムスリー	230,800	5,110.00	1,179,388,000
ツカダ・グローバルホールディング	6,700	277.00	1,855,900
プラス	1,600	438.00	700,800
アウトソーシング	60,100	618.00	37,141,800
ウェルネット	10,700	618.00	6,612,600
ワールドホールディングス	3,600	1,561.00	5,619,600
ディー・エヌ・エー	44,400	1,270.00	56,388,000
博報堂D Yホールディングス	145,700	1,243.00	181,105,100
ぐるなび	18,400	635.00	11,684,000
タカミヤ	11,300	540.00	6,102,000
ジャパンベストレスキューシステム	8,300	811.00	6,731,300
ファンコミュニケーションズ	29,000	447.00	12,963,000
ライク	3,500	1,615.00	5,652,500
ビジネス・ブレークスルー	4,700	374.00	1,757,800
エスプール	27,000	723.00	19,521,000
W D Bホールディングス	4,800	2,703.00	12,974,400
手間いらず	700	3,770.00	2,639,000
ティア	6,300	458.00	2,885,400
C D G	1,200	1,703.00	2,043,600
バリューコマース	5,900	3,350.00	19,765,000
インフォマート	114,800	672.00	77,145,600
J Pホールディングス	33,300	272.00	9,057,600
エコナックホールディングス	20,000	92.00	1,840,000
E P Sホールディングス	14,300	997.00	14,257,100
レッグス	2,700	880.00	2,376,000
プレステージ・インターナショナル	39,300	878.00	34,505,400
アミューズ	5,800	2,130.00	12,354,000

ドリームインキュベータ	3,300	1,365.00	4,504,500
クイック	6,600	1,116.00	7,365,600
T A C	6,900	195.00	1,345,500
ケネディクス	97,700	483.00	47,189,100
電通グループ	107,900	2,554.00	275,576,600
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,200	547.00	2,297,400
ぴあ	3,000	3,060.00	9,180,000
イオンファンタジー	4,100	1,569.00	6,432,900
シーティーエス	11,900	836.00	9,948,400
ネクシィーズグループ	3,300	856.00	2,824,800
H . U . グループホールディングス	29,300	2,458.00	72,019,400
アルプス技研	9,300	1,926.00	17,911,800
ダイオーズ	2,200	982.00	2,160,400
日本空調サービス	11,100	742.00	8,236,200
オリエンタルランド	111,300	14,000.00	1,558,200,000
ダスキン	26,100	2,735.00	71,383,500
明光ネットワークジャパン	13,400	771.00	10,331,400
ファルコホールディングス	5,800	1,575.00	9,135,000
ラウンドワン	29,400	727.00	21,373,800
リゾートトラスト	48,100	1,327.00	63,828,700
ビー・エム・エル	13,500	2,706.00	36,531,000
ワタベウェディング	2,000	277.00	554,000
りらいあコミュニケーションズ	19,000	1,164.00	22,116,000
リソー教育	48,200	315.00	15,183,000
早稲田アカデミー	4,700	975.00	4,582,500
ユー・エス・エス	117,200	1,696.00	198,771,200
東京個別指導学院	3,900	532.00	2,074,800
サイバーエージェント	64,500	5,760.00	371,520,000
楽天	488,000	1,004.00	489,952,000
クリーク・アンド・リバー社	5,600	1,200.00	6,720,000
テー・オー・ダブリュー	17,000	288.00	4,896,000
山田コンサルティンググループ	6,900	1,277.00	8,811,300
セントラルスポーツ	3,900	2,191.00	8,544,900
フルキャストホールディングス	10,500	1,303.00	13,681,500
エン・ジャパン	18,600	2,832.00	52,675,200
リソルホールディングス	1,200	3,485.00	4,182,000
テクノプロ・ホールディングス	20,900	5,780.00	120,802,000
アトラ	2,900	240.00	696,000
インターワークス	2,300	351.00	807,300
アイ・アールジャパンホールディングス	4,300	12,500.00	53,750,000
K e e P e r 技研	3,900	1,711.00	6,672,900
ファーストロジック	2,200	647.00	1,423,400

三機サービス	2,100	1,065.00	2,236,500
Gunosy	6,600	799.00	5,273,400
デザインワン・ジャパン	3,500	230.00	805,000
イー・ガーディアン	4,600	3,050.00	14,030,000
リブセンス	7,100	295.00	2,094,500
ジャパンマテリアル	32,300	1,667.00	53,844,100
ベクトル	13,200	790.00	10,428,000
ウチヤマホールディングス	5,500	297.00	1,633,500
チャーム・ケア・コーポレーション	9,000	766.00	6,894,000
キャリアリンク	3,600	808.00	2,908,800
I B J	7,300	679.00	4,956,700
アサンテ	4,300	1,473.00	6,333,900
N・フィールド	7,400	471.00	3,485,400
バリューHR	4,200	1,400.00	5,880,000
M&Aキャピタルパートナーズ	8,500	3,650.00	31,025,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,100	2,240.00	9,184,000
E R Iホールディングス	3,100	612.00	1,897,200
アビスト	1,700	2,695.00	4,581,500
シグマクシス	7,200	1,584.00	11,404,800
ウィルグループ	7,000	630.00	4,410,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,000	296.00	4,440,000
リクルートホールディングス	749,900	3,558.00	2,668,144,200
エラン	6,200	1,814.00	11,246,800
土木管理総合試験所	4,800	381.00	1,828,800
ネットマーケティング	4,200	565.00	2,373,000
日本郵政	858,000	775.70	665,550,600
ベルシステム24ホールディングス	17,600	1,747.00	30,747,200
鎌倉新書	8,000	842.00	6,736,000
S M N	2,300	1,013.00	2,329,900
一蔵	1,400	379.00	530,600
L I T A L I C O	3,600	2,202.00	7,927,200
グローバルキッズCOMPANY	2,100	660.00	1,386,000
エアトリ	5,500	1,114.00	6,127,000
アトラエ	3,200	2,780.00	8,896,000
ストライク	4,000	4,725.00	18,900,000
ソラスト	29,000	1,082.00	31,378,000
セラク	3,400	1,318.00	4,481,200
インソース	4,400	2,513.00	11,057,200
ベйкаレント・コンサルティング	6,400	12,900.00	82,560,000
Orchestra Holdings	2,200	1,662.00	3,656,400
アイモバイル	3,800	728.00	2,766,400
キャリアインデックス	4,600	399.00	1,835,400

MS - J a p a n	3,500	807.00	2,824,500
船場	1,800	940.00	1,692,000
グレイステクノロジー	4,800	5,690.00	27,312,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	11,100	3,550.00	39,405,000
フルテック	1,500	1,325.00	1,987,500
グリーンズ	2,900	464.00	1,345,600
GameWith	3,300	543.00	1,791,900
ソウルドアウト	2,200	2,238.00	4,923,600
MS&Consulting	2,200	574.00	1,262,800
ミダック	1,400	1,570.00	2,198,000
日総工産	7,100	629.00	4,465,900
キュービーネットホールディングス	4,400	1,793.00	7,889,200
RPAホールディングス	8,100	749.00	6,066,900
スプリックス	3,100	696.00	2,157,600
マネジメントソリューションズ	4,600	1,348.00	6,200,800
プロレド・パートナーズ	1,400	5,260.00	7,364,000
and factory	1,000	929.00	929,000
ギークス	1,200	1,089.00	1,306,800
カーブスホールディングス	28,900	573.00	16,559,700
フォーラムエンジニアリング	5,600	747.00	4,183,200
アドバンテッジリスクマネジメント	5,400	825.00	4,455,000
リログループ	57,300	1,965.00	112,594,500
東祥	6,600	1,199.00	7,913,400
エイチ・アイ・エス	16,300	1,556.00	25,362,800
ラックランド	2,500	2,220.00	5,550,000
共立メンテナンス	17,400	3,405.00	59,247,000
イチネンホールディングス	11,800	1,164.00	13,735,200
建設技術研究所	7,300	1,708.00	12,468,400
スペース	6,900	940.00	6,486,000
長大	4,300	1,067.00	4,588,100
燦ホールディングス	4,600	1,205.00	5,543,000
スバル興業	600	7,640.00	4,584,000
東京テアトル	4,200	1,203.00	5,052,600
タナベ経営	2,100	1,305.00	2,740,500
ナガワ	3,400	7,610.00	25,874,000
よみうりランド	2,300	3,595.00	8,268,500
東京都競馬	6,900	4,240.00	29,256,000
カナモト	17,200	2,299.00	39,542,800
東京ドーム	42,500	733.00	31,152,500
西尾レントオール	9,700	2,170.00	21,049,000
トランス・コスモス	10,000	2,596.00	25,960,000
乃村工藝社	45,000	808.00	36,360,000

藤田観光	4,600	1,529.00	7,033,400	
KNT-CTホールディングス	6,500	919.00	5,973,500	
日本管財	11,300	2,013.00	22,746,900	
トーカイ	10,200	2,264.00	23,092,800	
白洋舎	1,200	2,787.00	3,344,400	
セコム	111,100	9,366.00	1,040,562,600	
セントラル警備保障	5,100	3,575.00	18,232,500	
丹青社	19,900	703.00	13,989,700	
メイテック	12,800	5,370.00	68,736,000	
応用地質	11,300	1,449.00	16,373,700	
船井総研ホールディングス	21,700	2,369.00	51,407,300	
進学会ホールディングス	4,300	421.00	1,810,300	
オオバ	7,600	689.00	5,236,400	
いであ	2,600	1,831.00	4,760,600	
学究社	3,200	1,108.00	3,545,600	
ベネッセホールディングス	34,900	2,934.00	102,396,600	
イオンディライト	12,900	3,245.00	41,860,500	
ナック	5,900	930.00	5,487,000	
ニチイ学館	15,000	1,605.00	24,075,000	
ダイセキ	17,600	2,411.00	42,433,600	
ステップ	3,900	1,540.00	6,006,000	
合計	128,415,700		242,055,356,100	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2020年 7月27日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	

	2020年 7月27日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	553,548,423
国債証券	304,512,333,550
地方債証券	19,750,154,124
特殊債券	24,902,667,423
社債券	15,536,473,000
未収入金	669,272,500
未収利息	682,473,311
前払金	140,000
前払費用	16,874,493
流動資産合計	366,623,936,824
資産合計	366,623,936,824
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	141,320
未払金	672,426,000
未払解約金	155,189,254
未払利息	557
流動負債合計	827,757,131
負債合計	827,757,131
純資産の部	
元本等	
元本	265,539,402,653
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	100,256,777,040
元本等合計	365,796,179,693
純資産合計	365,796,179,693
負債純資産合計	366,623,936,824

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 7月27日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	2020年 7月27日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 7月27日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	265,539,402,653口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。
	有価証券 101,579,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3776円 (1万口当たり純資産額) (13,776円)

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

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2020年 7月27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債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月27日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2020年 7月27日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	224,331,028,299円
期中追加設定元本額	68,816,088,545円

区分	2020年 7月27日現在
期中一部解約元本額	27,607,714,191円
期末元本額	265,539,402,653円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	900,638,839円
D C日本債券インデックスファンド	2,649,116,371円
D C日本債券インデックスファンドL	41,613,827,262円
D Cバランスファンド30	9,037,151,776円
D Cバランスファンド50	5,830,565,745円
D Cバランスファンド70	1,488,481,822円
日本債券インデックスe	1,328,700,018円
インデックスコレクション（国内債券）	36,612,326,156円
インデックスコレクション（バランス株式30）	47,943,227,126円
インデックスコレクション（バランス株式50）	3,941,676,301円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,393,269,304円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	46,599,407,134円
日本債券パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	3,612,065,715円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	232,952,012円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	1,133,412,449円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	158,594,198円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	183,373,575円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	1,431,640,613円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	3,778,440,809円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	1,101,403,411円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	12,265,837,253円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	140,319,335円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	409,672,518円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	3,076,216,926円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	217,991,927円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	367,753,437円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,138,268,790円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	383,556,608円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	890,946,610円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	100,151,966円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	3,640,602,245円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	1,659,706,201円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	26,943,237,172円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	488,893,364円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	151,816,710円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	43,077,705円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	648,788,074円
私募日本債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	2,295,176円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 7月27日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		3,251,370,850
地方債証券		124,296,199
特殊債券		138,914,596
社債券		112,065,000
合計		3,626,646,645

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2020年 7月27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	609,380,000	-	609,240,000	140,000
	合計	609,380,000	-	609,240,000	140,000

(注)1.時価の算定方法

債券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.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.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

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第403回利付国債(2年)	40,000,000	40,105,200	
	第404回利付国債(2年)	200,000,000	200,570,000	
	第405回利付国債(2年)	740,000,000	742,308,800	

第406回利付国債(2年)	740,000,000	742,434,600	
第407回利付国債(2年)	4,890,000,000	4,907,115,000	
第408回利付国債(2年)	870,000,000	873,236,400	
第409回利付国債(2年)	2,640,000,000	2,650,401,600	
第410回利付国債(2年)	290,000,000	291,177,400	
第412回利付国債(2年)	270,000,000	271,212,300	
第413回利付国債(2年)	730,000,000	733,299,600	
第414回利付国債(2年)	100,000,000	100,453,000	
第129回利付国債(5年)	1,980,000,000	1,985,801,400	
第130回利付国債(5年)	1,880,000,000	1,886,711,600	
第131回利付国債(5年)	1,840,000,000	1,847,562,400	
第132回利付国債(5年)	1,125,000,000	1,130,231,250	
第133回利付国債(5年)	1,670,000,000	1,678,800,900	
第134回利付国債(5年)	3,330,000,000	3,349,613,700	
第135回利付国債(5年)	3,200,000,000	3,220,800,000	
第136回利付国債(5年)	1,670,000,000	1,682,140,900	
第137回利付国債(5年)	1,880,000,000	1,894,852,000	
第138回利付国債(5年)	7,610,000,000	7,674,913,300	
第139回利付国債(5年)	2,470,000,000	2,492,155,900	
第140回利付国債(5年)	1,800,000,000	1,816,920,000	
第141回利付国債(5年)	7,060,000,000	7,129,188,000	
第142回利付国債(5年)	1,560,000,000	1,575,865,200	
第143回利付国債(5年)	3,470,000,000	3,506,435,000	
第144回利付国債(5年)	310,000,000	313,357,300	
第1回利付国債(40年)	230,000,000	339,429,400	
第2回利付国債(40年)	350,000,000	502,225,500	
第3回利付国債(40年)	380,000,000	548,902,400	
第4回利付国債(40年)	595,000,000	866,076,050	
第5回利付国債(40年)	455,000,000	642,341,700	
第6回利付国債(40年)	430,000,000	598,938,400	
第7回利付国債(40年)	1,480,000,000	1,985,745,600	
第8回利付国債(40年)	960,000,000	1,206,220,800	
第9回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,007,158,900	
第10回利付国債(40年)	970,000,000	1,071,898,500	
第11回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,351,904,400	
第12回利付国債(40年)	640,000,000	620,896,000	
第13回利付国債(40年)	70,000,000	67,866,400	
第317回利付国債(10年)	280,000,000	284,040,400	
第318回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,165,272,000	
第319回利付国債(10年)	560,000,000	569,839,200	
第320回利付国債(10年)	1,270,000,000	1,290,535,900	
第321回利付国債(10年)	1,540,000,000	1,569,183,000	

第322回利付国債（10年）	860,000,000	874,878,000	
第323回利付国債（10年）	690,000,000	703,703,400	
第324回利付国債（10年）	1,660,000,000	1,689,813,600	
第325回利付国債（10年）	2,245,000,000	2,290,708,200	
第326回利付国債（10年）	1,260,000,000	1,285,603,200	
第327回利付国債（10年）	1,740,000,000	1,779,550,200	
第328回利付国債（10年）	2,010,000,000	2,049,737,700	
第329回利付国債（10年）	2,035,000,000	2,090,921,800	
第330回利付国債（10年）	1,590,000,000	1,637,763,600	
第331回利付国債（10年）	130,000,000	133,083,600	
第332回利付国債（10年）	2,270,000,000	2,328,112,000	
第333回利付国債（10年）	2,290,000,000	2,352,494,100	
第334回利付国債（10年）	1,640,000,000	1,687,527,200	
第335回利付国債（10年）	1,655,000,000	1,698,824,400	
第336回利付国債（10年）	270,000,000	277,581,600	
第337回利付国債（10年）	1,870,000,000	1,905,978,800	
第338回利付国債（10年）	3,610,000,000	3,698,517,200	
第339回利付国債（10年）	2,875,000,000	2,948,600,000	
第340回利付国債（10年）	3,930,000,000	4,036,896,000	
第341回利付国債（10年）	1,500,000,000	1,534,635,000	
第342回利付国債（10年）	3,190,000,000	3,230,768,200	
第343回利付国債（10年）	2,455,000,000	2,487,798,800	
第344回利付国債（10年）	3,500,000,000	3,548,790,000	
第345回利付国債（10年）	2,580,000,000	2,617,410,000	
第346回利付国債（10年）	2,495,000,000	2,532,599,650	
第347回利付国債（10年）	2,945,000,000	2,991,089,250	
第348回利付国債（10年）	3,900,000,000	3,961,854,000	
第349回利付国債（10年）	2,055,000,000	2,087,962,200	
第350回利付国債（10年）	2,650,000,000	2,691,843,500	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債（10年）	2,450,000,000	2,487,999,500	
第352回利付国債（10年）	1,360,000,000	1,380,073,600	
第353回利付国債（10年）	4,020,000,000	4,075,998,600	
第354回利付国債（10年）	3,660,000,000	3,707,653,200	
第355回利付国債（10年）	2,680,000,000	2,712,267,200	
第356回利付国債（10年）	3,390,000,000	3,428,849,400	
第357回利付国債（10年）	2,680,000,000	2,707,711,200	
第358回利付国債（10年）	3,190,000,000	3,220,751,600	
第1回利付国債（30年）	50,000,000	62,893,000	
第2回利付国債（30年）	100,000,000	122,961,000	
第3回利付国債（30年）	140,000,000	171,423,000	
第4回利付国債（30年）	190,000,000	245,947,400	
第5回利付国債（30年）	180,000,000	221,374,800	

第6回利付国債(30年)	20,000,000	25,203,000
第7回利付国債(30年)	190,000,000	238,653,300
第9回利付国債(30年)	180,000,000	207,763,200
第10回利付国債(30年)	170,000,000	190,039,600
第11回利付国債(30年)	280,000,000	334,692,400
第12回利付国債(30年)	370,000,000	462,429,700
第13回利付国債(30年)	330,000,000	409,104,300
第14回利付国債(30年)	350,000,000	453,771,500
第15回利付国債(30年)	370,000,000	486,039,400
第16回利付国債(30年)	250,000,000	329,337,500
第17回利付国債(30年)	420,000,000	548,923,200
第18回利付国債(30年)	340,000,000	440,640,000
第19回利付国債(30年)	300,000,000	389,718,000
第20回利付国債(30年)	290,000,000	386,361,200
第21回利付国債(30年)	630,000,000	822,704,400
第22回利付国債(30年)	380,000,000	509,101,200
第23回利付国債(30年)	170,000,000	228,303,200
第24回利付国債(30年)	75,000,000	101,034,750
第25回利付国債(30年)	335,000,000	441,432,850
第26回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,233,007,100
第27回利付国債(30年)	490,000,000	666,894,900
第28回利付国債(30年)	1,050,000,000	1,435,875,000
第29回利付国債(30年)	490,000,000	664,807,500
第30回利付国債(30年)	555,000,000	746,369,550
第31回利付国債(30年)	670,000,000	893,230,600
第32回利付国債(30年)	955,000,000	1,297,281,550
第33回利付国債(30年)	1,090,000,000	1,424,466,500
第34回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,648,183,400
第35回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,473,718,400
第36回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,966,829,800
第37回利付国債(30年)	1,295,000,000	1,688,485,750
第38回利付国債(30年)	875,000,000	1,125,836,250
第39回利付国債(30年)	1,040,000,000	1,362,920,000
第40回利付国債(30年)	545,000,000	702,924,650
第41回利付国債(30年)	565,000,000	717,538,700
第42回利付国債(30年)	1,000,000,000	1,271,200,000
第43回利付国債(30年)	905,000,000	1,151,558,200
第44回利付国債(30年)	710,000,000	904,291,500
第45回利付国債(30年)	760,000,000	934,397,200
第46回利付国債(30年)	1,080,000,000	1,330,084,800
第47回利付国債(30年)	975,000,000	1,224,648,750
第48回利付国債(30年)	760,000,000	919,987,600
第49回利付国債(30年)	1,330,000,000	1,610,630,000

第50回利付国債(30年)	830,000,000	886,589,400	
第51回利付国債(30年)	935,000,000	885,014,900	
第52回利付国債(30年)	950,000,000	944,537,500	
第53回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,088,596,600	
第54回利付国債(30年)	955,000,000	1,018,765,350	
第55回利付国債(30年)	780,000,000	831,526,800	
第56回利付国債(30年)	940,000,000	1,001,419,600	
第57回利付国債(30年)	580,000,000	618,198,800	
第58回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,555,046,000	
第59回利付国債(30年)	640,000,000	664,825,600	
第60回利付国債(30年)	1,420,000,000	1,548,680,400	
第61回利付国債(30年)	760,000,000	788,963,600	
第62回利付国債(30年)	360,000,000	354,664,800	
第63回利付国債(30年)	880,000,000	842,881,600	
第64回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,166,698,200	
第65回利付国債(30年)	910,000,000	869,950,900	
第66回利付国債(30年)	660,000,000	629,943,600	
第52回利付国債(20年)	430,000,000	441,175,700	
第53回利付国債(20年)	350,000,000	361,025,000	
第54回利付国債(20年)	280,000,000	289,212,000	
第55回利付国債(20年)	490,000,000	507,385,200	
第56回利付国債(20年)	410,000,000	426,715,700	
第57回利付国債(20年)	360,000,000	373,993,200	
第58回利付国債(20年)	250,000,000	261,015,000	
第59回利付国債(20年)	440,000,000	459,527,200	
第60回利付国債(20年)	570,000,000	591,181,200	
第61回利付国債(20年)	390,000,000	401,848,200	
第62回利付国債(20年)	250,000,000	256,870,000	
第63回利付国債(20年)	570,000,000	602,239,200	
第64回利付国債(20年)	410,000,000	436,514,700	
第65回利付国債(20年)	370,000,000	395,829,700	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	351,912,000	
第67回利付国債(20年)	310,000,000	333,160,100	
第68回利付国債(20年)	230,000,000	249,711,000	
第69回利付国債(20年)	530,000,000	573,481,200	
第70回利付国債(20年)	490,000,000	538,647,200	
第71回利付国債(20年)	400,000,000	436,580,000	
第72回利付国債(20年)	710,000,000	776,186,200	
第73回利付国債(20年)	540,000,000	590,868,000	
第74回利付国債(20年)	310,000,000	340,572,200	
第75回利付国債(20年)	360,000,000	397,411,200	
第76回利付国債(20年)	340,000,000	372,157,200	

第77回利付国債(20年)	290,000,000	318,782,500
第78回利付国債(20年)	20,000,000	21,984,200
第79回利付国債(20年)	100,000,000	110,413,000
第80回利付国債(20年)	250,000,000	277,262,500
第81回利付国債(20年)	180,000,000	199,765,800
第82回利付国債(20年)	485,000,000	540,770,150
第83回利付国債(20年)	70,000,000	78,442,000
第84回利付国債(20年)	190,000,000	211,880,400
第85回利付国債(20年)	360,000,000	405,410,400
第86回利付国債(20年)	240,000,000	273,002,400
第87回利付国債(20年)	170,000,000	192,409,400
第88回利付国債(20年)	340,000,000	388,854,600
第89回利付国債(20年)	320,000,000	364,080,000
第90回利付国債(20年)	420,000,000	480,349,800
第91回利付国債(20年)	310,000,000	356,462,800
第92回利付国債(20年)	790,000,000	903,056,900
第93回利付国債(20年)	260,000,000	296,914,800
第94回利付国債(20年)	445,000,000	511,158,150
第95回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,285,097,000
第96回利付国債(20年)	200,000,000	230,872,000
第97回利付国債(20年)	210,000,000	245,036,400
第98回利付国債(20年)	370,000,000	429,063,100
第99回利付国債(20年)	460,000,000	535,817,200
第100回利付国債(20年)	760,000,000	894,641,600
第101回利付国債(20年)	360,000,000	429,321,600
第102回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,281,870,700
第103回利付国債(20年)	335,000,000	398,670,100
第104回利付国債(20年)	260,000,000	305,279,000
第105回利付国債(20年)	730,000,000	860,159,000
第106回利付国債(20年)	270,000,000	320,355,000
第107回利付国債(20年)	270,000,000	319,218,300
第108回利付国債(20年)	725,000,000	844,922,250
第109回利付国債(20年)	290,000,000	338,943,300
第110回利付国債(20年)	515,000,000	610,856,950
第111回利付国債(20年)	450,000,000	539,748,000
第112回利付国債(20年)	550,000,000	654,786,000
第113回利付国債(20年)	905,000,000	1,081,321,150
第114回利付国債(20年)	610,000,000	731,060,600
第115回利付国債(20年)	370,000,000	446,911,900
第116回利付国債(20年)	260,000,000	315,161,600
第117回利付国債(20年)	240,000,000	288,604,800
第118回利付国債(20年)	450,000,000	538,263,000
第119回利付国債(20年)	320,000,000	376,438,400

第120回利付国債(20年)	1,330,000,000	1,538,291,300	
第121回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,249,279,500	
第122回利付国債(20年)	490,000,000	578,038,300	
第123回利付国債(20年)	480,000,000	582,379,200	
第124回利付国債(20年)	320,000,000	384,940,800	
第125回利付国債(20年)	500,000,000	613,815,000	
第126回利付国債(20年)	450,000,000	542,902,500	
第127回利付国債(20年)	400,000,000	478,344,000	
第128回利付国債(20年)	600,000,000	719,118,000	
第129回利付国債(20年)	260,000,000	308,804,600	
第130回利付国債(20年)	890,000,000	1,059,723,000	
第131回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,321,208,000	
第132回利付国債(20年)	600,000,000	709,374,000	
第133回利付国債(20年)	620,000,000	740,019,600	
第134回利付国債(20年)	970,000,000	1,159,790,200	
第135回利付国債(20年)	155,000,000	183,543,250	
第136回利付国債(20年)	450,000,000	527,688,000	
第137回利付国債(20年)	410,000,000	486,547,000	
第138回利付国債(20年)	540,000,000	628,133,400	
第139回利付国債(20年)	530,000,000	622,723,500	
第140回利付国債(20年)	1,195,000,000	1,420,209,700	
第141回利付国債(20年)	780,000,000	928,839,600	
第142回利付国債(20年)	540,000,000	649,625,400	
第143回利付国債(20年)	830,000,000	979,939,500	
第144回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,285,053,000	
第145回利付国債(20年)	1,730,000,000	2,067,920,900	
第146回利付国債(20年)	1,300,000,000	1,556,789,000	
第147回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,305,183,000	
第148回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,597,986,400	
第149回利付国債(20年)	2,140,000,000	2,517,817,000	
第150回利付国債(20年)	2,260,000,000	2,631,318,000	
第151回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,649,447,500	
第152回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,308,953,000	
第153回利付国債(20年)	2,530,000,000	2,917,773,100	
第154回利付国債(20年)	2,170,000,000	2,472,671,600	
第155回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,364,746,500	
第156回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,476,071,000	
第157回利付国債(20年)	1,300,000,000	1,281,241,000	
第158回利付国債(20年)	1,940,000,000	2,001,284,600	
第159回利付国債(20年)	1,380,000,000	1,443,562,800	
第160回利付国債(20年)	630,000,000	668,883,600	
第161回利付国債(20年)	1,065,000,000	1,112,797,200	

	第162回利付国債(20年)	1,170,000,000	1,222,252,200
	第163回利付国債(20年)	1,475,000,000	1,539,251,000
	第164回利付国債(20年)	960,000,000	984,739,200
	第165回利付国債(20年)	1,720,000,000	1,761,950,800
	第166回利付国債(20年)	2,040,000,000	2,159,992,800
	第167回利付国債(20年)	1,680,000,000	1,717,615,200
	第168回利付国債(20年)	1,400,000,000	1,404,872,000
	第169回利付国債(20年)	320,000,000	314,931,200
	第170回利付国債(20年)	2,600,000,000	2,556,008,000
	第171回利付国債(20年)	250,000,000	245,497,500
	第172回利付国債(20年)	310,000,000	310,000,000
	国債証券合計	281,645,000,000	304,512,333,550
地方債証券	第1回東京都公募公債(東京グリーンbond(30年))	100,000,000	108,161,000
	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	108,137,000
	第7回東京都公募公債(30年)	200,000,000	271,864,000
	第11回東京都公募公債(20年)	200,000,000	228,516,000
	第13回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,315,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,774,000
	第18回東京都公募公債(20年)	200,000,000	236,748,000
	第20回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,102,000
	第21回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,401,000
	第714回東京都公募公債	100,000,000	101,714,000
	第719回東京都公募公債	100,000,000	102,211,000
	第722回東京都公募公債	200,000,000	204,490,000
	第740回東京都公募公債	100,000,000	101,927,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	101,695,000
	第786回東京都公募公債	200,000,000	201,294,000
	第800回東京都公募公債	300,000,000	298,992,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,806,000
	第16回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	119,925,000
	第21回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,734,000
	第190回神奈川県公募公債	100,000,000	101,622,000
	第196回神奈川県公募公債	100,000,000	101,729,000
	第243回神奈川県公募公債	100,000,000	99,618,000
	第2回大阪府公募公債(20年)	300,000,000	358,584,000
	第363回大阪府公募公債(10年)	114,000,000	115,741,920
	第371回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	202,968,000
	第376回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,469,000
	第403回大阪府公募公債(10年)	300,000,000	306,423,000
	第415回大阪府公募公債(10年)	108,000,000	108,461,160
	第417回大阪府公募公債(10年)	108,000,000	109,223,640
	第423回大阪府公募公債(10年)	300,000,000	302,220,000

平成25年度第2回京都府公募公債（15年）	100,000,000	107,558,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,582,000	
平成27年度第13回京都府公募公債	105,860,000	106,187,107	
平成29年度第3回京都府公募公債	100,000,000	99,971,000	
令和元年度第3回京都府公募公債	100,000,000	99,941,000	
第3回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	115,864,000	
第4回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	109,063,000	
平成24年度第18回兵庫県公募公債	100,000,000	101,627,000	
平成25年度第14回兵庫県公募公債	100,000,000	102,405,000	
平成26年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	102,246,000	
平成28年度第30回兵庫県公募公債	100,000,000	100,925,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	104,397,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	101,733,000	
平成25年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	101,518,000	
平成27年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	102,294,000	
平成22年度第14回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	119,803,000	
平成24年度第2回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,674,000	
平成24年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,840,000	
平成25年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,135,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	203,566,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,080,000	
平成29年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,427,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	201,772,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,860,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	118,310,000	
平成24年度第2回広島県公募公債	100,000,000	101,625,000	
平成27年度第2回広島県公募公債	162,000,000	166,660,740	
平成29年度第7回広島県公募公債	131,440,000	132,739,941	
第5回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	234,652,000	
第9回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	104,938,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	197,724,000	
平成23年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,450,000	
平成24年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	101,599,000	
平成24年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	101,745,000	
平成27年度第8回埼玉県公募公債	200,000,000	203,898,000	
平成29年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	101,079,000	

平成19年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	136,177,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債（30年）	200,000,000	263,842,000	
平成22年度第2回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	109,380,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	109,000,000	
平成24年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	102,007,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	101,836,000	
平成29年度第6回福岡県公募公債	170,000,000	171,689,800	
平成29年度第8回福岡県公募公債	200,000,000	202,414,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	237,812,000	
第8回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	119,936,000	
平成24年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	102,035,000	
平成26年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	102,048,000	
平成28年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	100,145,000	
平成29年度第5回千葉県公募公債	120,000,000	121,282,800	
令和元年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	99,719,000	
平成24年度第2回新潟県公募公債	200,000,000	203,962,000	
平成27年度第3回新潟県公募公債	200,000,000	200,732,000	
平成24年度第1回岐阜県公募公債（10年）	139,630,000	142,042,806	
第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,106,000	
第102回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,167,000	
第103回共同発行市場公募地方債	177,400,000	179,555,410	
第105回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,948,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,788,000	
第110回共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,740,000	
第111回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,302,000	
第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,805,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,669,000	
第118回共同発行市場公募地方債	550,000,000	561,192,500	
第120回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,742,000	
第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,892,000	
第130回共同発行市場公募地方債	350,000,000	358,991,500	
第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,484,000	
第134回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,480,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,201,000	
第139回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,404,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,078,000	
第145回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,805,000	
第153回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,234,000	
第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	299,907,000	

	第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,180,000	
	第175回共同発行市場公募地方債	150,000,000	151,567,500	
	第181回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,847,000	
	平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	101,743,000	
	平成29年度第1回熊本県公募公債（5年）	100,000,000	99,970,000	
	平成23年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,357,000	
	第7回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	107,952,000	
	平成24年度第8回大阪市公募公債	300,000,000	306,375,000	
	平成29年度第1回大阪市公募公債（5年）	200,000,000	199,944,000	
	第1回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	106,676,000	
	第13回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	108,045,000	
	第25回名古屋市公募公債（5年）	100,000,000	100,010,000	
	第482回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,626,000	
	第488回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	102,376,000	
	第495回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,309,000	
	第2回京都市公募公債（20年）	100,000,000	110,601,000	
	第6回京都市公募公債（20年）	100,000,000	116,419,000	
	平成27年度第5回京都市公募公債	200,000,000	201,670,000	
	平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	117,992,000	
	第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	110,496,000	
	平成25年度第6回横浜市公募公債	100,000,000	102,358,000	
	第25回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	117,494,000	
	第26回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	118,579,000	
	平成24年度第7回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,560,000	
	第88回川崎市公募公債	100,000,000	102,201,000	
	平成29年度第12回福岡市公募公債	130,000,000	131,288,300	
	平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	101,715,000	
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,207,000	
	平成26年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	204,894,000	
	平成27年度第1回三重県公募公債	100,000,000	102,207,000	
	平成24年度第1回福井県公募公債	200,000,000	203,486,000	
	平成24年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	101,747,000	
	平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	102,308,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	101,648,000	
	地方債証券合計	18,816,330,000	19,750,154,124	
特殊債券	第2回政府保証新関西国際空港債券	200,000,000	205,236,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	210,000,000	216,008,100	
	第69回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,553,000	

第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,611,000	
第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,381,000	
第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	153,233,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	169,927,500	
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,779,000	
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,540,000	
第21回道路債券	100,000,000	130,742,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	296,472,000	
第27回道路債券	100,000,000	108,647,000	
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,004,000	
第28回道路債券	300,000,000	397,242,000	
第33回道路債券	100,000,000	134,279,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,999,000	
第38回道路債券	100,000,000	109,132,000	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,117,000	
第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,484,000	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,737,000	
第86回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,443,000	
第87回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,332,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,558,000	
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,023,000	
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	134,530,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	407,200,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	132,858,000	
第111回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,667,000	
第123回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	130,268,000	
第128回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,238,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,302,000	
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	126,740,000	

第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,488,000	
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,775,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,726,000	
第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,754,000	
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,650,000	
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	407,688,000	
第178回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,685,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,272,000	
第183回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,415,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	209,000,000	212,772,450	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,066,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,764,000	
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,712,000	
第197回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	116,000,000	118,961,480	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,708,000	
第271回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,112,000	
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,057,000	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,049,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	243,000,000	246,129,840	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,474,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	118,743,000	
第4回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	118,518,000	
第5回公営企業債券（20年）	100,000,000	106,565,000	
第5回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	239,146,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	119,782,000	
第9回公営企業債券（20年）	100,000,000	109,538,000	
第11回公営企業債券（20年）	100,000,000	109,649,000	
第12回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	119,681,000	
第15回公営企業債券（20年）	100,000,000	110,670,000	

第15回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	358,653,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	112,979,000	
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	118,110,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	100,000,000	100,066,000	
第22回公営企業債券(20年)	300,000,000	345,483,000	
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	350,394,000	
第24回公営企業債券(20年)	100,000,000	116,655,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,083,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,401,000	
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,048,000	
第35回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,758,000	
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	217,000,000	220,817,030	
第40回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,786,000	
第41回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,796,000	
第43回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,788,000	
第43回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,681,000	
第44回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,110,000	
第46回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,486,000	
第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,591,000	
第50回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,773,460	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,515,000	
第56回政府保証地方公共団体金融機構債券	193,000,000	197,950,450	
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,345,000	
第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,922,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	421,000,000	429,348,430	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,112,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,478,000	
第96回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,678,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,564,000	
第107回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,731,000	
第110回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	151,252,500	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,356,000	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,467,000	
F190回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,209,000	
F441回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,682,000	
第19回首都高速道路株式会社社債	200,000,000	200,124,000	
第21回首都高速道路株式会社社債	300,000,000	300,390,000	

第19回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,993,000	
第159回都市再生債券	100,000,000	87,655,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	95,815,000	
第38回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	101,507,000	
第18回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	101,814,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,028,000	11,165,078	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,645,000	65,550,531	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	26,388,000	27,320,024	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,496,000	14,041,238	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	33,471,000	34,001,180	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,660,000	11,863,350	
第5回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	273,093,000	273,286,896	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,063,000	12,391,113	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,119,000	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	48,436,000	49,751,521	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,023,000	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,730,000	13,152,254	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,530,000	29,585,610	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,713,000	13,136,597	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,125,000	13,558,125	
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,342,000	10,373,646	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,254,000	10,327,418	
第12回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,934,000	16,792,842	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	42,579,000	43,335,203	
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,053,000	10,083,963	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,242,000	14,478,844	
第18回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,623,000	
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,928,000	23,360,192	
第23回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,973,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,185,000	21,620,153	
第25回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,932,000	12,163,480	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,694,000	24,482,741	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,988,000	43,705,914	
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,332,000	13,747,158	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	37,011,000	37,935,164	
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,662,000	12,972,852	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,058,000	42,253,608	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,126,000	15,758,115	

第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,516,000	31,650,006	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,077,000	29,908,743	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,023,000	13,428,666	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,764,000	29,437,336	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,738,000	14,254,136	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,132,000	40,354,875	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,010,000	65,276,686	
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,886,000	31,232,364	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,297,000	14,929,642	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,848,000	13,352,926	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,652,000	40,828,880	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,558,000	39,908,755	
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	120,356,000	
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	109,419,000	116,428,381	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	123,300,000	131,145,579	
第47回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,124,000	13,657,621	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,027,000	30,787,487	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,863,000	31,522,486	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	38,586,000	39,974,710	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,315,000	34,225,785	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,557,000	14,092,908	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,499,000	38,579,443	
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,503,000	40,740,024	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,531,000	44,988,441	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,486,000	42,845,928	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,674,000	49,812,178	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,303,000	50,939,860	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,083,000	44,208,191	
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,006,000	42,739,733	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,110,000	43,923,677	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,547,000	50,178,726	
第85回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,819,000	
第87回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,768,000	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,132,000	
第92回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,463,000	
第102回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,815,000	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,937,000	76,587,641	
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	162,422,000	163,549,208	
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,911,000	82,593,450	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,853,000	84,465,965	

第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,126,000	84,559,248	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,221,000	85,016,888	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,761,000	85,986,644	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,191,000	86,304,446	
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,293,000	86,470,043	
第121回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,492,000	87,457,250	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,542,000	89,497,368	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,267,000	90,037,374	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,719,000	89,607,964	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,763,000	91,674,260	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,101,000	92,800,046	
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,486,000	93,548,664	
第139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,268,000	94,466,493	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,496,000	94,176,650	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,158,000	95,456,796	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,776,000	95,908,170	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,507,000	95,896,110	
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	294,537,000	293,747,640	
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	294,756,000	295,640,268	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,652,000	99,005,174	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,928,000	197,981,440	
第57回日本学生支援債券	100,000,000	99,981,000	
第59回日本学生支援債券	100,000,000	99,973,000	
い第832号商工債	100,000,000	99,813,000	
い第835号商工債	200,000,000	199,518,000	
第322回信金中金債（5年）	100,000,000	100,011,000	
第327回信金中金債（5年）	200,000,000	200,126,000	
第328回信金中金債（5年）	100,000,000	100,066,000	
第331回信金中金債（5年）	100,000,000	100,115,000	
第339回信金中金債（5年）	100,000,000	100,195,000	

	第342回信金中金債(5年)	100,000,000	100,212,000
	第231号商工債(3年)	100,000,000	100,069,000
	第236号商工債(3年)	400,000,000	399,744,000
	第48回東日本高速道路株式会社社債	300,000,000	300,390,000
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,276,000
	第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,869,000
	第83回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,015,000
	第18回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	204,542,000
	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,075,000
	第66回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	108,402,000
	特殊債券合計	23,514,295,000	24,902,667,423
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,436,000
	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	98,624,000
	第29回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	98,274,000
	第1回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	200,000,000	200,664,000
	第1回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,310,000
	第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,505,000
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,556,000
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,520,000
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,738,000
	第1回H S B C・ホールディングス・ビーエルシー円貨社債	100,000,000	100,093,000
	第1回バンク・サンタンドール・エセ・アー非上位円貨社債	100,000,000	98,769,000
	第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	200,000,000	200,504,000
	第20回株式会社大林組無担保社債	100,000,000	102,201,000
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,873,000
	第3回高砂熱学工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,026,000
	第2回株式会社伊藤園無担保社債	100,000,000	99,787,000
	第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,764,000
	第10回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,207,000
	第18回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,754,000
	第9回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	101,279,000
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	99,627,000
	第11回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,388,000

第22回レンゴー株式会社無担保社債	100,000,000	100,358,000	
第45回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,019,000	
第22回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,333,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,530,000	
第6回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,258,000	
第1回株式会社ツムラ無担保社債	100,000,000	99,942,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,767,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,915,000	
第5回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,864,000	
第14回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,404,000	
第1回JXTGホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,919,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,145,000	
第9回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	100,818,000	
第14回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	102,382,000	
第11回日本電気硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,472,000	
第9回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	99,293,000	
第31回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,289,000	
第1回株式会社リクルートホールディングス無担保社債	100,000,000	99,830,000	
第22回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	101,342,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	102,333,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,124,000	
第8回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	99,507,000	
第15回パナソニック株式会社無担保社債	300,000,000	300,324,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,407,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,851,000	
第1回株式会社東海理化電機製作所無担保社債	100,000,000	99,713,000	
第32回三菱重工株式会社無担保社債	100,000,000	99,868,000	
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	99,699,000	
第12回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,352,000	
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	100,000,000	99,423,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	95,543,000	
第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,264,000	
第1回ユニー・ファミリーマートホールディングス無担保社債	100,000,000	99,850,000	
第69回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,740,000	
第39回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,550,000	

第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	97,215,000	
第9回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	109,307,000	
第35回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,968,000	
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	104,682,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	100,880,000	
第11回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,396,000	
第25回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	109,080,000	
第23回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,392,000	
第1回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,936,000	
第41回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	98,725,000	
第42回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,734,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,205,000	
第25回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,928,000	
第50回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,303,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	103,579,000	
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	199,900,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,022,000	
第69回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,635,000	
第47回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	115,939,000	
第78回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	98,493,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	114,478,000	
第104回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,360,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	96,215,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,352,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	102,374,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,917,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,464,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	97,440,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,264,000	
第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,167,000	
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,889,000	
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,909,000	

第129回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,013,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,412,000	
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	107,706,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,127,000	
第51回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,541,000	
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,665,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	125,886,000	
第8回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	115,472,000	
第10回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	118,771,000	
第13回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	115,095,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	110,117,000	
第45回西日本鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	204,626,000	
第46回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,045,000	
第4回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,413,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	200,000,000	201,008,000	
第500回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,815,000	
第518回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,224,000	
第535回中部電力株式会社社債	200,000,000	199,260,000	
第495回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,748,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,260,000	
第509回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,867,000	
第510回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,989,000	
第377回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,023,000	
第393回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,030,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,660,000	
第321回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,561,000	
第479回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,438,000	
第521回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,712,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,564,000	
第371回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,104,000	
第426回九州電力株式会社社債	200,000,000	206,468,000	
第431回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,652,000	
第436回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,426,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,786,000	
第482回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,939,000	
第320回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,662,000	
第323回北海道電力株式会社社債	100,000,000	108,473,000	
第357回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,638,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	108,864,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,853,000	

第56回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,681,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,056,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	301,281,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,608,000	
第38回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	126,828,000	
第5回S C S K株式会社無担保社債	100,000,000	99,909,000	
第6回S C S K株式会社無担保社債	100,000,000	99,782,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,940,000	
社債券合計	15,200,000,000	15,536,473,000	
合計		364,701,628,097	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

	2020年 7月27日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	7,779,257,113
コール・ローン	1,089,754,703
株式	206,886,821,252
投資信託受益証券	150,956,535
投資証券	5,004,559,459
派生商品評価勘定	437,820,184
未収入金	12,051,525
未収配当金	195,560,909
差入委託証拠金	2,845,121,416
流動資産合計	224,401,903,096
資産合計	224,401,903,096
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	25,285,704
前受金	414,251,713
未払解約金	330,592,837
未払利息	1,098
流動負債合計	770,131,352

	2020年 7月27日現在
項目	金額（円）
負債合計	770,131,352
純資産の部	
元本等	
元本	76,769,062,125
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	146,862,709,619
元本等合計	223,631,771,744
純資産合計	223,631,771,744
負債純資産合計	224,401,903,096

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 7月27日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	2020年 7月27日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 7月27日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	76,769,062,125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 2.9130円 (1万口当たり純資産額) (29,130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

	2020年 7月27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。

	2020年 7月27日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 7月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

	2020年 7月27日現在

（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	2020年 7月27日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	68,961,764,192円
期中追加設定元本額	19,816,779,417円
期中一部解約元本額	12,009,481,484円
期末元本額	76,769,062,125円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,657,162,107円
D C 外国株式インデックスファンド	4,592,261,134円
D C 外国株式インデックスファンド L	22,640,410,871円
D C バランスファンド 3 0	715,221,646円
D C バランスファンド 5 0	1,474,037,303円
D C バランスファンド 7 0	868,746,437円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	367,695,769円
外国株式インデックス e	5,210,578,683円
インデックスコレクション（外国株式）	10,325,080,452円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	4,002,232,951円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	993,324,574円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	847,229,378円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,878,971,154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）	1,504,444,386円
外国株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	785,547,091円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	49,280,695円

区分	2020年 7月27日現在
バランスVA50（適格機関投資家専用）	550,908,003円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	67,000,902円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	236,494,012円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	1,067,894円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	2,339,701,752円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	449,759,127円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	317,739,108円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	5,888,411,265円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	586,812,350円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	240,864,841円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,004,754,023円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	26,699,110円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	118,765,663円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	140,958,327円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	436,583,499円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	24,530,971円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	102,709,409円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	317,926,812円
私募外国株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	5,150,426円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 7月27日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	8,597,728,399
投資信託受益証券	28,827,751
投資証券	879,454,753
合計	9,506,010,903

(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

（2020年 7月27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	11,286,485,957	-	11,700,737,670	414,251,713
	合計	11,286,485,957	-	11,700,737,670	414,251,713

(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

(2020年 7月27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	1,153,501,781	-	1,150,244,565	3,257,216
	アメリカドル	873,296,378	-	866,200,590	7,095,788
	ユーロ	176,017,350	-	179,389,000	3,371,650
	イギリスポンド	104,188,053	-	104,654,975	466,922
	売建	226,371,883	-	224,831,900	1,539,983
	アメリカドル	165,669,425	-	164,005,500	1,663,925
	ユーロ	36,986,340	-	37,110,000	123,660
	イギリスポンド	12,253,068	-	12,209,400	43,668
	スイスフラン	11,463,050	-	11,507,000	43,950
合計		1,379,873,664	-	1,375,076,465	1,717,233

(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	BAKER HUGHES CO	34,920	16.37	571,640.40	
	CABOT OIL & GAS CORP	18,624	19.04	354,600.96	
	CHENIERE ENERGY INC	11,266	48.99	551,921.34	
	CHEVRON CORP	93,547	90.13	8,431,391.11	

CONCHO RESOURCES INC	10,403	53.46	556,144.38
CONOCOPHILLIPS	53,372	40.28	2,149,824.16
DIAMONDBACK ENERGY INC	8,591	40.73	349,911.43
EOG RESOURCES INC	28,548	49.04	1,399,993.92
EXXON MOBIL	210,769	43.43	9,153,697.67
HALLIBURTON CO	47,020	14.71	691,664.20
HESS CORP	14,572	50.46	735,303.12
HOLLYFRONTIER CORP	7,524	26.98	202,997.52
KINDER MORGAN INC	104,998	14.25	1,496,221.50
MARATHON PETROLEUM CORP	31,690	38.70	1,226,403.00
NATIONAL OILWELL VARCO INC	20,993	12.74	267,450.82
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	43,476	16.74	727,788.24
ONEOK INC	19,982	28.72	573,883.04
PHILLIPS 66	21,603	65.06	1,405,491.18
PIONEER NATURAL RESOURCES	8,391	99.68	836,414.88
SCHLUMBERGER	67,961	19.48	1,323,880.28
VALERO ENERGY CORP	20,041	57.98	1,161,977.18
WILLIAMS COS	59,135	19.21	1,135,983.35
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	10,900	291.52	3,177,568.00
ALBEMARLE CORP	4,921	87.04	428,323.84
AMCOR PLC	83,398	10.67	889,856.66
AVERY DENNISON CORP	4,144	120.41	498,979.04
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,844	22.74	246,592.56
BALL CORP	15,864	73.16	1,160,610.24
CELANESE CORP-SERIES A	6,028	92.43	557,168.04
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	30.58	317,389.82
CORTEVA INC	37,876	28.52	1,080,223.52
CROWN HOLDINGS INC	6,344	70.70	448,520.80
DOW INC	36,358	42.61	1,549,214.38
DUPONT DE NEMOURS INC	36,390	54.55	1,985,074.50
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,407	76.64	491,032.48
ECOLAB INC	13,280	210.06	2,789,596.80
FMC CORP	6,680	107.34	717,031.20
FREEMPORT-MCMORAN INC	72,491	13.12	951,081.92
INT'L PAPER CO	19,784	36.32	718,554.88
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,553	126.82	577,411.46
LINDE PLC	26,509	244.07	6,470,051.63
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,927	68.50	885,499.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,199	223.65	715,456.35
MOSAIC CO/THE	20,003	13.67	273,441.01
NEWMONT CORPORATION	39,782	66.75	2,655,448.50
NUCOR CORP	16,038	42.85	687,228.30

PACKAGING CORP OF AMERICA	5,079	102.79	522,070.41
PPG INDUSTRIES INC	11,511	110.56	1,272,656.16
RPM INTERNATIONAL INC	6,943	79.69	553,287.67
SEALED AIR CORP	7,368	37.25	274,458.00
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,094	620.02	2,538,361.88
STEEL DYNAMICS INC	11,755	27.83	327,141.65
VULCAN MATERIALS CO	6,788	127.28	863,976.64
WESTROCK CO	13,827	30.21	417,713.67
3 M COMPANY	28,564	159.84	4,565,669.76
AERCAP HOLDINGS NV	5,656	28.23	159,668.88
ALLEGION PLC	4,638	101.02	468,530.76
AMETEK INC	11,592	92.90	1,076,896.80
BOEING CO	26,570	173.76	4,616,803.20
CARRIER GLOBAL CORP	41,753	26.58	1,109,794.74
CATERPILLAR	27,248	137.58	3,748,779.84
CUMMINS INC	7,338	188.24	1,381,305.12
DEERE&CO	14,699	175.35	2,577,469.65
DOVER CORP	7,651	105.51	807,257.01
EATON CORP	20,331	93.61	1,903,184.91
EMERSON ELECTRIC CO	31,361	63.36	1,987,032.96
FASTENAL CO	29,108	45.74	1,331,399.92
FORTIVE CORP	14,678	71.00	1,042,138.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,720	71.00	477,120.00
GENERAL DYNAMICS CORP	12,110	150.15	1,818,316.50
GENERAL ELECTRIC CO	432,652	6.86	2,967,992.72
GRAINGER (WW) INC	2,418	341.39	825,481.02
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,789	35.66	277,755.74
HEICO CORP	2,252	95.45	214,953.40
HEICO CORP-CLASS A	3,238	75.69	245,084.22
HONEYWELL INTL INC	35,399	149.43	5,289,672.57
HOWMET AEROSPACE INC	18,227	15.55	283,429.85
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	177.06	352,880.58
IDEX CORP	3,709	167.67	621,888.03
ILLINOIS TOOL WORKS	15,760	184.79	2,912,290.40
INGERSOLL-RAND INC	17,228	31.60	544,404.80
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,714	83.94	563,573.16
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,500	40.04	460,460.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	9,400	19.72	185,368.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	38,179	36.80	1,404,987.20
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	10,894	171.24	1,865,488.56
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,882	265.78	500,197.96
LOCKHEED MARTIN CORP	12,598	386.21	4,865,473.58

MASCO CORP	14,744	54.10	797,650.40
NORDSON CORP	2,944	192.23	565,925.12
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,866	312.69	2,459,619.54
OTIS WORLDWIDE CORP	20,876	58.13	1,213,521.88
OWENS CORNING	4,925	61.76	304,168.00
PACCAR INC	17,922	85.74	1,536,632.28
PARKER HANNIFIN CORP	6,258	182.86	1,144,337.88
PENTAIR PLC	9,170	42.38	388,624.60
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	75,262	62.07	4,671,512.34
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,016	226.19	1,360,759.04
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,226	415.27	2,170,201.02
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,602	40.42	307,272.84
SMITH (A.O.) CORP	6,846	51.31	351,268.26
SNAP-ON INC	2,819	141.75	399,593.25
STANLEY BLACK&DECKER	7,694	152.91	1,176,489.54
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,889	308.95	583,606.55
TEXTRON	10,911	34.35	374,792.85
TRANE TECHNOLOGIES PLC	11,613	103.76	1,204,964.88
TRANSDIGM GROUP INC	2,610	425.56	1,110,711.60
UNITED RENTALS INC	3,773	160.88	607,000.24
WABTEC CORP	8,979	61.87	555,530.73
XYLEM INC	9,287	74.25	689,559.75
CINTAS CORP	4,432	302.60	1,341,123.20
COPART INC	10,663	89.52	954,551.76
COSTAR GROUP INC	1,900	703.77	1,337,163.00
EQUIFAX INC	6,176	167.16	1,032,380.16
IHS MARKIT LTD	19,686	79.56	1,566,218.16
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,880	14.93	237,088.40
REPUBLIC SERVICES INC	11,640	85.03	989,749.20
ROBERT HALF INTL INC	6,315	52.73	332,989.95
ROLLINS INC	7,140	48.68	347,575.20
TRANSUNION	9,966	89.73	894,249.18
VERISK ANALYTICS INC	7,837	179.78	1,408,935.86
WASTE CONNECTIONS INC	13,249	99.43	1,317,348.07
WASTE MANAGEMENT INC	20,942	107.28	2,246,657.76
AMERCO	376	316.47	118,992.72
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	7,206	86.07	620,220.42
CSX CORP	38,244	71.34	2,728,326.96
DELTA AIR LINES INC	7,841	25.96	203,552.36
EXPEDITORS INTL WASH INC	9,000	80.19	721,710.00
FEDEX CORP	12,740	165.04	2,102,609.60
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,552	130.79	595,356.08

KANSAS CITY SOUTHERN	4,618	154.70	714,404.60
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,000	45.11	315,770.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,722	187.01	2,379,141.22
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,977	182.24	907,008.48
SOUTHWEST AIRLINES CO	8,049	31.66	254,831.34
UBER TECHNOLOGIES INC	46,637	31.18	1,454,141.66
UNION PACIFIC CORP	34,307	176.12	6,042,148.84
UNITED PARCEL SERVICE B	34,779	118.35	4,116,094.65
XPO LOGISTICS INC	5,001	79.25	396,329.25
APTIV PLC	12,401	82.25	1,019,982.25
AUTOLIV INC	3,858	68.49	264,234.42
BORGWARNER INC	9,348	38.36	358,589.28
FORD MOTOR COMPANY	190,386	6.88	1,309,855.68
GENERAL MOTORS CO	63,247	26.25	1,660,233.75
LEAR CORP	2,989	116.59	348,487.51
TESLA INC	7,333	1,417.00	10,390,861.00
DR HORTON INC	17,782	63.75	1,133,602.50
GARMIN LTD	7,602	96.74	735,417.48
HASBRO INC	6,321	77.59	490,446.39
LENNAR CORP-CL A	14,276	69.79	996,322.04
LULULEMON ATHLETICA INC	6,088	321.50	1,957,292.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,830	85.01	240,578.30
NEWELL BRANDS INC	20,391	17.14	349,501.74
NIKE B	61,746	98.43	6,077,658.78
NVR INC	171	3,810.39	651,576.69
PULTE GROUP INC	12,739	42.62	542,936.18
RALPH LAUREN CORPORATION	2,566	71.45	183,340.70
VF CORP	16,318	59.90	977,448.20
WHIRLPOOL CORP	3,060	157.95	483,327.00
ARAMARK	11,643	22.66	263,830.38
CARNIVAL CORPORATION	22,191	14.80	328,426.80
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,335	1,130.26	1,508,897.10
DARDEN RESTAURANTS INC	6,357	78.64	499,914.48
DOMINO'S PIZZA INC	2,006	386.91	776,141.46
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	13,513	77.43	1,046,311.59
LAS VEGAS SANDS CORP	18,124	44.36	803,980.64
MARRIOTT INTL A	13,485	87.50	1,179,937.50
MCDONALD'S CORP	37,072	198.72	7,366,947.84
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	10,511	15.25	160,292.75
MGM RESORTS INTERNATIONAL	25,221	15.79	398,239.59
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,553	50.83	485,578.99
STARBUCKS CORP	58,245	75.78	4,413,806.10

VAIL RESORTS INC	2,150	193.90	416,885.00
WYNN RESORTS LTD	5,210	73.41	382,466.10
YUM BRANDS INC	14,713	93.14	1,370,368.82
ACTIVISION BLIZZARD INC	37,933	79.99	3,034,260.67
ALPHABET INC-CL A	14,955	1,508.21	22,555,280.55
ALPHABET INC-CL C	15,304	1,511.87	23,137,658.48
ALTICE USA INC- A	18,078	24.09	435,499.02
CABLE ONE INC	247	1,797.54	443,992.38
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,284	561.72	4,091,568.48
COMCAST CORP-CL A	226,171	43.35	9,804,512.85
DISCOVERY INC - A	7,886	21.15	166,788.90
DISCOVERY INC-C	18,339	18.93	347,157.27
DISH NETWORK CORPORATION-A	12,603	33.36	420,436.08
ELECTRONIC ARTS INC	14,213	135.24	1,922,166.12
FACEBOOK INC-A	120,000	230.71	27,685,200.00
FOX CORP - CLASS A	18,452	26.66	491,930.32
FOX CORP- CLASS B	9,450	26.49	250,330.50
IAC/INTERACTIVECORP	3,832	125.79	482,027.28
INTERPUBLIC GROUP OF COS	20,801	18.55	385,858.55
LIBERTY BROADBAND-A	1,450	130.63	189,413.50
LIBERTY BROADBAND-C	5,220	132.77	693,059.40
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,885	35.08	346,765.80
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,928	34.41	272,802.48
LIBERTY SIRIUSXM-A	3,171	34.27	108,670.17
LIVE NATION ENTERTAINMENT	7,407	47.92	354,943.44
MATCH GROUP INC	10,667	90.36	963,870.12
NETFLIX INC	21,841	480.45	10,493,508.45
NEWS CORP-CLASS A	16,730	12.71	212,638.30
OMNICOM GROUP	11,546	56.56	653,041.76
PINTEREST INC- CLASS A	19,736	24.54	484,321.44
ROKU INC	4,881	151.17	737,860.77
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,402	5.90	356,673.81
SNAP INC - A	46,191	22.15	1,023,130.65
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,950	156.02	928,319.00
THE WALT DISNEY CO	89,914	117.61	10,574,785.54
TWITTER INC	38,208	37.54	1,434,328.32
VIACOMCBS INC-CLASS B	27,145	24.75	671,838.75
ZILLOW GROUP INC-C	7,027	65.72	461,814.44
ADVANCE AUTO PARTS	3,293	147.27	484,960.11
AMAZON.COM	21,117	3,008.91	63,539,152.47
AUTOZONE INC	1,153	1,168.59	1,347,384.27
BEST BUY COMPANY INC	11,269	96.99	1,092,980.31

BOOKING HOLDINGS INC	2,034	1,701.30	3,460,444.20
BURLINGTON STORES INC	3,511	186.92	656,276.12
CARMAX INC	8,658	97.46	843,808.68
DOLLAR GENERAL CORP	12,553	191.70	2,406,410.10
DOLLAR TREE INC	12,000	95.60	1,147,200.00
EBAY	39,141	55.12	2,157,451.92
EXPEDIA GROUP INC	6,437	83.72	538,905.64
GENUINE PARTS CO	7,736	88.64	685,719.04
HOME DEPOT	54,353	265.31	14,420,394.43
LKQ CORP	15,761	27.96	440,677.56
LOWES COMPANIES	38,046	147.03	5,593,903.38
MERCADOLIBRE INC	2,200	988.99	2,175,778.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,670	442.34	1,623,387.80
ROSS STORES INC	17,630	86.16	1,519,000.80
TARGET (DAYTON HUDSON)	25,059	123.71	3,100,048.89
TIFFANY & CO	5,652	121.41	686,209.32
TJX COMPANIES INC	59,560	52.89	3,150,128.40
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,225	146.53	912,149.25
ULTA BEAUTY INC	2,594	203.71	528,423.74
WAYFAIR INC- CLASS A	3,414	222.79	760,605.06
COSTCO WHOLESALE CORP	21,964	325.78	7,155,431.92
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	17,000	4.23	71,910.00
KROGER CO	41,354	34.71	1,435,397.34
SYSCO CORP	23,639	54.94	1,298,726.66
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	36,943	40.51	1,496,560.93
WALMART INC	70,591	131.24	9,264,362.84
ALTRIA GROUP INC	92,085	41.85	3,853,757.25
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	27,157	42.09	1,143,038.13
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14,978	68.00	1,018,504.00
BUNGE LIMITED	6,250	44.33	277,062.50
CAMPBELL SOUP CO (US)	9,742	49.40	481,254.80
COCA-COLA CO	202,912	48.49	9,839,202.88
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	10,990	41.02	450,809.80
CONAGRA BRANDS INC	25,534	36.61	934,799.74
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,201	179.85	1,474,949.85
GENERAL MILLS INC	31,075	64.23	1,995,947.25
HERSHEY FOODS CORPORATION	7,797	145.68	1,135,866.96
HORMEL FOODS CORP	14,360	50.27	721,877.20
INGREDION INC	3,679	87.35	321,360.65
JM SMUCKER CO	5,955	108.14	643,973.70
KELLOGG CO	13,372	68.68	918,388.96
KEURIG DR PEPPER INC	18,861	30.34	572,242.74

KRAFT HEINZ CO/THE	32,631	34.68	1,131,643.08
LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,853	67.79	532,354.87
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,998	193.52	1,160,732.96
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	10,321	36.49	376,613.29
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	70,986	54.87	3,895,001.82
MONSTER BEVERAGE CORP	19,724	74.88	1,476,933.12
PEPSICO INC	69,161	136.06	9,410,045.66
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	77,301	76.85	5,940,581.85
TYSON FOODS INC	14,963	60.82	910,049.66
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,525	85.87	1,075,521.75
CLOROX COMPANY	6,492	227.04	1,473,943.68
COLGATE-PALMOLIVE CO	40,149	74.32	2,983,873.68
ESTEE LAUDER CO-CL A	10,956	191.75	2,100,813.00
KIMBERLY-CLARK CORP	16,854	147.34	2,483,268.36
PROCTER & GAMBLE CO	123,058	125.96	15,500,385.68
ABBOTT LABORATORIES	87,724	98.95	8,680,289.80
ABIOMED INC	2,131	292.94	624,255.14
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,636	298.14	1,084,037.04
AMERISOURCEBERGEN CORP	8,181	103.76	848,860.56
ANTHEM INC	12,497	270.49	3,380,313.53
BAXTER INTERNATIONAL	25,160	89.26	2,245,781.60
BECTON DICKINSON & CO	13,418	271.89	3,648,220.02
BOSTON SCIENTIFIC CORP	68,950	38.60	2,661,470.00
CARDINAL HEALTH	15,354	56.50	867,501.00
CENTENE CORP	30,031	67.51	2,027,392.81
CERNER CORP	15,169	71.79	1,088,982.51
CIGNA CORP	18,460	181.02	3,341,629.20
CVS HEALTH CORP	64,686	63.34	4,097,211.24
DANAHER CORP	31,118	195.27	6,076,411.86
DAVITA INC	4,396	87.33	383,902.68
DENTSPLY SIRONA INC	11,899	43.24	514,512.76
DEXCOM INC	4,492	421.75	1,894,501.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	32,043	78.13	2,503,519.59
HCA HEALTHCARE INC	13,262	125.51	1,664,513.62
HENRY SCHEIN INC	6,861	67.03	459,892.83
HOLOGIC INC	13,047	61.75	805,652.25
HUMANA INC	6,521	392.14	2,557,144.94
IDEXX LABORATORIES INC	4,166	359.23	1,496,552.18
INSULET CORP	3,227	196.69	634,718.63
INTUITIVE SURGICAL INC	5,742	675.33	3,877,744.86
LABORATORY CRP OF AMER	5,131	198.74	1,019,734.94
MASIMO CORP	2,735	233.46	638,513.10

MCKESSON CORP	7,888	155.34	1,225,321.92
MEDTRONIC PLC	66,659	96.35	6,422,594.65
MOLINA HEALTHCARE INC	3,244	184.25	597,707.00
QUEST DIAGNOSTICS	7,120	124.99	889,928.80
RESMED INC	7,252	202.44	1,468,094.88
STERIS PLC	4,144	156.35	647,914.40
STRYKER CORP	16,690	198.83	3,318,472.70
TELADOC HEALTH INC	3,748	212.85	797,761.80
TELEFLEX INC	2,448	387.66	948,991.68
THE COOPER COS INC	2,406	283.58	682,293.48
UNITEDHEALTH GROUP INC	47,271	300.79	14,218,644.09
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	108.08	421,295.84
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,835	127.16	614,818.60
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,455	251.95	1,626,337.25
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,868	262.66	1,015,968.88
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,664	134.11	1,430,149.04
ABBVIE INC	87,876	97.11	8,533,638.36
AGILENT TECHNOLOGIES	15,189	94.81	1,440,069.09
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,797	101.49	1,095,787.53
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,952	153.10	911,251.20
AMGEN	29,320	247.98	7,270,773.60
AVANTOR INC	23,317	18.48	430,898.16
BEIGENE LTD-ADR	2,232	224.44	500,950.08
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,201	515.75	619,415.75
BIOGEN INC	8,595	272.33	2,340,676.35
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,468	122.95	1,164,090.60
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	112,241	57.85	6,493,141.85
CATALENT INC	8,308	81.64	678,265.12
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,778	23.59	490,153.02
EXACT SCIENCES CORP	7,646	95.39	729,351.94
GILEAD SCIENCES INC	62,710	73.64	4,617,964.40
ILLUMINA INC	7,257	382.25	2,773,988.25
INCYTE CORP	9,706	99.42	964,970.52
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,654	58.95	392,253.30
IQVIA HOLDINGS INC	9,429	157.88	1,488,650.52
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,663	112.89	300,626.07
JOHNSON & JOHNSON	131,360	148.12	19,457,043.20
LILLY (ELI) & CO	42,781	159.54	6,825,280.74
MERCK & CO	126,284	77.10	9,736,496.40
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,191	862.72	1,027,499.52
MODERNA INC	14,381	73.21	1,052,833.01
MYLAN NV	27,817	15.96	443,959.32

NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,708	125.20	589,441.60
PERKINELMER INC	5,468	110.37	603,503.16
PERRIGO CO PLC	7,371	55.80	411,301.80
PFIZER	275,513	37.66	10,375,819.58
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,987	608.94	3,036,783.78
SAREPTA THERAPEUTICS INC	4,016	158.63	637,058.08
SEATTLE GENETICS INC	6,223	168.81	1,050,535.74
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56,857	11.49	653,286.93
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	19,831	406.38	8,058,921.78
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,835	278.49	3,574,419.15
WATERS CORP	3,249	223.05	724,689.45
ZOETIS INC	23,504	144.22	3,389,746.88
BANK OF AMERICA CORP	391,205	24.35	9,525,841.75
CITIGROUP	104,679	51.67	5,408,763.93
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,232	25.58	517,534.56
COMERICA INC	7,736	37.42	289,481.12
EAST WEST BANCORP INC	6,421	35.61	228,651.81
FIFTH THIRD BANCORP	37,592	19.54	734,547.68
FIRST REPUBLIC BANK/CA	9,019	114.82	1,035,561.58
HUNTINGTON BANCSHARES INC	49,512	9.60	475,315.20
JPMORGAN CHASE & CO	153,228	98.28	15,059,247.84
KEY CORP	48,707	12.25	596,660.75
M & T BANK CORP	6,910	105.13	726,448.30
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	22,684	12.00	272,208.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	21,389	106.84	2,285,200.76
REGIONS FINL CORP	46,000	10.92	502,320.00
SIGNATURE BANK	2,815	109.59	308,495.85
SVB FINANCIAL GROUP	2,758	230.43	635,525.94
TRUIST FINANCIAL CORP	66,347	37.74	2,503,935.78
US BANCORP	67,719	36.92	2,500,185.48
WELLS FARGO & CO	193,547	26.26	5,082,544.22
ZIONS BANCORPORATION	8,203	33.63	275,866.89
ALLY FINANCIAL INC	18,129	21.18	383,972.22
AMERICAN EXPRESS	34,025	95.33	3,243,603.25
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,178	155.26	959,196.28
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	9,341	52.02	485,918.82
BANK NEW YORK CO	40,579	36.23	1,470,177.17
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	69,060	194.52	13,433,551.20
BLACKROCK INC	7,559	570.62	4,313,316.58
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	33,131	55.70	1,845,396.70
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	22,449	65.06	1,460,531.94
CARLYLE GROUP INC/THE	7,865	28.71	225,804.15

CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,888	89.46	526,740.48
CME GROUP INC	17,740	168.75	2,993,625.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	15,312	50.82	778,155.84
E*TRADE FINANCIAL CORP	10,854	51.77	561,911.58
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,238	20.30	451,431.40
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,887	347.94	656,562.78
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	20.60	303,808.80
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,261	201.47	3,276,103.67
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	27,332	96.32	2,632,618.24
INVESCO LTD	19,405	10.44	202,588.20
KKR & CO INC	25,570	34.69	887,023.30
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,975	505.81	998,974.75
MOODY'S CORP	8,316	289.68	2,408,978.88
MORGAN STANLEY	59,292	50.18	2,975,272.56
MSCI INC	4,264	385.65	1,644,411.60
NASDAQ INC	6,126	130.56	799,810.56
NORTHERN TRUST CORP	10,269	76.03	780,752.07
PRICE T ROWE GROUP INC	11,555	133.97	1,548,023.35
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,565	72.12	473,467.80
S&P GLOBAL INC	12,085	349.97	4,229,387.45
SCHWAB (CHARLES) CORP	59,165	34.94	2,067,225.10
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	52.97	333,128.33
STATE STREET CORP	17,955	62.35	1,119,494.25
SYNCHRONY FINANCIAL	28,151	23.56	663,237.56
TD AMERITRADE HOLDING CORP	12,743	37.77	481,303.11
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,522	54.49	246,403.78
VOYA FINANCIAL INC	6,370	49.19	313,340.30
AFLAC	33,539	36.77	1,233,229.03
ALLEGHANY CORP	778	537.00	417,786.00
ALLSTATE CORP	15,543	94.36	1,466,637.48
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,803	61.90	235,405.70
AMERICAN INT'L GROUP	45,065	31.31	1,410,985.15
AON PLC	11,415	207.17	2,364,845.55
ARCH CAPITAL GROUP LTD	19,644	30.85	606,017.40
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,925	103.93	1,031,505.25
ASSURANT INC	3,282	106.79	350,484.78
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	6,517	33.39	217,602.63
BROWN & BROWN INC	12,618	45.40	572,857.20
CHUBB LTD	22,354	134.91	3,015,778.14
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,964	83.23	662,843.72
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,444	206.25	297,825.00
EVEREST RE GROUP LTD	2,144	224.01	480,277.44

FNF GROUP	14,864	33.39	496,308.96
GLOBE LIFE INC	5,519	80.37	443,562.03
HARTFORD FINANCIAL SVCS	17,456	41.48	724,074.88
LINCOLN NATIONAL CORP	9,779	37.21	363,876.59
LOEWS CORP	12,517	36.87	461,501.79
MARKEL CORP	699	1,015.44	709,792.56
MARSH & MCLENNAN COS	24,895	114.62	2,853,464.90
METLIFE INC	38,140	38.22	1,457,710.80
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,665	44.77	656,552.05
PROGRESSIVE CORP	29,923	87.86	2,629,034.78
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	19,394	64.91	1,258,864.54
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,361	87.29	293,381.69
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,195	180.14	395,407.30
TRAVELERS COS INC/THE	12,496	118.28	1,478,026.88
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,646	211.52	1,405,761.92
MR BERKLEY CORP	7,737	63.96	494,858.52
CBRE GROUP INC-A	16,805	43.16	725,303.80
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	47,400	3.88	183,912.00
JONES LANG LASALLE INC	2,230	100.06	223,133.80
WEYERHAEUSER CO	39,134	26.11	1,021,788.74
ACCENTURE PLC-CL A	31,568	221.44	6,990,417.92
ADOBE INC	23,999	430.31	10,327,009.69
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	8,444	111.74	943,532.56
ANSYS INC	4,187	293.51	1,228,926.37
AUTODESK INC	10,860	232.88	2,529,076.80
AUTOMATIC DATA PROCESS	21,374	145.43	3,108,420.82
AVALARA INC	4,011	123.93	497,083.23
BLACK KNIGHT INC	8,009	73.17	586,018.53
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,486	74.34	556,509.24
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	6,056	131.28	795,031.68
CADENCE DESIGN SYSTEMS	14,289	102.59	1,465,908.51
CDK GLOBAL INC	5,199	43.95	228,496.05
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,391	123.48	789,160.68
CITRIX SYSTEMS INC	6,139	142.49	874,746.11
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	26,881	61.80	1,661,245.80
COUPA SOFTWARE INC	3,528	292.11	1,030,564.08
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	5,578	100.03	557,967.34
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,100	113.52	238,392.00
DATADOG INC - CLASS A	5,705	84.84	484,012.20
DOCUSIGN INC	8,300	190.95	1,584,885.00
DROPBOX INC-CLASS A	10,931	21.35	233,376.85
DYNATRACE INC	7,027	41.28	290,074.56

EPAM SYSTEMS INC	2,881	274.10	789,682.10
FAIR ISAAC CORP	1,555	414.33	644,283.15
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	30,568	143.70	4,392,621.60
FISERV INC	28,586	100.63	2,876,609.18
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,156	258.08	1,072,580.48
FORTINET INC	7,709	133.04	1,025,605.36
GARTNER INC	4,660	124.69	581,055.40
GLOBAL PAYMENTS INC	14,805	172.63	2,555,787.15
GODADDY INC - CLASS A	8,747	68.61	600,131.67
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,453	116.64	519,397.92
INTL BUSINESS MACHINES CORP	44,136	125.79	5,551,867.44
INTUIT INC	12,904	288.68	3,725,126.72
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,785	179.59	679,748.15
LEIDOS HOLDINGS	7,121	91.07	648,509.47
MASTERCARD INC-CLASS A	44,588	306.92	13,684,948.96
MICROSOFT CORP	360,651	201.30	72,599,046.30
MONGODB INC	2,429	204.64	497,070.56
NORTONLIFELOCK INC	30,049	20.38	612,548.86
OKTA INC	5,377	205.64	1,105,726.28
ORACLE CORP	111,568	55.65	6,208,759.20
PALO ALTO NETWORKS INC	5,106	243.77	1,244,689.62
PAYCHEX INC	15,734	72.19	1,135,837.46
PAYCOM SOFTWARE INC	2,631	286.97	755,018.07
PAYPAL HOLDINGS INC	55,451	172.56	9,568,624.56
PTC INC	5,381	81.46	438,336.26
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,491	268.25	936,460.75
SALESFORCE.COM INC	41,906	188.49	7,898,861.94
SERVICENOW INC	9,402	425.19	3,997,636.38
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	16,471	29.72	489,518.12
SPLUNK INC	8,007	199.57	1,597,956.99
SQUARE INC - A	17,387	121.41	2,110,955.67
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,145	55.75	621,333.75
SYNOPSYS INC	7,339	193.37	1,419,142.43
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	2,173	426.07	925,850.11
TWILIO INC - A	5,760	248.29	1,430,150.40
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,028	357.19	724,381.32
VERISIGN INC	5,091	208.53	1,061,626.23
VISA INC-CLASS A SHARES	85,040	195.15	16,595,556.00
VMWARE INC-CLASS A	4,372	140.82	615,665.04
WESTERN UNION CO	20,387	22.47	458,095.89
WIX.COM LTD	2,600	267.47	695,422.00
WORKDAY INC-CLASS A	8,479	182.78	1,549,791.62

ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	5,267	246.56	1,298,631.52
AMPHENOL CORPORATION	15,325	104.39	1,599,776.75
APPLE INC	218,395	370.46	80,906,611.70
ARISTA NETWORKS INC	2,873	236.81	680,355.13
ARROW ELECTRONICS INC	3,851	67.35	259,364.85
CDW CORP/DE	7,547	114.56	864,584.32
CISCO SYSTEMS	211,141	46.40	9,796,942.40
COGNEX CORP	9,214	64.22	591,723.08
CORNING	40,119	29.29	1,175,085.51
DELL TECHNOLOGIES -C	12,902	60.80	784,441.60
F5 NETWORKS INC	3,275	152.34	498,913.50
FLIR SYSTEMS INC	7,341	40.97	300,760.77
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	63,109	9.62	607,108.58
HP INC	68,031	17.50	1,190,542.50
IPG PHOTONICS CORP	1,782	175.29	312,366.78
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	24.48	399,219.84
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,591	96.85	928,888.35
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,852	141.73	1,254,593.96
NETAPP INC	10,843	43.20	468,417.60
SEAGATE TECHNOLOGY	11,767	48.04	565,286.68
TE CONNECTIVITY LTD	16,358	87.27	1,427,562.66
TRIMBLE IMS HOLDINGS	13,321	44.03	586,523.63
WESTERN DIGITAL CORP	15,203	42.85	651,448.55
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,862	269.98	772,682.76
AT&T INC	357,261	29.57	10,564,207.77
CENTURYLINK INC	43,517	10.09	439,086.53
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,831	22.46	175,884.26
LIBERTY GLOBAL PLC-C	22,447	22.11	496,303.17
T-MOBILE US INC	26,592	104.93	2,790,298.56
VERIZON COMMUNICATIONS	206,004	56.85	11,711,327.40
AES CORP	32,456	15.40	499,822.40
ALLIANT ENERGY CORPORATION	12,663	53.12	672,658.56
AMEREN CORPORATION	12,485	79.52	992,807.20
AMERICAN ELECTRIC POWER	24,328	88.05	2,142,080.40
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,811	144.52	1,273,365.72
ATMOS ENERGY CORP	6,189	103.00	637,467.00
CENTERPOINT ENERGY INC	27,008	19.74	533,137.92
CMS ENERGY CORP	14,458	63.53	918,516.74
CONSOLIDATED EDISON INC	17,160	75.58	1,296,952.80
DOMINION ENERGY INC	41,492	80.41	3,336,371.72
DTE ENERGY COMPANY	9,677	114.57	1,108,693.89
DUKE ENERGY CORP	36,269	82.79	3,002,710.51

EDISON INTL	18,014	56.02	1,009,144.28	
ENERGY CORP	9,686	102.66	994,364.76	
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,385	45.70	520,294.50	
EVERGY INC	11,198	64.06	717,343.88	
EVERSOURCE ENERGY	16,717	89.48	1,495,837.16	
EXELON CORP	49,875	37.80	1,885,275.00	
FIRSTENERGY CORP	28,016	29.48	825,911.68	
NEXTERA ENERGY INC	24,299	280.25	6,809,794.75	
NISOURCE INC	20,005	24.54	490,922.70	
NRG ENERGY INC	12,298	34.19	420,468.62	
OGE ENERGY CORP	10,926	32.97	360,230.22	
PINNACLE WEST CAPITAL	6,029	81.38	490,640.02	
PPL CORPORATION	37,348	25.71	960,217.08	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	26,177	52.27	1,368,271.79	
SEMPRA ENERGY	14,372	125.62	1,805,410.64	
SOUTHERN CO	52,132	54.85	2,859,440.20	
UGI CORP	11,353	32.83	372,718.99	
VISTRA CORP	23,603	18.88	445,624.64	
WEC ENERGY GROUP INC	16,258	93.59	1,521,586.22	
XCEL ENERGY INC	26,974	67.88	1,830,995.12	
ADVANCED MICRO DEVICES	57,845	69.40	4,014,443.00	
ANALOG DEVICES	18,148	112.21	2,036,387.08	
APPLIED MATERIALS	45,360	60.62	2,749,723.20	
BROADCOM INC	19,853	305.79	6,070,848.87	
INTEL CORP	213,104	50.59	10,780,931.36	
KLA CORP	7,674	188.21	1,444,323.54	
LAM RESEARCH CORP	7,443	345.72	2,573,193.96	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	32,661	34.99	1,142,808.39	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	14,195	67.13	952,910.35	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	11,691	100.21	1,171,555.11	
MICRON TECHNOLOGY	54,916	50.02	2,746,898.32	
NVIDIA CORP	30,476	407.78	12,427,503.28	
NXP SEMICONDUCTORS NV	13,670	115.75	1,582,302.50	
ON SEMICONDUCTOR CORP	19,013	20.47	389,196.11	
QORVO INC	5,629	111.92	629,997.68	
QUALCOMM	56,740	88.89	5,043,618.60	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,278	131.61	1,089,467.58	
TERADYNE INC	8,937	83.53	746,507.61	
TEXAS INSTRUMENTS	46,411	129.63	6,016,257.93	
XILINX INC	12,116	102.66	1,243,828.56	
アメリカドル 小計	14,766,000		1,386,176,193.82 (146,685,164,830)	

カナダドル	CAMECO CORP	19,186	16.00	306,976.00
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	56,391	24.39	1,375,376.49
	CENOVUS ENERGY INC	50,155	6.73	337,543.15
	ENBRIDGE	99,378	41.96	4,169,900.88
	IMPERIAL OIL	11,645	22.43	261,197.35
	INTER PIPELINE LTD	18,856	12.93	243,808.08
	KEYERA CORP	10,963	20.88	228,907.44
	PARKLAND CORP	8,544	34.77	297,074.88
	PEMBINA PIPELINE CORP	26,492	33.39	884,567.88
	SUNCOR ENERGY	73,664	22.42	1,651,546.88
	TC ENERGY CORP	47,876	60.29	2,886,444.04
	AGNICO EAGLE MINES	12,637	96.41	1,218,333.17
	B2GOLD CORP	61,440	8.76	538,214.40
	BARRICK GOLD CORP	91,164	38.18	3,480,641.52
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	44.28	323,332.56
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	21,114	12.06	254,634.84
	FRANCO-NEVADA CORP	9,757	212.99	2,078,143.43
	KINROSS GOLD CORP	60,197	11.30	680,226.10
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	12,974	64.74	839,936.76
	LUNDIN MINING CORP	30,173	7.96	240,177.08
	NUTRIEN LTD	27,026	44.00	1,189,144.00
	PAN AMERICAN SILVER CORP	12,397	49.25	610,552.25
	TECK RESOURCES LTD-CL B	28,309	15.01	424,918.09
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	23,487	71.93	1,689,419.91
	YAMANA GOLD INC	57,051	8.47	483,221.97
	CAE INC	11,940	19.73	235,576.20
	WSP GLOBAL INC	5,400	82.85	447,390.00
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	6,642	59.17	393,007.14
	THOMSON REUTERS CORP	7,925	91.62	726,088.50
	AIR CANADA	6,737	16.47	110,958.39
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	34,994	129.53	4,532,772.82
	CP RAILWAY LIMITED	6,612	367.70	2,431,232.40
	MAGNA INTERNATIONAL INC	14,428	64.11	924,979.08
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	22.39	223,900.00
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	14,471	76.31	1,104,282.01
	QUEBECOR INC -CL B	11,279	29.11	328,331.69
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	26,673	23.71	632,416.83
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,526	119.92	302,917.92
	DOLLARAMA INC	16,037	47.29	758,389.73
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	45,007	45.83	2,062,670.81
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	34.75	254,717.50	
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	69.13	626,870.84	

METRO INC	13,499	58.36	787,801.64	
WESTON (GEORGE) LTD	3,705	103.47	383,356.35	
SAPUTO INC	10,742	32.12	345,033.04	
BAUSCH HEALTH COS INC	14,544	22.88	332,766.72	
CANOPY GROWTH CORP	13,748	22.12	304,105.76	
CRONOS GROUP INC	8,200	8.48	69,536.00	
BANK MONTREAL	32,874	73.73	2,423,800.02	
BANK NOVA SCOTIA	59,268	55.55	3,292,337.40	
CANADIAN IMPERIAL BANK	22,999	93.38	2,147,646.62	
NATIONAL BANK OF CANADA	16,271	62.09	1,010,266.39	
ROYAL BANK OF CANADA	70,308	93.72	6,589,265.76	
TORONTO-DOMINION BANK	89,263	60.58	5,407,552.54	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	68,469	44.97	3,079,050.93	
CI FINANCIAL CORP	9,872	18.21	179,769.12	
IGM FINANCIAL INC	3,890	33.24	129,303.60	
ONEX CORP	4,872	60.32	293,879.04	
TMX GROUP LTD	3,330	140.85	469,030.50	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,399	425.35	595,064.65	
GREAT-WEST LIFECO INC	11,567	23.91	276,566.97	
IA FINANCIAL CORP INC	5,415	44.73	242,212.95	
INTACT FINANCIAL CORP	6,563	137.36	901,493.68	
MANULIFE FINANCIAL CORP	100,839	18.68	1,883,672.52	
POWER CORP OF CANADA	26,652	23.91	637,249.32	
SUN LIFE FINANCIAL INC	29,501	53.20	1,569,453.20	
BLACKBERRY LIMITED	25,075	6.23	156,217.25	
CGI INC - CL A	12,624	86.69	1,094,374.56	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	954	1,546.32	1,475,189.28	
OPEN TEXT CORP	13,214	59.71	789,007.94	
SHOPIFY INC - CLASS A	5,140	1,247.01	6,409,631.40	
BCE INC	7,663	55.88	428,208.44	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	17,504	54.33	950,992.32	
TELUS CORP	23,120	22.91	529,679.20	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	26,086	17.78	463,809.08	
ALTAGAS INCOME LTD	14,516	16.73	242,852.68	
ATCO LTD -CLASS I	4,372	40.51	177,109.72	
CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	33.43	199,844.54	
EMERA INC	11,783	54.27	639,463.41	
FORTIS INC	21,705	52.56	1,140,814.80	
HYDRO ONE LTD	14,740	27.67	407,855.80	
カナダドル 小計	1,947,511		91,246,006.15 (7,209,346,945)	
ユーロ	ENI	131,368	8.52	1,119,255.36

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	23,722	10.35	245,522.70
NESTE OIL OYJ	22,270	41.39	921,755.30
OMV AG	8,201	29.56	242,421.56
REPSOL SA	78,934	7.39	583,322.26
TENARIS SA	19,529	5.63	109,987.32
TOTAL SE	122,317	32.65	3,993,650.05
VOPAK	3,661	47.57	174,153.77
AIR LIQUIDE	23,289	139.10	3,239,499.90
AKZO NOBEL	10,648	82.02	873,348.96
ARCELORMITTAL	35,308	9.87	348,666.50
ARKEMA	3,446	88.56	305,177.76
BASF SE	44,903	52.44	2,354,713.32
COVESTRO AG	8,327	36.03	300,021.81
CRH PLC	42,400	32.81	1,391,144.00
EVONIK INDUSTRIES AG	9,603	24.34	233,737.02
FUCHS PETROLUB SE -PREF	3,246	38.10	123,672.60
HEIDELBERGCEMENT AG	6,759	51.88	350,656.92
KONINKLIJKE DSM NV	8,224	130.30	1,071,587.20
LANXESS	3,921	46.88	183,816.48
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	13,393	27.00	361,611.00
SOLVAY SA	3,676	70.60	259,525.60
STORA ENSO OYJ R	31,971	11.18	357,595.63
SYMRISE AG	6,316	107.85	681,180.60
THYSSEN KRUPP	18,959	7.13	135,291.42
UMICORE	9,946	44.77	445,282.42
UPM KYMMENE OYJ	27,357	24.63	673,802.91
VOESTALPINE AG	5,948	19.41	115,450.68
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	14,513	22.28	323,349.64
AIRBUS SE	29,922	63.93	1,912,913.46
ALSTOM	9,679	49.36	477,755.44
ANDRITZ AG	3,617	31.34	113,356.78
BOUYGUES ORD	11,344	31.41	356,315.04
BRENTAG AG	8,461	54.74	463,155.14
CNH INDUSTRIAL NV	54,274	6.45	350,392.94
DASSAULT AVIATION SA	121	782.00	94,622.00
EIFFAGE	4,629	77.80	360,136.20
FERROVIAL SA	22,165	22.40	496,496.00
GEA GROUP AG	7,649	32.54	248,898.46
HOCHTIEF AG	998	77.75	77,594.50
KINGSPAN GROUP PLC	6,373	63.30	403,410.90
KION GROUP AG	3,430	70.26	240,991.80
KNORR-BREMSE AG	2,788	106.08	295,751.04

KONE OYJ-B	17,409	66.46	1,157,002.14
LEGRAND SA	13,518	70.38	951,396.84
LEONARDO SPA	22,011	6.14	135,235.58
MTU AERO ENGINES AG	2,894	147.00	425,418.00
PRYSMIAN SPA	11,275	22.85	257,633.75
SAFRAN SA	15,584	88.54	1,379,807.36
SAINT-GOBAIN	26,009	33.32	866,619.88
SCHNEIDER ELECTRIC SE	27,176	99.18	2,695,315.68
SIEMENS	37,692	112.78	4,250,903.76
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	12,322	19.08	235,165.37
THALES SA	4,776	66.80	319,036.80
VINCI S.A.	25,260	79.40	2,005,644.00
WARTSILA OYJ	18,738	7.45	139,635.57
BUREAU VERITAS SA	13,374	20.20	270,154.80
RANDSTAD NV	5,866	43.14	253,059.24
TELEPERFORMANCE	3,026	237.60	718,977.60
WOLTERS KLUWER	14,206	67.36	956,916.16
ADP	1,532	91.00	139,412.00
AENA SME SA	3,518	116.00	408,088.00
ATLANTIA SPA	26,089	13.57	354,027.73
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,748	8.22	80,187.04
DEUTSCHE POST AG-REG	50,993	34.74	1,771,496.82
FRAPORT AG	1,934	35.36	68,386.24
GETLINK	24,901	13.30	331,183.30
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	15,606	60.22	939,793.32
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,582	46.60	120,321.20
CONTINENTAL AG	5,742	90.60	520,225.20
DAIMLER AG	41,352	39.95	1,652,012.40
FAURECIA	3,558	34.75	123,640.50
FERRARI NV	5,665	154.50	875,242.50
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	59,582	9.07	540,766.23
MICHELIN	8,706	92.38	804,260.28
PEUGEOT SA	30,939	14.83	458,980.06
PIRELLI & C SPA	20,549	3.61	74,366.83
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	7,141	53.74	383,757.34
RENAULT SA	10,803	25.24	272,667.72
VALEO SA	10,585	22.68	240,067.80
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,592	142.02	1,362,255.84
VOLKSWAGEN STAMM	1,657	150.00	248,550.00
ADIDAS AG	9,299	239.10	2,223,390.90
ESSILORLUXOTTICA	14,558	114.80	1,671,258.40
HERMES INTERNATIONAL	1,528	741.60	1,133,164.80

KERING	3,705	495.00	1,833,975.00
LVMH	13,765	399.10	5,493,611.50
MONCLER SPA	9,963	33.62	334,956.06
PUMA SE	4,644	66.48	308,733.12
SEB SA	1,191	146.40	174,362.40
ACCOR	10,837	22.62	245,132.94
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,703	126.00	844,578.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,332	27.24	145,243.68
SODEXO	5,008	60.24	301,681.92
BOLLORE	37,200	2.95	110,037.60
JC DECAUX SA	3,750	15.15	56,812.50
PUBLICIS GROUPE	11,844	29.65	351,174.60
SCOUT24 AG	5,889	74.25	437,258.25
SES	16,206	6.13	99,375.19
TELENET GROUP HOLDING NV	2,831	36.48	103,274.88
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,969	71.04	352,997.76
VIVENDI	41,830	22.75	951,632.50
DELIVERY HERO SE	6,869	89.76	616,561.44
INDITEX	51,704	22.88	1,182,987.52
JUST EAT TAKEAWAY	6,525	89.84	586,206.00
PROSUS	25,025	82.20	2,057,055.00
ZALANDO SE	8,215	63.52	521,816.80
CARREFOUR	30,831	13.55	417,760.05
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,298	26.90	88,716.20
COLRUYT SA	2,228	49.05	109,283.40
JERONIMO MARTINS	13,062	14.37	187,766.25
KONINKLIJKE AHOLD NV	56,607	25.00	1,415,175.00
METRO AG	8,880	8.62	76,616.64
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	39,098	46.96	1,836,237.57
DANONE (GROUPE)	31,644	60.74	1,922,056.56
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	26,648	8.16	217,580.92
HEINEKEN HOLDING NV	6,065	74.80	453,662.00
HEINEKEN NV	13,426	82.88	1,112,746.88
KERRY GROUP PLC-A	8,698	108.70	945,472.60
PERNOD-RICARD	10,313	144.25	1,487,650.25
REMY COINTREAU	1,020	135.00	137,700.00
BEIERSDORF AG	4,768	101.30	482,998.40
HENKEL AG & CO KGAA	5,620	75.50	424,310.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	9,117	85.80	782,238.60
LOREAL	12,384	284.90	3,528,201.60
UNILEVER NV	71,996	50.54	3,638,677.84
BIOMERIEUX	1,835	129.30	237,265.50

CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,091	87.90	183,798.90
DIASORIN SPA	1,418	162.70	230,708.60
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	11,179	76.42	854,299.18
FRESENIUS SE&CO KGAA	21,184	44.50	942,688.00
KONINKLIJKE PHILIPS	44,587	44.60	1,988,803.13
ORPEA	2,927	108.00	316,116.00
SARTORIUS AG-VORZUG	1,793	326.40	585,235.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	8,210	43.85	360,049.55
BAYER	48,223	60.69	2,926,653.87
EUROFINS SCIENTIFIC	649	554.80	360,065.20
GALAPAGOS NV	2,380	167.60	398,888.00
GRIFOLS SA	14,240	25.09	357,281.60
IPSEN	1,866	78.20	145,921.20
MERCK KGAA	6,893	112.00	772,016.00
ORION OYJ-CLASS B	5,393	43.40	234,056.20
QIAGEN N.V.	11,006	42.00	462,252.00
RECORDATI SPA	5,195	46.96	243,957.20
SANOFI	55,872	88.81	4,961,992.32
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,536	259.60	398,745.60
UCB (GROUPE)	6,228	109.95	684,768.60
ABN AMRO BANK NV-CVA	19,718	7.69	151,710.29
BANCO BILBAO VIZCAYA	311,860	3.11	972,067.62
BANCO SANTANDER SA	800,366	2.12	1,701,578.11
BANKINTER SA	24,407	4.63	113,028.81
BNP PARIBAS	55,080	37.14	2,045,671.20
CAIXABANK	190,947	2.10	402,325.32
COMMERZBANK AG	55,963	4.58	256,590.35
CREDIT AGRICOLE SA	59,470	8.90	529,758.76
ERSTE GROUP BANK AG	14,009	21.10	295,589.90
FINECOBANK SPA	28,289	12.82	362,664.98
ING GROEP NV-CVA	188,246	6.39	1,203,080.18
INTESA SANPAOLO	767,057	1.81	1,392,515.27
KBC GROEP NV	12,075	52.52	634,179.00
MEDIOBANCA	29,447	7.08	208,484.76
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,866	15.97	125,620.02
SOCIETE GENERALE	39,271	14.69	576,890.99
UNICREDIT SPA	98,080	8.68	851,432.48
AMUNDI SA	2,812	70.90	199,370.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	100,131	8.27	828,383.76
DEUTSCHE BOERSE	9,803	166.95	1,636,610.85
EURAZEO SA	2,340	45.66	106,844.40
EXOR NV	5,889	49.55	291,799.95

GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,728	75.00	279,600.00
NATIXIS	40,748	2.21	90,216.07
SOFINA	961	233.00	223,913.00
WENDEL	1,047	80.45	84,231.15
AEGON	76,385	2.65	202,420.25
AGEAS	10,380	33.05	343,059.00
ALLIANZ SE-REG	20,546	183.64	3,773,067.44
ASSICURAZIONI GENERALI	57,446	13.59	780,691.14
AXA	94,459	17.90	1,691,571.77
CNP ASSURANCES	8,406	10.54	88,599.24
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,976	151.20	449,971.20
MAPFRE SA	56,454	1.64	92,584.56
MUENCHENER RUECKVERSICH.	7,421	233.90	1,735,771.90
NN GROUP NV	14,216	31.94	454,059.04
POSTE ITALIANE SPA	25,777	8.14	210,030.99
SAMPO OYJ-A SHS	22,035	32.77	722,086.95
SCOR SE	6,580	23.50	154,630.00
AROUNDTOWN SA	64,179	4.93	316,851.72
DEUTSCHE WOHNEN SE	15,741	40.76	641,603.16
LEG IMMOBILIEN AG	3,774	116.28	438,840.72
VONOVIA SE	24,718	54.46	1,346,142.28
ADYEN NV	863	1,355.00	1,169,365.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	22,353	46.23	1,033,379.19
ATOS SE	5,368	75.00	402,600.00
CAPGEMINI SA	8,103	104.00	842,712.00
DASSAULT SYSTEMES SA	6,288	145.80	916,790.40
EDENRED	12,673	43.30	548,740.90
NEMETSCHKE SE	3,320	63.20	209,824.00
NEXI SPA	19,721	14.97	295,321.97
SAP SE	51,687	135.64	7,010,824.68
TEAMVIEWER AG	7,213	45.82	330,499.66
WORLDLINE SA	6,787	73.74	500,473.38
INGENICO GROUP	3,351	138.50	464,113.50
NOKIA OYJ	285,445	3.72	1,062,997.18
ALTICE NV -A	27,649	3.70	102,384.24
CELLNEX TELECOM SA	13,166	58.42	769,157.72
DEUTSCHE TELEKOM	162,804	14.88	2,422,523.52
ELISA A	6,757	52.50	354,742.50
ILIAD SA	637	176.40	112,366.80
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,877	8.97	133,521.07
KPN (KON.)	173,861	2.39	416,570.95
ORANGE	102,847	10.64	1,094,292.08

	PROXIMUS	7,531	17.98	135,445.03
	TELECOM ITALIA ORD	489,749	0.38	186,986.16
	TELECOM ITALIA RNC	345,204	0.37	130,279.98
	TELEFONICA	251,416	3.86	971,974.25
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	2.46	100,848.49
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,889	39.46	232,379.94
	E.ON SE	116,273	10.34	1,202,262.82
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL-RTS	119,401	0.10	11,952.04
	ELECTRICITE DE FRANCE	32,823	9.48	311,162.04
	ELIA GROUP SA/NV	1,959	94.30	184,733.70
	ENAGAS	11,944	22.00	262,768.00
	ENDESA	17,138	23.88	409,255.44
	ENEL	393,341	7.94	3,124,700.90
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	119,401	4.44	531,215.04
	ENGIE	87,566	10.92	956,220.72
	FORTUM OYJ	24,235	18.03	436,957.05
	IBERDROLA SA	282,610	11.04	3,121,427.45
	IBERDROLA SA-RTS	282,610	0.25	70,652.50
	NATURGY ENERGY GROUP SA	14,147	16.65	235,618.28
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,296	16.86	392,770.56
	RWE STAMM	27,348	32.79	896,740.92
	SNAM SPA	108,807	4.62	503,449.98
	SUEZ	17,194	10.26	176,496.41
	TERNA SPA	66,644	6.29	419,590.62
	UNIPER SE	8,984	29.90	268,621.60
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	25,222	19.65	495,612.30
	VERBUND AG	3,100	44.60	138,260.00
	ASML HOLDING NV	21,114	322.55	6,810,320.70
	INFINEON TECHNOLOGIES	59,916	21.79	1,305,569.64
	STMICROELECTRONICS	30,153	25.89	780,661.17
	ユーロ 小計	9,804,080		189,250,566.49 (23,410,295,074)
イギリスポンド	BP PLC	1,002,984	2.98	2,989,895.30
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	203,479	12.42	2,528,430.05
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	183,840	11.93	2,193,578.88
	ANGLO AMERICAN PLC	59,712	19.56	1,168,324.99
	ANTOFAGASTA PLC	16,971	10.29	174,631.59
	BHP GROUP PLC	103,710	17.09	1,773,233.58
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,013	57.26	401,564.38
	EVRAZ PLC	34,476	3.05	105,220.75
	GLENCORE PLC	520,278	1.82	951,068.18
	JOHNSON MATTHEY PLC	8,385	22.90	192,016.50

MONDI PLC	22,324	14.42	321,912.08
RIO TINTO PLC REG	55,346	47.47	2,627,551.35
ASHTED GROUP PLC	22,351	25.81	576,879.31
BAE SYSTEMS PLC	161,098	4.77	769,887.34
BUNZL PLC	15,320	22.33	342,095.60
DCC PLC	4,508	70.08	315,920.64
FERGUSON PLC	11,486	69.92	803,101.12
MELROSE INDUSTRIES PLC	238,890	1.04	249,281.71
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	87,932	2.68	235,745.69
SMITHS GROUP PLC	20,046	14.36	287,860.56
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,672	105.05	385,743.60
EXPERIAN PLC	44,292	27.76	1,229,545.92
INTERTEK GROUP PLC	8,461	54.16	458,247.76
RELX PLC	94,963	16.71	1,586,831.73
RENTOKIL INITIAL PLC	86,094	5.44	468,523.54
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	5.18	264,473.86
BURBERRY GROUP PLC	18,236	13.08	238,618.06
PERSIMMON PLC	16,612	24.63	409,153.56
TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.30	215,862.40
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,550	44.52	291,606.00
COMPASS GROUP PLC	86,808	11.20	972,249.60
GVC HOLDINGS PLC	33,300	7.41	246,952.80
INTERCONTINENTAL HOTELS	9,162	37.68	345,224.16
WHITBREAD PLC	10,170	22.90	232,893.00
AUTO TRADER GROUP PLC	54,849	5.27	289,273.62
INFORMA PLC	69,225	4.00	277,523.02
ITV PLC	154,979	0.61	95,219.09
PEARSON	33,153	5.44	180,551.23
WPP PLC	65,133	6.17	402,131.14
JD SPORTS FASHION PLC	22,866	5.98	136,921.60
KINGFISHER PLC	90,095	2.48	223,705.88
NEXT PLC	6,461	51.46	332,483.06
OCADO GROUP PLC	23,500	20.83	489,505.00
MORRISON SUPERMARKETS	111,872	1.88	210,431.23
SAINSBURY (J) PLC	82,018	1.91	156,695.38
TESCO	504,901	2.20	1,114,316.50
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,743	18.33	343,652.90
BRITISH AMERICAN TOBACCO	113,594	26.92	3,057,950.48
COCA-COLA HBC AG-CDI	9,115	20.59	187,677.85
DIAGEO	115,651	27.96	3,233,601.96
IMPERIAL BRANDS PLC	45,253	13.95	631,505.61
RECKITT BENCKISER PLC	35,002	77.12	2,699,354.24

	UNILEVER PLC	57,664	46.78	2,697,521.92
	SMITH & NEPHEW PLC	44,384	16.11	715,026.24
	ASTRAZENECA	65,165	86.52	5,638,075.80
	GLAXOSMITHKLINE	248,644	15.80	3,929,072.48
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	8,586	21.52	184,770.72
	BARCLAYS	842,125	1.13	956,654.00
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,007,196	3.64	3,674,754.60
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,604,337	0.29	1,070,307.87
	NATWEST GROUP PLC	252,932	1.15	290,871.80
	STANDARD CHARTERED PLC	142,008	4.26	605,380.10
	3I GROUP PLC	50,412	8.70	438,584.40
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,246	17.07	311,550.45
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	16,220	83.68	1,357,289.60
	M&G PLC	112,358	1.62	183,031.18
	SCHRODERS PLC	5,525	29.60	163,540.00
	ST JAMES'S PLACE PLC	26,728	9.52	254,664.38
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	105,490	2.59	273,430.08
	ADMIRAL GROUP PLC	9,872	23.46	231,597.12
	AVIVA PIC	206,665	2.81	580,728.65
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	68,857	2.93	201,819.86
	LEGAL & GENERAL GROUP	301,878	2.16	654,169.62
	PRUDENTIAL	127,523	11.50	1,466,514.50
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	51,693	4.41	228,017.82
	AVEVA GROUP PLC	3,423	41.15	140,856.45
	SAGE GROUP PLC	58,775	7.48	439,754.55
	HALMA PLC	20,325	22.30	453,247.50
	BT GROUP PLC	440,451	1.12	494,846.69
	VODAFONE GROUP PLC	1,315,044	1.22	1,606,457.75
	NATIONAL GRID PLC	178,513	9.03	1,611,972.39
	SEVERN TRENT PLC	11,927	24.22	288,871.94
	SSE PLC	52,436	13.28	696,350.08
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	8.82	306,264.55
	イギリスボンド 小計	14,462,023		72,562,620.47 (9,844,570,719)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	8,748	18.15	158,776.20
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	408	797.50	325,380.00
	GIVAUDAN-REG	475	3,768.00	1,789,800.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	24,760	44.10	1,091,916.00
	SIKA AG-BR	6,442	203.00	1,307,726.00
	ABB LTD	89,158	23.78	2,120,177.24
	GEBERIT AG-REG	1,882	506.20	952,668.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	911	231.00	210,441.00

	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,021	231.10	467,053.10
	ADECCO GROUP AG-REG	8,520	45.77	389,960.40
	SGS SA	311	2,423.00	753,553.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,066	159.70	489,640.20
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	26,841	59.02	1,584,155.82
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,586	188.70	299,278.20
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	36.26	108,925.04
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	149	1,911.00	284,739.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	78,900.00	394,500.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	61	7,190.00	438,590.00
	NESTLE SA - REGISTERED	148,015	109.48	16,204,682.20
	ALCON INC	23,565	55.10	1,298,431.50
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,689	203.80	548,018.20
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	480	917.00	440,160.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,833	563.20	2,158,745.60
	NOVARTIS	106,545	78.07	8,317,968.15
	ROCHE HOLDING GENUSS	34,900	318.90	11,129,610.00
	VIFOR PHARMA AG	2,126	134.15	285,202.90
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	250	97.00	24,250.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	124,429	9.82	1,222,141.63
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,752	41.45	445,670.40
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	951	889.60	846,009.60
	UBS GROUP AG	177,740	11.26	2,002,241.10
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	142.30	332,128.20
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,587	348.50	553,069.50
	SWISS RE LTD	15,271	74.44	1,136,773.24
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,645	347.70	2,658,166.50
	SWISS PRIME SITE-REG	3,622	83.30	301,712.60
	TEMENOS AG - REG	3,520	146.20	514,624.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	9,187	63.70	585,211.90
	SWISSCOM	1,253	494.10	619,107.30
	スイスフラン 小計	859,042		64,791,204.12 (7,455,523,858)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	9,250	221.00	2,044,250.00
	BOLIDEN AB	13,081	245.00	3,204,845.00
	SCA SV CELLULOSA B	31,928	105.90	3,381,175.20
	ALFA LAVAL AB	14,233	217.30	3,092,830.90
	ASSA ABLOY AB-B	52,153	202.70	10,571,413.10
	ATLAS COPCO A	29,922	400.20	11,974,784.40
	ATLAS COPCO B	20,378	350.50	7,142,489.00
	EPIROC AB-A	35,996	124.05	4,465,303.80
	EPIROC AB-B	21,132	121.10	2,559,085.20

	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,081	179.50	1,450,539.50	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	16,465	216.00	3,556,440.00	
	SANDVIK AB	58,793	168.00	9,877,224.00	
	SKANSKA B	18,477	183.40	3,388,681.80	
	SKF AB-B	18,340	168.05	3,082,037.00	
	VOLVO B	77,339	157.65	12,192,493.35	
	SECURITAS B	15,577	129.65	2,019,558.05	
	ELECTROLUX AB-SER B	8,955	167.25	1,497,723.75	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	81.12	1,771,741.92	
	EVOLUTION GAMING GROUP	6,697	603.00	4,038,291.00	
	HENNES & MAURITZ B	38,673	135.00	5,220,855.00	
	ICA GRUPPEN AB	4,719	431.40	2,035,776.60	
	SWEDISH MATCH AB	8,284	679.80	5,631,463.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	25,376	287.30	7,290,524.80	
	NORDEA BANK ABP	152,044	71.04	10,801,205.76	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	84,995	88.26	7,501,658.70	
	SVENSKA HANDELSBK A	81,197	86.08	6,989,437.76	
	SWEDBANK AB-A	46,881	145.96	6,842,750.76	
	EQT AB	12,798	205.80	2,633,828.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	218.80	1,888,462.80	
	INVESTOR AB-B SHS	23,675	522.80	12,377,290.00	
	KINNEVIK AB - B	11,182	305.80	3,419,455.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,093	419.80	1,718,241.40	
	ERICSSON (LM) B	136,614	100.65	13,750,199.10	
	HEXAGON AB-B SHS	14,685	572.40	8,405,694.00	
	TELE2 AB-B SHS	24,520	130.10	3,190,052.00	
	TELIA CO AB	133,145	35.52	4,729,310.40	
	スウェーデンクローナ 小計	1,290,150		195,737,113.25 (2,352,760,101)	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	51,412	144.50	7,429,034.00	
	NORSK HYDRO	61,358	26.74	1,640,712.92	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,800	377.80	3,702,440.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	4,706	288.60	1,358,151.60	
	MOWI ASA	23,314	167.55	3,906,260.70	
	ORKLA	33,665	87.78	2,955,113.70	
	DNB ASA	48,569	144.50	7,018,220.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	190.30	2,122,415.90	
	TELENOR ASA	38,320	149.15	5,715,428.00	
	ノルウェークローネ 小計	282,297		35,847,777.32 (416,909,650)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,314	722.20	3,837,770.80	
	NOVOZYMES A/S	11,390	387.00	4,407,930.00	

	VESTAS WIND SYSYEMS	10,339	848.00	8,767,472.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	199	7,780.00	1,548,220.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	361	8,390.00	3,028,790.00
	DSV PANALPINA A S	11,022	863.20	9,514,190.40
	PANDORA A/S	5,549	400.40	2,221,819.60
	CARLSBERG AS-B	5,576	935.00	5,213,560.00
	AMBU A/S-B	8,639	219.50	1,896,260.50
	COLOPLAST-B	6,101	1,058.00	6,454,858.00
	DEMANT A/S	4,463	195.30	871,623.90
	GN STORE NORD A/S	6,740	380.40	2,563,896.00
	GENMAB A/S	3,382	2,234.00	7,555,388.00
	H LUNDBECK A/S	3,647	223.50	815,104.50
	NOVO NORDISK A/S-B	85,316	424.35	36,203,844.60
	DANSKE BANK A/S	32,879	105.95	3,483,530.05
	TRYG A/S	5,192	191.70	995,306.40
	ORSTED A/S	9,837	905.20	8,904,452.40
	デンマーククローネ 小計	215,946		108,284,017.15 (1,799,680,365)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	12,821	27.53	352,962.13
	OIL SEARCH LTD	110,184	3.14	345,977.76
	ORIGIN ENERGY LIMITED	87,883	5.71	501,811.93
	SANTOS	83,906	5.58	468,195.48
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	4,845	20.28	98,256.60
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	48,027	20.99	1,008,086.73
	BHP GROUP LTD	143,673	37.08	5,327,394.84
	BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	11.75	253,200.75
	EVOLUTION MINING LTD	88,310	5.82	513,964.20
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	89,546	16.29	1,458,704.34
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	20,708	28.37	587,485.96
	NEWCREST MINING LIMITED	40,587	34.60	1,404,310.20
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	40,122	15.50	621,891.00
	ORICA LTD	19,570	17.34	339,343.80
	RIO TINTO LTD	18,760	102.92	1,930,779.20
	SOUTH32 LTD	268,050	2.19	587,029.50
	CIMIC GROUP LIMITED	2,943	22.64	66,629.52
	BRAMBLES LTD	82,211	10.67	877,191.37
	AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	4.66	436,194.64
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	39,948	3.64	145,410.72
	TRANSURBAN GROUP	141,919	13.70	1,944,290.30
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	30,759	25.99	799,426.41
	CROWN RESORTS LTD	18,801	9.07	170,525.07
	TABCORP HOLDINGS LTD	90,583	3.64	329,722.12

	REA GROUP LTD	3,000	107.32	321,960.00
	SEEK LTD	17,113	22.02	376,828.26
	WESFARMERS LTD	58,648	46.36	2,718,921.28
	COLES GROUP LTD	70,757	17.78	1,258,059.46
	WOOLWORTHS GROUP LTD	59,620	38.63	2,303,120.60
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	22,146	8.83	195,549.18
	TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	11.14	384,107.20
	COCHLEAR LIMITED	3,460	193.96	671,101.60
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,641	63.41	611,335.81
	SONIC HEALTHCARE LTD	24,299	32.05	778,782.95
	CSL LIMITED	22,228	277.02	6,157,600.56
	AUST AND NZ BANKING GROUP	137,327	18.29	2,511,710.83
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	86,585	72.86	6,308,583.10
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	156,208	17.98	2,808,619.84
	WESTPAC BANKING	177,722	17.76	3,156,342.72
	AMP LTD	182,052	1.71	311,308.92
	ASX LTD	10,329	83.44	861,851.76
	MACQUARIE GROUP LIMITED	16,822	125.79	2,116,039.38
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	6,690	58.56	391,766.40
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	114,505	5.32	609,166.60
	MEDIBANK PRIVATE LTD	129,252	2.95	381,293.40
	QBE INSURANCE GROUP	78,439	10.40	815,765.60
	SUNCORP GROUP LIMITED	58,518	8.98	525,491.64
	AFTERPAY LTD	11,615	69.81	810,843.15
	COMPUTERSHARE LIMITED	21,970	13.51	296,814.70
	WISETECH GLOBAL LTD	10,764	20.74	223,245.36
	TELSTRA CORP	233,571	3.33	777,791.43
	TPG TELECOM LTD	22,697	8.02	182,029.94
	AGL ENERGY LTD	32,928	17.23	567,349.44
	AUSNET SERVICES	20,479	1.76	36,043.04
	オーストラリアドル 小計	3,433,174		60,038,208.72 (4,525,079,791)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	49,114	6.34	311,382.76
	A2 MILK CO LTD	40,302	20.84	839,893.68
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	29,782	35.24	1,049,517.68
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,000	13.35	293,700.00
	SPARK NEW ZEALAND LTD	104,543	4.85	507,033.55
	MERCURY NZ LTD	46,613	4.69	218,614.97
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	4.75	304,161.50
	ニュージーランドドル 小計	356,388		3,524,304.14 (248,251,983)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	134,948	49.80	6,720,410.40

	NWS HOLDINGS LTD	73,500	6.59	484,365.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	73,000	82.10	5,993,300.00	
	MTR CORP	82,500	38.30	3,159,750.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	112,000	50.05	5,605,600.00	
	SANDS CHINA LTD	127,000	29.25	3,714,750.00	
	SJM HOLDINGS LTD	150,000	8.27	1,240,500.00	
	WYNN MACAU LTD	60,800	12.98	789,184.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	103,300	23.75	2,453,375.00	
	WH GROUP LTD	516,000	6.79	3,503,640.00	
	BANK EAST ASIA	46,964	17.58	825,627.12	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	196,000	21.90	4,292,400.00	
	HANG SENG BANK	39,300	124.30	4,884,990.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	61,400	360.40	22,128,560.00	
	AIA GROUP LTD	599,000	71.90	43,068,100.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	131,948	43.30	5,713,348.40	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	115,000	19.02	2,187,300.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	79,761	28.60	2,281,164.60	
	KERRY PROPERTIES LTD	37,000	18.50	684,500.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	76,250	37.25	2,840,312.50	
	SINO LAND CO	128,600	9.34	1,201,124.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	50,000	92.45	4,622,500.00	
	SWIRE PACIFIC A	20,000	38.10	762,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,000	17.52	1,208,880.00	
	WHARF HOLDINGS	40,000	13.08	523,200.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	101,000	28.00	2,828,000.00	
	PCCW LTD	212,000	4.36	924,320.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	38.30	1,225,600.00	
	CLP HOLDINGS	84,000	71.50	6,006,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	541,229	11.04	5,975,168.16	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	42.35	3,112,725.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	11,700	98.05	1,147,185.00	
	香港ドル 小計	4,178,700		152,107,879.18 (2,076,272,550)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	80,200	5.71	457,942.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	3.25	243,100.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	117,400	0.92	108,595.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,750	3.62	158,375.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	0.75	239,775.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,600	20.00	92,000.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	112,800	4.29	483,912.00	
	DBS GROUP	85,800	20.64	1,770,912.00	
	OCBC BANK	171,450	8.98	1,539,621.00	

	UNITED OVERSEAS BANK	54,800	20.23	1,108,604.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	8.32	353,600.00	
	CAPITALAND LTD	118,900	2.82	335,298.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	8.26	181,720.00	
	UOL GROUP LIMITED	24,800	6.67	165,416.00	
	VENTURE CORP LTD	14,300	16.98	242,814.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	408,180	2.48	1,012,286.40	
	シンガポールドル 小計	1,695,980		8,493,970.40 (651,062,831)	
イスラエルシ ケル	ICL LTD	28,484	11.06	315,033.04	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,248	463.00	577,824.00	
	BANK HAPOLIM BM	61,880	19.83	1,227,080.40	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,692	17.19	1,215,195.48	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,227	10.63	682,733.01	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,272	70.58	442,677.76	
	AZRIELI GROUP	1,471	158.80	233,594.80	
	NICE LTD	3,165	675.90	2,139,223.50	
	イスラエルシケル 小計	237,439		6,833,361.99 (211,902,555)	
	合 計	53,528,730		206,886,821,252 (206,886,821,252)	

(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	704,429.55	
		LENDLEASE GROUP	36,448	434,824.64	
		SYDNEY AIRPORT	53,915	291,141.00	
		オーストラリアドル 小計	153,768	1,430,395.19 (107,808,885)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000	1,033,500.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	2,127,500.00	
		香港ドル 小計	315,000	3,161,000.00 (43,147,650)	
		投資信託受益証券合計	468,768	150,956,535 (150,956,535)	
投資証券	アメリカド ル	AGNC INVESTMENT CORP	29,331	396,555.12	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6,461	1,089,001.55	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	22,004	5,640,285.32	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	71,103	508,386.45	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,110	1,044,103.50	

BOSTON PROPERTIES	7,834	710,308.78	
CAMDEN PROPERTY TRUST	5,093	455,976.29	
CROWN CASTLE INTL CORP	20,585	3,431,519.50	
DIGITAL REALTY TRUST INC	12,906	1,897,052.94	
DUKE REALTY CORP	19,101	711,703.26	
EQUINIX INC	4,223	3,113,997.97	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,979	588,753.03	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	18,126	984,966.84	
ESSEX PROPERTY TRUST	3,352	717,730.24	
EXTRA SPACE STORAGE INC	6,715	640,611.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,030	294,149.70	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	24,568	644,664.32	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,932	345,786.00	
INVITATION HOMES INC	27,833	766,242.49	
IRON MOUNTAIN INC	15,540	423,309.60	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	27,097	512,675.24	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,042	672,293.34	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	9,434	324,529.60	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	12,315	384,228.00	
PROLOGIS INC	36,577	3,654,408.07	
PUBLIC STORAGE	7,710	1,429,125.60	
REALTY INCOME CORP	16,184	929,285.28	
REGENCY CENTERS CORP	8,875	354,645.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,697	1,701,579.96	
SIMON PROPERTY GROUP	14,987	907,762.59	
SUN COMMUNITIES INC	4,728	670,808.64	
UDR INC	14,820	525,961.80	
VENTAS INC	18,598	665,250.46	
VEREIT INC	55,232	342,990.72	
VICI PROPERTIES INC	24,099	506,801.97	
VORNADO REALTY TRUST	7,639	267,441.39	
WELLTOWER INC	20,006	1,028,708.52	
WP CAREY INC	8,887	590,096.80	
アメリカドル 小計	646,753	39,873,696.88	(4,219,434,603)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,069	241,081.64
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	7,000	92,260.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	133,369.95
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,942	59,693.18
カナダドル 小計	23,956	526,404.77	(41,591,240)
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	-
	COVIVIO(FP)	1,902	116,877.90

	GECINA SA	2,760	299,184.00
	ICADE	1,843	104,498.10
	KLEPIERRE	8,356	132,484.38
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,340	354,668.80
	ユーロ 小計	1,627,785	1,007,713.18 (124,654,120)
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	39,175	140,442.37
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	174,669.55
	SEGRO PLC	58,155	537,933.75
	イギリスポンド 小計	129,462	853,045.67 (115,732,706)
オーストラ リアドル	DEXUS	59,885	537,767.30
	GOODMAN GROUP	84,283	1,370,441.58
	GPT GROUP	84,564	348,403.68
	MIRVAC GROUP	176,235	368,331.15
	SCENTRE GROUP	274,323	578,821.53
	STOCKLAND	121,481	392,383.63
	VICINITY CENTERS	163,023	223,341.51
	オーストラリアドル 小計	963,794	3,819,490.38 (287,874,989)
香港ドル	LINK REIT	108,900	6,414,210.00
	香港ドル 小計	108,900	6,414,210.00 (87,553,966)
シンガポ ールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	139,548	485,627.04
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	110,000	189,200.00
	CAPITALAND MALL TRUST	117,100	231,858.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	132,200	248,536.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	165,400	353,956.00
	SUNTEC REIT	113,000	157,070.00
	シンガポールドル 小計	777,248	1,666,247.04 (127,717,835)
	投資証券合計	4,277,898	5,004,559,459 (5,004,559,459)
	合計		5,155,515,994 (5,155,515,994)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 590銘柄	97.2%			69.2%
	投資証券 38銘柄			2.8%	2.0%
カナダドル	株式 81銘柄	99.4%			3.4%
	投資証券 4銘柄			0.6%	0.0%
ユーロ	株式 241銘柄	99.5%			11.0%
	投資証券 6銘柄			0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式 84銘柄	98.8%			4.6%
	投資証券 3銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%			3.5%
スウェーデンクローナ	株式 36銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 54銘柄	92.0%			2.1%
	投資信託受益証券 3銘柄		2.2%		0.1%
	投資証券 7銘柄			5.9%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 32銘柄	94.1%			1.0%
	投資信託受益証券 2銘柄		2.0%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.0%	0.0%
シンガポールドル	株式 16銘柄	83.6%			0.3%
	投資証券 6銘柄			16.4%	0.1%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	2020年 7月27日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	152,973,807
コール・ローン	1,771,331,474
国債証券	140,917,772,447
派生商品評価勘定	20,880,770
未収入金	2,239,917
未収利息	942,276,742
前払費用	53,953,425
差入委託証拠金	354,387,936
流動資産合計	144,215,816,518
資産合計	144,215,816,518
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,616,068
前受金	8,984,028
未払金	26,701
未払解約金	262,790,957
未払利息	1,785
流動負債合計	280,419,539
負債合計	280,419,539
純資産の部	
元本等	
元本	56,037,038,869
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	87,898,358,110
元本等合計	143,935,396,979
純資産合計	143,935,396,979
負債純資産合計	144,215,816,518

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 7月27日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	2020年 7月27日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 7月27日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	56,037,038,869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 2.5686円 (1万口当たり純資産額) (25,686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

	2020年 7月27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。

	2020年 7月27日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 7月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 7月27日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	56,338,276,909円
期中追加設定元本額	13,214,793,125円
期中一部解約元本額	13,516,031,165円
期末元本額	56,037,038,869円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,185,899,936円
DC外国債券インデックスファンド	2,105,027,226円
DC外国債券インデックスファンドL	13,191,576,774円
DCバランスファンド30	827,673,449円
DCバランスファンド50	811,763,261円
DCバランスファンド70	164,354,642円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	423,503,513円
外国債券インデックスe	1,206,562,903円
インデックスコレクション（外国債券）	7,023,904,830円
インデックスコレクション（バランス株式30）	4,417,036,798円
インデックスコレクション（バランス株式50）	547,146,973円
インデックスコレクション（バランス株式70）	144,020,138円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	4,080,960,497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）	1,382,650,097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）	570,674,496円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	127,810,474円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	626,111,629円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	357,898,874円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	421,112,654円

区分	2020年 7月27日現在
V Aバランス株式30（適格機関投資家専用）	582,803円
V Aバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	1,301,024,805円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,824,805,233円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	656,350,271円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	6,822,327,149円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	339,990,338円
V Aバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	312,724,786円
V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,677,352,352円
V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	118,864,190円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	201,114,122円
V Aバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	104,573,304円
V Aバランス50-50（適格機関投資家専用）	53,979,308円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	109,214,040円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	277,710,844円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	79,361,957円
V Aバランス20-80（適格機関投資家専用）	1,532,903,810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）	8,470,393円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 7月27日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		4,474,267,847
合計		4,474,267,847

(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

（2020年 7月27日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益	
			(円)		
市場取引	債券先物取引 買建	2,098,724,913	うち1年超	8,984,028	
			-		
合計		2,098,724,913	-	2,107,708,941	8,984,028

(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

（2020年 7月27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	1,938,821,926	-	1,942,102,600	3,280,674
	アメリカドル	855,617,677	-	847,458,000	8,159,677
	カナダドル	97,755,368	-	97,947,600	192,232
	ユーロ	836,828,068	-	847,482,000	10,653,932
	イギリスポンド	148,620,813	-	149,215,000	594,187
	合計		1,938,821,926	-	1,942,102,600

(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 0.5% 03/31/25	4,000,000.00	4,044,843.76	
		T 0.625% 03/31/27	3,400,000.00	3,445,421.89	
		T 0.625% 05/15/30	1,500,000.00	1,505,742.19	
		T 1.125% 05/15/40	2,850,000.00	2,904,996.10	
		T 1.125% 06/30/21	4,000,000.00	4,036,640.64	
		T 1.25% 05/15/50	2,070,000.00	2,079,864.84	
		T 1.25% 07/31/23	3,950,000.00	4,078,220.71	
		T 1.25% 10/31/21	4,950,000.00	5,018,739.26	
		T 1.375% 08/31/23	3,450,000.00	3,577,892.56	

T 1.375% 09/30/23	3,550,000.00	3,684,927.72	
T 1.375% 10/15/22	2,250,000.00	2,310,908.19	
T 1.5% 01/31/22	3,000,000.00	3,060,996.09	
T 1.5% 02/15/30	1,820,000.00	1,978,539.07	
T 1.5% 02/28/23	1,760,000.00	1,821,118.74	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,143,437.52	
T 1.5% 08/15/22	5,800,000.00	5,960,632.79	
T 1.5% 08/15/26	8,300,000.00	8,859,925.80	
T 1.5% 09/30/24	8,000,000.00	8,421,562.48	
T 1.625% 02/15/26	5,750,000.00	6,159,013.65	
T 1.625% 04/30/23	5,800,000.00	6,033,359.40	
T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	5,794,453.15	
T 1.625% 05/31/23	4,350,000.00	4,530,287.09	
T 1.625% 08/15/22	1,400,000.00	1,442,328.13	
T 1.625% 08/15/29	6,260,000.00	6,860,079.71	
T 1.625% 08/31/22	500,000.00	515,371.09	
T 1.625% 09/30/26	2,150,000.00	2,312,929.68	
T 1.625% 11/15/22	4,000,000.00	4,134,843.76	
T 1.625% 11/30/26	5,030,000.00	5,416,681.25	
T 1.75% 01/31/23	2,650,000.00	2,755,689.44	
T 1.75% 02/28/22	3,650,000.00	3,742,818.36	
T 1.75% 03/31/22	2,500,000.00	2,566,845.70	
T 1.75% 04/30/22	2,000,000.00	2,056,210.94	
T 1.75% 05/15/22	4,600,000.00	4,732,160.16	
T 1.75% 05/15/23	1,750,000.00	1,827,656.25	
T 1.75% 05/31/22	2,650,000.00	2,727,791.99	
T 1.75% 06/30/22	2,500,000.00	2,576,757.82	
T 1.75% 06/30/24	2,000,000.00	2,119,921.88	
T 1.75% 07/15/22	1,200,000.00	1,237,664.06	
T 1.75% 09/30/22	1,050,000.00	1,086,462.88	
T 1.75% 11/15/29	3,220,000.00	3,571,935.95	
T 1.875% 01/31/22	3,800,000.00	3,898,710.92	
T 1.875% 03/31/22	5,100,000.00	5,246,923.80	
T 1.875% 04/30/22	2,800,000.00	2,884,710.94	
T 1.875% 05/31/22	2,350,000.00	2,424,447.27	
T 1.875% 06/30/26	3,980,000.00	4,332,914.08	
T 1.875% 07/31/22	2,880,000.00	2,979,675.01	
T 1.875% 07/31/26	1,800,000.00	1,961,156.25	
T 1.875% 08/31/22	2,600,000.00	2,693,539.05	
T 1.875% 09/30/22	1,500,000.00	1,556,250.00	
T 1.875% 10/31/22	2,000,000.00	2,077,656.26	
T 1.875% 11/30/21	3,500,000.00	3,581,142.56	

T 2.125% 02/29/24	1,400,000.00	1,496,687.50
T 2.125% 03/31/24	1,200,000.00	1,284,468.75
T 2.125% 05/15/22	5,400,000.00	5,591,320.32
T 2.125% 05/15/25	7,250,000.00	7,892,021.50
T 2.125% 06/30/21	3,000,000.00	3,055,253.91
T 2.125% 06/30/22	1,100,000.00	1,141,658.19
T 2.125% 07/31/24	1,500,000.00	1,614,140.62
T 2.125% 08/15/21	2,900,000.00	2,960,435.53
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	2,046,484.38
T 2.125% 09/30/24	2,200,000.00	2,373,164.06
T 2.125% 11/30/23	2,700,000.00	2,874,550.78
T 2.125% 11/30/24	1,400,000.00	1,513,968.75
T 2.125% 12/31/22	3,800,000.00	3,980,945.32
T 2.25% 01/31/24	5,090,000.00	5,456,639.06
T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	4,364,343.75
T 2.25% 03/31/26	1,500,000.00	1,661,191.41
T 2.25% 04/15/22	2,680,000.00	2,776,469.52
T 2.25% 04/30/24	7,600,000.00	8,180,984.35
T 2.25% 07/31/21	4,500,000.00	4,596,064.47
T 2.25% 08/15/27	2,320,000.00	2,611,812.50
T 2.25% 08/15/46	6,180,000.00	7,609,607.84
T 2.25% 08/15/49	5,110,000.00	6,398,678.12
T 2.25% 10/31/24	2,500,000.00	2,713,476.57
T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	5,430,468.75
T 2.25% 11/15/25	6,500,000.00	7,163,964.86
T 2.25% 11/15/27	5,260,000.00	5,938,046.87
T 2.25% 12/31/23	3,500,000.00	3,746,230.46
T 2.25% 12/31/24	2,900,000.00	3,156,015.62
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,277,343.75
T 2.375% 04/30/26	1,820,000.00	2,030,721.87
T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	4,070,812.50
T 2.375% 05/15/29	3,890,000.00	4,505,714.06
T 2.375% 08/15/24	6,700,000.00	7,281,800.79
T 2.375% 11/15/49	2,010,000.00	2,583,478.12
T 2.5% 01/15/22	4,000,000.00	4,137,421.88
T 2.5% 01/31/25	4,000,000.00	4,404,062.52
T 2.5% 02/15/45	2,150,000.00	2,746,625.00
T 2.5% 02/15/46	4,750,000.00	6,099,667.99
T 2.5% 02/28/26	650,000.00	728,203.12
T 2.5% 05/15/24	3,700,000.00	4,021,292.97
T 2.5% 08/15/23	3,450,000.00	3,694,599.61
T 2.625% 01/31/26	1,350,000.00	1,519,804.68
T 2.625% 02/15/29	5,390,000.00	6,337,039.87

T 2.625% 03/31/25	2,500,000.00	2,774,902.35
T 2.625% 12/15/21	6,320,000.00	6,536,262.50
T 2.75% 02/15/24	8,900,000.00	9,705,171.87
T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	5,460,251.56
T 2.75% 04/30/23	4,200,000.00	4,499,085.94
T 2.75% 06/30/25	2,000,000.00	2,242,109.38
T 2.75% 08/15/42	1,450,000.00	1,917,964.85
T 2.75% 08/15/47	3,950,000.00	5,353,792.98
T 2.75% 11/15/23	4,450,000.00	4,825,642.56
T 2.75% 11/15/42	1,040,000.00	1,375,075.00
T 2.75% 11/15/47	2,500,000.00	3,395,507.82
T 2.875% 04/30/25	2,300,000.00	2,584,085.94
T 2.875% 05/15/28	2,260,000.00	2,673,862.50
T 2.875% 05/15/43	1,050,000.00	1,416,843.75
T 2.875% 05/15/49	4,400,000.00	6,183,718.77
T 2.875% 08/15/28	4,200,000.00	4,987,828.14
T 2.875% 08/15/45	3,580,000.00	4,881,945.33
T 2.875% 10/15/21	4,250,000.00	4,391,113.30
T 2.875% 11/15/21	7,000,000.00	7,247,597.63
T 2% 02/15/22	3,100,000.00	3,188,822.25
T 2% 02/15/23	6,500,000.00	6,804,687.50
T 2% 02/15/25	6,050,000.00	6,528,328.12
T 2% 02/15/50	1,920,000.00	2,291,700.00
T 2% 04/30/24	8,000,000.00	8,538,437.52
T 2% 05/31/24	1,500,000.00	1,602,656.25
T 2% 06/30/24	1,000,000.00	1,069,843.75
T 2% 07/31/22	3,900,000.00	4,044,574.20
T 2% 08/15/25	3,750,000.00	4,072,412.10
T 2% 08/31/21	4,200,000.00	4,285,230.47
T 2% 10/31/21	4,200,000.00	4,297,945.30
T 2% 10/31/22	4,500,000.00	4,687,382.83
T 2% 11/15/21	1,300,000.00	1,331,332.02
T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,969,789.07
T 2% 11/30/22	5,500,000.00	5,736,757.84
T 2% 12/31/21	3,380,000.00	3,469,055.09
T 3.125% 02/15/42	1,300,000.00	1,816,445.31
T 3.125% 02/15/43	2,100,000.00	2,936,882.82
T 3.125% 08/15/44	2,600,000.00	3,664,781.25
T 3.125% 11/15/28	5,260,000.00	6,377,339.08
T 3.125% 11/15/41	870,000.00	1,212,154.68
T 3.375% 05/15/44	2,000,000.00	2,921,093.76
T 3.5% 02/15/39	1,100,000.00	1,587,179.69

	T 3.625% 02/15/44	2,650,000.00	4,002,949.23	
	T 3.625% 08/15/43	1,600,000.00	2,409,500.00	
	T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,664,437.50	
	T 3.75% 11/15/43	2,500,000.00	3,835,937.50	
	T 3.875% 08/15/40	680,000.00	1,036,415.62	
	T 3% 02/15/48	4,400,000.00	6,250,750.00	
	T 3% 02/15/49	1,940,000.00	2,780,414.07	
	T 3% 05/15/42	1,100,000.00	1,509,492.19	
	T 3% 05/15/45	2,100,000.00	2,916,867.19	
	T 3% 05/15/47	3,400,000.00	4,800,375.00	
	T 3% 08/15/48	6,910,000.00	9,858,626.56	
	T 3% 09/30/25	3,660,000.00	4,168,825.79	
	T 3% 10/31/25	5,950,000.00	6,788,113.31	
	T 3% 11/15/44	2,050,000.00	2,839,089.85	
	T 4.25% 05/15/39	850,000.00	1,338,949.22	
	T 4.25% 11/15/40	900,000.00	1,438,664.06	
	T 4.375% 02/15/38	500,000.00	790,078.12	
	T 4.375% 05/15/40	750,000.00	1,210,312.50	
	T 4.375% 05/15/41	550,000.00	895,984.37	
	T 4.375% 11/15/39	650,000.00	1,043,148.43	
	T 4.5% 02/15/36	100,000.00	155,062.50	
	T 4.5% 08/15/39	750,000.00	1,217,753.91	
	T 4.625% 02/15/40	1,500,000.00	2,482,734.37	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,273,300.78	
	T 5.0% 05/15/37	650,000.00	1,080,929.68	
	T 5.25% 02/15/29	500,000.00	698,984.37	
	T 5.25% 11/15/28	900,000.00	1,249,031.25	
	T 5.375% 02/15/31	750,000.00	1,119,667.97	
	T 5.5% 08/15/28	250,000.00	349,296.87	
	T 6.0% 02/15/26	600,000.00	787,218.75	
	T 6.125% 11/15/27	1,050,000.00	1,481,402.34	
	T 6.25% 05/15/30	720,000.00	1,112,681.25	
	T 6.25% 08/15/23	1,350,000.00	1,601,121.10	
	T 8.0% 11/15/21	2,600,000.00	2,866,144.52	
	アメリカドル 小計	528,680,000.00	594,782,334.56 (62,939,866,643)	
カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	1,110,000.00	1,114,956.15	
	CAN 0.5% 09/01/25	880,000.00	886,947.60	
	CAN 0.75% 09/01/21	1,740,000.00	1,750,300.80	
	CAN 1.25% 03/01/25	1,300,000.00	1,355,354.00	
	CAN 1.25% 06/01/30	1,750,000.00	1,876,210.00	
	CAN 1.5% 02/01/22	1,220,000.00	1,243,417.90	
	CAN 1.5% 05/01/22	990,000.00	1,011,780.00	

	CAN 1.5% 06/01/23	2,010,000.00	2,082,018.30
	CAN 1.5% 06/01/26	840,000.00	896,212.80
	CAN 1.75% 03/01/23	700,000.00	727,310.50
	CAN 1% 06/01/27	1,060,000.00	1,104,652.50
	CAN 1% 09/01/22	2,360,000.00	2,397,429.60
	CAN 2.25% 03/01/24	670,000.00	717,087.60
	CAN 2.25% 06/01/25	1,530,000.00	1,674,340.20
	CAN 2.25% 06/01/29	390,000.00	451,348.95
	CAN 2.5% 06/01/24	1,780,000.00	1,932,305.70
	CAN 2.75% 06/01/22	1,000,000.00	1,046,800.00
	CAN 2.75% 12/01/48	870,000.00	1,257,772.05
	CAN 2.75% 12/01/64	290,000.00	478,778.40
	CAN 2% 06/01/28	530,000.00	595,216.50
	CAN 2% 12/01/51	640,000.00	817,792.00
	CAN 3.5% 12/01/45	1,400,000.00	2,209,221.00
	CAN 4.0% 06/01/41	820,000.00	1,309,609.70
	CAN 5.75% 06/01/29	960,000.00	1,400,236.80
	CAN 5.75% 06/01/33	700,000.00	1,141,836.50
	CAN 5% 06/01/37	670,000.00	1,118,846.40
	CAN 8.0% 06/01/27	480,000.00	726,424.80
	カナダドル 小計	28,690,000.00	33,324,206.75 (2,632,945,575)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	8,726,592.00
	MBONO 10% 12/05/24	24,100,000.00	28,912,408.50
	MBONO 5.75% 03/05/26	13,280,000.00	13,650,976.80
	MBONO 6.5% 06/09/22	17,400,000.00	18,006,477.00
	MBONO 6.75% 03/09/23	5,800,000.00	6,101,455.00
	MBONO 7.25% 12/09/21	19,090,000.00	19,771,799.35
	MBONO 7.5% 06/03/27	20,200,000.00	22,543,200.00
	MBONO 7.75% 05/29/31	10,950,000.00	12,492,252.75
	MBONO 7.75% 11/13/42	13,980,000.00	15,550,373.40
	MBONO 7.75% 11/23/34	4,320,000.00	4,940,460.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	20,040,000.00	23,864,333.40
	MBONO 8.5% 11/18/38	9,320,000.00	11,235,446.40
	MBONO 8% 09/05/24	5,910,000.00	6,604,868.25
	MBONO 8% 11/07/47	9,870,000.00	11,227,371.75
	MBONO 8% 12/07/23	15,420,000.00	16,984,667.40
	メキシコペソ 小計	196,080,000.00	220,612,682.00 (1,050,116,366)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	730,000.00	749,655.25
	BGB 0.2% 10/22/23	640,000.00	656,835.20
	BGB 0.4% 06/22/40	410,000.00	414,290.65

BGB 0.5% 10/22/24	490,000.00	511,868.70
BGB 0.8% 06/22/25	1,100,000.00	1,171,951.00
BGB 0.8% 06/22/27	750,000.00	811,095.00
BGB 0.8% 06/22/28	980,000.00	1,066,891.70
BGB 0.9% 06/22/29	790,000.00	871,326.55
BGB 0% 10/22/27	1,170,000.00	1,198,647.45
BGB 1.25% 04/22/33	330,000.00	383,804.85
BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	482,680.00
BGB 1.6% 06/22/47	810,000.00	1,030,700.70
BGB 1.7% 06/22/50	490,000.00	644,901.25
BGB 1.9% 06/22/38	510,000.00	658,007.10
BGB 1% 06/22/26	1,260,000.00	1,368,051.30
BGB 1% 06/22/31	1,140,000.00	1,277,985.60
BGB 2.15% 06/22/66	440,000.00	700,376.60
BGB 2.25% 06/22/23	970,000.00	1,051,324.80
BGB 2.25% 06/22/57	380,000.00	584,886.50
BGB 2.6% 06/22/24	1,200,000.00	1,349,868.00
BGB 3.75% 06/22/45	620,000.00	1,099,842.80
BGB 3% 06/22/34	500,000.00	705,422.50
BGB 4.25% 03/28/41	1,110,000.00	1,970,433.15
BGB 4.25% 09/28/21	1,130,000.00	1,194,376.10
BGB 4.25% 09/28/22	940,000.00	1,040,476.60
BGB 4.5% 03/28/26	750,000.00	963,483.75
BGB 4% 03/28/22	790,000.00	851,789.85
BGB 4% 03/28/32	450,000.00	664,740.00
BGB 5.5% 03/28/28	1,190,000.00	1,729,070.00
BGB 5% 03/28/35	1,270,000.00	2,181,174.20
BKO 0% 03/11/22	830,000.00	838,768.95
BKO 0% 12/10/21	1,180,000.00	1,190,625.90
BTPS 0.05% 01/15/23	330,000.00	330,438.90
BTPS 0.35% 02/01/25	1,740,000.00	1,738,338.30
BTPS 0.35% 11/01/21	800,000.00	805,288.00
BTPS 0.6% 06/15/23	720,000.00	731,347.20
BTPS 0.65% 10/15/23	560,000.00	569,738.40
BTPS 0.85% 01/15/27	1,100,000.00	1,113,579.50
BTPS 0.9% 08/01/22	1,500,000.00	1,529,565.00
BTPS 0.95% 03/01/23	1,720,000.00	1,760,815.60
BTPS 0.95% 08/01/30	980,000.00	975,977.10
BTPS 1.2% 04/01/22	1,000,000.00	1,021,655.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,170,000.00	1,216,033.65
BTPS 1.35% 04/01/30	350,000.00	362,439.00
BTPS 1.35% 04/15/22	1,000,000.00	1,024,710.00
BTPS 1.45% 03/01/36	600,000.00	604,455.00

BTPS 1.45% 05/15/25	1,070,000.00	1,121,194.15
BTPS 1.45% 09/15/22	1,550,000.00	1,599,181.50
BTPS 1.45% 11/15/24	600,000.00	628,458.00
BTPS 1.5% 06/01/25	1,500,000.00	1,576,807.50
BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,430,379.00
BTPS 1.65% 03/01/32	1,340,000.00	1,416,581.00
BTPS 1.65% 12/01/30	1,330,000.00	1,407,412.65
BTPS 1.75% 07/01/24	990,000.00	1,046,009.25
BTPS 1.85% 05/15/24	380,000.00	402,788.60
BTPS 2.05% 08/01/27	2,320,000.00	2,528,568.00
BTPS 2.1% 07/15/26	1,470,000.00	1,598,419.20
BTPS 2.15% 12/15/21	1,700,000.00	1,754,774.00
BTPS 2.2% 06/01/27	1,840,000.00	2,023,107.60
BTPS 2.25% 09/01/36	990,000.00	1,106,612.10
BTPS 2.45% 09/01/33	990,000.00	1,130,872.05
BTPS 2.45% 09/01/50	410,000.00	457,113.10
BTPS 2.45% 10/01/23	870,000.00	934,201.65
BTPS 2.5% 11/15/25	1,650,000.00	1,821,855.75
BTPS 2.5% 12/01/24	1,300,000.00	1,418,683.50
BTPS 2.7% 03/01/47	1,240,000.00	1,452,988.60
BTPS 2.8% 03/01/67	600,000.00	712,644.00
BTPS 2.8% 12/01/28	1,260,000.00	1,458,166.50
BTPS 2.95% 09/01/38	1,100,000.00	1,335,147.00
BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,133,123.25
BTPS 3.1% 03/01/40	930,000.00	1,150,642.50
BTPS 3.25% 09/01/46	680,000.00	870,920.20
BTPS 3.35% 03/01/35	850,000.00	1,069,763.25
BTPS 3.45% 03/01/48	1,120,000.00	1,489,555.20
BTPS 3.5% 03/01/30	1,950,000.00	2,401,912.50
BTPS 3.75% 08/01/21	1,900,000.00	1,975,116.50
BTPS 3.75% 09/01/24	1,740,000.00	1,979,902.50
BTPS 3.85% 09/01/49	1,510,000.00	2,150,187.15
BTPS 3% 08/01/29	1,760,000.00	2,079,413.60
BTPS 4.5% 03/01/24	1,810,000.00	2,086,043.10
BTPS 4.5% 03/01/26	1,980,000.00	2,409,947.10
BTPS 4.5% 05/01/23	1,050,000.00	1,179,139.50
BTPS 4.75% 08/01/23	1,610,000.00	1,835,247.05
BTPS 4.75% 09/01/21	2,630,000.00	2,772,164.65
BTPS 4.75% 09/01/28	1,650,000.00	2,154,611.25
BTPS 4.75% 09/01/44	1,230,000.00	1,925,577.30
BTPS 4% 02/01/37	1,800,000.00	2,445,525.00
BTPS 5.0% 08/01/39	1,440,000.00	2,229,724.80

BTPS 5.25% 11/01/29	2,300,000.00	3,180,198.50
BTPS 5.5% 09/01/22	1,700,000.00	1,897,973.50
BTPS 5.5% 11/01/22	2,200,000.00	2,472,547.00
BTPS 5.75% 02/01/33	1,570,000.00	2,385,332.40
BTPS 5% 03/01/22	1,450,000.00	1,569,451.00
BTPS 5% 03/01/25	1,740,000.00	2,104,051.50
BTPS 5% 08/01/34	1,800,000.00	2,632,401.00
BTPS 5% 09/01/40	1,600,000.00	2,493,312.00
BTPS 6.5% 11/01/27	2,070,000.00	2,901,643.20
BTPS 6% 05/01/31	1,940,000.00	2,902,307.90
BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	491,949.50
BTPS 9% 11/01/23	1,800,000.00	2,317,797.00
DBR 0.25% 02/15/27	2,870,000.00	3,039,645.70
DBR 0.25% 02/15/29	2,680,000.00	2,866,956.80
DBR 0.25% 08/15/28	1,300,000.00	1,387,971.00
DBR 0.5% 02/15/25	1,140,000.00	1,202,278.20
DBR 0.5% 02/15/26	2,300,000.00	2,451,179.00
DBR 0.5% 02/15/28	1,510,000.00	1,637,836.60
DBR 0.5% 08/15/27	900,000.00	972,283.50
DBR 0% 02/15/30	960,000.00	1,005,374.40
DBR 0% 05/15/35	220,000.00	229,142.10
DBR 0% 08/15/26	1,620,000.00	1,684,775.70
DBR 0% 08/15/29	2,430,000.00	2,545,643.70
DBR 0% 08/15/50	940,000.00	948,934.70
DBR 1.25% 08/15/48	1,400,000.00	1,915,984.00
DBR 1.5% 02/15/23	950,000.00	1,004,026.50
DBR 1.5% 05/15/23	1,180,000.00	1,253,331.10
DBR 1.5% 05/15/24	1,020,000.00	1,106,098.20
DBR 1.5% 09/04/22	920,000.00	962,784.60
DBR 1.75% 02/15/24	1,250,000.00	1,360,193.75
DBR 1.75% 07/04/22	1,650,000.00	1,728,012.00
DBR 1% 08/15/24	1,610,000.00	1,721,605.20
DBR 1% 08/15/25	760,000.00	825,189.00
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,013,219.00
DBR 2.5% 07/04/44	1,950,000.00	3,206,531.25
DBR 2.5% 08/15/46	2,090,000.00	3,517,762.60
DBR 2% 01/04/22	1,370,000.00	1,423,532.75
DBR 2% 08/15/23	1,890,000.00	2,047,673.25
DBR 3.25% 07/04/21	2,210,000.00	2,291,084.90
DBR 3.25% 07/04/42	1,410,000.00	2,498,139.30
DBR 4.0% 01/04/37	1,670,000.00	2,881,785.40
DBR 4.25% 07/04/39	1,470,000.00	2,754,728.55
DBR 4.75% 07/04/28	700,000.00	1,003,446.50

DBR 4.75% 07/04/34	1,840,000.00	3,193,163.60
DBR 4.75% 07/04/40	1,310,000.00	2,646,049.35
DBR 5.5% 01/04/31	1,780,000.00	2,919,324.60
DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	2,210,317.50
DBR 6.25% 01/04/24	1,370,000.00	1,701,348.20
DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	1,011,309.85
DBR 6.5% 07/04/27	1,920,000.00	2,890,185.60
FRTR 0.25% 11/25/26	2,050,000.00	2,138,724.00
FRTR 0.5% 05/25/25	3,350,000.00	3,517,952.25
FRTR 0.5% 05/25/26	3,130,000.00	3,308,707.35
FRTR 0.5% 05/25/29	2,830,000.00	3,022,623.95
FRTR 0.5% 05/25/40	720,000.00	749,574.00
FRTR 0.75% 05/25/28	2,960,000.00	3,212,562.00
FRTR 0.75% 05/25/52	630,000.00	665,995.05
FRTR 0.75% 11/25/28	2,510,000.00	2,731,281.60
FRTR 0% 02/25/22	2,970,000.00	2,999,195.10
FRTR 0% 02/25/23	430,000.00	436,548.90
FRTR 0% 02/25/26	790,000.00	809,829.00
FRTR 0% 03/25/23	1,880,000.00	1,910,615.80
FRTR 0% 03/25/24	2,050,000.00	2,093,224.25
FRTR 0% 03/25/25	2,850,000.00	2,919,468.75
FRTR 0% 05/25/22	1,350,000.00	1,365,464.25
FRTR 0% 11/25/29	3,300,000.00	3,367,881.00
FRTR 1.25% 05/25/34	1,830,000.00	2,139,087.00
FRTR 1.25% 05/25/36	2,010,000.00	2,367,136.80
FRTR 1.5% 05/25/31	2,950,000.00	3,480,056.00
FRTR 1.5% 05/25/50	1,690,000.00	2,155,958.35
FRTR 1.75% 05/25/23	2,600,000.00	2,774,291.00
FRTR 1.75% 05/25/66	850,000.00	1,230,086.00
FRTR 1.75% 06/25/39	2,010,000.00	2,581,402.80
FRTR 1.75% 11/25/24	1,980,000.00	2,180,059.20
FRTR 1% 05/25/27	2,480,000.00	2,718,551.20
FRTR 1% 11/25/25	2,240,000.00	2,421,451.20
FRTR 2.25% 05/25/24	2,040,000.00	2,263,196.40
FRTR 2.25% 10/25/22	1,700,000.00	1,810,330.00
FRTR 2.5% 05/25/30	2,450,000.00	3,108,413.00
FRTR 2.75% 10/25/27	2,400,000.00	2,952,948.00
FRTR 2% 05/25/48	2,140,000.00	3,002,002.70
FRTR 3.25% 05/25/45	1,770,000.00	2,965,024.35
FRTR 3.25% 10/25/21	4,120,000.00	4,318,954.80
FRTR 3.5% 04/25/26	3,120,000.00	3,842,607.60
FRTR 3% 04/25/22	3,750,000.00	3,988,612.50

FRTR 4.25% 10/25/23	2,870,000.00	3,327,664.55
FRTR 4.5% 04/25/41	2,340,000.00	4,334,955.30
FRTR 4.75% 04/25/35	1,810,000.00	3,069,207.95
FRTR 4% 04/25/55	970,000.00	2,025,311.50
FRTR 4% 04/25/60	1,080,000.00	2,384,110.80
FRTR 4% 10/25/38	1,600,000.00	2,699,760.00
FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	3,783,937.50
FRTR 5.75% 10/25/32	2,720,000.00	4,686,315.20
FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	1,954,136.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,100,000.00	1,377,755.50
IRISH 0.2% 05/15/27	530,000.00	547,585.40
IRISH 0.2% 10/18/30	300,000.00	308,296.50
IRISH 0.8% 03/15/22	750,000.00	767,047.50
IRISH 0.9% 05/15/28	440,000.00	479,481.20
IRISH 1.1% 05/15/29	550,000.00	611,954.75
IRISH 1.3% 05/15/33	530,000.00	614,691.35
IRISH 1.35% 03/18/31	340,000.00	391,125.80
IRISH 1.5% 05/15/50	270,000.00	340,040.70
IRISH 1.7% 05/15/37	560,000.00	694,971.20
IRISH 1% 05/15/26	730,000.00	788,940.20
IRISH 2.4% 05/15/30	770,000.00	960,863.75
IRISH 2% 02/18/45	580,000.00	795,986.20
IRISH 3.4% 03/18/24	420,000.00	480,097.80
IRISH 3.9% 03/20/23	580,000.00	649,167.90
IRISH 5.4% 03/13/25	700,000.00	890,946.00
NETHER 0.25% 07/15/25	920,000.00	958,833.20
NETHER 0.25% 07/15/29	800,000.00	846,780.00
NETHER 0.5% 01/15/40	620,000.00	688,680.50
NETHER 0.5% 07/15/26	1,260,000.00	1,339,764.30
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	978,754.50
NETHER 0.75% 07/15/28	790,000.00	867,052.65
NETHER 0% 01/15/22	900,000.00	908,127.00
NETHER 0% 01/15/24	550,000.00	561,869.00
NETHER 0% 01/15/27	180,000.00	185,834.70
NETHER 0% 07/15/30	850,000.00	877,820.50
NETHER 1.75% 07/15/23	1,170,000.00	1,253,731.05
NETHER 2.25% 07/15/22	750,000.00	793,023.75
NETHER 2.5% 01/15/33	980,000.00	1,321,309.50
NETHER 2.75% 01/15/47	1,110,000.00	1,925,589.15
NETHER 2% 07/15/24	1,560,000.00	1,724,502.00
NETHER 3.25% 07/15/21	1,330,000.00	1,379,781.90
NETHER 3.75% 01/15/23	300,000.00	332,911.50
NETHER 3.75% 01/15/42	1,080,000.00	1,974,407.40

NETHER 4% 01/15/37	1,020,000.00	1,723,468.50	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,010,000.00	1,468,343.05	
NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	842,625.00	
OBL 0% 04/05/24	2,260,000.00	2,318,206.30	
OBL 0% 04/08/22	1,460,000.00	1,476,468.80	
OBL 0% 04/11/25	1,700,000.00	1,754,017.50	
OBL 0% 04/14/23	2,110,000.00	2,150,385.40	
OBL 0% 10/07/22	1,530,000.00	1,553,156.55	
OBL 0% 10/08/21	1,120,000.00	1,128,853.60	
OBL 0% 10/18/24	2,150,000.00	2,211,780.25	
RAGB 0.5% 02/20/29	700,000.00	749,658.00	
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	947,560.75	
RAGB 0.75% 02/20/28	620,000.00	673,887.30	
RAGB 0.75% 03/20/51	260,000.00	296,095.80	
RAGB 0.75% 10/20/26	600,000.00	646,998.00	
RAGB 0% 02/20/30	210,000.00	215,204.85	
RAGB 0% 07/15/23	650,000.00	661,615.50	
RAGB 0% 07/15/24	590,000.00	603,564.10	
RAGB 0% 09/20/22	430,000.00	435,740.50	
RAGB 1.2% 10/20/25	540,000.00	589,871.70	
RAGB 1.5% 02/20/47	450,000.00	598,882.50	
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	420,493.95	
RAGB 1.65% 10/21/24	560,000.00	613,838.40	
RAGB 1.75% 10/20/23	750,000.00	807,806.25	
RAGB 2.1% 09/20/17	340,000.00	688,687.00	
RAGB 2.4% 05/23/34	530,000.00	711,188.45	
RAGB 3.15% 06/20/44	520,000.00	887,367.00	
RAGB 3.4% 11/22/22	1,210,000.00	1,323,945.70	
RAGB 3.5% 09/15/21	1,000,000.00	1,046,455.00	
RAGB 3.65% 04/20/22	500,000.00	537,195.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	230,000.00	536,481.90	
RAGB 4.15% 03/15/37	990,000.00	1,670,590.35	
RAGB 4.85% 03/15/26	760,000.00	995,132.60	
RAGB 6.25% 07/15/27	820,000.00	1,206,671.00	
RFGB 0.125% 04/15/36	200,000.00	204,142.00	
RFGB 0.25% 09/15/40	200,000.00	205,822.00	
RFGB 0.5% 04/15/26	530,000.00	560,708.20	
RFGB 0.5% 09/15/27	380,000.00	405,228.20	
RFGB 0.5% 09/15/28	540,000.00	578,010.60	
RFGB 0.5% 09/15/29	290,000.00	310,971.35	
RFGB 0.75% 04/15/31	270,000.00	298,142.10	
RFGB 0.875% 09/15/25	300,000.00	322,227.00	

RFGB 0% 04/15/22	250,000.00	252,650.00	
RFGB 0% 09/15/23	100,000.00	101,915.50	
RFGB 0% 09/15/24	300,000.00	307,339.50	
RFGB 1.125% 04/15/34	280,000.00	326,338.60	
RFGB 1.375% 04/15/47	230,000.00	302,767.40	
RFGB 1.5% 04/15/23	590,000.00	624,116.75	
RFGB 1.625% 09/15/22	380,000.00	398,367.30	
RFGB 2.625% 07/04/42	340,000.00	528,004.70	
RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	475,570.00	
RFGB 2% 04/15/24	410,000.00	450,321.45	
RFGB 4% 07/04/25	320,000.00	393,688.00	
SPGB 0.05% 10/31/21	3,470,000.00	3,491,149.65	
SPGB 0.25% 07/30/24	1,580,000.00	1,614,056.90	
SPGB 0.35% 07/30/23	1,570,000.00	1,602,342.00	
SPGB 0.4% 04/30/22	1,040,000.00	1,054,757.60	
SPGB 0.45% 10/31/22	800,000.00	815,328.00	
SPGB 0.5% 04/30/30	2,200,000.00	2,246,695.00	
SPGB 0.6% 10/31/29	1,200,000.00	1,240,062.00	
SPGB 0.75% 07/30/21	500,000.00	506,025.00	
SPGB 0.8% 07/30/27	480,000.00	505,459.20	
SPGB 0% 01/31/25	710,000.00	716,901.20	
SPGB 0% 04/30/23	1,580,000.00	1,594,923.10	
SPGB 1.2% 10/31/40	750,000.00	790,492.50	
SPGB 1.25% 10/31/30	1,200,000.00	1,309,212.00	
SPGB 1.3% 10/31/26	1,460,000.00	1,586,012.60	
SPGB 1.4% 04/30/28	1,020,000.00	1,122,326.40	
SPGB 1.4% 07/30/28	1,320,000.00	1,454,587.20	
SPGB 1.45% 04/30/29	750,000.00	831,450.00	
SPGB 1.45% 10/31/27	1,840,000.00	2,025,039.60	
SPGB 1.5% 04/30/27	1,970,000.00	2,172,545.55	
SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,358,331.25	
SPGB 1.85% 07/30/35	920,000.00	1,077,876.60	
SPGB 1.95% 04/30/26	1,340,000.00	1,500,250.60	
SPGB 1.95% 07/30/30	1,680,000.00	1,953,512.40	
SPGB 1% 10/31/50	540,000.00	520,408.80	
SPGB 2.15% 10/31/25	1,760,000.00	1,974,016.00	
SPGB 2.35% 07/30/33	1,290,000.00	1,586,448.45	
SPGB 2.7% 10/31/48	1,070,000.00	1,483,522.90	
SPGB 2.75% 10/31/24	1,560,000.00	1,760,974.80	
SPGB 2.9% 10/31/46	1,100,000.00	1,562,209.00	
SPGB 3.45% 07/30/66	900,000.00	1,539,837.00	
SPGB 3.8% 04/30/24	1,500,000.00	1,732,837.50	
SPGB 4.2% 01/31/37	1,450,000.00	2,246,238.50	

	SPGB 4.4% 10/31/23	1,320,000.00	1,525,583.40
	SPGB 4.65% 07/30/25	1,410,000.00	1,753,151.70
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,300,000.00	2,248,304.50
	SPGB 4.8% 01/31/24	1,150,000.00	1,358,127.00
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,310,000.00	2,289,880.00
	SPGB 5.15% 10/31/28	750,000.00	1,057,230.00
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,030,000.00	1,949,645.80
	SPGB 5.4% 01/31/23	920,000.00	1,053,841.60
	SPGB 5.75% 07/30/32	1,450,000.00	2,352,799.00
	SPGB 5.85% 01/31/22	1,780,000.00	1,949,206.80
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,360,000.00	1,851,130.00
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	3,505,506.75
	ユーロ 小計	387,200,000.00	467,149,768.55 (57,786,426,369)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	420,000.00	424,124.40
	UKT 0.125% 01/31/23	510,000.00	512,822.85
	UKT 0.375% 10/22/30	710,000.00	723,965.70
	UKT 0.5% 07/22/22	1,800,000.00	1,821,393.00
	UKT 0.5% 10/22/61	420,000.00	408,445.80
	UKT 0.625% 06/07/25	1,210,000.00	1,252,930.80
	UKT 0.625% 10/22/50	340,000.00	335,710.90
	UKT 0.75% 07/22/23	1,500,000.00	1,539,487.50
	UKT 0.875% 10/22/29	1,130,000.00	1,212,038.00
	UKT 1.25% 07/22/27	1,190,000.00	1,296,415.75
	UKT 1.25% 10/22/41	350,000.00	393,471.75
	UKT 1.5% 07/22/26	1,060,000.00	1,160,795.40
	UKT 1.5% 07/22/47	1,310,000.00	1,582,617.55
	UKT 1.625% 10/22/28	1,400,000.00	1,584,807.00
	UKT 1.625% 10/22/54	600,000.00	781,557.00
	UKT 1.625% 10/22/71	610,000.00	925,549.95
	UKT 1.75% 01/22/49	800,000.00	1,027,884.00
	UKT 1.75% 07/22/57	930,000.00	1,285,669.20
	UKT 1.75% 09/07/22	1,640,000.00	1,704,247.00
	UKT 1.75% 09/07/37	1,540,000.00	1,845,828.60
	UKT 1% 04/22/24	1,450,000.00	1,511,690.25
	UKT 2.25% 09/07/23	1,160,000.00	1,245,370.20
	UKT 2.5% 07/22/65	1,100,000.00	1,938,238.50
	UKT 2.75% 09/07/24	420,000.00	469,776.30
	UKT 2% 09/07/25	420,000.00	465,847.20
	UKT 3.25% 01/22/44	1,430,000.00	2,237,656.85
UKT 3.5% 01/22/45	1,470,000.00	2,415,077.70	
UKT 3.5% 07/22/68	1,170,000.00	2,620,595.25	

	UKT 3.75% 07/22/52	1,110,000.00	2,110,581.75
	UKT 3.75% 09/07/21	1,650,000.00	1,719,745.50
	UKT 4.25% 03/07/36	1,490,000.00	2,342,227.85
	UKT 4.25% 06/07/32	1,290,000.00	1,889,798.40
	UKT 4.25% 09/07/39	1,060,000.00	1,771,026.80
	UKT 4.25% 12/07/27	750,000.00	985,946.25
	UKT 4.25% 12/07/40	1,130,000.00	1,922,389.90
	UKT 4.25% 12/07/46	1,260,000.00	2,354,373.00
	UKT 4.25% 12/07/49	980,000.00	1,919,962.10
	UKT 4.25% 12/07/55	1,040,000.00	2,239,078.40
	UKT 4.5% 09/07/34	910,000.00	1,425,792.55
	UKT 4.5% 12/07/42	1,370,000.00	2,478,576.60
	UKT 4.75% 12/07/30	1,550,000.00	2,284,180.75
	UKT 4.75% 12/07/38	880,000.00	1,530,843.60
	UKT 4% 01/22/60	1,000,000.00	2,205,130.00
	UKT 4% 03/07/22	910,000.00	970,009.95
	UKT 5% 03/07/25	1,600,000.00	1,977,920.00
	UKT 6.0% 12/07/28	450,000.00	672,322.50
	イギリスポンド 小計	48,520,000.00	67,523,920.30 (9,160,970,267)
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	2,800,000.00	2,999,304.00
	SGB 0.75% 11/12/29	3,770,000.00	4,056,897.00
	SGB 1.5% 11/13/23	5,670,000.00	6,012,014.40
	SGB 1% 11/12/26	4,940,000.00	5,337,818.20
	SGB 2.5% 05/12/25	4,150,000.00	4,709,129.50
	SGB 3.5% 03/30/39	2,950,000.00	4,618,579.00
	SGB 3.5% 06/01/22	6,990,000.00	7,484,752.20
	スウェーデンクローナ 小計	31,270,000.00	35,218,494.30 (423,326,301)
ノルウェー クローネ	NGB 1.375% 08/19/30	2,690,000.00	2,895,798.45
	NGB 1.5% 02/19/26	3,460,000.00	3,686,578.10
	NGB 1.75% 02/17/27	2,900,000.00	3,155,939.50
	NGB 1.75% 03/13/25	2,610,000.00	2,790,011.70
	NGB 1.75% 09/06/29	2,240,000.00	2,480,172.80
	NGB 2% 04/26/28	2,160,000.00	2,412,244.80
	NGB 2% 05/24/23	5,000,000.00	5,262,325.00
	NGB 3% 03/14/24	3,640,000.00	4,010,679.40
	ノルウェークローネ 小計	24,700,000.00	26,693,749.75 (310,448,309)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/22	520,000.00	530,098.40
	DGB 0.5% 11/15/27	5,450,000.00	5,822,725.50
	DGB 0.5% 11/15/29	5,780,000.00	6,230,897.80
	DGB 1.5% 11/15/23	3,890,000.00	4,161,444.20

	DGB 1.75% 11/15/25	4,230,000.00	4,746,821.40	
	DGB 3% 11/15/21	6,370,000.00	6,668,466.35	
	DGB 4.5% 11/15/39	8,740,000.00	16,519,867.30	
デンマーククローネ 小計		34,980,000.00	44,680,320.95 (742,586,934)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0% 07/25/22	1,000,000.00	998,390.00	
	POLGB 1.75% 07/25/21	2,050,000.00	2,086,274.75	
	POLGB 2.25% 04/25/22	3,900,000.00	4,051,768.50	
	POLGB 2.25% 10/25/24	1,860,000.00	1,995,119.70	
	POLGB 2.5% 01/25/23	1,550,000.00	1,642,581.50	
	POLGB 2.5% 04/25/24	2,180,000.00	2,349,800.20	
	POLGB 2.5% 07/25/26	2,780,000.00	3,027,406.10	
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,910,000.00	2,087,458.10	
	POLGB 2.75% 04/25/28	1,920,000.00	2,137,132.80	
	POLGB 2.75% 10/25/29	2,200,000.00	2,483,756.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	1,710,000.00	1,919,056.05	
	POLGB 4% 10/25/23	2,080,000.00	2,330,068.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	900,000.00	1,245,874.50	
	POLGB 5.75% 09/23/22	1,500,000.00	1,683,412.50	
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,130,000.00	1,211,388.25	
ポーランドズロチ 小計		28,670,000.00	31,249,486.95 (878,110,583)	
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	1,730,000.00	1,720,467.70	
	ACGB 1.5% 06/21/31	1,190,000.00	1,258,752.25	
	ACGB 1% 12/21/30	2,220,000.00	2,237,571.30	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,450,000.00	1,618,504.50	
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,480,000.00	2,859,960.80	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,810,000.00	1,972,737.10	
	ACGB 2.75% 05/21/41	510,000.00	613,512.15	
	ACGB 2.75% 06/21/35	630,000.00	762,706.35	
	ACGB 2.75% 11/21/27	2,400,000.00	2,756,436.00	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,750,000.00	2,029,422.50	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,440,000.00	1,686,571.20	
	ACGB 2% 12/21/21	690,000.00	706,811.85	
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,750,000.00	1,983,152.50	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,330,000.00	2,811,214.90	
	ACGB 3.25% 06/21/39	650,000.00	836,670.25	
	ACGB 3.75% 04/21/37	810,000.00	1,101,940.20	
	ACGB 3% 03/21/47	880,000.00	1,118,590.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,600,000.00	3,150,719.00	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,220,000.00	1,727,837.20	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,750,000.00	2,229,500.00	
ACGB 5.5% 04/21/23	1,810,000.00	2,067,644.45		

	ACGB 5.75% 07/15/22	3,920,000.00	4,340,949.20	
オーストラリアドル 小計		36,020,000.00	41,591,671.40 (3,134,764,273)	
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	630,000.00	637,377.30	
	SIGB 1.75% 02/01/23	320,000.00	331,878.40	
	SIGB 1.75% 04/01/22	160,000.00	164,160.00	
	SIGB 2.125% 06/01/26	520,000.00	566,802.60	
	SIGB 2.25% 08/01/36	340,000.00	399,670.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	500,000.00	544,975.00	
	SIGB 2.375% 07/01/39	100,000.00	121,343.00	
	SIGB 2.625% 05/01/28	190,000.00	217,015.15	
	SIGB 2.75% 03/01/46	630,000.00	852,484.50	
	SIGB 2.75% 04/01/42	300,000.00	393,573.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	540,000.00	578,674.80	
	SIGB 2.875% 07/01/29	640,000.00	754,051.20	
	SIGB 2.875% 09/01/30	370,000.00	442,877.05	
	SIGB 2% 02/01/24	90,000.00	95,202.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	320,000.00	339,358.40	
	SIGB 3.375% 09/01/33	270,000.00	350,677.35	
	SIGB 3.5% 03/01/27	530,000.00	627,745.25	
	SIGB 3% 09/01/24	510,000.00	563,958.00	
シンガポールドル 小計		6,960,000.00	7,981,823.00 (611,806,732)	
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,220,000.00	1,257,216.10	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,300,000.00	1,351,044.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	100,000.00	107,583.50	
	MGS 3.62% 11/30/21	950,000.00	972,923.50	
	MGS 3.733% 06/15/28	300,000.00	327,147.00	
	MGS 3.795% 09/30/22	800,000.00	832,064.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	550,000.00	579,029.00	
	MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	936,952.80	
	MGS 3.882% 03/14/25	950,000.00	1,023,644.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	260,000.00	287,086.80	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,200,000.00	1,314,150.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,160,000.00	1,282,014.60	
	MGS 3.9% 11/30/26	360,000.00	395,337.60	
	MGS 3.955% 09/15/25	150,000.00	163,543.50	
	MGS 4.059% 09/30/24	750,000.00	809,568.75	
	MGS 4.127% 04/15/32	690,000.00	770,930.10	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,040,000.00	2,086,481.40	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,090,000.00	1,178,698.75	
MGS 4.232% 06/30/31	850,000.00	969,803.25		

	MGS 4.254% 05/31/35	890,000.00	996,088.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,650,000.00	1,841,746.50	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,260,000.00	1,456,578.90	
	MGS 4.642% 11/07/33	660,000.00	776,499.90	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,090,000.00	1,278,248.45	
	MGS 4.762% 04/07/37	1,160,000.00	1,379,408.20	
	MGS 4.893% 06/08/38	570,000.00	688,198.05	
	MGS 4.921% 07/06/48	900,000.00	1,090,759.50	
	MGS 4.935% 09/30/43	530,000.00	636,111.30	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,480,000.00	1,769,132.80	
	マレーシアリングット 小計	25,770,000.00	28,557,990.75 (710,237,229)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.75% 07/31/22	3,180,000.00	3,223,350.39	
	ILGOV 1% 03/31/30	960,000.00	992,272.41	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	1,050,000.00	1,193,780.28	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	2,000,000.00	2,259,653.40	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	1,100,000.00	1,619,009.36	
	ILGOV 4.25% 03/31/23	200,000.00	222,042.06	
	ILGOV 5.5% 01/31/22	940,000.00	1,017,858.41	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,270,000.00	2,265,525.18	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	3,300,000.00	4,496,636.43	
	イスラエルシェケル 小計	14,000,000.00	17,290,127.92 (536,166,866)	
	合計		140,917,772,447 (140,917,772,447)	

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 170銘柄	100.0%	44.7%
カナダドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 313銘柄	100.0%	41.0%
イギリスポンド	国債証券 46銘柄	100.0%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%

オーストラリアドル	国債証券	22銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドル	国債証券	18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券	29銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券	9銘柄	100.0%	0.4%

(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】

【インデックスコレクション（バランス株式30）】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「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11期中間計算期間(2020年7月28日から2021年1月27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。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 (2020年7月27日現在)	第11期中間計算期間 (2021年1月27日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	635,727,697	716,878,474
親投資信託受益証券	111,665,613,936	121,361,557,404
未収入金	110,390,988	75,982,180
流動資産合計	112,411,732,621	122,154,418,058
資産合計	112,411,732,621	122,154,418,058
負債の部		
流動負債		
未払解約金	41,763,279	43,795,889
未払受託者報酬	12,056,062	12,992,330
未払委託者報酬	72,336,325	77,953,933
未払利息	640	314
その他未払費用	1,047,864	1,073,282
流動負債合計	127,204,170	135,815,748
負債合計	127,204,170	135,815,748
純資産の部		
元本等		
元本	71,224,303,613	73,456,970,168
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	41,060,224,838	48,561,632,142
(分配準備積立金)	5,062,621,653	4,875,828,450
元本等合計	112,284,528,451	122,018,602,310
純資産合計	112,284,528,451	122,018,602,310
負債純資産合計	112,411,732,621	122,154,418,058

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期中間計算期間 自 2019年 7月26日 至 2020年 1月25日	第11期中間計算期間 自 2020年 7月28日 至 2021年 1月27日
営業収益		
受取利息	-	2,389
有価証券売買等損益	2,195,911,362	6,245,612,088
営業収益合計	2,195,911,362	6,245,614,477
営業費用		
支払利息	62,358	147,883
受託者報酬	7,269,360	12,992,330
委託者報酬	48,539,806	77,953,933
その他費用	923,319	1,073,282
営業費用合計	56,794,843	92,167,428
営業利益又は営業損失（ ）	2,139,116,519	6,153,447,049
経常利益又は経常損失（ ）	2,139,116,519	6,153,447,049
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,139,116,519	6,153,447,049
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（ ）	81,483,718	91,845,251
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	20,947,672,932	41,060,224,838
剰余金増加額又は欠損金減少額	20,818,500,188	3,014,109,972
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	20,818,500,188	3,014,109,972
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,933,252,997	1,574,304,466
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,933,252,997	1,574,304,466
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	41,890,552,924	48,561,632,142

(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7月26日から翌年7月25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11期中間計算期間は2020年 7月28日から2021年 1月27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10期 (2020年 7月27日現在)	第11期中間計算期間 (2021年 1月27日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	71,224,303,613口	73,456,970,168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) 1.5765円 (15,765円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6611円 (16,611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11期中間計算期間 (2021年 1月27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

	第11期中間計算期間 (2021年 1月27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	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（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10期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27日	第11期中間計算期間 自 2020年 7月28日 至 2021年 1月27日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	37,905,869,352円	71,224,303,613円
期中追加設定元本額	40,477,320,641円	4,960,311,110円
期中一部解約元本額	7,158,886,380円	2,727,644,555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。

【インデックスコレクション（バランス株式50）】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「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11期中間計算期間(2020年7月28日から2021年1月27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。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 (2020年7月27日現在)	第11期中間計算期間 (2021年1月27日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	79,638,793	99,071,123
親投資信託受益証券	13,848,096,851	16,119,745,711
未収入金	7,596,906	-
流動資産合計	13,935,332,550	16,218,816,834
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,353,173	10,170,053
未払受託者報酬	1,436,534	1,663,455
未払委託者報酬	8,619,127	9,980,643
未払利息	80	43
その他未払費用	359,079	415,802
流動負債合計	11,767,993	22,229,996
純資産の部		
元本等		
元本	7,380,420,310	7,865,008,893
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	6,543,144,247	8,331,577,945
(分配準備積立金)	1,964,640,384	1,892,453,273
元本等合計	13,923,564,557	16,196,586,838
純資産合計	13,923,564,557	16,196,586,838
負債純資産合計	13,935,332,550	16,218,816,834

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期中間計算期間 自 2019年 7月26日 至 2020年 1月25日	第11期中間計算期間 自 2020年 7月28日 至 2021年 1月27日
営業収益		
受取利息	-	289
有価証券売買等損益	690,004,671	1,339,365,246
営業収益合計	690,004,671	1,339,365,535
営業費用		
支払利息	11,968	17,512
受託者報酬	1,362,705	1,663,455
委託者報酬	9,474,663	9,980,643
その他費用	340,624	415,802
営業費用合計	11,189,960	12,077,412
営業利益又は営業損失（ ）	678,814,711	1,327,288,123
経常利益又は経常損失（ ）	678,814,711	1,327,288,123
中間純利益又は中間純損失（ ）	678,814,711	1,327,288,123
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（ ）	7,933,111	22,370,943
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,330,668,951	6,543,144,247
剰余金増加額又は欠損金減少額	649,773,671	738,415,297
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	649,773,671	738,415,297
剰余金減少額又は欠損金増加額	173,575,300	254,898,779
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	173,575,300	254,898,779
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	6,477,748,922	8,331,577,945

(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7月26日から翌年7月25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11期中間計算期間は2020年 7月28日から2021年 1月27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10期 (2020年 7月27日現在)	第11期中間計算期間 (2021年 1月27日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	7,380,420,310口	7,865,008,893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) 1.8866円 (18,866円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.0593円 (20,593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11期中間計算期間 (2021年 1月27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

	第11期中間計算期間 (2021年 1月27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	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(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10期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27日	第11期中間計算期間 自 2020年 7月28日 至 2021年 1月27日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	6,339,102,081円	7,380,420,310円
期中追加設定元本額	1,649,045,263円	771,337,228円
期中一部解約元本額	607,727,034円	286,748,645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。

【インデックスコレクション（バランス株式70）】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「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11期中間計算期間(2020年7月28日から2021年1月27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。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 (2020年7月27日現在)	第11期中間計算期間 (2021年1月27日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	39,629,773	51,403,405
親投資信託受益証券	7,927,234,485	9,615,136,159
未収入金	9,106,729	591,350
流動資産合計	7,975,970,987	9,667,130,914
資産合計	7,975,970,987	9,667,130,914
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,263,269	6,041,514
未払受託者報酬	809,883	964,582
未払委託者報酬	4,859,231	5,787,442
未払利息	39	22
その他未払費用	202,410	241,081
流動負債合計	10,134,832	13,034,641
負債合計	10,134,832	13,034,641
純資産の部		
元本等		
元本	3,642,734,613	3,908,477,518
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	4,323,101,542	5,745,618,755
(分配準備積立金)	955,934,005	883,992,203
元本等合計	7,965,836,155	9,654,096,273
純資産合計	7,965,836,155	9,654,096,273
負債純資産合計	7,975,970,987	9,667,130,914

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期中間計算期間 自 2019年 7月26日 至 2020年 1月25日	第11期中間計算期間 自 2020年 7月28日 至 2021年 1月27日
営業収益		
受取利息	-	197
有価証券売買等損益	539,944,604	1,078,860,521
営業収益合計	539,944,604	1,078,860,718
営業費用		
支払利息	6,983	9,862
受託者報酬	778,095	964,582
委託者報酬	5,586,195	5,787,442
その他費用	194,465	241,081
営業費用合計	6,565,738	7,002,967
営業利益又は営業損失（ ）	533,378,866	1,071,857,751
経常利益又は経常損失（ ）	533,378,866	1,071,857,751
中間純利益又は中間純損失（ ）	533,378,866	1,071,857,751
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（ ）	13,182,118	36,673,922
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,507,303,245	4,323,101,542
剰余金増加額又は欠損金減少額	598,770,872	738,432,154
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	598,770,872	738,432,154
剰余金減少額又は欠損金増加額	248,375,155	351,098,770
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	248,375,155	351,098,770
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	4,377,895,710	5,745,618,755

(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7月26日から翌年7月25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11期中間計算期間は2020年 7月28日から2021年 1月27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10期 (2020年 7月27日現在)	第11期中間計算期間 (2021年 1月27日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,642,734,613口	3,908,477,518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) 2.1868円 (21,868円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.4700円 (24,700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11期中間計算期間 (2021年 1月27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

	第11期中間計算期間 (2021年 1月27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	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（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10期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27日	第11期中間計算期間 自 2020年 7月28日 至 2021年 1月27日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,120,001,692円	3,642,734,613円
期中追加設定元本額	1,230,292,042円	560,320,198円
期中一部解約元本額	707,559,121円	294,577,293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

	2021年 1月27日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,317,269,356
株式	276,237,369,040
派生商品評価勘定	42,852,550
未収入金	800,756,577
未収配当金	349,645,863
差入委託証拠金	147,513,250
流動資産合計	279,895,406,636
資産合計	279,895,406,636
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	91,650
前受金	42,763,650
未払解約金	173,342,072
未払利息	1,017
流動負債合計	216,198,389
負債合計	216,198,389
純資産の部	
元本等	
元本	135,773,840,114
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	143,905,368,133
元本等合計	279,679,208,247
純資産合計	279,679,208,247
負債純資産合計	279,895,406,636

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1月27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。

	2021年 1月27日現在
	(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）

	2021年 1月27日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	135,773,840,114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 2.0599円 (1万口当たり純資産額) (20,599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

	2021年 1月27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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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	2021年 1月27日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	141,188,957,091円
期中追加設定元本額	3,945,264,051円
期中一部解約元本額	9,360,381,028円
期末元本額	135,773,840,114円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	625,166,411円
D C日本株式インデックスファンド	316,660,639円
D C日本株式インデックスファンドL	53,397,797,940円
D C日本株式インデックスファンドA	898,310,153円
D Cバランスファンド30	2,228,812,041円
D Cバランスファンド50	3,437,943,624円
D Cバランスファンド70	1,923,815,276円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	566,489,572円
日本株式インデックスe	1,537,746,732円
インデックスコレクション（国内株式）	18,821,618,539円
インデックスコレクション（バランス株式30）	12,159,495,466円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,435,297,987円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,910,124,005円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,619,291,967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）	2,804,710,291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）	1,232,215,124円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	64,778,174円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	737,022,911円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	86,349,290円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	177,224,584円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	2,588,040円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	443,488,456円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	977,270,929円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	526,762,823円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	8,953,080,721円

区分	2021年 1月27日現在
バランスVA75（適格機関投資家専用）	811,914,642円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	108,944,228円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,432,317,136円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	35,777,089円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	174,012,355円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,273,270,560円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	67,471,480円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	72,164,982円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	28,803,354円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	738,287,744円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	337,369,764円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	5,495,174,604円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	103,341,225円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	44,139,272円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	10,041,429円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	152,599,543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）	4,149,012円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 1月27日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,318,406,350	-	3,361,170,000	42,763,650
合計		3,318,406,350	-	3,361,170,000	42,763,650

(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。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2021年 1月27日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	999,050,311

	2021年 1月27日現在
項目	金額（円）
国債証券	314,558,356,650
地方債証券	20,826,071,496
特殊債証券	24,891,865,519
社債証券	16,737,512,000
未収利息	699,781,106
前払費用	9,274,273
差入委託証拠金	60,000
流動資産合計	378,721,971,355
資産合計	378,721,971,355
負債の部	
流動負債	
未払金	1,897,000,980
未払解約金	118,979,945
未払利息	438
流動負債合計	2,015,981,363
負債合計	2,015,981,363
純資産の部	
元本等	
元本	273,785,725,672
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	102,920,264,320
元本等合計	376,705,989,992
純資産合計	376,705,989,992
負債純資産合計	378,721,971,355

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 1月27日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債証券、社債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 1月27日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	273,785,725,672口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 101,328,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3759円 (1万口当たり純資産額) (13,759円)

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

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 1月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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	2021年 1月27日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日

区分	2021年 1月27日現在
期首元本額	265,539,402,653円
期中追加設定元本額	13,921,652,459円
期中一部解約元本額	5,675,329,440円
期末元本額	273,785,725,672円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	873,980,509円
D C日本債券インデックスファンド	2,528,654,891円
D C日本債券インデックスファンドL	42,675,669,081円
D Cバランスファンド30	9,599,882,253円
D Cバランスファンド50	6,527,927,796円
D Cバランスファンド70	1,699,884,931円
日本債券インデックスe	1,282,920,658円
インデックスコレクション（国内債券）	37,338,401,844円
インデックスコレクション（バランス株式30）	52,206,374,780円
インデックスコレクション（バランス株式50）	4,541,313,920円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,697,219,964円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	48,136,617,655円
日本債券パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	3,890,792,245円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	208,516,886円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	1,028,823,870円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	143,623,172円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	96,439,258円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	957,474,618円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	3,624,924,722円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	1,066,110,786円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	11,910,951,024円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	135,548,082円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	390,804,312円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	3,082,080,488円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	205,178,259円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	375,464,055円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,135,014,291円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	387,126,583円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	931,695,108円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	82,645,608円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	3,495,624,303円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	1,546,270,988円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	26,641,250,283円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	483,849,278円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	149,444,646円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	44,845,856円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	656,730,490円

区分	2021年 1月27日現在
私募日本債券インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	5,648,179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。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2021年 1月27日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,918,410,273
コール・ローン	1,132,034,362
株式	259,510,529,270
投資信託受益証券	154,689,816
投資証券	5,605,829,161
派生商品評価勘定	197,919,185
未収配当金	184,957,238
差入委託証拠金	1,996,366,704
流動資産合計	270,700,736,009
資産合計	270,700,736,009
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,236,998
前受金	196,951,852
未払解約金	192,846,183
未払利息	497
流動負債合計	391,035,530
負債合計	391,035,530
純資産の部	
元本等	
元本	78,387,274,895
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	191,922,425,584
元本等合計	270,309,700,479
純資産合計	270,309,700,479
負債純資産合計	270,700,736,009

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1月27日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

	2021年 1月27日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引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> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引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</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引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</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

	2021年 1月27日現在
	(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)

	2021年 1月27日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	78,387,274,895口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産 の額	1口当たり純資産額 3.4484円 (1万口当たり純資産額) (34,484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

	2021年 1月27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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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	2021年 1月27日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	76,769,062,125円
期中追加設定元本額	9,628,938,138円
期中一部解約元本額	8,010,725,368円
期末元本額	78,387,274,895円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,595,171,437円
DC外国株式インデックスファンド	4,568,845,215円
DC外国株式インデックスファンドL	23,101,466,131円
DCバランスファンド30	678,345,886円
DCバランスファンド50	1,390,718,605円
DCバランスファンド70	866,944,575円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	338,584,525円
外国株式インデックスe	4,953,308,733円
インデックスコレクション（外国株式）	10,859,387,963円
インデックスコレクション（バランス株式30）	3,646,215,001円
インデックスコレクション（バランス株式50）	987,522,194円
インデックスコレクション（バランス株式70）	856,744,459円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	11,690,021,719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）	1,534,121,572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）	710,884,408円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	38,947,155円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	444,754,140円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	51,315,705円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	105,254,303円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	763,860円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	1,315,966,998円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	398,464,881円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	278,382,341円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	5,350,979,766円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	554,434,228円

区分	2021年 1月27日現在
V A バランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	194,239,610円
V A ポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	851,299,348円
V A ポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	21,258,028円
バランス V A 4 0（適格機関投資家専用）	104,445,184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）	120,306,742円
V A バランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	386,020,117円
V A ファンド 2 5（適格機関投資家専用）	17,118,983円
バランス V A 2 5 L（適格機関投資家専用）	91,396,539円
V A バランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	272,081,548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）	11,562,996円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 1月27日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,481,178,352	-	5,678,130,204	196,951,852
合計		5,481,178,352	-	5,678,130,204	196,951,852

(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

（2021年 1月27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	1,697,057,357	-	1,696,736,160	321,197
	アメリカドル	1,329,523,382	-	1,329,594,160	70,778
	カナダドル	24,504,060	-	24,501,000	3,060
	ユーロ	183,475,375	-	182,881,000	594,375
	イギリスポンド	85,248,120	-	85,455,000	206,880
	スイスフラン	29,236,450	-	29,235,000	1,450

	スウェーデンク ローナ	12,489,800	-	12,490,000	200
	デンマーククロー ネ	8,475,200	-	8,475,000	200
	オーストラリアド ル	24,104,970	-	24,105,000	30
	売建	53,959,932	-	53,908,400	51,532
	アメリカドル	53,959,932	-	53,908,400	51,532
	合計	1,751,017,289	-	1,750,644,560	269,665

(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

	2021年 1月27日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	137,473,177
コール・ローン	1,121,518,540
国債証券	140,930,823,662
派生商品評価勘定	949,913
未収入金	440,503
未収利息	979,829,838
前払金	4,276,226
前払費用	28,528,126
差入委託証拠金	339,974,605
流動資産合計	143,543,814,590
資産合計	143,543,814,590
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,122,335
未払金	763,326
未払解約金	101,005,733
未払利息	492
流動負債合計	107,891,886
負債合計	107,891,886
純資産の部	
元本等	
元本	55,733,586,929
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	87,702,335,775
元本等合計	143,435,922,704
純資産合計	143,435,922,704
負債純資産合計	143,543,814,590

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 1月27日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 1月27日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	55,733,586,929口

	2021年 1月27日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5736円 (25,736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

	2021年 1月27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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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	2021年 1月27日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	2020年 7月28日

区分	2021年 1月27日現在
期首元本額	56,037,038,869円
期中追加設定元本額	3,113,021,145円
期中一部解約元本額	3,416,473,085円
期末元本額	55,733,586,929円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,131,493,713円
DC外国債券インデックスファンド	2,034,444,381円
DC外国債券インデックスファンドL	13,621,566,761円
DCバランスファンド30	859,804,367円
DCバランスファンド50	869,936,004円
DCバランスファンド70	164,826,390円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	428,684,425円
外国債券インデックスe	1,126,227,581円
インデックスコレクション（外国債券）	7,478,124,464円
インデックスコレクション（バランス株式30）	4,627,701,984円
インデックスコレクション（バランス株式50）	563,222,736円
インデックスコレクション（バランス株式70）	151,876,431円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	3,833,470,574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）	1,750,116,121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）	535,079,669円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	111,463,679円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	550,486,720円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	317,483,214円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	216,940,346円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	460,444円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	846,220,413円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,688,948,901円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	624,258,810円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	6,504,596,395円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	336,390,066円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	292,121,413円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,645,997,472円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	109,550,629円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	203,123,055円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	103,387,363円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	55,293,221円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	88,280,253円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	245,316,517円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	75,340,175円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	1,519,928,476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）	21,423,766円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2021年 1月27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	1,521,621,255	-	1,517,345,029	4,276,226
	合計	1,521,621,255	-	1,517,345,029	4,276,226

（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。

- 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。
- 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。
- 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

（2021年 1月27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	1,311,361,196	-	1,310,465,000	896,196
	アメリカドル	553,530,828	-	553,544,400	13,572
	カナダドル	83,191,851	-	83,293,200	101,349
	ユーロ	564,019,867	-	562,539,800	1,480,067
	イギリスポンド	110,618,650	-	111,087,600	468,950
	合計	1,311,361,196	-	1,310,465,000	896,196

（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】

【インデックスコレクション（バランス株式30）】

【純資産額計算書】

(2021年 2月26日現在)

資産総額	122,225,986,427円
負債総額	71,659,834円
純資産総額（ - ）	122,154,326,593円
発行済口数	73,761,684,558口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6561円
（1万口当たり純資産額）	（16,561円）

【インデックスコレクション（バランス株式50）】

【純資産額計算書】

(2021年 2月26日現在)

資産総額	16,321,457,333円
負債総額	17,846,972円
純資産総額（ - ）	16,303,610,361円
発行済口数	7,896,025,613口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0648円
（1万口当たり純資産額）	（20,648円）

【インデックスコレクション（バランス株式70）】

【純資産額計算書】

(2021年 2月26日現在)

資産総額	9,802,031,735円
負債総額	31,443,845円
純資産総額（ - ）	9,770,587,890円
発行済口数	3,930,949,482口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4856円
（1万口当たり純資産額）	（24,856円）

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

(2021年 2月26日現在)

資産総額	278,375,731,824円
負債総額	1,021,161,401円
純資産総額（ - ）	277,354,570,423円
発行済口数	134,266,867,551口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0657円
（1万口当たり純資産額）	（20,657円）

日本債券マザーファンド

純資産額計算書

(2021年 2月26日現在)

資産総額	381,166,645,364円
負債総額	7,280,593,025円
純資産総額（ - ）	373,886,052,339円
発行済口数	274,301,261,245口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3630円
（1万口当たり純資産額）	（13,630円）

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

(2021年 2月26日現在)

資産総額	274,837,235,383円
負債総額	524,543,792円
純資産総額（ - ）	274,312,691,591円
発行済口数	77,602,793,409口
1口当たり純資産額（ / ）	3.5348円
（1万口当たり純資産額）	（35,348円）

外国債券マザーファンド

純資産額計算書

(2021年 2月26日現在)

資産総額	142,362,751,356円
負債総額	159,792,584円
純資産総額（ - ）	142,202,958,772円
発行済口数	55,555,773,723口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5596円
（1万口当たり純資産額）	（25,596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ます。)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（2021年 2月26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年における資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（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 - D0 - 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2021年 4月27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。

2021年2月26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	524	14,079,487
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	78	294,131
単位型公社債投資信託	43	281,810
合計	645	14,655,429

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

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34期事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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35期事業年度の中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,830	24,869
金銭の信託	-	5,823
有価証券	2,268	-
前払費用	197	348
未収委託者報酬	6,351	7,284
未収運用受託報酬	5,525	5,842
未収収益	212	190
その他	2,261	4,624
流動資産合計	40,648	48,983
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 282	1 256
器具備品	1 564	1 576
その他	1 14	1 0
有形固定資産合計	861	832
無形固定資産		
ソフトウェア	1,487	3,030
その他	7	40
無形固定資産合計	1,494	3,070
投資その他の資産		
投資有価証券	11,334	8,469
関係会社株式	4,663	5,636
繰延税金資産	141	700
その他	32	35
投資その他の資産合計	16,171	14,842
固定資産合計	18,527	18,745
資産合計	59,176	67,729

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	38	38
未払金	5,327	7,988
未払収益分配金	0	0
未払手数料	2,718	3,355
その他未払金	2,608	4,632
未払費用	178	204
未払法人税等	1,992	897
賞与引当金	132	324
その他	395	1,070
流動負債合計	8,063	10,524
固定負債		
退職給付引当金	537	600
資産除去債務	131	132
その他	0	7
固定負債合計	669	740
負債合計	8,733	11,264
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	75	305
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	28,501	35,122
利益剰余金合計	30,676	37,528
株主資本合計	49,916	56,767
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	393	587
繰延ヘッジ損益	133	284
評価・換算差額等合計	526	302
純資産合計	50,442	56,464
負債・純資産合計	59,176	67,729

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	30,551	34,967
運用受託報酬	5,464	11,091
その他営業収益	283	500
営業収益合計	36,299	46,559
営業費用		
支払手数料	13,423	15,998
広告宣伝費	276	331
公告費	1	0
調査費	5,508	5,018
調査費	567	788
委託調査費	4,935	4,217
図書費	5	11
営業雑経費	2,315	3,434
通信費	45	52
印刷費	449	470
協会費	38	53
諸会費	5	16
情報機器関連費	1,657	2,726
その他営業雑経費	118	114
営業費用合計	21,525	24,783
一般管理費		
給料	3,931	5,756
役員報酬	161	244
給料・手当	3,425	4,962
賞与	343	549
退職給付費用	98	118
福利費	297	535
交際費	9	14
旅費交通費	141	190
租税公課	270	344
不動産賃借料	219	269
寄付金	8	7
減価償却費	152	334
業務委託費	657	864
諸経費	433	750
一般管理費合計	6,219	9,185
営業利益	8,554	12,589

（単位：百万円）

	前事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）	当事業年度 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）
営業外収益		
受取利息	11	15
収益分配金	8	119
投資有価証券売却益	46	483
投資有価証券償還益	0	316
為替差益	-	273
デリバティブ利益	250	666
貸倒引当金戻入	17	-
その他	5	30
営業外収益合計	340	1,906
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	1,076
投資有価証券売却損	34	4
投資有価証券償還損	1	19
固定資産除却損	7	19
為替差損	198	-
その他	3	0
営業外費用合計	245	1,118
経常利益	8,649	13,377
特別損失		
統合関連費用	286	-
システム統合費用	49	149
特別損失合計	355	149
税引前当期純利益	8,313	13,227
法人税、住民税及び事業税	2,674	4,263
法人税等調整額	125	193
法人税等合計	2,549	4,070
当期純利益	5,764	9,157

（3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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	300	350	350
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替	1,700	1,700	1,700
会社分割による増加		18,589	18,589
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	1,700	16,889	16,889
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	74	2,100	22,767	24,942	25,592
当期変動額					
その他資本剰余金から 資本金への振替					-
会社分割による増加					18,589
剰余金の配当	0		30	30	30
当期純利益			5,764	5,764	5,764
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	0	-	5,734	5,734	24,323
当期末残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916

	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	0	-	0	25,592
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				18,589
剰余金の配当				30
当期純利益				5,764
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	393	133	526	526
当期変動額合計	393	133	526	24,850
当期末残高	393	133	526	50,442

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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			
その他資本剰余金から 資本金への振替			
会社分割による増加			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			

当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
その他資本剰余金から 資本金への振替					-
会社分割による増加					-
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	-	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	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	393	133	526	50,442
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				-
剰余金の配当				2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	980	151	829	829
当期変動額合計	980	151	829	6,022
当期末残高	587	284	302	56,464

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

時価のあるもの

決算末日の市場価格等に基づく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。）

時価のないもの

移動平均法による原価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、原則として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、期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. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度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。

7. 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。

8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

当事業年度より、連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

注記事項

(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		当事業年度	
	(2019年3月31日)		(2020年3月31日)	
建 物	53	百万円	77	百万円
器具備品	351	"	285	"
そ の 他	3	"	4	"
計	408	"	367	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

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

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

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

2020年6月26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
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	利益 剰余金	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29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7.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（注2）を参照ください）。

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	23,830	23,830	-
(2) 金銭の信託	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	6,351	6,351	-
(4) 未収運用受託報酬	5,525	5,525	-

(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	13,602	13,602	-
(6) 未払金	(5,327)	(5,327)	-
(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(0)	(0)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	82	82	-
デリバティブ取引計	81	81	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金及び預金	24,869	24,869	-
(2) 金銭の信託	5,823	5,823	-
(3) 未収委託者報酬	7,284	7,284	-
(4) 未収運用受託報酬	5,842	5,842	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	8,469	8,469	-
(6) 未払金	(7,988)	(7,988)	-
(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	6	6	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(114)	(114)	-
デリバティブ取引計	(107)	(107)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(6) 未払金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

（単位：百万円）

区分	前事業年度 2019年3月31日	当事業年度 2020年3月31日
非上場株式	0	0

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(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（2019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	23,830	-	-	-
未収委託者報酬	6,351	-	-	-
未収運用受託報酬	5,525	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268	491	7,800	0

当事業年度（2020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	24,869	-	-	-
未収委託者報酬	7,284	-	-	-
未収運用受託報酬	5,842	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	9	5,605	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる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）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

当事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる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）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

前事業年度（2019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	4,405	3,432	973

小計	4,405	3,432	973
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9,196	9,602	406
小計	9,196	9,602	406
合計	13,602	13,035	566

当事業年度（2020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	891	806	84
小計	891	806	84
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	7,578	8,509	931
小計	7,578	8,509	931
合計	8,469	9,316	846

（注）非上場株式（貸借対照表計上額0百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538	46	34

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2019年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	887	-	3	3
	英ポンド	66	-	1	1
	カナダドル	3	-	0	0
	スイスフラン	7	-	0	0
	香港ドル	183	-	0	0
	ユーロ	183	-	2	2
	買建				
	米ドル	10	-	0	0
	スイスフラン	1	-	0	0
	香港ドル	0	-	0	0
ユーロ	2	-	0	0	
合計	1,346	-	7	7	

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(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	6,739	-	8	8
合計		6,739	-	8	8

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

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					
	米ドル	有価証券 投資有価証券 子会社株式	3,432	-	13	
	英ポンド		2,575	-	50	
	カナダドル		40	-	0	
	スイスフラン		34	-	0	
	香港ドル		566	-	2	
	人民元		1,725	-	9	
	ユーロ		262	-	6	
	買建					
	ユーロ		6	-	0	
	合計		8,643	-	82	

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2020年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	1,443	-	23	23
	英ポンド	79	-	1	1
	カナダドル	15	-	0	0
	スイスフラン	26	-	0	0
	香港ドル	247	-	4	4
	人民元	18	-	0	0
	ユーロ	223	-	2	2
合計		2,055	-	32	32

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(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	8,412	-	358	358
合計		8,412	-	358	358

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

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				
	米ドル	投資有価証券 子会社株式	2,819	-	44
	英ポンド		2,660	-	67
	カナダドル		6	-	0
	スイスフラン		35	-	0
	香港ドル		71	-	1
	ユーロ		72	-	0
合計			5,666	-	114

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	496	537
退職給付費用	79	74
退職給付の支払額	38	11
退職給付債務の期末残高	537	600

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

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600
退職給付引当金	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度79百万円 当事業年度74百万円

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19百万円、当事業年度44百万円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

(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 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	125	百万円	168	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	40	"	99	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	164	"	183	"
有価証券評価差額	-		259	"
その他	82	"	151	"
繰延税金資産 合計	413	"	862	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	173	"	-	
繰延ヘッジ損益	58	"	125	"
その他	38	"	35	"
繰延税金負債 合計	271	"	161	"
繰延税金資産の純額	141	"	700	"

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

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

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(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 2018年4月1日 至 2019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	4,679百万円

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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	9,534百万円

[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。

(持分法損益等)

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 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	4,540	未収運用受託報酬	4,903
							投信販売代行手数料等	9,564	未払手数料	1,774
							投資助言費用	3,357	その他未払金	182
							吸収分割による承継 (承継資産合計) うち、投資有価証券 うち、関係会社株式 (承継負債合計) (差引純資産) (分割対価)	18,603 13,907 4,663 13 18,589 無対価	-	-

(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。

投資助言費用

各助言案件について、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。

吸収分割

共通支配下の取引に該当するため、承継資産及び承継負債は、分割会社の適正な帳簿価額によって引き継いでおります。また、当該会社分割は、無対価取引であるため、差引純資産と同額のその他資本剰余金を増額しております。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

(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（2019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（2020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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	16,814,137円07銭	18,821,541円72銭
1株当たり当期純利益金額	1,921,511円21銭	3,052,463円23銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
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35期中間会計期間末

(2020年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		22,768
金銭の信託		8,094
未収委託者報酬		7,732
未収運用受託報酬		5,430
その他		3,718
流動資産合計		47,745

固定資産

有形固定資産	1	801
無形固定資産		3,344
投資その他の資産		
投資有価証券		9,175
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		261
その他		33
投資その他の資産合計		15,106

固定資産合計		19,252
--------	--	--------

資産合計		66,997
------	--	--------

負債の部

流動負債

未払金		7,364
未払法人税等		473

賞与引当金		289
その他	2	612
流動負債合計		8,740
固定負債		
退職給付引当金		614
資産除去債務		132
その他		6
固定負債合計		752
負債合計		9,493

(単位：百万円)

第35期中間会計期間末

(2020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		35,114
利益剰余金合計		37,714
株主資本合計		56,953
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		251
繰延ヘッジ損益		299
評価・換算差額等合計		551
純資産合計		57,504
負債・純資産合計		66,997

中間損益計算書

(単位：百万円)

第35期中間会計期間

(自 2020年4月1日

至 2020年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		17,868
運用受託報酬		5,169
その他営業収益		206
営業収益合計		23,244
営業費用		13,137
一般管理費	1	4,842
営業利益		5,264
営業外収益	2	1,933

営業外費用	3	1,484
経常利益		5,714
特別損失		110
税引前中間純利益		5,603
法人税、住民税及び事業税		1,692
法人税等調整額		62
法人税等合計		1,754
中間純利益		3,848

中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
別途積立金		繰越利益剰余金			
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当中間期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
中間純利益			3,848	3,848	3,848
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	194	-	8	185	185
当中間期末残高	500	2,100	35,114	37,714	56,953

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	587	284	302	56,464
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,662
中間純利益				3,848

株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）	838	15	854	854
当中間期変動額合計	838	15	854	1,040
当中間期末残高	251	299	551	57,504

重要な会計方針

第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1. 資産の評価基準及び評価方法	<p>有価証券</p> <p>子会社株式 移動平均法による原価法によっております。</p> <p>その他有価証券</p> <p>時価のあるもの 中間会計期間末日の市場価格等に基づく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。)</p> <p>時価のないもの 移動平均法による原価法によっております。</p>
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	<p>(1) 有形固定資産 定額法によっております。</p> <p>(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）に基づく定額法によっております。</p>
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. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法によ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。</p>
7. ヘッジ会計の会計処理	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象</p>

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。

8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第35期中間会計期間末 (2020年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 431百万円
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35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 64百万円
	無形固定資産 255百万円
2	営業外収益の主要項目
	金銭の信託運用益 1,775百万円
3	営業外費用の主要項目
	デリバティブ費用 1,335百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第35期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

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
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

（金融商品関係）

第35期中間会計期間末（2020年9月30日）

2020年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（注2）を参照ください。）。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1)現金及び預金	22,768	22,768	-
(2)金銭の信託	8,094	8,094	-
(3)未収委託者報酬	7,732	7,732	-
(4)未収運用受託報酬	5,430	5,430	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	9,175	9,175	-
(6)未払金	(7,364)	(7,364)	-
(7)デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(80)	(80)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(9)	(9)	-
デリバティブ取引計	(89)	(89)	-

(*1)負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1)現金及び預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2)金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3)未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(6)未払金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(7)デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額：投資有価証券0百万円、関係会社株式5,636百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)投資有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第35期中間会計期間末（2020年9月30日）

1. 子会社株式

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる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)

	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	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	8,605	8,201	403
小計	8,605	8,201	403
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	570	610	40
小計	570	610	40
合計	9,175	8,812	362

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額0百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建			
	米ドル	1,861	-	2
	英ポンド	105	-	0
	カナダドル	19	-	0
	スイスフラン	50	-	0
	香港ドル	178	-	0
	ユーロ	306	-	3
合計	2,521	-	1	1

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	10,865	-	82	82
合計		10,865	-	82	82

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

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 子会社株式			
	米ドル		3,535	-	4
	英ポンド		2,791	-	5
	カナダドル		8	-	0
	スイスフラン		55	-	0
	香港ドル		98	-	0
	ユーロ		84	-	0
合計			6,574	-	9

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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	4,593百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*1)	2,993百万円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第35期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）	
1株当たり純資産額	19,168,213円23銭
1株当たり中間純利益	1,282,957円88銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在し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35期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）
中間純利益	3,848百万円
普通株式に係る中間純利益	3,848百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2021年 4月27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（2020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） （2020年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

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（2020年7月27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。）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

2020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 藤 澤 孝 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明 印**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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2019年4月1日から2020年3月31日までの第34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2020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。

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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年9月25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 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式30）の2019年7月26日から2020年7月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスコレクション（バランス株式30）の2020年7月27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。

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、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. 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

2020年9月25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 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式50）の2019年7月26日から2020年7月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスコレクション（バランス株式50）の2020年7月27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。

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、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. 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

2020年9月25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 中島紀子 印
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」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式70）の2019年7月26日から2020年7月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスコレクション（バランス株式70）の2020年7月27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。

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、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020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 藤 澤 孝 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明 印

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2020年4月1日から2021年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020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2020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（2020年4月1日から2020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、継続企業的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、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

2021年3月26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 印

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」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式30）の2020年7月28日から2021年1月27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、インデックスコレクション（バランス株式30）の2021年1月27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（2020年7月28日から2021年1月27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。

独立監査人の中間監査報告書

2021年3月26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 印

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」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式50）の2020年7月28日から2021年1月27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、インデックスコレクション（バランス株式50）の2021年1月27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（2020年7月28日から2021年1月27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。

独立監査人の中間監査報告書

2021年3月26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 印

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」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式70）の2020年7月28日から2021年1月27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、インデックスコレクション（バランス株式70）の2021年1月27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（2020年7月28日から2021年1月27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。