

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2021年5月20日

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

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 高村 孝

【本店の所在の場所】 東京都港区虎ノ門一丁目23番1号

【事務連絡者氏名】 鈴木 愛

【電話番号】 03 - 4530 - 7385

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

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

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

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

（以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

2兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

基準価額は、販売会社（後記「（８）申込取扱場所」をご参照ください。）にてご確認いただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の紙面に、「AMC安定型」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

< 照会先 >

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

（受付時間：原則として委託会社の営業日午前9時～午後5時）

ホームページアドレス：www.ssga.com/jp

### （５）【申込手数料】

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

### （６）【申込単位】

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

**(7) 【申込期間】**

2021年5月21日から2022年5月20日まで

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

**(8) 【申込取扱場所】**

販売会社において申込みを取り扱います。

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

**(9) 【払込期日】**

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

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

**(10) 【払込取扱場所】**

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

**(11) 【振替機関に関する事項】**

ファンドの受益権の振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

**(12) 【その他】**

申込証拠金

該当事項はありません。

本邦以外の地域での発行

該当事項はありません。

振替受益権について

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

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

(参考)

投資信託振替制度とは

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

##### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### 当ファンドが該当する商品分類

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

##### 属性区分表

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

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

#### 当ファンドが該当する属性区分

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

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

#### ファンドの特色

- 1 株式会社トータルアセットデザインが算出した資産配分に基づき、マザーファンドの配分を行います。**  
日本および世界主要国の株式や公社債等、運用資産全体のリスク（＝収益のブレ）総量をバジェット化することにより、株式会社トータルアセットデザインが決定した資産配分に基づき、資産別のインデックス型マザーファンドの配分を行います。なお、資産配分は定期的に見直しが行われます。
- <株式会社トータルアセットデザインの概要>**  
1998年2月に設立され、年金基金ならびに金融機関等の資産運用について、資産配分の策定・運用機関の選択と配分構成・リスク管理に至るまで、トータルなコンサルティングサービスを提供しています。なお、2015年1月29日付にて、株式会社エー・エム・シーは、株式会社トータルアセットデザインに社名変更されました。
- 2 マザーファンドは、それぞれのベンチマークに連動した投資成果の獲得を目指し、当ファンドは、「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」に連動した投資成果の獲得を目指します。**  
※AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数は、株式会社トータルアセットデザインが決定した資産配分に基づき、投資対象とするマザーファンドのベンチマークのリターンを合成した指数であり、当ファンドの投資成果の比較基準となるベンチマークとします。  
投資対象とするマザーファンドのベンチマークについては「マザーファンドの概要」をご参照ください。
- 3 実質的に保有する外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。**  
※投資対象国の通貨と円との間の為替変動により基準価額は変動します。

## 投資対象とするマザーファンドの概要

### 日本株式インデックス・マザーファンド

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

※TOPIX（東証株価指数配当込み）は、東京証券取引所第一部に上場している株式全銘柄で構成される株価指数で、配当を考慮したものです。

### 日本債券インデックス・マザーファンド

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

※NOMURA-BPI総合指数は、日本の国債、事業債（社債）、地方債、政府保証債等の固定利付債券で構成される債券価格指数です。

### 外国株式インデックス・オープン・マザーファンド

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

※MSCI コクサイ指数は、日本を除く世界の主要先進国の株式で構成される株価指数であり、投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。

### 外国債券インデックス・マザー・ファンド

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

※FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、日本を除く世界の主要国の国債で構成される債券価格指数であり、投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。

## ■ ベンチマーク(オリジナル指数)

以下に掲げるベンチマークは、マザーファンドのベンチマークです。

### TOPIX(東証株価指数配当込み)

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

### NOMURA-BPI総合指数

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

### MSCI コクサイ指数

MSCI コクサイ指数は、MSCI Inc.の登録商標です。

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

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

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

### FTSE世界国債インデックス(除く日本)

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2012年3月9日 投資信託契約締結、設定、運用開始

### （３）【ファンドの仕組み】

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



各マザーファンドには、当ファンド以外にも、当該各マザーファンドに投資する他のファンド（ベビーファンド）があります。

#### ファンドの関係法人

ファンドの関係法人は以下のとおりです。

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

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

- 2) 三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）

（再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行）

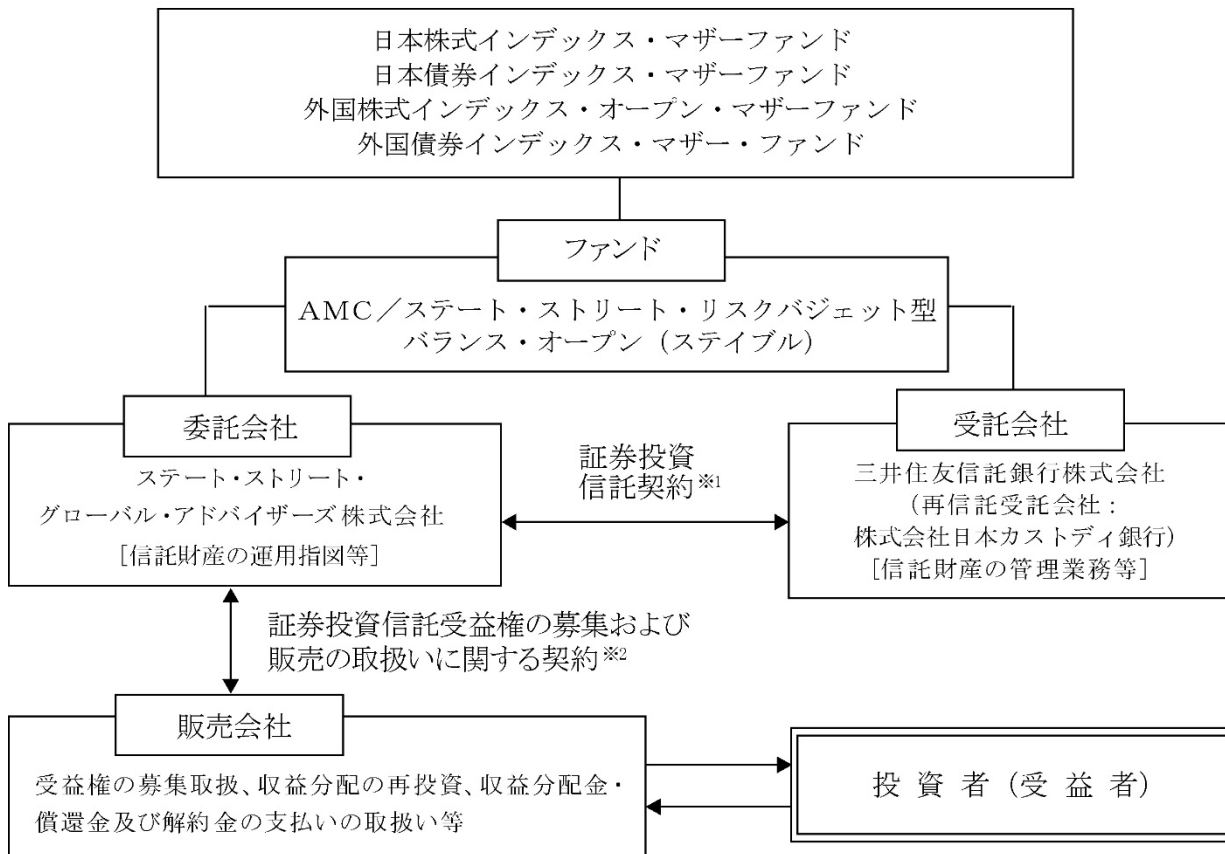
受託会社は、信託財産の管理業務、信託財産の計算等を行います。また、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。

- 3) 販売会社

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



## ファンド関係法人



### 1 証券投資信託契約

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

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

### 2 証券投資信託受益権の募集および販売に関する契約

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

## 委託会社の概況（本書提出日現在）

### 1) 資本金の額

3億1千万円

### 2) 沿革

1998年2月25日	ステート・ストリート投資顧問株式会社 設立
1998年3月31日	投資顧問業の登録
1998年8月28日	ステート・ストリート投信投資顧問株式会社に商号変更
1998年9月30日	投資一任契約に係る業務の認可
1998年9月30日	証券投資信託の委託会社としての認可取得
2007年9月30日	金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第345号）
2008年7月1日	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社に商号変更

### 3) 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

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

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

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

「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」をベンチマークとします。

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

日本株式インデックス・マザーファンド

[ベンチマーク：TOPIX（東証株価指数配当込み）]

日本債券インデックス・マザーファンド

[ベンチマーク：NOMURA - BPI総合指数]

外国株式インデックス・オープン・マザーファンド

[ベンチマーク：MSCIコクサイ指数（円ベース）<sup>1</sup>]

外国債券インデックス・マザー・ファンド

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

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

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

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

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

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

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

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

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- (a) 有価証券
- (b) デリバティブ取引に係る権利
- (c) 金銭債権
- (d) 約束手形

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

- (a) 為替手形

### 投資の対象とする有価証券の指図範囲等

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

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

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

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

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

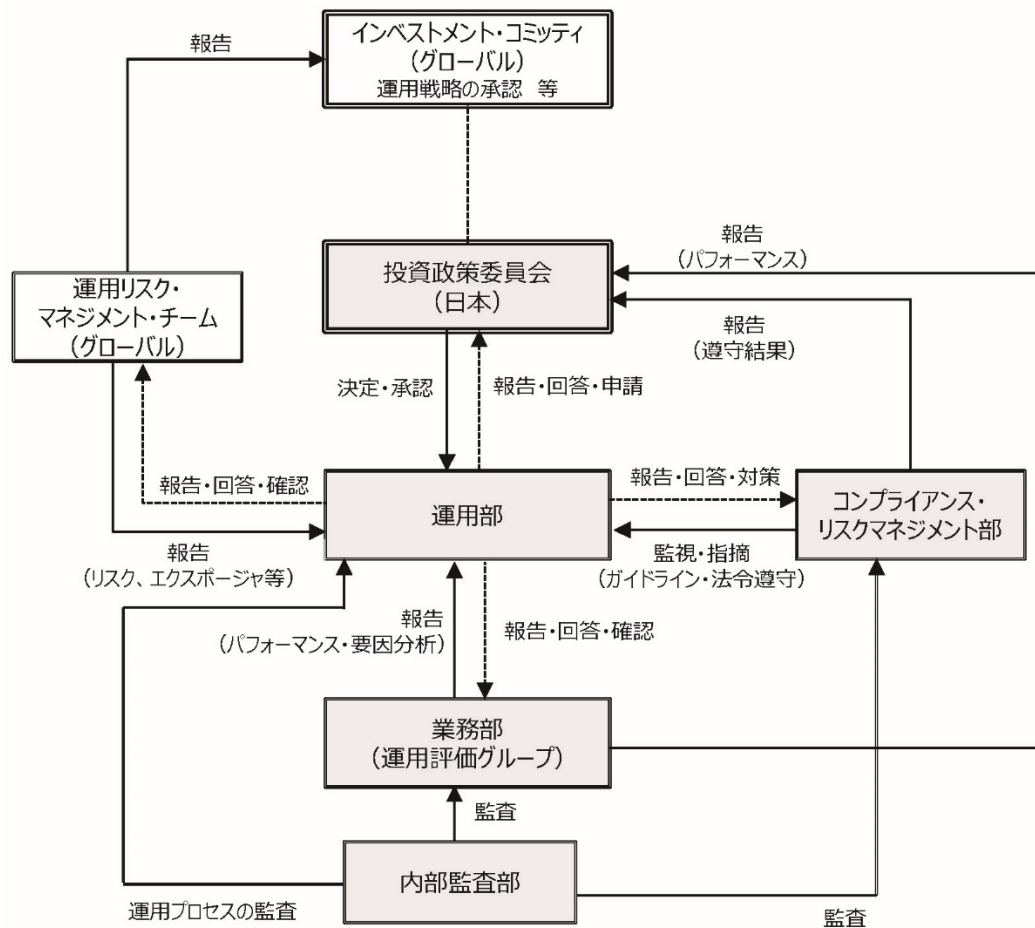
- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形

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

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

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

## (3) 【運用体制】



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

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

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

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

当チームが行った戦略代表口座の分析結果は、インベストメント・コミッティ（グローバル）およびグローバルの運用戦略責任者によってレビューされています。

上記運用体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### （４）【分配方針】

##### 収益分配方針

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

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

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

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

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

##### < 収益分配金に関する留意事項 >

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

#### （５）【投資制限】

信託約款の「運用の基本方針」に定める主な投資制限

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

信託約款上のその他の投資制限

- 1) 投資する株式等の範囲（信託約款第18条）

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

## 2) 信用取引の指図範囲（信託約款第19条）

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

## 3) 先物取引等の運用指図（信託約款第20条）

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

## 4) スワップ取引の運用指図（信託約款第21条）

- (a) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

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



- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (b) 上記(a)の指図にあたっては、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (d) 上記(a)の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- 9) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款第26条）  
外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 10) 外国為替予約取引の指図および範囲（信託約款第27条）  
(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産の額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額についての為替変動リスクを回避するため、もしくはベンチマークとの連動性を維持するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (b) 上記(a)の予約取引の指図は、原則として信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額の為替変動リスクを回避するため、もしくはベンチマークとの連動性を維持するための当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (c) 上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内にその超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (d) 上記(a)および(b)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 11) デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第22条の2）  
委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人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。  
法令に基づく投資制限
- 1) 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）  
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- 2) デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）  
委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定め

た合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

（参考）「日本株式インデックス・マザーファンド」の概要

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

#### （１）投資方針

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

日本の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

TOPIX（東証株価指数配当込み）をベンチマークとします。

株式の組入比率は、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）および金利先渡取引を行うことができます。

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむをえない事情が発生した場合には、上記のような運用が行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

#### （２）投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- （a）有価証券
- （b）デリバティブ取引に係る権利
- （c）金銭債権
- （d）約束手形

２）次に掲げる特定資産以外の資産

- （a）為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

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

- １）株券または新株引受権証書
- ２）国債証券
- ３）地方債証券
- ４）特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

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

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

### (3) 主な投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

信用取引の指図は、信託約款第15条の範囲で行います。

有価証券先物取引等は、信託約款第16条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第17条の範囲で行います。

金利先渡取引は、信託約款第18条の範囲で行います。

一般社団法人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およびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第18条の2）

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

（参考）「日本債券インデックス・マザーファンド」の概要

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

#### （1）投資方針

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

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

NOMURA-BPI総合指数をベンチマークとします。

債券組入比率は原則として高位を維持します。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）ならびに金利先渡取引を行うことができます。

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

#### （2）投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

（a）有価証券

（b）デリバティブ取引に係る権利

（c）金銭債権

(d) 約束手形

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

(a) 為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### （3）主な投資制限

公社債の投資割合には制限を設けません。

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

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等は、信託約款第15条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第16条の範囲で行います。

金利先渡取引は、信託約款第17条の範囲で行います。

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第17条の2）

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人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。

### （参考）「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の概要

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

#### （1）投資方針

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

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

株式への投資にあたっては、日本を除く世界各国の株式（これに準ずるものを含みます。）を主要投資対象とし、MSCIコクサイ指数に連動した投資成果をめざして運用を行います。

株式の組入率は、原則として高位を維持します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

信託財産に属する資産の価格変動および金利変動により生じるリスク（為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいう。以下同じ。）を減じるため、ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実

現するために限定して、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の価格変動および金利変動により生じるリスクを減じるため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

## (2) 投資対象

### 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

### 投資の対象とする有価証券の指図範囲等

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

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 8) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)から7)までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 投資信託又は外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号定めるものをいいます。)
- 10) 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(クローズド・エンド型の会社型外国投資信託証券を除きます。以下同じ。)(金融商品取引法第2条第1項第11号定めるものをいいます。)
- 11) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 12) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 13) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 14) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 15) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

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

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

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

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

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

### (3) 主な投資制限

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

投資信託証券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。

同一銘柄の株式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。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は信託約款第17条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第18条の範囲で行います。

金利先物取引及び為替先渡取引は、信託約款第19条の範囲で行います。

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限(信託約款第19条の2)

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人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。

### (参考)「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の概要

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

#### (1) 投資方針

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

日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象とします。

公社債への投資は原則として高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。



信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。その際の実質投資比率は、原則として信託財産の純資産総額の100%以内とします。また、実質投資比率がこの上限を超過した場合には、速やかに調整するものとします。なお、ここでいう実質投資比率は、現物資産の時価総額と有価証券先物等の買建玉の時価総額の合計額から売建玉の時価総額を差引いた額の、純資産総額に対する比率をいいます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

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

資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては上記の運用ができないことがあります。

## （２）投資対象

### 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

### 投資の対象とする有価証券の指図範囲等

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

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)

- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 14) 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 15) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 16) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 17) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 20) 外国の者に対する権利で19) の有価証券の性質を有するもの。
- 21) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 22) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

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

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

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

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

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

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

### (3) 主な投資制限

公社債の投資割合には制限を設けません。

株式への投資は、転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号

および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)の転換による取得に限り、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は、信託約款15条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款16条の範囲で行います。

金利先渡取引及び為替先渡取引は、信託約款17条の範囲で行います。

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第17条の2）

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人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【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク特性

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

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

なお、投資信託は預貯金とは異なります。

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

#### 資産配分リスク

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

#### 株価変動リスク

当ファンドは、日本および世界主要国の株式を実質的な投資対象としていることから、株式の投資に係る価格変動リスクを伴います。一般に、株式の価格は、個々の企業の活動および業績、経営方針、ならびに法令順守の状況等に反応して変動するほか、投資対象国の経済情勢および景気見通し、ならびに金利変動、為替相場およびそれらの見通し等にも反応して変動します。したがって、マザーファンドに組み入れられる株式の価格は短期的または長期的に下落する可能性があります。

#### 信用リスク

当ファンドは、日本および世界主要国の株式や公社債等を実質的な投資対象としていることから、株式の発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。また公社債等の価格は、公社債等の発行体の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等、信用状況によって変動し、特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはでき

なくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともあります。）。したがって、このような状態が生じた場合には、当ファンドが実質的に保有する株式や公社債等の価格が下落し、基準価額が下落する要因となります。また、金融商品取引の相手方や受託会社の決済不履行または債務不履行等により損失を被ることがあります。運用資産の規模等によっては、当ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

#### 金利変動リスク

当ファンドは、日本および世界主要国の公社債等を実質的な投資対象としていることから、金利変動リスクを伴います。一般に、公社債等の価格は、金利が上昇した場合には下落し、金利が下落した場合には上昇します（価格の変動幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。したがって、金利が上昇した場合、当ファンドが実質的に保有する公社債等の価格が下落し、基準価額が下落する要因となります。

#### 為替変動リスク

当ファンドの実質的な投資対象である世界主要国の株式や公社債等（日本を除く）は外貨建資産であるため、当ファンドの基準価額は為替変動の影響を受けます。一般に、主な為替相場の変動要因としては、金利変動、中央銀行等による政策金利の変更または為替介入、政治的要因等があります。

#### 流動性リスク

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

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

#### 投資対象国への投資リスク

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

#### デリバティブ取引のリスク

先物・スワップ取引等のデリバティブ取引を用いた投資手法は運用の効率を高めるため、または証券価格、市場金利、為替等の変動による当ファンドおよびマザーファンドへの影響を低減するために用いられますが、デリバティブ取引は必ず用いられるわけではなく、また用いられたとしても本来の目的を達成できる保証はありません。

#### パッシブ運用のリスク

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

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

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

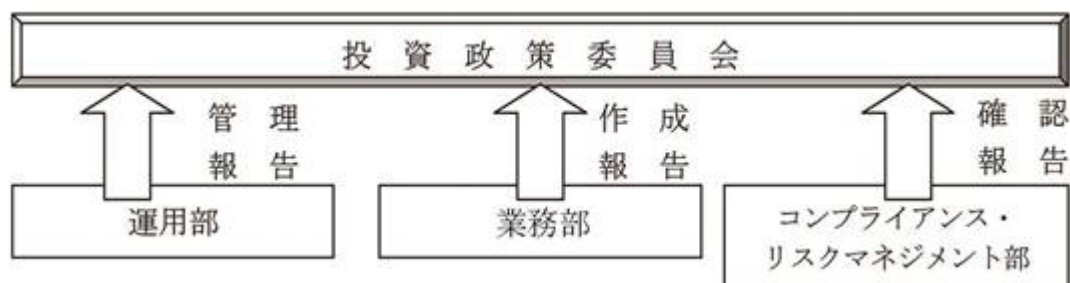
#### ファミリーファンド方式のリスク

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

#### （２）その他の留意点

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

#### （３）リスク管理体制



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

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

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

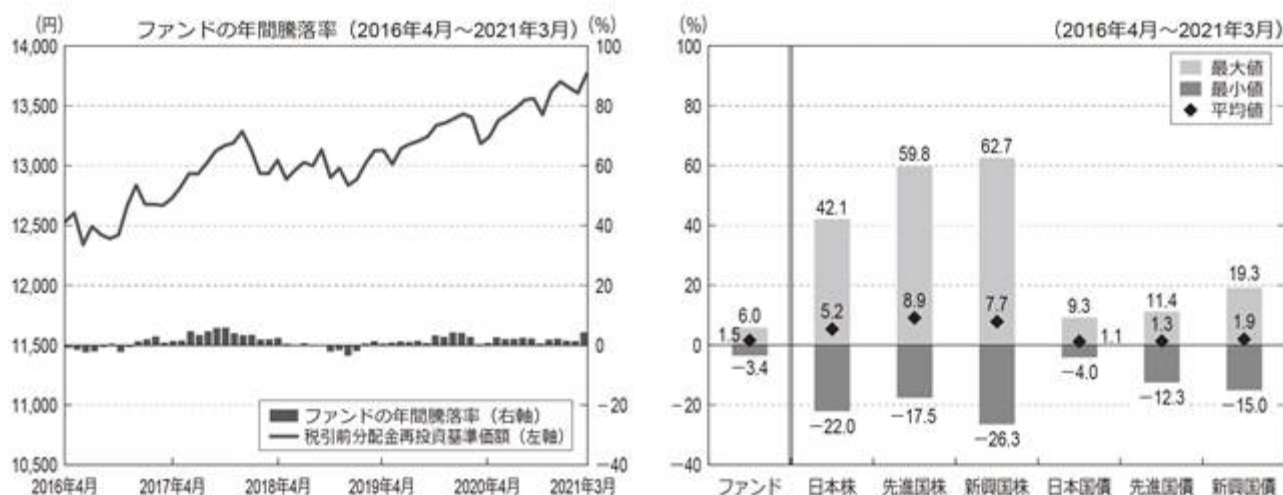
投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をします。

上記リスクに対する管理体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## ＜参考情報＞代表的な資産クラスと騰落率の比較等

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

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



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

### 「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

#### 日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

#### 先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

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

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

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

#### 日本国債:NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村証券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、同指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村証券株式会社に帰属します。

#### 先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

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

購入時手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の事務等の対価です。

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

### (2)【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

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

### (3)【信託報酬等】

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

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

< 信託報酬率の配分（税抜）>

支払先	信託報酬率（年率）	役務の内容
委託会社	0.60%	委託した資金の運用の対価
販売会社	0.10%	交付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	0.05%	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

消費税等相当額は、消費税および地方消費税に相当する金額です。

### (4)【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します（信託約款第38条）。

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

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

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

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

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

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

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

#### (5)【課税上の取扱い】

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

##### 個人、法人別の課税について

##### 個人の投資家に対する課税

###### <収益分配金に対する課税>

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

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

###### <換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対する課税>

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

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

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

少額投資非課税制度(NISA)、未成年者少額投資非課税制度(ジュニアNISA)をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

##### 法人の投資者に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

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

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



<注1> 個別元本について

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

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

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

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

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

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

上記は、2021年3月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

(2021年3月31日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	4,060,664,567	85.19
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		705,833,568	14.81
純資産総額		4,766,498,135	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

## &lt;参考情報&gt;

親投資信託受益証券(日本株式インデックス・マザーファンド)

(2021年3月31日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	99,932,089,510	97.19
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		2,894,061,144	2.81
純資産総額		102,826,150,654	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

## &lt;参考情報&gt;

親投資信託受益証券(日本債券インデックス・マザーファンド)

(2021年3月31日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	132,288,163,500	82.00
特殊債券	日本	13,280,747,473	8.23
地方債証券	日本	9,674,087,654	6.00
社債券	日本	5,291,941,400	3.28
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		791,278,855	0.49
純資産総額		161,326,218,882	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

## &lt;参考情報&gt;

親投資信託受益証券(外国株式インデックス・オープン・マザーファンド)

(2021年3月31日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	121,646,776,022	67.48
	イギリス	8,121,687,028	4.51
	フランス	6,286,527,266	3.49
	カナダ	6,151,839,304	3.41
	ドイツ	5,427,867,692	3.01
	スイス	5,279,752,501	2.93
	オーストラリア	3,773,795,527	2.09
	オランダ	2,404,130,166	1.33
	スウェーデン	2,071,357,602	1.15
	香港	1,897,631,076	1.05
	イタリア	1,430,818,417	0.79
	スペイン	1,363,178,436	0.76
	デンマーク	1,342,694,462	0.74
	フィンランド	576,436,506	0.32

	シンガポール	554,577,750	0.31
	ベルギー	537,185,725	0.30
	アイルランド	405,724,351	0.23
	ノルウェー	358,904,287	0.20
	イスラエル	346,331,376	0.19
	ニュージーランド	144,605,230	0.08
	オーストリア	103,939,766	0.06
	ポルトガル	91,181,563	0.05
	小計	170,316,942,053	94.48
投資証券	アメリカ	3,263,967,761	1.81
	オーストラリア	240,038,094	0.13
	イギリス	103,820,271	0.06
	フランス	93,905,876	0.05
	シンガポール	84,821,458	0.05
	香港	67,081,737	0.04
	カナダ	21,811,749	0.01
	小計	3,875,446,946	2.15
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		6,080,191,619	3.37
純資産総額		180,272,580,618	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

#### < 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

（2021年3月31日現在）

種類	国 / 地域名	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	60,518,721,595	43.47
	フランス	14,479,042,999	10.40
	イタリア	13,382,663,675	9.61
	ドイツ	10,465,299,000	7.52
	イギリス	9,208,172,732	6.62
	スペイン	8,259,267,225	5.93
	ベルギー	3,468,998,017	2.49
	オーストラリア	3,233,821,968	2.32
	カナダ	2,767,158,076	1.99
	オランダ	2,609,580,923	1.88
	オーストリア	2,103,245,828	1.51
	アイルランド	1,200,256,859	0.86
	メキシコ	1,092,104,086	0.79
	フィンランド	899,591,714	0.65
	ポーランド	881,306,516	0.63
	デンマーク	700,162,134	0.50
	マレーシア	677,318,053	0.49
	イスラエル	616,854,253	0.44
	シンガポール	602,207,174	0.43
	スウェーデン	470,312,393	0.34
ノルウェー	350,997,350	0.25	
	小計	137,987,082,570	99.12
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		1,230,015,735	0.88
純資産総額		139,217,098,305	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

## (2) 【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

(2021年3月31日現在)

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資 信託受 益証券	日本債券インデックス・マ ザーファンド		2,571,141,239	1.2785	3,287,204,074	1.2830	3,298,774,209	69.20
2	日本	親投資 信託受 益証券	外国株式インデックス・ オープン・マザーファンド		73,584,902	3.5122	258,444,892	3.7030	272,484,892	5.72
3	日本	親投資 信託受 益証券	日本株式インデックス・マ ザーファンド		77,885,317	3.3455	260,565,328	3.4025	265,004,791	5.56
4	日本	親投資 信託受 益証券	外国債券インデックス・マ ザー・ファンド		88,566,395	2.4865	220,220,341	2.5337	224,400,675	4.71
									投資比率：合計	85.19

(注1) 投資有価証券は4銘柄です。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	-	85.19
合計		85.19

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

### 【投資不動産物件】

該当する事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当する事項はありません。

## < 参考情報 >

親投資信託受益証券(日本株式インデックス・マザーファンド)

投資有価証券の主要銘柄(上位30銘柄)

(2021年3月31日現在)

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	377,800	7,969.00	3,010,688,200	8,616.00	3,255,124,800	3.17
2	日本	株式	ソニー	電気機器	233,600	11,215.00	2,619,824,000	11,595.00	2,708,592,000	2.63
3	日本	株式	ソフトバンクグルー プ	情報・通信 業	290,300	10,055.00	2,918,966,500	9,330.00	2,708,499,000	2.63
4	日本	株式	キーエンス	電気機器	36,600	51,450.00	1,883,070,000	50,270.00	1,839,882,000	1.79
5	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	2,515,700	565.00	1,421,370,500	591.70	1,488,539,690	1.45
6	日本	株式	リクルートホール ディングス	サービス業	255,200	4,931.00	1,258,391,200	5,401.00	1,378,335,200	1.34
7	日本	株式	任天堂	その他製品	21,300	62,030.00	1,321,239,000	61,810.00	1,316,553,000	1.28
8	日本	株式	信越化学工業	化学	67,500	17,490.00	1,180,575,000	18,610.00	1,256,175,000	1.22
9	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	310,200	3,758.00	1,165,731,600	3,985.00	1,236,147,000	1.20

10	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	428,000	2,761.50	1,181,922,000	2,842.00	1,216,376,000	1.18
11	日本	株式	日本電産	電気機器	89,700	13,295.00	1,192,561,500	13,435.00	1,205,119,500	1.17
12	日本	株式	ダイキン工業	機械	47,500	21,815.00	1,036,212,500	22,320.00	1,060,200,000	1.03
13	日本	株式	第一三共	医薬品	320,100	3,095.00	990,709,500	3,225.00	1,032,322,500	1.00
14	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	21,800	41,480.00	904,264,000	46,790.00	1,020,022,000	0.99
15	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	254,500	3,831.00	974,989,500	4,007.00	1,019,781,500	0.99
16	日本	株式	KDDI	情報・通信業	293,400	3,278.00	961,765,200	3,395.00	996,093,000	0.97
17	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	293,600	3,101.00	910,453,600	3,319.00	974,458,400	0.95
18	日本	株式	村田製作所	電気機器	109,500	9,278.00	1,015,941,000	8,842.00	968,199,000	0.94
19	日本	株式	HOYA	精密機器	73,400	11,880.00	871,992,000	13,005.00	954,567,000	0.93
20	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	256,900	3,329.00	855,220,100	3,587.00	921,500,300	0.90
21	日本	株式	日立製作所	電気機器	179,300	5,245.00	940,428,500	5,004.00	897,217,200	0.87
22	日本	株式	ファナック	電気機器	32,700	25,795.00	843,496,500	26,185.00	856,249,500	0.83
23	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	499,700	1,566.00	782,530,200	1,599.00	799,020,300	0.78
24	日本	株式	SMC	機械	10,900	63,550.00	692,695,000	64,310.00	700,979,000	0.68
25	日本	株式	三菱商事	卸売業	223,600	3,037.00	679,073,200	3,130.00	699,868,000	0.68
26	日本	株式	三井物産	卸売業	298,200	2,286.00	681,685,200	2,302.00	686,456,400	0.67
27	日本	株式	花王	化学	89,300	7,312.00	652,961,600	7,313.00	653,050,900	0.64
28	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	121,900	5,382.00	656,065,800	5,265.00	641,803,500	0.62
29	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	143,700	4,254.00	611,299,800	4,463.00	641,333,100	0.62
30	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	37,900	17,635.00	668,366,500	16,625.00	630,087,500	0.61
									投資比率：合計	34.76

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	電気機器	16.96
	情報・通信業	8.95
	化学	7.17
	輸送用機器	7.16
	機械	5.51
	サービス業	5.43
	医薬品	5.35
	銀行業	5.02
	卸売業	4.66
	小売業	4.58
	陸運業	3.32
	食料品	3.24
	精密機器	2.46
	建設業	2.34
	その他製品	2.31
	不動産業	1.97
	保険業	1.80
	電気・ガス業	1.33
	その他金融業	1.09
	ガラス・土石製品	0.81
証券、商品先物取引業	0.76	
鉄鋼	0.75	

非鉄金属	0.74
金属製品	0.62
ゴム製品	0.59
繊維製品	0.48
空運業	0.45
石油・石炭製品	0.44
パルプ・紙	0.24
海運業	0.23
倉庫・運輸関連業	0.17
鉱業	0.17
水産・農林業	0.09
合計	97.19

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該種類及び業種の評価金額の比率です。

#### 投資不動産物件

該当する事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	TOPIX(先物) (2021年6月限)	大阪取引所	買建	143	2,802,504,380	2,794,220,000	2.72

（注1）投資比率は、純資産総額に対する当該取引の評価金額の比率です。

（注2）先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

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

#### < 参考情報 >

親投資信託受益証券（日本債券インデックス・マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2021年3月31日現在）

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	国債 証券	第146回利付 国債(5年)	0.100	2025/12/20	2,350,000,000	100.93	2,371,988,000	100.92	2,371,714,000	1.47
2	日本	国債 証券	第145回利付 国債(5年)	0.100	2025/09/20	2,100,000,000	100.93	2,119,614,000	100.94	2,119,803,000	1.31
3	日本	国債 証券	第360回利付 国債(10年)	0.100	2030/09/20	2,100,000,000	100.28	2,105,964,000	100.18	2,103,948,000	1.30
4	日本	国債 証券	第144回利付 国債(5年)	0.100	2025/06/20	1,900,000,000	100.88	1,916,758,000	100.91	1,917,309,000	1.19
5	日本	国債 証券	第135回利付 国債(5年)	0.100	2023/03/20	1,900,000,000	100.46	1,908,892,000	100.46	1,908,797,000	1.18
6	日本	国債 証券	第418回利付 国債(2年)	0.100	2022/11/01	1,800,000,000	100.39	1,807,146,000	100.37	1,806,714,000	1.12
7	日本	国債 証券	第136回利付 国債(5年)	0.100	2023/06/20	1,700,000,000	100.52	1,708,959,000	100.53	1,709,078,000	1.06

8	日本	国債証券	第9回利付国債(40年)	0.400	2056/03/20	1,730,000,000	91.17	1,577,327,500	91.31	1,579,766,800	0.98
9	日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	0.100	2023/09/20	1,550,000,000	100.58	1,559,067,500	100.59	1,559,222,500	0.97
10	日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	0.400	2025/09/20	1,480,000,000	102.30	1,514,069,600	102.29	1,513,906,800	0.94
11	日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	0.100	2028/06/20	1,500,000,000	100.98	1,514,775,000	100.86	1,513,005,000	0.94
12	日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	0.100	2028/12/20	1,500,000,000	100.89	1,513,440,000	100.77	1,511,580,000	0.94
13	日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	0.100	2030/03/20	1,500,000,000	100.49	1,507,410,000	100.40	1,506,015,000	0.93
14	日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	0.100	2022/09/20	1,500,000,000	100.35	1,505,310,000	100.33	1,504,965,000	0.93
15	日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	0.100	2022/06/20	1,500,000,000	100.29	1,504,440,000	100.27	1,504,110,000	0.93
16	日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	0.300	2025/12/20	1,300,000,000	101.89	1,324,687,000	101.89	1,324,661,000	0.82
17	日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	0.100	2024/06/20	1,300,000,000	100.74	1,309,646,000	100.75	1,309,867,000	0.81
18	日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	0.100	2027/12/20	1,260,000,000	101.02	1,272,864,600	100.94	1,271,881,800	0.79
19	日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	0.100	2026/06/20	1,200,000,000	100.95	1,211,460,000	100.96	1,211,628,000	0.75
20	日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	0.100	2026/09/20	1,200,000,000	100.97	1,211,676,000	100.96	1,211,532,000	0.75
21	日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	0.100	2024/12/20	1,200,000,000	100.81	1,209,804,000	100.84	1,210,092,000	0.75
22	日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	0.100	2024/03/20	1,200,000,000	100.70	1,208,400,000	100.70	1,208,400,000	0.75
23	日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	0.100	2028/09/20	1,160,000,000	100.94	1,170,938,800	100.82	1,169,535,200	0.72
24	日本	国債証券	第174回利付国債(20年)	0.400	2040/09/20	1,180,000,000	98.65	1,164,176,200	98.66	1,164,223,400	0.72
25	日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	0.100	2029/09/20	1,150,000,000	100.63	1,157,337,000	100.54	1,156,313,500	0.72
26	日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	0.100	2030/06/20	1,150,000,000	100.41	1,154,772,500	100.32	1,153,680,000	0.72
27	日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	0.100	2029/03/20	1,100,000,000	100.80	1,108,833,000	100.67	1,107,436,000	0.69
28	日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	0.100	2029/12/20	1,100,000,000	100.56	1,106,259,000	100.47	1,105,247,000	0.69
29	日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	0.100	2030/12/20	1,100,000,000	100.14	1,101,584,000	100.09	1,101,056,000	0.68
30	日本	国債証券	第173回利付国債(20年)	0.400	2040/06/20	1,100,000,000	98.76	1,086,382,000	98.76	1,086,426,000	0.67
										投資比率：合計	27.22

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
国債証券	-	82.00
特殊債券	-	8.23
地方債証券	-	6.00
社債券	-	3.28
合計		99.51

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

## 投資不動産物件

該当する事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当する事項はありません。

## &lt; 参考情報 &gt;

親投資信託受益証券（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2021年3月31日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ ハードウェアおよび機器	539,368	12,908.78	6,962,586,087	13,274.12	7,159,640,410	3.97
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・ サービス	227,832	23,824.79	5,428,050,010	25,668.11	5,848,017,634	3.24
3	アメリカ	株式	AMAZON COM INC	小売	13,488	353,690.77	4,770,581,139	338,251.15	4,562,331,590	2.53
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	76,252	30,754.13	2,345,063,989	31,884.47	2,431,255,368	1.35
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	9,512	197,767.91	1,881,168,413	226,564.69	2,155,083,366	1.20
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	9,381	198,487.53	1,862,011,524	227,568.83	2,134,823,226	1.18
7	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部 品	24,100	64,799.67	1,561,672,049	70,369.49	1,695,904,713	0.94
8	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	96,690	13,412.51	1,296,856,220	17,102.48	1,653,638,868	0.92
9	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	83,525	15,943.34	1,331,668,066	18,268.25	1,525,856,174	0.85
10	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・ サービス	53,695	23,357.59	1,254,186,106	23,459.44	1,259,655,114	0.70
11	アメリカ	株式	UNITED HEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・ サービス	30,091	37,408.90	1,125,671,480	41,356.82	1,244,468,299	0.69
12	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	43,434	25,624.93	1,112,993,496	28,584.21	1,241,526,789	0.69
13	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO NEW	メディア・娯楽	57,464	16,289.86	936,081,055	20,540.02	1,180,312,071	0.65
14	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソ ナル用品	78,639	15,345.51	1,206,755,804	14,995.66	1,179,244,453	0.65
15	アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	34,139	30,558.17	1,043,225,509	33,746.62	1,152,075,935	0.64
16	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバ コ	91,360	12,015.13	1,097,702,733	12,442.65	1,136,760,778	0.63



17	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	28,214	37,532.90	1,058,953,359	39,656.32	1,118,863,468	0.62
18	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	19,600	58,740.51	1,151,314,031	57,001.25	1,117,224,650	0.62
19	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	246,887	3,207.26	791,832,947	4,316.58	1,065,708,202	0.59
20	アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	35,322	23,408.52	826,835,828	26,187.34	924,989,343	0.51
21	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	129,928	5,255.40	682,824,091	7,059.97	917,288,652	0.51
22	オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	13,496	47,544.44	641,659,789	67,015.73	904,444,427	0.50
23	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	144,812	5,724.81	829,021,779	6,086.83	881,446,865	0.49
24	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	131,184	6,705.70	879,681,165	6,486.49	850,924,871	0.47
25	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	134,051	4,443.89	595,709,158	6,276.14	841,324,170	0.47
26	アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	14,007	54,396.25	761,928,293	56,837.40	796,121,558	0.44
27	スイス	株式	ROCHE HOLDING AG GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	22,276	35,519.22	791,226,345	35,687.18	794,967,677	0.44
28	アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	15,228	52,814.20	804,254,721	51,531.07	784,715,234	0.44
29	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	225,883	3,212.80	725,717,851	3,402.11	768,480,687	0.43
30	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	133,982	4,727.31	633,375,386	5,731.45	767,912,031	0.43
投資比率：合計										27.79

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

(注3) 2021年3月31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います。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	ソフトウェア・サービス	11.07
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.14
	メディア・娯楽	6.89
	資本財	6.56
	銀行	6.13
	小売	5.59
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.51
	ヘルスケア機器・サービス	5.02
	各種金融	4.43
	素材	4.37
	半導体・半導体製造装置	4.36
	食品・飲料・タバコ	3.89
	エネルギー	3.30
	保険	3.18
	公益事業	3.02

	運輸	2.01
	自動車・自動車部品	1.98
	耐久消費財・アパレル	1.88
	家庭用品・パーソナル用品	1.81
	電気通信サービス	1.80
	消費者サービス	1.64
	食品・生活必需品小売り	1.31
	商業・専門サービス	1.15
	不動産	0.44
	小計	94.48
投資証券		2.15
	合計	96.63

（注1）投資比率は、純資産総額に対する当該種類及び業種の評価金額の比率です。

（注2）2021年3月31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います。

#### 投資不動産物件

該当する事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	MINI S&P 500	シカゴ商業取引 所	買建	アメリカ・ ドル	204	40,123,502.50	40,266,540.00	4,457,908,643	2.47
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ ドイツ金融先物 取引所	買建	ユーロ	131	4,956,190.00	5,072,320.00	658,387,136	0.37
	FSMI INDEX	ユーレックス・ チューリッヒ取 引所	買建	スイス・フ ラン	22	2,347,450.00	2,418,460.00	284,048,127	0.16
	FTSE100INDEX	インターコンチ ネンタル取引所	買建	イギリス・ ポンド	24	1,613,180.02	1,615,560.00	245,936,698	0.14
	S&P 60	モンリオール 取引所	買建	カナダ・ド ル	12	2,672,126.14	2,671,200.00	234,477,936	0.13
	SPI 200	シドニー先物取 引所	買建	オーストラ リア・ドル	14	2,359,975.00	2,348,500.00	198,119,460	0.11

（注1）投資比率は、純資産総額に対する当該取引の評価金額（2021年3月31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います）の比率です。

（注2）先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

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

#### < 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2021年3月31日現在）

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1.625	2022/11/15	10,000,000	11,359.45	1,135,945,147	11,339.99	1,133,999,075	0.81
2	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.000	2022/11/30	9,300,000	11,441.18	1,064,030,350	11,416.10	1,061,697,660	0.76
3	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.000	2025/02/15	8,000,000	11,777.64	942,211,289	11,667.79	933,423,687	0.67

4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2026/08/15	8,000,000	11,549.73	923,978,742	11,350.36	908,029,585	0.65
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2030/08/15	8,000,000	10,398.09	831,847,262	10,041.74	803,339,437	0.58
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2022/08/31	6,900,000	11,325.28	781,444,804	11,307.98	780,251,212	0.56
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2025/03/31	6,300,000	12,065.66	760,136,589	11,944.13	752,480,734	0.54
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2027/02/15	6,200,000	12,020.68	745,282,421	11,770.72	729,784,747	0.52
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.875	2030/11/15	7,100,000	10,616.05	753,739,627	10,247.59	727,579,200	0.52
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2023/05/31	6,300,000	11,442.91	720,903,733	11,414.37	719,105,556	0.52
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2025/05/15	6,100,000	11,853.75	723,079,008	11,726.61	715,323,257	0.51
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2025/11/15	5,900,000	11,957.54	705,495,146	11,798.83	696,131,075	0.50
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2023/02/15	6,000,000	11,482.27	688,936,222	11,454.16	687,249,626	0.49
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2023/05/15	5,800,000	11,467.99	665,143,952	11,436.86	663,337,996	0.48
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2022/03/15	5,800,000	11,338.26	657,619,125	11,314.90	656,264,662	0.47
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2027/05/15	5,500,000	12,111.06	666,108,768	11,843.80	651,409,424	0.47
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2023/02/28	5,500,000	11,628.00	639,540,532	11,594.27	637,685,272	0.46
18	フランス	国債証券	FRENCH GOVERNMENT BOND	2.500	2030/05/25	3,900,000	16,166.40	630,489,922	16,092.29	627,599,398	0.45
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.375	2027/09/30	6,000,000	10,683.94	641,036,845	10,428.79	625,727,732	0.45
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2024/08/15	5,300,000	11,870.32	629,127,288	11,787.15	624,719,231	0.45
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2022/04/30	5,500,000	11,305.39	621,796,663	11,285.50	620,702,534	0.45
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2022/03/31	5,500,000	11,273.39	620,036,543	11,256.09	619,085,129	0.44
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2023/08/15	5,300,000	11,714.06	620,845,680	11,672.55	618,645,318	0.44
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2023/09/30	5,200,000	11,851.15	616,260,294	11,800.56	613,629,203	0.44
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.750	2025/02/28	5,100,000	12,110.20	617,620,385	11,991.27	611,555,120	0.44
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2024/11/15	5,200,000	11,852.61	616,335,855	11,755.58	611,290,455	0.44
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2024/09/30	5,200,000	11,787.58	612,954,562	11,700.23	608,411,995	0.44
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.750	2028/02/15	5,000,000	12,411.19	620,559,823	12,088.14	604,407,406	0.43
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2029/02/15	5,000,000	12,352.81	617,640,710	11,986.95	599,347,616	0.43
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.750	2024/02/15	5,000,000	11,908.24	595,412,218	11,843.80	592,190,386	0.43
										投資比率：合計	15.24

（注1）評価金額の上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

（注3）2021年3月31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います。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（％）
----	----	---------

国債証券	-	99.12
合計		99.12

（注1）投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

（注2）2021年3月31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います。

#### 投資不動産物件

該当する事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当する事項はありません。

### （3）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

2021年3月31日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

計算期間・月末		純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
第1期	（2013年 2月20日）	分配付：	213,198,476	分配付：	1.0667
		分配落：	213,198,476	分配落：	1.0667
第2期	（2014年 2月20日）	分配付：	1,623,142,054	分配付：	1.1583
		分配落：	1,616,135,543	分配落：	1.1533
第3期	（2015年 2月20日）	分配付：	1,749,455,838	分配付：	1.2424
		分配落：	1,726,925,712	分配落：	1.2264
第4期	（2016年 2月22日）	分配付：	2,799,520,026	分配付：	1.1999
		分配落：	2,783,188,603	分配落：	1.1929
第5期	（2017年 2月20日）	分配付：	3,353,263,422	分配付：	1.2368
		分配落：	3,315,305,934	分配落：	1.2228
第6期	（2018年 2月20日）	分配付：	4,218,203,352	分配付：	1.2495
		分配落：	4,167,563,611	分配落：	1.2345
第7期	（2019年 2月20日）	分配付：	4,251,424,588	分配付：	1.2434
		分配落：	4,213,813,566	分配落：	1.2324
第8期	（2020年 2月20日）	分配付：	4,636,953,719	分配付：	1.2790
		分配落：	4,582,572,120	分配落：	1.2640
第9期	（2021年 2月22日）	分配付：	4,734,124,014	分配付：	1.2791
		分配落：	4,697,113,247	分配落：	1.2691
2020年 3月末日			4,514,229,674		1.2328
4月末日			4,537,743,254		1.2383
5月末日			4,593,764,439		1.2509
6月末日			4,618,526,969		1.2557
7月末日			4,642,012,039		1.2605
8月末日			4,667,488,562		1.2670
9月末日			4,678,330,047		1.2681
10月末日			4,637,742,384		1.2553
11月末日			4,703,738,207		1.2739
12月末日			4,734,609,999		1.2813
2021年 1月末日			4,724,893,479		1.2767
2月末日			4,706,796,699		1.2624
3月末日			4,766,498,135		1.2772

## 【分配の推移】

	計算期間	一口当たりの分配金
第1期	自2012年 3月 9日 至2013年 2月20日	0.0000円
第2期	自2013年 2月21日 至2014年 2月20日	0.0050円
第3期	自2014年 2月21日 至2015年 2月20日	0.0160円
第4期	自2015年 2月21日 至2016年 2月22日	0.0070円
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	0.0140円
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	0.0150円
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	0.0110円
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	0.0150円
第9期	自2020年 2月21日 至2021年 2月22日	0.0100円

## 【収益率の推移】

	計算期間	収益率
第1期	自2012年 3月 9日 至2013年 2月20日	6.7%
第2期	自2013年 2月21日 至2014年 2月20日	8.6%
第3期	自2014年 2月21日 至2015年 2月20日	7.7%
第4期	自2015年 2月21日 至2016年 2月22日	2.2%
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	3.7%
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	2.2%
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	0.7%
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	3.8%
第9期	自2020年 2月21日 至2021年 2月22日	1.2%

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末の分配落基準価額（設定時は当初元本額）を控除した額を、前期末の分配落基準価額（同）で除して得た数に100を乗じて得た数です。

## （４）【設定及び解約の実績】

	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第1期	自2012年 3月 9日 至2013年 2月20日	199,976,258	109,100	199,867,158

第2期	自2013年 2月21日 至2014年 2月20日	1,202,700,140	1,264,903	1,401,302,395
第3期	自2014年 2月21日 至2015年 2月20日	12,384,800	5,554,258	1,408,132,937
第4期	自2015年 2月21日 至2016年 2月22日	932,006,609	7,079,090	2,333,060,456
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	468,679,521	90,490,774	2,711,249,203
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	757,459,918	92,726,355	3,375,982,766
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	128,819,369	85,618,294	3,419,183,841
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	271,844,830	65,588,688	3,625,439,983
第9期	自2020年 2月21日 至2021年 2月22日	129,832,227	54,195,439	3,701,076,771

(注1) 日本国外における設定、解約はありません。

(注2) 第1期の設定口数は、当初募集期間の設定口数を含みます。

## （参考情報）運用実績

(2021年3月31日現在)

## 基準価額・純資産の推移



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

## ＜基準価額・純資産総額＞

基準価額	12,772円
純資産総額	4,766百万円

## 分配の推移

決算期	分配金
第5期（2017年2月20日）	140円
第6期（2018年2月20日）	150円
第7期（2019年2月20日）	110円
第8期（2020年2月20日）	150円
第9期（2021年2月22日）	100円
設定来累計	930円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

## 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	投資銘柄 (上位3銘柄)	国/ 地域名	種類	業種	利率	償還日	投資 比率
日本債券 インデックス・マザーファンド	69.20%	第146回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.100%	2025/12/20	1.47%
		第145回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.100%	2025/09/20	1.31%
		第360回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	0.100%	2030/09/20	1.30%
外国株式 インデックス・オープン・ マザーファンド	5.72%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	—	—	3.97%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・ サービス	—	—	3.24%
		AMAZON COM INC	アメリカ	株式	小売	—	—	2.53%
日本株式 インデックス・マザーファンド	5.56%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	3.17%
		ソニー	日本	株式	電気機器	—	—	2.63%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	—	—	2.63%
外国債券 インデックス・マザー・ファンド	4.71%	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	1.625%	2022/11/15	0.81%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	2.000%	2022/11/30	0.76%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	2.000%	2025/02/15	0.67%

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

## 年間収益率の推移（暦年ベース）



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

※2012年のファンドとベンチマークの年間収益率は設定日から年末までで算出しています。

※2021年のファンドとベンチマークの年間収益率は年初から3月末までで算出しています。

※年間収益率の推移は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

※基準価額と同一基準のデータを取得できないため、設定時以前のベンチマークの収益率は記載していません。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

### 2【換金（解約）手続等】

- 1) 受益者（当ファンドの受益権を取得した者）は、自己に帰属する受益権につき、取得申込みを行った販売会社を通じ、委託会社に一部解約の実行の請求を行うことにより、当ファンドを換金することができます。
- 2) 当ファンドの換金申込みの申込受付締切時間は、原則として販売会社の営業日の午後3時までとし、この受付時刻を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。
- 3) 解約単位（換金単位）は、販売会社が定める単位にて受付けます。なお、1億円または1億口を超える大口の換金申込みには、制限を設けることがあります。
- 4) 解約価額（換金価額）は、換金申込受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を控除した価額です。換金価額は、販売会社または委託会社においてご確認いただけます。換金価額の照会



方法については、後記「3 資産管理等の概要（1）資産の評価 3）基準価額の公表」をご参照ください。

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

### 3 【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### 1）基準価額の算出方法

基準価額とは、算出日において、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入公社債を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法\*により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」）を、算出日における受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当りの価額で表示されます。

\* 一部償却原価法とは、残存期間1年以内の公社債等について適用するアキュムレーションまたはアモチゼーションによる評価をいいます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
投資信託証券	原則として、基準価額算出日の基準価額で評価します。ただし、上場している場合は、原則として、基準価額計算日の取引所の終値で評価します。
株式	原則として、基準価額計算日の取引所の終値で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日における以下のいずれかの価額で評価します。 日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値） 証券会社、銀行等の提示する価額 価格情報会社の提供する価額
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行います。

外国で取引されているものについては、原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日の終値等で評価します。

## 2) 基準価額の算出頻度

基準価額は原則として委託会社の営業日において日々算出されます。

## 3) 基準価額の公表

基準価額は、販売会社にてご確認いただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の紙面に、「AMC安定型」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

<照会先>

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

（受付時間：原則として委託会社の営業日午前9時～午後5時）

ホームページアドレス：www.ssga.com/jp

## (2) 【保管】

該当事項はありません。

## (3) 【信託期間】

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

## (4) 【計算期間】

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

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

## (5) 【その他】

## 1) 信託契約の解約

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

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

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

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

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

当ファンドに係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- (c) 上記(b)の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本(c)において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (d) 上記(b)の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行います。
- (e) 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- (f) 上記(b)から上記(e)までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (g) 上記(a)から上記(f)までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### 7) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### 8) 運用報告書の交付

毎決算時（毎年2月20日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日。）および償還時に、期中の運用経過等を記載した運用報告書を作成します。

- (a) 交付運用報告書は、知っている受益者に対して販売会社を通じて交付されます。
- (b) 運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページ（[www.ssga.com/jp](http://www.ssga.com/jp)）に掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、販売会社を通じて交付されます。

#### 9) 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 10) 関係法人との契約の更改に関する手続き等

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

### 4 【受益者の権利等】

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

#### 分配金請求権

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

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

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

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

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

#### 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

#### 一部解約実行請求権

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

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

#### 書面決議における議決権

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

#### 帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2020年2月21日から2021年2月22日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

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

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 (2020年 2月20日現在)	第9期 (2021年 2月22日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	1,752,015	562,108
コール・ローン	714,877,190	729,542,983
親投資信託受益証券	3,876,459,431	4,026,434,635
未収入金	63,000,000	-
<b>流動資産合計</b>	<b>4,656,088,636</b>	<b>4,756,539,726</b>
<b>資産合計</b>		
	<b>4,656,088,636</b>	<b>4,756,539,726</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払収益分配金	54,381,599	37,010,767
未払解約金	12,697	2,439,613
未払受託者報酬	1,257,910	1,314,096
未払委託者報酬	17,610,661	18,397,201
未払利息	1,973	1,992
その他未払費用	251,676	262,810
<b>流動負債合計</b>	<b>73,516,516</b>	<b>59,426,479</b>
<b>負債合計</b>		
	<b>73,516,516</b>	<b>59,426,479</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	1 3,625,439,983	1 3,701,076,771
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	957,132,137	996,036,476
(分配準備積立金)	252,048,259	267,726,376
<b>元本等合計</b>	<b>4,582,572,120</b>	<b>4,697,113,247</b>
<b>純資産合計</b>		
	<b>4,582,572,120</b>	<b>4,697,113,247</b>
<b>負債純資産合計</b>		
	<b>4,656,088,636</b>	<b>4,756,539,726</b>

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期 自 2019年 2月21日 至 2020年 2月20日	第9期 自 2020年 2月21日 至 2021年 2月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	204,033,213	95,775,204
営業収益合計	204,033,213	95,775,204
営業費用		
支払利息	642,813	700,944
受託者報酬	2,410,833	2,565,799
委託者報酬	33,751,482	35,921,004
その他費用	493,489	526,544
営業費用合計	37,298,617	39,714,291
営業利益又は営業損失（ ）	166,734,596	56,060,913
経常利益又は経常損失（ ）	166,734,596	56,060,913
当期純利益又は当期純損失（ ）	166,734,596	56,060,913
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	1,104,368	282,005
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	794,629,725	957,132,137
剰余金増加額又は欠損金減少額	66,494,091	33,843,302
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	66,494,091	33,843,302
剰余金減少額又は欠損金増加額	15,240,308	14,271,114
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	15,240,308	14,271,114
分配金	1 54,381,599	1 37,010,767
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	957,132,137	996,036,476



## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間 2021年2月20日が休日のため、当計算期間は2020年2月21日から2021年2月22日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	第8期 (2020年 2月20日現在)	第9期 (2021年 2月22日現在)
1 期首元本額	3,419,183,841円	3,625,439,983円
期中追加設定元本額	271,844,830円	129,832,227円
期中一部解約元本額	65,588,688円	54,195,439円
2 受益権の総数	3,625,439,983口	3,701,076,771口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第8期 自 2019年 2月21日 至 2020年 2月20日	第9期 自 2020年 2月21日 至 2021年 2月22日
1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(57,990,427円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(99,914,483円)、収益調整金(705,083,878円)及び分配準備積立金(148,524,948円)より分配対象収益は1,011,513,736円(1万口当たり2,790円)であり、うち54,381,599円(1万口当たり150円)を分配金額としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(35,908,145円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(20,434,773円)、収益調整金(728,310,100円)及び分配準備積立金(248,394,225円)より分配対象収益は1,033,047,243円(1万口当たり2,791円)であり、うち37,010,767円(1万口当たり100円)を分配金額としております。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第8期 (2020年 2月20日現在)	第9期 (2021年 2月22日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありませ ん。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。	同左
---------------------------	---	----

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	第8期 （2020年 2月20日現在）	第9期 （2021年 2月22日現在）
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額	当計算期間の損益に 含まれた評価差額
親投資信託受益証券	187,249,744	62,348,719
合計	187,249,744	62,348,719

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

該当する事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当する事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第8期 （2020年 2月20日現在）	第9期 （2021年 2月22日現在）
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2640円 （12,640円）	1.2691円 （12,691円）

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・オープン・マザーファンド	73,584,902	258,444,892	
	外国債券インデックス・マザー・ファンド	88,566,395	220,220,341	
	日本株式インデックス・マザー・ファンド	77,885,317	260,565,328	
	日本債券インデックス・マザー・ファンド	2,571,141,239	3,287,204,074	
合計		2,811,177,853	4,026,434,635	

（注）親投資信託受益証券における券面総額は、証券数です。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当する事項はありません。

#### <参考>

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

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「日本株式インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### (1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2020年 2月20日現在)	(2021年 2月22日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		5,512,468	326,844
コール・ローン		2,249,260,101	424,200,395
株式		110,153,135,760	102,630,639,840
派生商品評価勘定		407,880	19,894,820
未収入金		56,065,000	
未収配当金		198,374,640	138,709,857
前払金		76,040,000	
差入委託証拠金		72,960,000	24,000,000
流動資産合計		112,811,755,849	103,237,771,756
資産合計		112,811,755,849	103,237,771,756
負債の部			
流動負債			
前受金			17,025,000
派生商品評価勘定		66,668,200	511,320
未払解約金		1,520,000	54,490,000
未払利息		6,209	1,158
その他未払費用		2,118	95
流動負債合計		68,196,527	72,027,573
負債合計		68,196,527	72,027,573
純資産の部			
元本等			
元本	1	39,957,438,054	30,837,565,787
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		72,786,121,268	72,328,178,396
元本等合計		112,743,559,322	103,165,744,183
純資産合計		112,743,559,322	103,165,744,183
負債純資産合計		112,811,755,849	103,237,771,756

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

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	(2020年 2月20日現在)	(2021年 2月22日現在)
1 期首元本額	34,028,428,491円	39,957,438,054円
期中追加設定元本額	16,615,151,052円	4,496,542,874円
期中一部解約元本額	10,686,141,489円	13,616,415,141円
元本の内訳		
ファンド名		
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	78,934,572円	77,885,317円
日本株式インデックス・ファンド（年金1）＜適格機関投資家限定＞	1,043,143,411円	966,270,156円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	2,410,204円	1,800,931円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	78,349,730円	59,201,981円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	113,663円	108,056円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	4,296,283円	3,085,321円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	8,286,777円	10,424,368円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	6,359,391,050円	5,334,743,584円
日本株式インデックス・ファンドVA1＜適格機関投資家限定＞	351,598,400円	305,896,023円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	5,395,183円	2,807,158円

バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	1,034,208,209円	806,857,855円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	698,343,954円	572,925,014円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	53,601,698円	42,340,565円
日本株式インデックス・ファンドM<適格機関投資家限定>	209,506,257円	76,543,985円
日本株式インデックス・ファンドS<適格機関投資家限定>	14,021,767,576円	8,413,872,369円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	202,362,083円	156,975,461円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	2,197,395,012円	1,923,669,346円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	385,628,566円	310,112,500円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	1,711,718,779円	1,384,202,736円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	52,946,881円	42,681,797円
日本株式インデックス・ファンドF O F<適格機関投資家限定>	4,582,230,110円	4,358,069,504円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	16,719,154円	15,785,928円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	17,890,351円	17,029,816円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	10,382,223円	9,311,206円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	481,080,971円	485,099,134円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	2,315,027円	1,890,835円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	3,110,323円	2,455,575円
日本株式インデックス・ファンドVA2<適格機関投資家限定>	1,543,140,525円	283,343,486円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	319,559,278円	262,441,846円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	1,409,047,064円	1,254,941,539円
T a dリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド(ステイブル)年金<適格機関投資家限定>	82,260,796円	76,579,661円
フレックス資産配分戦略ファンド<適格機関投資家限定>	210,197,995円	195,842,569円
T a dリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド(ステイブル)<適格機関投資家限定>	72,629,322円	42,010,156円
ステート・ストリート日本株式インデックス・オープン	2,430,319,428円	2,812,488,573円

世界バランス40VA<適格機関投資家限定>	円	7,210,502円
世界バランス60VA<適格機関投資家限定>	円	48,644,371円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	564,205円	531,262円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	249,059,389円	447,501,796円
グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	20,669,489円	17,116,080円
グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	6,864,116円	6,867,425円
計	39,957,438,054円	30,837,565,787円
2 受益権の総数	39,957,438,054口	30,837,565,787口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(3) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク等の市場リスクに晒されております。</p> <p>デリバティブ取引には、ファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、ファンドの効率的な運用に資することを目的に利用している株価指数先物取引があり、株価変動リスクに晒されております。</p>
3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	（2020年 2月20日現在）	（2021年 2月22日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありませ	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。  (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。  (3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左  (2)有価証券 売買目的有価証券 同左  (3)デリバティブ取引 同左
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。 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。	同左

## （有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	（2020年 2月20日現在）	（2021年 2月22日現在）
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,101,286,772	22,250,182,487
合計	2,101,286,772	22,250,182,487

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



## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

(単位：円)

区 分	種 類	(2020年 2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX (先物)	2,616,720,000		2,550,560,000	66,160,000
	合 計	2,616,720,000		2,550,560,000	66,160,000

(単位：円)

区 分	種 類	(2021年 2月22日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX (先物)	465,475,000		484,875,000	19,400,000
	合 計	465,475,000		484,875,000	19,400,000

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	(2020年 2月20日現在)	(2021年 2月22日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8216円 (28,216円)	3.3455円 (33,455円)

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株式

銘 柄	株数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	1,800	3,050.00	5,490,000	
日本水産	52,400	502.00	26,304,800	
マルハニチロ	7,600	2,480.00	18,848,000	
ハウスイ	600	963.00	577,800	
雪国まいたけ	3,200	1,768.00	5,657,600	

カネコ種苗	1,800	1,597.00	2,874,600
サカタのタネ	6,200	3,880.00	24,056,000
ホクト	4,000	2,145.00	8,580,000
ホクリヨウ	700	679.00	475,300
ヒノキヤグループ	1,500	2,191.00	3,286,500
ショーボンドホールディングス	7,500	4,730.00	35,475,000
ミライト・ホールディングス	18,200	1,712.00	31,158,400
タマホーム	2,800	1,898.00	5,314,400
サンヨーホームズ	600	818.00	490,800
日本アクア	2,500	632.00	1,580,000
ファーストコーポレーション	1,700	698.00	1,186,600
ベステラ	1,100	1,749.00	1,923,900
TATERU	12,500	179.00	2,237,500
キャンディル	600	541.00	324,600
スペースバリューホールディングス	6,300	814.00	5,128,200
住石ホールディングス	11,700	124.00	1,450,800
日鉄鉱業	1,200	5,990.00	7,188,000
三井松島ホールディングス	2,300	932.00	2,143,600
国際石油開発帝石	193,400	776.00	150,078,400
石油資源開発	6,800	2,239.00	15,225,200
K&Oエナジーグループ	2,500	1,464.00	3,660,000
ダイセキ環境ソリューション	1,200	846.00	1,015,200
第一カッター興業	1,600	1,307.00	2,091,200
明豊ファシリティワークス	1,700	630.00	1,071,000
安藤・間	31,200	782.00	24,398,400
東急建設	15,200	544.00	8,268,800
コムシスホールディングス	18,600	3,250.00	60,450,000
ビーアールホールディングス	5,600	684.00	3,830,400
高松コンストラクショングループ	3,200	2,127.00	6,806,400
東建コーポレーション	1,600	8,570.00	13,712,000
ソネック	700	832.00	582,400
ヤマウラ	2,600	953.00	2,477,800
大成建設	37,700	3,790.00	142,883,000
大林組	121,500	936.00	113,724,000
清水建設	113,500	817.00	92,729,500
飛鳥建設	3,400	1,119.00	3,804,600
長谷工コーポレーション	39,700	1,354.00	53,753,800
松井建設	4,700	716.00	3,365,200
銭高組	600	4,575.00	2,745,000
鹿島建設	88,800	1,421.00	126,184,800
不動テトラ	3,100	1,805.00	5,595,500
大末建設	1,600	926.00	1,481,600
鉄建建設	2,600	1,966.00	5,111,600
西松建設	9,300	2,596.00	24,142,800
三井住友建設	29,100	460.00	13,386,000
大豊建設	3,000	3,680.00	11,040,000
前田建設工業	30,300	998.00	30,239,400
佐田建設	2,600	427.00	1,110,200
ナカノフドー建設	3,500	371.00	1,298,500

奥村組	5,700	2,682.00	15,287,400
東鉄工業	5,200	2,648.00	13,769,600
イチケン	800	2,093.00	1,674,400
富士ピー・エス	2,200	609.00	1,339,800
浅沼組	1,300	4,530.00	5,889,000
戸田建設	50,300	743.00	37,372,900
熊谷組	5,600	2,800.00	15,680,000
北野建設	900	2,478.00	2,230,200
植木組	600	2,910.00	1,746,000
矢作建設工業	5,300	847.00	4,489,100
ピーエス三菱	3,800	685.00	2,603,000
日本ハウスホールディングス	9,000	336.00	3,024,000
大東建託	13,300	12,350.00	164,255,000
新日本建設	5,100	846.00	4,314,600
N I P P O	10,000	2,832.00	28,320,000
東亜道路工業	700	4,140.00	2,898,000
前田道路	7,400	2,003.00	14,822,200
日本道路	1,200	8,010.00	9,612,000
東亜建設工業	3,700	2,170.00	8,029,000
日本国土開発	11,700	558.00	6,528,600
若築建設	2,500	1,277.00	3,192,500
東洋建設	13,400	553.00	7,410,200
五洋建設	48,100	795.00	38,239,500
世紀東急工業	5,700	890.00	5,073,000
福田組	1,400	5,020.00	7,028,000
日本ドライケミカル	1,100	1,582.00	1,740,200
住友林業	28,500	2,099.00	59,821,500
日本基礎技術	3,900	498.00	1,942,200
巴コーポレーション	5,800	397.00	2,302,600
大和ハウス工業	112,000	3,200.00	358,400,000
ライト工業	6,900	1,647.00	11,364,300
積水ハウス	131,800	2,081.00	274,275,800
日特建設	3,600	785.00	2,826,000
北陸電気工事	2,400	1,192.00	2,860,800
ユアテック	6,800	816.00	5,548,800
日本リーテック	2,500	2,494.00	6,235,000
四電工	700	2,804.00	1,962,800
中電工	4,900	2,211.00	10,833,900
関電工	17,200	884.00	15,204,800
きんでん	26,100	1,776.00	46,353,600
東京エネシス	3,900	918.00	3,580,200
トーエネック	1,200	3,735.00	4,482,000
住友電設	3,400	2,434.00	8,275,600
日本電設工業	6,600	1,932.00	12,751,200
協和エクシオ	18,400	2,722.00	50,084,800
新日本空調	3,200	2,270.00	7,264,000
日本工営	2,500	2,891.00	7,227,500
九電工	8,500	3,390.00	28,815,000
三機工業	8,500	1,296.00	11,016,000

日揮ホールディングス	40,400	1,355.00	54,742,000
中外炉工業	1,400	1,744.00	2,441,600
ヤマト	4,500	669.00	3,010,500
太平電業	2,900	2,663.00	7,722,700
高砂熱学工業	9,200	1,596.00	14,683,200
三晃金属工業	500	3,095.00	1,547,500
N E C ネットエスアイ	12,500	1,889.00	23,612,500
朝日工業社	900	3,010.00	2,709,000
明星工業	7,700	806.00	6,206,200
大気社	5,900	2,947.00	17,387,300
ダイダン	2,900	2,809.00	8,146,100
日比谷総合設備	3,900	1,878.00	7,324,200
ニッポン	11,300	1,609.00	18,181,700
日清製粉グループ本社	43,900	1,727.00	75,815,300
日東富士製粉	300	6,860.00	2,058,000
昭和産業	3,500	3,245.00	11,357,500
鳥越製粉	3,400	859.00	2,920,600
中部飼料	4,700	1,443.00	6,782,100
フィード・ワン	5,100	914.00	4,661,400
東洋精糖	900	1,225.00	1,102,500
日本甜菜製糖	2,000	1,685.00	3,370,000
三井製糖	3,400	1,938.00	6,589,200
塩水港精糖	3,900	228.00	889,200
日新製糖	1,800	1,870.00	3,366,000
L I F U L L	12,700	422.00	5,359,400
ミクシィ	7,000	2,747.00	19,229,000
ジェイエイシーリクルートメント	2,400	1,665.00	3,996,000
日本M & Aセンター	30,300	6,090.00	184,527,000
メンバーズ	1,300	2,785.00	3,620,500
中広	500	343.00	171,500
U T グループ	5,800	3,285.00	19,053,000
アイティメディア	1,400	1,908.00	2,671,200
タケエイ	4,100	1,272.00	5,215,200
E・Jホールディングス	1,600	997.00	1,595,200
ビーネックスグループ	4,600	1,407.00	6,472,200
コシダカホールディングス	8,700	551.00	4,793,700
アルトナー	600	838.00	502,800
パソナグループ	4,000	1,923.00	7,692,000
C D S	1,000	1,389.00	1,389,000
リンクアンドモチベーション	7,400	531.00	3,929,400
G C A	5,100	796.00	4,059,600
エス・エム・エス	12,500	3,700.00	46,250,000
サニーサイドアップグループ	800	744.00	595,200
パーソルホールディングス	37,000	2,169.00	80,253,000
リニカル	1,900	792.00	1,504,800
クックパッド	12,700	311.00	3,949,700
エスクリ	1,200	398.00	477,600
アイ・ケイ・ケイ	2,500	610.00	1,525,000
森永製菓	9,100	3,980.00	36,218,000

中村屋	1,000	3,970.00	3,970,000
江崎グリコ	10,700	4,480.00	47,936,000
名糖産業	1,800	1,515.00	2,727,000
井村屋グループ	2,200	2,516.00	5,535,200
不二家	2,600	2,278.00	5,922,800
山崎製パン	29,100	1,887.00	54,911,700
第一屋製パン	500	971.00	485,500
モロゾフ	600	5,650.00	3,390,000
亀田製菓	2,200	4,810.00	10,582,000
寿スピリッツ	3,700	6,820.00	25,234,000
カルビー	17,700	2,903.00	51,383,100
森永乳業	7,200	4,830.00	34,776,000
六甲バター	2,500	1,738.00	4,345,000
ヤクルト本社	26,700	5,530.00	147,651,000
明治ホールディングス	25,700	6,970.00	179,129,000
雪印メグミルク	9,300	2,189.00	20,357,700
プリマハム	5,400	3,340.00	18,036,000
日本ハム	14,800	4,665.00	69,042,000
林兼産業	1,200	626.00	751,200
丸大食品	4,100	1,698.00	6,961,800
S Foods	3,100	3,465.00	10,741,500
柿安本店	1,300	2,724.00	3,541,200
伊藤ハム米久ホールディングス	24,900	745.00	18,550,500
学情	1,400	1,416.00	1,982,400
スタジオアリス	2,100	2,139.00	4,491,900
クロスキャット	1,200	1,144.00	1,372,800
シミックホールディングス	2,000	1,717.00	3,434,000
エプコ	1,100	926.00	1,018,600
システナ	13,500	1,947.00	26,284,500
N J S	800	1,883.00	1,506,400
デジタルアーツ	1,900	10,990.00	20,881,000
日鉄ソリューションズ	5,700	3,225.00	18,382,500
総合警備保障	14,700	4,970.00	73,059,000
キューブシステム	2,200	1,172.00	2,578,400
いちご	42,100	338.00	14,229,800
エイジア	700	1,730.00	1,211,000
日本駐車場開発	37,100	142.00	5,268,200
コア	1,700	1,541.00	2,619,700
カカクコム	27,300	3,530.00	96,369,000
アイロムグループ	1,400	1,932.00	2,704,800
セントケア・ホールディング	2,900	940.00	2,726,000
サイネックス	400	722.00	288,800
ルネサンス	2,400	1,174.00	2,817,600
ディップ	5,000	3,025.00	15,125,000
S B Sホールディングス	2,800	2,541.00	7,114,800
デジタルホールディングス	2,500	1,971.00	4,927,500
新日本科学	3,900	650.00	2,535,000
ツクイホールディングス	8,500	924.00	7,854,000
キャリアデザインセンター	1,300	942.00	1,224,600

ベネフィット・ワン	13,400	2,931.00	39,275,400
エムスリー	65,200	8,800.00	573,760,000
ツカダ・グローバルホールディング	2,800	354.00	991,200
プラス	200	498.00	99,600
アウトソーシング	21,100	1,483.00	31,291,300
ウェルネット	4,100	529.00	2,168,900
ワールドホールディングス	1,400	2,465.00	3,451,000
ディー・エヌ・エー	15,600	2,253.00	35,146,800
博報堂D Yホールディングス	51,400	1,818.00	93,445,200
ぐるなび	6,300	637.00	4,013,100
タカミヤ	4,200	510.00	2,142,000
ジャパンベストレスキューシステム	3,400	886.00	3,012,400
ファンコミュニケーションズ	10,000	406.00	4,060,000
ライク	1,400	1,966.00	2,752,400
ビジネス・ブレークスルー	1,800	435.00	783,000
エスプール	9,400	1,018.00	9,569,200
W D Bホールディングス	1,700	2,700.00	4,590,000
手間いらず	300	5,260.00	1,578,000
ティア	2,300	529.00	1,216,700
C D G	400	1,559.00	623,600
アドウェイズ	4,500	965.00	4,342,500
パリュウコマース	2,500	3,080.00	7,700,000
インフォマート	37,400	1,048.00	39,195,200
サッポロホールディングス	13,200	2,244.00	29,620,800
アサヒグループホールディングス	85,000	4,548.00	386,580,000
キリンホールディングス	165,000	2,115.00	348,975,000
宝ホールディングス	28,800	1,499.00	43,171,200
オエノンホールディングス	11,900	400.00	4,760,000
養命酒製造	1,300	1,924.00	2,501,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	29,700	1,832.00	54,410,400
サントリー食品インターナショナル	26,000	3,770.00	98,020,000
ダイドーグループホールディングス	2,000	5,410.00	10,820,000
伊藤園	11,800	6,310.00	74,458,000
キーコーヒー	3,800	2,157.00	8,196,600
ユニカフェ	1,000	1,004.00	1,004,000
ジャパンフーズ	800	1,264.00	1,011,200
日清オイリオグループ	5,000	3,195.00	15,975,000
不二製油グループ本社	9,500	3,190.00	30,305,000
かどや製油	500	4,095.00	2,047,500
J - オイルミルズ	2,000	3,805.00	7,610,000
ローソン	9,600	5,150.00	49,440,000
サンエー	3,200	4,220.00	13,504,000
カワチ薬品	2,900	2,974.00	8,624,600
エービーシー・マート	5,900	6,130.00	36,167,000
ハードオフコーポレーション	1,700	808.00	1,373,600
高千穂交易	1,400	1,214.00	1,699,600
アスクル	3,300	3,735.00	12,325,500
ゲオホールディングス	5,000	1,172.00	5,860,000
アダストリア	5,200	2,056.00	10,691,200

ジーフット	3,200	419.00	1,340,800
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	800	424.00	339,200
オルパヘルスケアホールディングス	500	1,560.00	780,000
伊藤忠食品	900	5,270.00	4,743,000
くら寿司	2,200	7,640.00	16,808,000
キャンドウ	1,800	1,915.00	3,447,000
エレマテック	3,500	988.00	3,458,000
アイケイ	800	837.00	669,600
バルグループホールディングス	3,800	1,640.00	6,232,000
JALUX	1,100	1,685.00	1,853,500
エディオン	17,400	1,076.00	18,722,400
あらた	3,000	4,635.00	13,905,000
サーラコーポレーション	7,600	584.00	4,438,400
ワッツ	1,800	846.00	1,522,800
トーメンデバイス	700	3,970.00	2,779,000
ハローズ	1,400	3,000.00	4,200,000
J Pホールディングス	11,300	293.00	3,310,900
フジオフードグループ本社	3,100	1,296.00	4,017,600
あみやき亭	900	2,934.00	2,640,600
東京エレクトロン デバイス	1,400	3,915.00	5,481,000
ひらまつ	7,900	180.00	1,422,000
フィールズ	3,500	615.00	2,152,500
双日	210,500	281.00	59,150,500
アルフレッサ ホールディングス	39,500	2,171.00	85,754,500
大黒天物産	900	6,170.00	5,553,000
ハニーズホールディングス	3,300	1,033.00	3,408,900
ファーマライズホールディングス	800	782.00	625,600
キッコーマン	28,000	7,400.00	207,200,000
味の素	92,300	2,267.50	209,290,250
キューピー	21,600	2,394.00	51,710,400
ハウス食品グループ本社	14,500	3,720.00	53,940,000
カゴメ	15,900	3,340.00	53,106,000
焼津水産化学工業	2,000	993.00	1,986,000
アリアケジャパン	3,500	6,800.00	23,800,000
ピエトロ	500	1,780.00	890,000
エバラ食品工業	1,100	2,647.00	2,911,700
やまみ	200	2,105.00	421,000
ニチレイ	18,500	2,807.00	51,929,500
横浜冷凍	9,900	901.00	8,919,900
東洋水産	20,000	4,615.00	92,300,000
イートアンドホールディングス	1,500	1,940.00	2,910,000
大冷	700	1,962.00	1,373,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,500	957.00	2,392,500
日清食品ホールディングス	15,200	8,340.00	126,768,000
永谷園ホールディングス	1,900	2,358.00	4,480,200
一正蒲鉾	1,700	1,157.00	1,966,900
フジッコ	4,200	2,003.00	8,412,600
ロック・フィールド	4,100	1,555.00	6,375,500
日本たばこ産業	208,600	1,936.50	403,953,900

ケンコーマヨネーズ	2,100	2,024.00	4,250,400
わらべや日洋ホールディングス	2,500	1,716.00	4,290,000
なとり	2,100	2,019.00	4,239,900
イフジ産業	700	936.00	655,200
ピクルスコーポレーション	800	3,580.00	2,864,000
北の達人コーポレーション	13,400	636.00	8,522,400
ユーグレナ	16,700	990.00	16,533,000
スター・マイカ・ホールディングス	2,300	1,194.00	2,746,200
S R Eホールディングス	400	4,910.00	1,964,000
A Dワークスグループ	8,100	157.00	1,271,700
片倉工業	5,000	1,391.00	6,955,000
グンゼ	2,800	3,790.00	10,612,000
ヒューリック	81,000	1,199.00	97,119,000
神栄	400	1,498.00	599,200
ラサ商事	2,300	913.00	2,099,900
アルペン	2,900	2,320.00	6,728,000
ハブ	1,300	703.00	913,900
ラクーンホールディングス	1,800	2,231.00	4,015,800
クオールホールディングス	5,500	1,445.00	7,947,500
アルコニックス	4,000	1,633.00	6,532,000
神戸物産	26,300	2,924.00	76,901,200
ソリトンシステムズ	1,800	1,862.00	3,351,600
ジンスホールディングス	2,000	7,320.00	14,640,000
ビックカメラ	22,600	1,184.00	26,758,400
D C Mホールディングス	23,300	1,101.00	25,653,300
ベッパーフードサービス	4,100	298.00	1,221,800
ハイパー	600	522.00	313,200
M o n o t a R O	27,100	6,860.00	185,906,000
東京一番フーズ	700	596.00	417,200
D Dホールディングス	1,600	686.00	1,097,600
あい ホールディングス	5,400	2,041.00	11,021,400
ディーブイエックス	1,200	1,044.00	1,252,800
きちりホールディングス	1,200	608.00	729,600
アークランドサービスホールディングス	3,100	2,146.00	6,652,600
J . フロント リテイリング	45,500	1,012.00	46,046,000
ドトール・日レスホールディングス	5,400	1,655.00	8,937,000
マツモトキヨシホールディングス	15,800	4,280.00	67,624,000
ブロンコビリー	2,000	2,319.00	4,638,000
Z O Z O	22,400	3,590.00	80,416,000
トレジャー・ファクトリー	1,200	808.00	969,600
物語コーポレーション	1,000	12,300.00	12,300,000
ココカラファイン	3,400	7,440.00	25,296,000
三越伊勢丹ホールディングス	66,600	732.00	48,751,200
東洋紡	14,900	1,342.00	19,995,800
ユニチカ	10,900	446.00	4,861,400
富士紡ホールディングス	1,800	4,290.00	7,722,000
日清紡ホールディングス	23,600	804.00	18,974,400
倉敷紡績	3,700	1,920.00	7,104,000
ダイワボウホールディングス	3,200	8,130.00	26,016,000



シキボウ	2,300	1,013.00	2,329,900
日東紡績	5,700	4,390.00	25,023,000
トヨタ紡織	11,200	1,733.00	19,409,600
マクニカ・富士エレホールディングス	9,100	2,111.00	19,210,100
H a m e e	1,400	1,672.00	2,340,800
ラクト・ジャパン	1,600	2,643.00	4,228,800
ウエルシアホールディングス	20,100	3,615.00	72,661,500
クリエイトSDホールディングス	5,600	3,395.00	19,012,000
グリムス	800	1,752.00	1,401,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	7,100	790.00	5,609,000
八洲電機	3,400	951.00	3,233,400
メディアスホールディングス	2,300	841.00	1,934,300
レスターホールディングス	3,900	2,055.00	8,014,500
ジュテックホールディングス	800	1,057.00	845,600
丸善CHIホールディングス	4,600	379.00	1,743,400
大光	1,800	671.00	1,207,800
OCHIホールディングス	1,200	1,347.00	1,616,400
TOKAIホールディングス	18,400	956.00	17,590,400
黒谷	700	789.00	552,300
ミサワ	500	667.00	333,500
ティーライフ	500	1,223.00	611,500
Cominix	800	772.00	617,600
エー・ピーホールディングス	800	463.00	370,400
三洋貿易	3,700	1,078.00	3,988,600
チムニー	1,300	1,400.00	1,820,000
シュッピン	3,000	1,103.00	3,309,000
ビューティガレージ	700	2,531.00	1,771,700
オイシックス・ラ・大地	3,700	2,921.00	10,807,700
ウイン・パートナーズ	2,700	1,165.00	3,145,500
ネクステージ	6,400	1,721.00	11,014,400
ジョイフル本田	11,100	1,415.00	15,706,500
鳥貴族ホールディングス	1,400	1,759.00	2,462,600
ホットランド	2,800	1,227.00	3,435,600
すかいらーくホールディングス	42,700	1,638.00	69,942,600
SFPホールディングス	2,500	1,446.00	3,615,000
綿半ホールディングス	3,000	1,262.00	3,786,000
日本毛織	12,400	958.00	11,879,200
ダイトウボウ	5,000	106.00	530,000
トーア紡コーポレーション	1,400	479.00	670,600
ダイドーリミテッド	5,900	190.00	1,121,000
ヨシックス	600	2,220.00	1,332,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	11,000	1,127.00	12,397,000
三栄建築設計	1,600	1,793.00	2,868,800
野村不動産ホールディングス	23,200	2,415.00	56,028,000
三重交通グループホールディングス	7,500	487.00	3,652,500
サムティ	5,400	1,771.00	9,563,400
ディア・ライフ	5,300	428.00	2,268,400
コーセーアールイー	1,300	592.00	769,600
日本商業開発	2,400	1,650.00	3,960,000

プレサンスコーポレーション	6,200	1,503.00	9,318,600
フィル・カンパニー	700	2,076.00	1,453,200
THEグローバル社	1,700	268.00	455,600
ハウスコム	400	1,301.00	520,400
日本管理センター	2,200	1,222.00	2,688,400
サンセイランディック	1,600	768.00	1,228,800
エストラスト	600	711.00	426,600
フージャースホールディングス	7,500	692.00	5,190,000
オープンハウス	12,000	4,100.00	49,200,000
東急不動産ホールディングス	103,800	678.00	70,376,400
飯田グループホールディングス	31,800	2,449.00	77,878,200
イーグランド	500	866.00	433,000
ムゲンエステート	2,900	488.00	1,415,200
帝国繊維	4,200	2,275.00	9,555,000
日本コークス工業	35,300	104.00	3,671,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,900	1,264.00	2,401,600
ミタチ産業	1,700	601.00	1,021,700
B E E N O S	1,700	2,613.00	4,442,100
あさひ	2,800	1,514.00	4,239,200
日本調剤	2,300	1,595.00	3,668,500
コスモス薬品	3,800	15,860.00	60,268,000
シップヘルスケアホールディングス	6,700	5,880.00	39,396,000
トーエル	1,900	831.00	1,578,900
ソフトクリエイティブホールディングス	1,600	2,498.00	3,996,800
オンリー	500	466.00	233,000
セブン&アイ・ホールディングス	149,300	4,202.00	627,358,600
クリエイティブ・レストランツ・ホールディング	20,400	840.00	17,136,000
明治電機工業	1,100	1,413.00	1,554,300
ツルハホールディングス	8,300	14,110.00	117,113,000
デリカフーズホールディングス	1,400	626.00	876,400
スターティアホールディングス	1,000	1,067.00	1,067,000
サンマルクホールディングス	3,300	1,626.00	5,365,800
フェリシモ	800	1,354.00	1,083,200
トリドールホールディングス	9,400	1,505.00	14,147,000
帝人	35,600	1,873.00	66,678,800
東レ	274,700	706.80	194,157,960
クラレ	59,700	1,196.00	71,401,200
旭化成	251,600	1,147.50	288,711,000
サカイオーベックス	1,100	2,851.00	3,136,100
T O K Y O B A S E	3,300	722.00	2,382,600
稲葉製作所	2,100	1,427.00	2,996,700
宮地エンジニアリンググループ	1,300	2,221.00	2,887,300
トーカロ	10,600	1,403.00	14,871,800
アルファC o	1,300	1,096.00	1,424,800
S U M C O	49,000	2,520.00	123,480,000
川田テクノロジーズ	800	4,680.00	3,744,000
R S T e c h n o l o g i e s	1,200	6,330.00	7,596,000
ジェイテックコーポレーション	300	3,595.00	1,078,500
信和	1,900	767.00	1,457,300

ビーロット	2,400	630.00	1,512,000
ファーストブラザーズ	1,000	972.00	972,000
ハウズドゥ	2,200	1,170.00	2,574,000
シーアールイー	1,200	1,236.00	1,483,200
プロパティエージェント	800	1,596.00	1,276,800
ケイアイスター不動産	1,200	3,675.00	4,410,000
アグレ都市デザイン	400	765.00	306,000
グッドコムアセット	2,000	1,410.00	2,820,000
ジェイ・エス・ビー	800	3,470.00	2,776,000
テンポイノベーション	1,200	958.00	1,149,600
グローバル・リンク・マネジメント	300	839.00	251,700
住江織物	1,000	2,048.00	2,048,000
日本フェルト	2,000	444.00	888,000
イチカワ	600	1,328.00	796,800
エコナックホールディングス	9,000	99.00	891,000
日東製網	400	1,569.00	627,600
芦森工業	800	1,031.00	824,800
アツギ	3,600	546.00	1,965,600
ウイルプラスホールディングス	400	1,090.00	436,000
JMホールディングス	2,800	2,005.00	5,614,000
コメダホールディングス	8,300	1,938.00	16,085,400
サツドラホールディングス	500	2,033.00	1,016,500
アレンザホールディングス	2,000	1,376.00	2,752,000
串カツ田中ホールディングス	1,200	1,900.00	2,280,000
パロックジャパンリミテッド	3,200	817.00	2,614,400
クスリのアオキホールディングス	3,400	8,840.00	30,056,000
ダイニック	1,400	801.00	1,121,400
共和レザー	2,500	667.00	1,667,500
ピーバンドットコム	400	863.00	345,200
力の源ホールディングス	2,400	624.00	1,497,600
スシログローバルホールディングス	20,900	4,275.00	89,347,500
アセンテック	1,000	1,689.00	1,689,000
セーレン	9,300	1,909.00	17,753,700
ソトー	1,600	830.00	1,328,000
東海染工	800	1,128.00	902,400
小松マテーレ	6,100	1,024.00	6,246,400
ワコールホールディングス	9,400	2,223.00	20,896,200
ホギメディカル	4,300	3,185.00	13,695,500
クラウディアホールディングス	1,300	294.00	382,200
T S Iホールディングス	12,600	278.00	3,502,800
マツオカコーポレーション	1,200	1,916.00	2,299,200
ワールド	5,300	1,381.00	7,319,300
T I S	38,000	2,264.00	86,032,000
J N Sホールディングス	2,100	624.00	1,310,400
電算システム	1,400	3,270.00	4,578,000
グリー	23,200	603.00	13,989,600
GMOペパボ	200	7,090.00	1,418,000
コーエーテクモホールディングス	7,800	6,370.00	49,686,000
三菱総合研究所	1,600	4,105.00	6,568,000

ボルテージ	900	578.00	520,200
電算	400	2,549.00	1,019,600
A G S	2,300	835.00	1,920,500
ファインデックス	3,500	1,222.00	4,277,000
ブレインパッド	1,000	5,080.00	5,080,000
K L a b	6,800	867.00	5,895,600
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	4,500	1,166.00	5,247,000
イーブックイニシアティブジャパン	600	2,262.00	1,357,200
ネクソン	95,900	3,490.00	334,691,000
アイスタイル	10,400	551.00	5,730,400
エムアップホールディングス	1,200	2,695.00	3,234,000
エイチーム	2,800	1,238.00	3,466,400
エニグモ	3,500	1,242.00	4,347,000
テクノスジャパン	2,800	693.00	1,940,400
e n i s h	2,000	537.00	1,074,000
コロブラ	12,400	910.00	11,284,000
オルトプラス	2,400	443.00	1,063,200
ブロードリーフ	18,700	513.00	9,593,100
クロス・マーケティンググループ	1,200	408.00	489,600
デジタルハーツホールディングス	2,100	1,461.00	3,068,100
システム情報	2,800	1,065.00	2,982,000
メディアドゥ	1,200	6,220.00	7,464,000
じげん	9,200	406.00	3,735,200
ブイキューブ	2,200	2,769.00	6,091,800
エンカレッジ・テクノロジー	500	610.00	305,000
サイバーリンクス	1,000	2,007.00	2,007,000
ディー・エル・イー	3,700	320.00	1,184,000
フィックスターズ	3,900	1,003.00	3,911,700
C A R T A H O L D I N G S	1,500	1,567.00	2,350,500
オブティム	2,000	3,180.00	6,360,000
セレス	1,300	4,355.00	5,661,500
S H I F T	1,700	14,750.00	25,075,000
特種東海製紙	2,300	4,735.00	10,890,500
ティーガイア	3,300	1,877.00	6,194,100
セック	600	2,822.00	1,693,200
日本アジアグループ	4,500	1,246.00	5,607,000
テクマトリックス	5,300	1,751.00	9,280,300
プロシップ	1,000	1,356.00	1,356,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	9,100	2,363.00	21,503,300
G M O ペイメントゲートウェイ	8,000	15,830.00	126,640,000
ザッパラス	1,600	464.00	742,400
システムリサーチ	1,100	1,842.00	2,026,200
インターネットイニシアティブ	10,100	2,311.00	23,341,100
さくらインターネット	3,900	681.00	2,655,900
ヴィンクス	1,400	1,138.00	1,593,200
G M O グローバルサイン・ホールディングス	800	8,460.00	6,768,000
S R A ホールディングス	2,000	2,602.00	5,204,000
システムインテグレータ	1,500	667.00	1,000,500
朝日ネット	2,900	838.00	2,430,200

e B A S E	5,000	930.00	4,650,000
アバント	3,500	1,409.00	4,931,500
アドソル日進	1,500	2,738.00	4,107,000
ODKソリューションズ	600	716.00	429,600
フリービット	2,400	998.00	2,395,200
コムチュア	3,500	2,887.00	10,104,500
サイバーコム	900	1,589.00	1,430,100
アステリア	2,600	916.00	2,381,600
アイル	2,000	1,644.00	3,288,000
王子ホールディングス	170,400	709.00	120,813,600
日本製紙	16,700	1,406.00	23,480,200
三菱製紙	4,600	361.00	1,660,600
北越コーポレーション	22,400	514.00	11,513,600
中越パルプ工業	1,800	1,202.00	2,163,600
巴川製紙所	1,200	770.00	924,000
大王製紙	18,300	2,224.00	40,699,200
阿波製紙	1,000	451.00	451,000
マークライnz	1,700	2,400.00	4,080,000
メディカル・データ・ビジョン	4,300	2,158.00	9,279,400
g u m i	4,800	989.00	4,747,200
ショーケース	600	997.00	598,200
モバイルファクトリー	1,100	1,041.00	1,145,100
テラスカイ	1,400	3,900.00	5,460,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,700	1,644.00	2,794,800
P C Iホールディングス	1,600	1,300.00	2,080,000
パイブドHD	400	1,508.00	603,200
アイピーシー	800	1,034.00	827,200
ネオジャパン	700	1,795.00	1,256,500
P R T I M E S	600	3,410.00	2,046,000
ランドコンピュータ	400	1,127.00	450,800
ダブルスタンダード	600	4,155.00	2,493,000
オーブンドア	2,000	2,335.00	4,670,000
マイネット	1,500	787.00	1,180,500
アカツキ	1,300	4,340.00	5,642,000
ベネフィットジャパン	200	1,787.00	357,400
U b i c o mホールディングス	800	3,110.00	2,488,000
カナミックネットワーク	4,100	777.00	3,185,700
ノムラシステムコーポレーション	1,200	325.00	390,000
レンゴー	35,800	879.00	31,468,200
トーモク	2,300	1,869.00	4,298,700
ザ・パック	2,800	2,737.00	7,663,600
チェンジ	5,200	3,465.00	18,018,000
シンクロ・フード	1,800	363.00	653,400
オークネット	2,200	1,348.00	2,965,600
キャピタル・アセット・プランニング	500	1,002.00	501,000
セグエグループ	600	1,224.00	734,400
エイトレッド	800	2,346.00	1,876,800
A O I T Y O H o l d i n g s	4,100	477.00	1,955,700
マクロミル	7,600	873.00	6,634,800

ビーグリー	800	1,469.00	1,175,200
オロ	1,200	3,950.00	4,740,000
ユーザーローカル	300	4,620.00	1,386,000
テモナ	500	946.00	473,000
ニーズウェル	500	676.00	338,000
サインポスト	600	1,017.00	610,200
昭和電工	28,800	2,592.00	74,649,600
住友化学	298,100	522.00	155,608,200
住友精化	1,700	4,020.00	6,834,000
日産化学	20,900	6,240.00	130,416,000
ラサ工業	1,500	2,248.00	3,372,000
クレハ	3,200	7,190.00	23,008,000
多木化学	1,500	6,390.00	9,585,000
テイカ	2,700	1,440.00	3,888,000
石原産業	6,700	821.00	5,500,700
片倉コープアグリ	1,000	1,289.00	1,289,000
日本曹達	5,600	3,385.00	18,956,000
東ソー	58,600	1,989.00	116,555,400
トクヤマ	10,900	2,682.00	29,233,800
セントラル硝子	7,700	2,301.00	17,717,700
東亜合成	23,800	1,243.00	29,583,400
大阪ソーダ	3,800	2,643.00	10,043,400
関東電化工業	8,900	887.00	7,894,300
デンカ	13,800	4,120.00	56,856,000
イビデン	18,600	4,820.00	89,652,000
信越化学工業	70,100	18,740.00	1,313,674,000
日本カーバイド工業	1,400	1,338.00	1,873,200
堺化学工業	2,400	1,976.00	4,742,400
第一稀元素化学工業	4,000	1,046.00	4,184,000
エア・ウォーター	38,600	1,743.00	67,279,800
日本酸素ホールディングス	31,200	2,009.00	62,680,800
日本化学工業	1,100	3,310.00	3,641,000
東邦アセチレン	700	1,369.00	958,300
日本パーカライジング	19,100	1,101.00	21,029,100
高压ガス工業	5,900	739.00	4,360,100
チタン工業	500	2,145.00	1,072,500
四国化成工業	5,500	1,261.00	6,935,500
戸田工業	900	2,171.00	1,953,900
ステラ ケミファ	2,000	3,275.00	6,550,000
保土谷化学工業	1,400	4,930.00	6,902,000
日本触媒	6,800	5,790.00	39,372,000
大日精化工業	3,300	2,404.00	7,933,200
カネカ	9,800	4,275.00	41,895,000
協和キリン	39,000	3,085.00	120,315,000
三菱瓦斯化学	37,900	2,597.00	98,426,300
三井化学	32,700	3,240.00	105,948,000
J S R	38,000	3,390.00	128,820,000
東京応化工業	6,500	6,810.00	44,265,000
大阪有機化学工業	3,500	3,840.00	13,440,000

三菱ケミカルホールディングス	253,700	731.50	185,581,550
KHネオケム	6,200	2,508.00	15,549,600
ダイセル	47,300	775.00	36,657,500
住友ベークライト	5,900	4,435.00	26,166,500
積水化学工業	80,200	2,021.00	162,084,200
日本ゼオン	34,200	1,654.00	56,566,800
アイカ工業	10,500	3,840.00	40,320,000
宇部興産	19,100	2,141.00	40,893,100
積水樹脂	6,800	2,066.00	14,048,800
タキロンシーアイ	8,100	691.00	5,597,100
旭有機材	2,300	1,473.00	3,387,900
ニチバン	1,900	1,822.00	3,461,800
リケンテクノス	9,100	495.00	4,504,500
大倉工業	1,700	2,000.00	3,400,000
積水化成品工業	5,900	561.00	3,309,900
群栄化学工業	1,000	2,502.00	2,502,000
タイガースポリマー	2,100	467.00	980,700
ミライアル	1,300	1,216.00	1,580,800
ダイキアクシス	1,300	983.00	1,277,900
ダイキョーニシカワ	7,900	799.00	6,312,100
竹本容器	1,400	867.00	1,213,800
森六ホールディングス	2,000	2,047.00	4,094,000
恵和	100	1,933.00	193,300
日本化薬	23,400	1,060.00	24,804,000
カーリットホールディングス	4,400	728.00	3,203,200
E P Sホールディングス	4,900	1,201.00	5,884,900
ソルクシーズ	1,500	1,043.00	1,564,500
レグス	900	1,685.00	1,516,500
プレステージ・インターナショナル	13,800	764.00	10,543,200
フェイス	1,700	809.00	1,375,300
プロトコーポレーション	3,300	1,171.00	3,864,300
ハイマックス	1,200	1,727.00	2,072,400
アミューズ	2,000	2,516.00	5,032,000
野村総合研究所	69,200	3,565.00	246,698,000
ドリームインキュベータ	1,300	1,215.00	1,579,500
サイバネットシステム	2,600	856.00	2,225,600
クイック	2,600	1,194.00	3,104,400
T A C	2,500	276.00	690,000
C Eホールディングス	2,100	547.00	1,148,700
日本システム技術	500	1,578.00	789,000
電通グループ	41,600	3,670.00	152,672,000
インテージホールディングス	4,700	1,197.00	5,625,900
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,600	868.00	1,388,800
東邦システムサイエンス	1,300	927.00	1,205,100
びあ	1,200	3,325.00	3,990,000
イオンファンタジー	1,500	2,456.00	3,684,000
ソースネクスト	17,700	337.00	5,964,900
シーティーエス	4,500	880.00	3,960,000
ネクシーズグループ	1,500	1,075.00	1,612,500

インフォコム	3,400	2,808.00	9,547,200
メディカルシステムネットワーク	4,100	732.00	3,001,200
日本精化	3,000	1,417.00	4,251,000
扶桑化学工業	3,000	3,970.00	11,910,000
トリケミカル研究所	3,200	4,250.00	13,600,000
HEROZ	600	3,540.00	2,124,000
ラクスル	3,000	3,810.00	11,430,000
IPS	700	3,095.00	2,166,500
FIG	4,900	269.00	1,318,100
システムサポート	1,000	1,450.00	1,450,000
ADEKA	17,400	1,863.00	32,416,200
日油	14,300	5,850.00	83,655,000
ミヨシ油脂	1,600	1,200.00	1,920,000
新日本理化	6,200	279.00	1,729,800
ハリマ化成グループ	3,000	948.00	2,844,000
イーソル	2,400	1,412.00	3,388,800
アルテリア・ネットワークス	4,100	1,567.00	6,424,700
EduLab	400	7,210.00	2,884,000
東海ソフト	200	1,139.00	227,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	600	2,016.00	1,209,600
東名	200	1,124.00	224,800
ヴィッツ	200	2,285.00	457,000
トビラシステムズ	500	1,608.00	804,000
Link-U	300	1,405.00	421,500
ギフトィ	1,700	4,450.00	7,565,000
花王	92,800	7,270.00	674,656,000
第一工業製薬	1,400	3,770.00	5,278,000
石原ケミカル	1,100	2,210.00	2,431,000
日華化学	1,200	888.00	1,065,600
ニイタカ	900	2,704.00	2,433,600
三洋化成工業	2,200	5,230.00	11,506,000
ベース	300	5,710.00	1,713,000
武田薬品工業	321,900	3,687.00	1,186,845,300
アステラス製薬	336,100	1,779.00	597,921,900
大日本住友製薬	28,700	1,701.00	48,818,700
塩野義製薬	48,700	5,811.00	282,995,700
わかもと製薬	4,300	245.00	1,053,500
あすか製薬	4,400	1,411.00	6,208,400
日本新薬	11,000	7,810.00	85,910,000
バイオフェルミン製薬	700	2,726.00	1,908,200
中外製薬	121,200	5,250.00	636,300,000
科研製薬	6,600	4,155.00	27,423,000
エーザイ	42,700	7,625.00	325,587,500
理研ビタミン	3,600	1,363.00	4,906,800
ロート製薬	18,400	2,967.00	54,592,800
小野薬品工業	89,000	3,055.00	271,895,000
久光製薬	11,200	7,070.00	79,184,000
有機合成薬品工業	3,000	296.00	888,000
持田製薬	5,400	4,145.00	22,383,000



参天製薬	67,200	1,572.00	105,638,400
扶桑薬品工業	1,300	2,654.00	3,450,200
日本ケミファ	700	2,295.00	1,606,500
ツムラ	12,000	3,435.00	41,220,000
日医工	10,900	1,106.00	12,055,400
テルモ	118,600	4,278.00	507,370,800
H . U . グループホールディングス	10,300	3,290.00	33,887,000
キッセイ薬品工業	6,800	2,237.00	15,211,600
生化学工業	7,400	1,061.00	7,851,400
栄研化学	6,800	2,142.00	14,565,600
日水製薬	1,800	997.00	1,794,600
鳥居薬品	2,400	3,005.00	7,212,000
J C R ファーマ	10,900	3,270.00	35,643,000
東和薬品	4,900	2,230.00	10,927,000
富士製薬工業	3,000	1,280.00	3,840,000
沢井製薬	7,900	4,895.00	38,670,500
ゼリア新薬工業	7,000	2,024.00	14,168,000
第一三共	332,100	3,261.00	1,082,978,100
キョーリン製薬ホールディングス	8,500	1,931.00	16,413,500
大幸薬品	4,700	1,322.00	6,213,400
ダイト	2,500	3,590.00	8,975,000
大塚ホールディングス	80,500	4,469.00	359,754,500
大正製薬ホールディングス	9,200	6,920.00	63,664,000
ペプチドリーム	19,700	5,420.00	106,774,000
大日本塗料	4,200	924.00	3,880,800
日本ペイントホールディングス	31,300	8,710.00	272,623,000
関西ペイント	42,600	2,917.00	124,264,200
神東塗料	2,000	201.00	402,000
中国塗料	10,700	936.00	10,015,200
日本特殊塗料	3,100	1,154.00	3,577,400
藤倉化成	5,900	525.00	3,097,500
太陽ホールディングス	2,800	5,890.00	16,492,000
D I C	16,000	2,860.00	45,760,000
サカタインクス	8,200	1,103.00	9,044,600
東洋インキ S C ホールディングス	8,000	2,007.00	16,056,000
T & K T O K A	3,400	828.00	2,815,200
アルプス技研	3,200	2,027.00	6,486,400
サニックス	7,100	297.00	2,108,700
ダイオーズ	700	972.00	680,400
日本空調サービス	3,800	736.00	2,796,800
オリエンタルランド	39,400	18,040.00	710,776,000
フォーカスシステムズ	2,700	933.00	2,519,100
ダスキン	8,500	2,802.00	23,817,000
パーク 2 4	20,500	2,234.00	45,797,000
明光ネットワークジャパン	5,000	569.00	2,845,000
ファルコホールディングス	2,000	1,616.00	3,232,000
クレスコ	2,500	1,386.00	3,465,000
フジ・メディア・ホールディングス	36,600	1,320.00	48,312,000
秀英予備校	1,000	427.00	427,000

田谷	800	566.00	452,800
ラウンドワン	10,200	1,110.00	11,322,000
リゾートトラスト	16,900	1,747.00	29,524,300
オービック	12,000	19,350.00	232,200,000
ジャストシステム	5,400	6,970.00	37,638,000
TDCソフト	3,200	949.00	3,036,800
Zホールディングス	522,200	661.00	345,174,200
ビー・エム・エル	4,700	3,650.00	17,155,000
ワタベウェディング	400	345.00	138,000
トレンドマイクロ	20,300	5,640.00	114,492,000
りらいあコミュニケーションズ	6,400	1,396.00	8,934,400
IDホールディングス	1,600	1,218.00	1,948,800
リソー教育	16,600	334.00	5,544,400
日本オラクル	7,700	11,930.00	91,861,000
早稲田アカデミー	1,700	997.00	1,694,900
アルファシステムズ	1,200	3,600.00	4,320,000
フューチャー	4,500	1,900.00	8,550,000
CAC Holdings	2,700	1,437.00	3,879,900
S Bテクノロジー	1,500	3,000.00	4,500,000
トーセ	1,300	814.00	1,058,200
ユー・エス・エス	41,400	2,100.00	86,940,000
オービックビジネスコンサルタント	3,900	6,340.00	24,726,000
伊藤忠テクノソリューションズ	17,300	3,435.00	59,425,500
アイティフォー	4,500	863.00	3,883,500
東京個別指導学院	1,200	675.00	810,000
東計電算	500	4,285.00	2,142,500
サイバーエージェント	22,800	6,990.00	159,372,000
楽天	172,600	1,145.00	197,627,000
エクスネット	500	992.00	496,000
クリーク・アンド・リバー社	2,300	1,294.00	2,976,200
モーニングスター	4,300	495.00	2,128,500
テー・オー・ダブリュー	6,800	304.00	2,067,200
大塚商会	20,600	5,140.00	105,884,000
サイボウズ	4,400	2,497.00	10,986,800
山田コンサルティンググループ	2,400	1,004.00	2,409,600
セントラルスポーツ	1,300	2,429.00	3,157,700
バラカ	1,100	1,620.00	1,782,000
電通国際情報サービス	4,600	3,830.00	17,618,000
ACCESS	4,100	835.00	3,423,500
デジタルガレージ	6,200	4,445.00	27,559,000
EMシステムズ	5,300	856.00	4,536,800
ウェザーニューズ	1,300	5,300.00	6,890,000
C I J	2,500	872.00	2,180,000
ビジネスエンジニアリング	500	3,230.00	1,615,000
日本エンタープライズ	4,000	255.00	1,020,000
WOWOW	1,800	2,872.00	5,169,600
スカラ	2,900	723.00	2,096,700
インテリジェント ウェイブ	2,600	688.00	1,788,800
フルキャストホールディングス	3,200	1,980.00	6,336,000

エン・ジャパン	6,600	3,370.00	22,242,000
富士フイルムホールディングス	68,000	6,333.00	430,644,000
コニカミノルタ	78,300	550.00	43,065,000
資生堂	77,000	8,150.00	627,550,000
ライオン	50,400	2,175.00	109,620,000
高砂香料工業	2,400	2,609.00	6,261,600
マンダム	8,700	1,870.00	16,269,000
ミルボン	5,200	6,400.00	33,280,000
ファンケル	14,100	4,080.00	57,528,000
コーセー	7,300	18,100.00	132,130,000
コタ	2,500	1,828.00	4,570,000
シーボン	700	1,995.00	1,396,500
ポーラ・オルビスホールディングス	16,500	2,476.00	40,854,000
ノエビアホールディングス	3,300	4,865.00	16,054,500
アジュバンコスメジャパン	800	1,099.00	879,200
新日本製薬	800	2,485.00	1,988,000
エステー	2,400	1,973.00	4,735,200
アグロ カネショウ	1,400	1,623.00	2,272,200
コニシ	6,300	1,678.00	10,571,400
長谷川香料	6,600	1,951.00	12,876,600
星光PMC	2,100	773.00	1,623,300
小林製薬	10,900	10,990.00	119,791,000
荒川化学工業	3,400	1,295.00	4,403,000
メック	2,600	2,073.00	5,389,800
日本高純度化学	1,200	2,688.00	3,225,600
タカラバイオ	10,100	3,085.00	31,158,500
JCU	4,700	3,410.00	16,027,000
新田ゼラチン	2,500	680.00	1,700,000
OATアグリオ	800	1,384.00	1,107,200
デクセリアルズ	10,000	1,538.00	15,380,000
アース製薬	2,900	6,070.00	17,603,000
北興化学工業	3,500	1,046.00	3,661,000
大成ラミック	1,200	2,935.00	3,522,000
クミアイ化学工業	15,900	882.00	14,023,800
日本農薬	6,700	530.00	3,551,000
富士興産	1,400	1,287.00	1,801,800
ニチレキ	4,500	1,538.00	6,921,000
ユシロ化学工業	2,500	1,085.00	2,712,500
ビーピー・カストロール	1,500	1,237.00	1,855,500
富士石油	11,900	211.00	2,510,900
MORESCO	1,300	1,150.00	1,495,000
出光興産	43,000	2,742.00	117,906,000
ENEOSホールディングス	582,900	462.90	269,824,410
コスモエネルギーホールディングス	11,200	2,485.00	27,832,000
横浜ゴム	22,400	1,961.00	43,926,400
TOYO TIRE	20,300	1,906.00	38,691,800
ブリヂストン	103,000	4,199.00	432,497,000
住友ゴム工業	34,700	1,194.00	41,431,800
藤倉コンポジット	3,100	435.00	1,348,500

オカモト	2,300	4,115.00	9,464,500
アキレス	2,600	1,487.00	3,866,200
フコク	1,700	711.00	1,208,700
ニッタ	4,300	2,396.00	10,302,800
クリエートメディック	1,400	970.00	1,358,000
住友理工	7,400	641.00	4,743,400
三ツ星ベルト	5,000	1,726.00	8,630,000
バンドー化学	6,700	737.00	4,937,900
A G C	35,600	3,905.00	139,018,000
日本板硝子	18,300	552.00	10,101,600
石塚硝子	800	1,929.00	1,543,200
有沢製作所	6,000	982.00	5,892,000
日本山村硝子	1,500	918.00	1,377,000
日本電気硝子	14,300	2,502.00	35,778,600
オハラ	1,600	2,052.00	3,283,200
住友大阪セメント	7,300	3,560.00	25,988,000
太平洋セメント	22,900	2,748.00	62,929,200
リソルホールディングス	500	4,165.00	2,082,500
日本ヒューム	4,200	769.00	3,229,800
日本コンクリート工業	9,500	386.00	3,667,000
三谷セキサン	1,800	4,820.00	8,676,000
アジアパイルホールディングス	5,900	530.00	3,127,000
東海カーボン	37,800	1,515.00	57,267,000
日本カーボン	2,100	4,095.00	8,599,500
東洋炭素	2,200	1,987.00	4,371,400
ノリタケカンパニーリミテド	2,100	3,615.00	7,591,500
T O T O	27,700	6,850.00	189,745,000
日本碍子	42,500	1,881.00	79,942,500
日本特殊陶業	29,400	1,868.00	54,919,200
ダントーホールディングス	3,000	380.00	1,140,000
M A R U W A	1,300	10,570.00	13,741,000
品川リフラクトリーズ	1,200	2,762.00	3,314,400
黒崎播磨	700	4,825.00	3,377,500
ヨータイ	3,600	1,038.00	3,736,800
イソライト工業	2,100	649.00	1,362,900
東京窯業	5,300	324.00	1,717,200
ニッカトー	1,900	717.00	1,362,300
フジミインコーポレーテッド	3,400	4,225.00	14,365,000
クニミネ工業	1,900	1,211.00	2,300,900
エーアンドエーマテリアル	800	1,070.00	856,000
ニチアス	9,700	2,486.00	24,114,200
日本製鉄	182,600	1,551.50	283,303,900
神戸製鋼所	70,000	636.00	44,520,000
中山製鋼所	5,700	401.00	2,285,700
合同製鐵	2,000	2,080.00	4,160,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	110,600	1,113.00	123,097,800
東京製鐵	14,800	722.00	10,685,600
共英製鋼	4,300	1,432.00	6,157,600
大和工業	8,100	2,712.00	21,967,200

東京鐵鋼	1,800	2,007.00	3,612,600
大阪製鐵	2,200	1,256.00	2,763,200
淀川製鋼所	5,100	2,303.00	11,745,300
丸一鋼管	12,400	2,502.00	31,024,800
モリ工業	1,300	2,333.00	3,032,900
大同特殊鋼	6,300	4,695.00	29,578,500
日本高周波鋼業	1,400	364.00	509,600
日本冶金工業	3,100	2,119.00	6,568,900
山陽特殊製鋼	2,500	1,749.00	4,372,500
愛知製鋼	2,100	3,275.00	6,877,500
日立金属	36,000	1,722.00	61,992,000
日本金属	1,000	1,144.00	1,144,000
大平洋金属	2,600	2,500.00	6,500,000
新日本電工	24,400	298.00	7,271,200
栗本鐵工所	1,800	1,765.00	3,177,000
虹技	500	1,172.00	586,000
日本鑄鐵管	300	1,392.00	417,600
日本製鋼所	11,600	2,887.00	33,489,200
三菱製鋼	3,100	764.00	2,368,400
日亜鋼業	6,000	294.00	1,764,000
日本精線	700	3,655.00	2,558,500
エンビプロ・ホールディングス	1,700	755.00	1,283,500
大紀アルミニウム工業所	6,200	802.00	4,972,400
日本輕金属ホールディングス	9,600	2,167.00	20,803,200
三井金属鉱業	10,300	3,885.00	40,015,500
東邦亜鉛	2,100	2,415.00	5,071,500
三菱マテリアル	25,300	2,598.00	65,729,400
住友金属鉱山	49,000	5,578.00	273,322,000
DOWAホールディングス	9,700	4,175.00	40,497,500
古河機械金属	6,700	1,352.00	9,058,400
エス・サイエンス	19,300	42.00	810,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	3,900	818.00	3,190,200
東邦チタニウム	6,700	981.00	6,572,700
UACJ	5,800	2,507.00	14,540,600
CKサンエツ	900	3,955.00	3,559,500
古河電気工業	11,900	2,871.00	34,164,900
住友電気工業	133,400	1,549.50	206,703,300
フジクラ	46,100	525.00	24,202,500
昭和電線ホールディングス	4,400	1,753.00	7,713,200
東京特殊電線	600	2,596.00	1,557,600
タツタ電線	7,500	651.00	4,882,500
カナレ電気	700	1,758.00	1,230,600
平河ヒューテック	1,800	1,189.00	2,140,200
リョービ	4,600	1,306.00	6,007,600
アーレスティ	5,700	405.00	2,308,500
アサヒホールディングス	6,700	4,315.00	28,910,500
東洋製罐グループホールディングス	24,300	1,361.00	33,072,300
ホッカンホールディングス	2,400	1,430.00	3,432,000
コロナ	2,400	951.00	2,282,400

横河ブリッジホールディングス	7,100	1,912.00	13,575,200
OSJBホールディングス	18,800	273.00	5,132,400
駒井ハルテック	800	2,089.00	1,671,200
高田機工	300	2,640.00	792,000
三和ホールディングス	36,100	1,315.00	47,471,500
文化シャッター	11,200	1,000.00	11,200,000
三協立山	5,400	828.00	4,471,200
アルインコ	3,000	974.00	2,922,000
東洋シャッター	1,500	703.00	1,054,500
LIXIL	52,600	3,025.00	159,115,000
日本ファイルコン	3,200	500.00	1,600,000
ノーリツ	7,900	1,675.00	13,232,500
長府製作所	3,900	2,108.00	8,221,200
リンナイ	7,400	11,460.00	84,804,000
ユニプレス	7,400	962.00	7,118,800
ダイニチ工業	2,000	852.00	1,704,000
日東精工	4,600	667.00	3,068,200
三洋工業	700	1,852.00	1,296,400
岡部	7,600	789.00	5,996,400
ジーテクト	4,700	1,448.00	6,805,600
東プレ	7,100	1,586.00	11,260,600
高周波熱錬	8,100	540.00	4,374,000
東京製綱	2,900	1,445.00	4,190,500
サンコール	2,100	487.00	1,022,700
モリテック スチール	2,800	420.00	1,176,000
バイオラックス	5,600	1,594.00	8,926,400
エイチワン	4,000	772.00	3,088,000
日本発條	38,000	812.00	30,856,000
中央発條	600	2,830.00	1,698,000
アドバネクス	600	1,599.00	959,400
三浦工業	16,600	6,140.00	101,924,000
タクマ	12,900	2,023.00	26,096,700
テクノプロ・ホールディングス	7,400	8,100.00	59,940,000
アトラ	700	394.00	275,800
インターワークス	700	381.00	266,700
アイ・アールジャパンホールディングス	1,500	13,980.00	20,970,000
Keepers 技研	2,700	1,954.00	5,275,800
ファーストロジック	400	766.00	306,400
三機サービス	800	1,010.00	808,000
Gunosy	2,700	808.00	2,181,600
デザインワン・ジャパン	600	232.00	139,200
イー・ガーディアン	1,600	3,210.00	5,136,000
リブセンス	2,500	234.00	585,000
ジャパンマテリアル	11,300	1,464.00	16,543,200
ベクトル	4,500	1,198.00	5,391,000
ウチヤマホールディングス	2,400	365.00	876,000
チャーム・ケア・コーポレーション	3,200	1,427.00	4,566,400
キャリアリンク	1,200	2,767.00	3,320,400
IBJ	2,900	1,024.00	2,969,600

アサンテ	1,600	1,733.00	2,772,800
N・フィールド	3,000	1,197.00	3,591,000
パリュールHR	1,600	1,995.00	3,192,000
M&Aキャピタルパートナーズ	3,000	4,890.00	14,670,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,400	1,721.00	2,409,400
E R Iホールディングス	900	618.00	556,200
アビスト	600	2,972.00	1,783,200
シグマクシス	2,500	1,780.00	4,450,000
ウィルグループ	2,600	981.00	2,550,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	5,000	304.00	1,520,000
メドピア	1,700	6,150.00	10,455,000
レアジョブ	300	2,077.00	623,100
リクルートホールディングス	264,800	5,475.00	1,449,780,000
エラン	5,000	1,400.00	7,000,000
ツガミ	7,900	1,635.00	12,916,500
オークマ	4,500	5,970.00	26,865,000
芝浦機械	4,300	2,956.00	12,710,800
アマダ	56,000	1,289.00	72,184,000
アイダエンジニアリング	9,900	957.00	9,474,300
滝澤鉄工所	1,600	1,059.00	1,694,400
F U J I	15,200	2,667.00	40,538,400
牧野フライス製作所	4,500	4,025.00	18,112,500
オーエスジー	18,900	1,973.00	37,289,700
ダイジェット工業	400	1,382.00	552,800
旭ダイヤモンド工業	9,800	510.00	4,998,000
D M G 森精機	24,200	1,599.00	38,695,800
ソディック	8,200	991.00	8,126,200
ディスコ	5,200	35,500.00	184,600,000
日東工器	2,000	1,858.00	3,716,000
日進工具	1,500	2,746.00	4,119,000
パンチ工業	4,000	599.00	2,396,000
富士ダイス	2,400	657.00	1,576,800
土木管理総合試験所	1,200	351.00	421,200
ネットマーケティング	1,300	609.00	791,700
日本郵政	279,600	900.00	251,640,000
ベルシステム24ホールディングス	6,100	1,847.00	11,266,700
鎌倉新書	3,200	903.00	2,889,600
S M N	400	752.00	300,800
一蔵	400	395.00	158,000
L I T A L I C O	1,200	3,825.00	4,590,000
グローバルキッズCOMPANY	400	848.00	339,200
エアトリ	2,200	1,995.00	4,389,000
アトラエ	1,300	3,270.00	4,251,000
ストライク	1,400	4,715.00	6,601,000
ソラスト	9,000	1,495.00	13,455,000
セラク	1,300	1,782.00	2,316,600
インソース	3,000	2,249.00	6,747,000
豊田自動織機	31,400	9,520.00	298,928,000
豊和工業	2,300	858.00	1,973,400

OKK	2,200	468.00	1,029,600
石川製作所	900	1,726.00	1,553,400
東洋機械金属	2,800	458.00	1,282,400
津田駒工業	800	887.00	709,600
エンシュウ	1,100	880.00	968,000
島精機製作所	6,000	2,304.00	13,824,000
オプトラン	4,800	2,775.00	13,320,000
NCホールディングス	1,100	661.00	727,100
イワキポンプ	2,900	836.00	2,424,400
フリュー	3,700	1,120.00	4,144,000
ヤマシンフィルタ	8,500	890.00	7,565,000
日阪製作所	4,600	841.00	3,868,600
やまびこ	7,400	1,177.00	8,709,800
平田機工	1,800	7,280.00	13,104,000
ベガサスミシン製造	4,500	460.00	2,070,000
マルマエ	1,700	1,304.00	2,216,800
タツモ	1,900	1,644.00	3,123,600
ナプテスコ	22,600	4,860.00	109,836,000
三井海洋開発	4,000	1,752.00	7,008,000
レオン自動機	3,700	1,135.00	4,199,500
S M C	11,300	65,860.00	744,218,000
ホソカワミクロン	1,300	6,550.00	8,515,000
ユニオンツール	1,400	3,480.00	4,872,000
オイレス工業	4,900	1,697.00	8,315,300
日精エー・エス・ビー機械	1,100	5,630.00	6,193,000
サトーホールディングス	5,400	2,497.00	13,483,800
技研製作所	3,400	5,190.00	17,646,000
日本エアーテック	1,400	1,260.00	1,764,000
カワタ	1,300	905.00	1,176,500
日精樹脂工業	3,700	921.00	3,407,700
オカダアイヨン	1,200	1,190.00	1,428,000
ワイエイシーホールディングス	1,700	1,004.00	1,706,800
小松製作所	175,600	3,253.00	571,226,800
住友重機械工業	22,200	2,901.00	64,402,200
日立建機	18,100	3,325.00	60,182,500
日工	5,200	727.00	3,780,400
巴工業	1,500	2,054.00	3,081,000
井関農機	3,800	1,541.00	5,855,800
T O W A	3,900	2,179.00	8,498,100
丸山製作所	800	1,648.00	1,318,400
北川鉄工所	2,000	1,478.00	2,956,000
シンニッタン	8,100	219.00	1,773,900
ローツェ	1,700	8,110.00	13,787,000
タカキタ	1,300	685.00	890,500
クボタ	203,600	2,471.50	503,197,400
荏原実業	900	4,650.00	4,185,000
東洋エンジニアリング	5,500	506.00	2,783,000
三菱化工機	1,400	2,966.00	4,152,400
月島機械	7,100	1,293.00	9,180,300



帝国電機製作所	3,100	1,210.00	3,751,000
東京機械製作所	1,300	307.00	399,100
新東工業	9,100	759.00	6,906,900
澁谷工業	3,400	3,530.00	12,002,000
アイチ コーポレーション	6,600	897.00	5,920,200
小森コーポレーション	9,700	721.00	6,993,700
鶴見製作所	2,900	1,727.00	5,008,300
住友精密工業	700	2,047.00	1,432,900
日本ギア工業	1,200	308.00	369,600
酒井重工業	800	2,088.00	1,670,400
荏原製作所	16,000	4,110.00	65,760,000
石井鐵工所	500	2,938.00	1,469,000
西島製作所	3,800	836.00	3,176,800
北越工業	3,900	1,118.00	4,360,200
ダイキン工業	49,300	22,100.00	1,089,530,000
オルガノ	1,400	6,190.00	8,666,000
トーヨーカネツ	1,600	2,777.00	4,443,200
栗田工業	21,000	4,430.00	93,030,000
椿本チエイン	5,500	2,941.00	16,175,500
大同工業	1,700	775.00	1,317,500
日機装	12,400	1,075.00	13,330,000
木村化工機	3,700	657.00	2,430,900
レイズネクスト	6,400	1,177.00	7,532,800
アネスト岩田	5,900	1,087.00	6,413,300
ダイフク	21,300	11,310.00	240,903,000
サムコ	1,100	3,695.00	4,064,500
加藤製作所	2,300	1,002.00	2,304,600
油研工業	800	1,632.00	1,305,600
タダノ	18,600	1,013.00	18,841,800
フジテック	13,300	2,536.00	33,728,800
C K D	8,900	2,475.00	22,027,500
キトー	2,900	1,472.00	4,268,800
平和	10,700	1,601.00	17,130,700
理想科学工業	3,400	1,365.00	4,641,000
SANKYO	8,600	2,954.00	25,404,400
日本金銭機械	4,600	553.00	2,543,800
マースグループホールディングス	2,400	1,595.00	3,828,000
フクシマガリレイ	2,400	4,195.00	10,068,000
オーイズミ	2,000	410.00	820,000
ダイコク電機	1,900	944.00	1,793,600
竹内製作所	6,400	2,779.00	17,785,600
アマノ	10,100	2,418.00	24,421,800
JUKI	6,200	830.00	5,146,000
サンデンホールディングス	5,400	436.00	2,354,400
蛇の目ミシン工業	3,700	813.00	3,008,100
ブラザー工業	47,300	2,262.00	106,992,600
マックス	5,800	1,614.00	9,361,200
モリタホールディングス	6,700	1,813.00	12,147,100
グローリー	9,900	2,290.00	22,671,000

新晃工業	3,500	1,975.00	6,912,500
大和冷機工業	6,600	1,085.00	7,161,000
セガサミーホールディングス	35,100	1,832.00	64,303,200
日本ピストンリング	1,300	1,040.00	1,352,000
リケン	1,800	2,249.00	4,048,200
T P R	5,100	1,523.00	7,767,300
ツバキ・ナカシマ	7,300	1,274.00	9,300,200
ホシザキ	12,200	9,650.00	117,730,000
大豊工業	3,600	753.00	2,710,800
日本精工	79,400	1,014.00	80,511,600
N T N	89,400	315.00	28,161,000
ジェイテクト	37,100	1,146.00	42,516,600
不二越	3,600	4,685.00	16,866,000
ミネベアミツミ	66,600	2,670.00	177,822,000
日本トムソン	11,200	569.00	6,372,800
T H K	24,100	3,640.00	87,724,000
ユースン精機	3,400	945.00	3,213,000
前澤給装工業	1,600	2,233.00	3,572,800
イーグル工業	4,700	1,153.00	5,419,100
前澤工業	2,700	572.00	1,544,400
日本ビラー工業	3,900	1,723.00	6,719,700
キッツ	14,000	582.00	8,148,000
日立製作所	186,200	4,934.00	918,710,800
三菱電機	387,600	1,601.50	620,741,400
富士電機	23,300	4,665.00	108,694,500
東洋電機製造	1,600	1,210.00	1,936,000
安川電機	41,700	5,670.00	236,439,000
シンフォニアテクノロジー	5,000	1,339.00	6,695,000
明電舎	7,100	2,372.00	16,841,200
オリジン	1,100	1,373.00	1,510,300
山洋電気	1,900	6,040.00	11,476,000
デンヨー	3,300	2,117.00	6,986,100
バイカレント・コンサルティング	2,400	21,270.00	51,048,000
Orchestra Holdings	900	2,904.00	2,613,600
アイモバイル	1,600	1,382.00	2,211,200
キャリアインデックス	1,400	606.00	848,400
M S - J a p a n	1,600	1,146.00	1,833,600
船場	500	864.00	432,000
グレイステクノロジー	1,700	5,760.00	9,792,000
ジャパンエレベーターサービスホールディン	10,600	2,241.00	23,754,600
フルテック	400	1,377.00	550,800
グリーンズ	1,500	573.00	859,500
ツナググループ・ホールディングス	400	340.00	136,000
GameWith	700	606.00	424,200
ソウルドアウト	1,100	1,601.00	1,761,100
M S & C o n s u l t i n g	500	596.00	298,000
エル・ティー・エス	300	3,615.00	1,084,500
ミダック	500	4,480.00	2,240,000
日総工産	2,300	837.00	1,925,100

キュービーネットホールディングス	1,800	1,734.00	3,121,200
R P Aホールディングス	3,300	639.00	2,108,700
三櫻工業	4,800	940.00	4,512,000
マキタ	50,500	4,695.00	237,097,500
東芝テック	4,100	3,860.00	15,826,000
芝浦メカトロニクス	700	5,070.00	3,549,000
マブチモーター	10,700	4,885.00	52,269,500
日本電産	93,100	14,650.00	1,363,915,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	2,200	895.00	1,969,000
トレックス・セミコンダクター	2,400	1,609.00	3,861,600
東光高岳	2,300	1,560.00	3,588,000
ダブル・スコープ	6,700	792.00	5,306,400
宮越ホールディングス	1,800	1,030.00	1,854,000
ダイヘン	4,200	4,680.00	19,656,000
ヤーマン	6,300	1,935.00	12,190,500
J V Cケンウッド	31,000	193.00	5,983,000
ミマキエンジニアリング	3,700	569.00	2,105,300
I - P E X	1,800	2,024.00	3,643,200
日新電機	9,000	1,270.00	11,430,000
大崎電気工業	7,500	609.00	4,567,500
オムロン	32,200	9,420.00	303,324,000
日東工業	5,600	2,094.00	11,726,400
I D E C	5,500	1,881.00	10,345,500
正興電機製作所	700	2,253.00	1,577,100
不二電機工業	600	1,271.00	762,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	12,900	3,370.00	43,473,000
サクサホールディングス	1,100	1,495.00	1,644,500
メルコホールディングス	1,300	3,910.00	5,083,000
テクノメディカ	1,000	1,615.00	1,615,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	500	4,295.00	2,147,500
日本電気	49,100	6,290.00	308,839,000
富士通	34,800	15,905.00	553,494,000
沖電気工業	15,600	1,050.00	16,380,000
岩崎通信機	1,800	873.00	1,571,400
電気興業	1,800	2,943.00	5,297,400
サンケン電気	4,200	5,580.00	23,436,000
ナカヨ	800	1,440.00	1,152,000
アイホン	2,100	1,753.00	3,681,300
ルネサスエレクトロニクス	166,100	1,255.00	208,455,500
セイコーエプソン	48,000	1,768.00	84,864,000
ワコム	26,000	796.00	20,696,000
アルバック	7,100	5,110.00	36,281,000
アクセル	1,700	800.00	1,360,000
E I Z O	3,000	3,830.00	11,490,000
ジャパンディスプレイ	110,000	48.00	5,280,000
日本信号	9,800	957.00	9,378,600
京三製作所	8,900	426.00	3,791,400
能美防災	5,100	2,256.00	11,505,600
ホーチキ	2,700	1,294.00	3,493,800

星和電機	2,300	616.00	1,416,800
エレコム	4,400	4,980.00	21,912,000
パナソニック	412,500	1,441.50	594,618,750
シャープ	44,800	2,140.00	95,872,000
アンリツ	23,200	2,380.00	55,216,000
富士通ゼネラル	10,500	2,986.00	31,353,000
ソニー	242,300	11,980.00	2,902,754,000
TDK	18,700	16,260.00	304,062,000
帝国通信工業	1,800	1,143.00	2,057,400
タムラ製作所	12,800	556.00	7,116,800
アルプスアルパイン	31,500	1,437.00	45,265,500
池上通信機	1,300	833.00	1,082,900
日本電波工業	3,700	694.00	2,567,800
鈴木	2,200	1,071.00	2,356,200
日本トリム	600	4,390.00	2,634,000
ローランド ディー . ジー .	2,300	1,909.00	4,390,700
フォスター電機	4,000	1,307.00	5,228,000
SMK	1,100	3,015.00	3,316,500
ヨコオ	2,500	2,997.00	7,492,500
ティアック	3,000	126.00	378,000
ホシデン	10,500	1,087.00	11,413,500
ヒロセ電機	6,000	16,780.00	100,680,000
日本航空電子工業	8,800	1,696.00	14,924,800
TOA	4,000	903.00	3,612,000
マクセルホールディングス	8,300	1,444.00	11,985,200
古野電気	4,900	1,144.00	5,605,600
ユニデンホールディングス	1,200	2,356.00	2,827,200
スミダコーポレーション	3,200	1,027.00	3,286,400
アイコム	2,100	2,780.00	5,838,000
リオン	1,600	2,935.00	4,696,000
本多通信工業	3,800	523.00	1,987,400
船井電機	4,500	482.00	2,169,000
横河電機	38,700	2,143.00	82,934,100
新電元工業	1,300	3,160.00	4,108,000
アズビル	26,100	5,010.00	130,761,000
東亜ディーケーケー	2,000	832.00	1,664,000
日本光電工業	16,000	3,020.00	48,320,000
チノー	1,400	1,393.00	1,950,200
共和電業	4,600	385.00	1,771,000
日本電子材料	1,600	1,903.00	3,044,800
堀場製作所	7,700	6,740.00	51,898,000
アドバンテスト	28,800	9,670.00	278,496,000
小野測器	1,600	545.00	872,000
エスベック	3,400	1,927.00	6,551,800
キーエンス	38,000	56,750.00	2,156,500,000
日置電機	1,800	3,810.00	6,858,000
シスメックス	30,200	11,760.00	355,152,000
日本マイクロニクス	6,700	1,888.00	12,649,600
メガチップス	3,600	3,445.00	12,402,000

OBARA GROUP	2,200	3,970.00	8,734,000
IMAGICA GROUP	3,400	513.00	1,744,200
澤藤電機	400	2,319.00	927,600
デンソー	85,300	6,672.00	569,121,600
原田工業	1,700	914.00	1,553,800
コーセル	5,100	1,164.00	5,936,400
イリソ電子工業	3,200	5,040.00	16,128,000
オプテックスグループ	6,300	1,762.00	11,100,600
千代田インテグレ	1,800	1,800.00	3,240,000
アイ・オー・データ機器	1,700	1,003.00	1,705,100
レーザーテック	17,000	14,580.00	247,860,000
スタンレー電気	27,100	3,440.00	93,224,000
岩崎電気	1,600	1,521.00	2,433,600
ウシオ電機	19,800	1,377.00	27,264,600
岡谷電機産業	3,100	375.00	1,162,500
ヘリオス テクノ ホールディング	3,900	344.00	1,341,600
エノモト	1,400	1,868.00	2,615,200
日本セラミック	3,900	2,740.00	10,686,000
遠藤照明	1,900	647.00	1,229,300
古河電池	2,900	1,588.00	4,605,200
双信電機	1,800	447.00	804,600
山一電機	2,700	1,480.00	3,996,000
図研	2,500	2,950.00	7,375,000
日本電子	7,000	4,315.00	30,205,000
カシオ計算機	31,100	2,055.00	63,910,500
ファナック	34,000	27,585.00	937,890,000
日本シイエムケイ	8,900	437.00	3,889,300
エンブラス	2,000	4,645.00	9,290,000
大真空	1,500	2,680.00	4,020,000
ローム	16,100	11,470.00	184,667,000
浜松ホトニクス	27,800	6,820.00	189,596,000
三井ハイテック	3,800	4,535.00	17,233,000
新光電気工業	13,000	3,035.00	39,455,000
京セラ	59,000	6,944.00	409,696,000
協栄産業	600	1,386.00	831,600
太陽誘電	17,200	5,840.00	100,448,000
村田製作所	113,600	9,882.00	1,122,595,200
双葉電子工業	6,000	968.00	5,808,000
日東電工	24,800	9,430.00	233,864,000
北陸電気工業	1,500	937.00	1,405,500
東海理化電機製作所	10,200	1,806.00	18,421,200
ニチコン	13,100	1,147.00	15,025,700
日本ケミコン	3,100	1,847.00	5,725,700
K O A	5,800	1,520.00	8,816,000
三井E & Sホールディングス	13,800	441.00	6,085,800
日立造船	30,500	707.00	21,563,500
三菱重工業	60,800	3,055.00	185,744,000
川崎重工業	30,100	2,307.00	69,440,700
I H I	26,000	1,899.00	49,374,000

名村造船所	14,400	193.00	2,779,200
サノヤスホールディングス	4,800	152.00	729,600
スプリックス	1,300	839.00	1,090,700
マネジメントソリューションズ	1,700	1,990.00	3,383,000
プロレド・パートナーズ and factory	600 300	3,520.00 845.00	2,112,000 253,500
テノ・ホールディングス	300	1,094.00	328,200
フロンティア・マネジメント	600	1,903.00	1,141,800
ピアラ	200	1,824.00	364,800
コプロ・ホールディングス	300	2,832.00	849,600
ギークス	400	1,636.00	654,400
カーブスホールディングス	10,000	972.00	9,720,000
フォーラムエンジニアリング	2,100	1,059.00	2,223,900
日本車輛製造	1,600	2,491.00	3,985,600
三菱ロジスネクスト	5,100	1,154.00	5,885,400
近畿車輛	600	1,254.00	752,400
F P G	11,600	614.00	7,122,400
島根銀行	700	679.00	475,300
じもとホールディングス	2,900	797.00	2,311,300
全国保証	9,900	5,160.00	51,084,000
めぶきフィナンシャルグループ	198,200	234.00	46,378,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	2,100	1,313.00	2,757,300
東京きらぼしフィナンシャルグループ	5,100	1,231.00	6,278,100
九州フィナンシャルグループ	77,700	451.00	35,042,700
かんぼ生命保険	47,300	2,172.00	102,735,600
ゆうちょ銀行	108,200	1,006.00	108,849,200
富山第一銀行	10,500	297.00	3,118,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	232,200	426.00	98,917,200
ジェイリース	800	781.00	624,800
西日本フィナンシャルホールディングス	25,300	710.00	17,963,000
マーキュリアインベストメント	1,600	703.00	1,124,800
イントラスト	1,600	721.00	1,153,600
日本モーゲージサービス	1,800	1,115.00	2,007,000
C a s a	1,200	1,012.00	1,214,400
アルヒ	6,000	1,641.00	9,846,000
プレミアグループ	2,000	2,432.00	4,864,000
日産自動車	457,000	587.20	268,350,400
いすゞ自動車	112,200	1,124.00	126,112,800
トヨタ自動車	391,900	8,060.00	3,158,714,000
日野自動車	48,300	1,017.00	49,121,100
三菱自動車工業	143,000	293.00	41,899,000
エフテック	2,600	667.00	1,734,200
レシップホールディングス	1,800	600.00	1,080,000
G M B	700	921.00	644,700
ファルテック	700	821.00	574,700
武蔵精密工業	8,600	1,897.00	16,314,200
日産車体	7,500	808.00	6,060,000
新明和工業	10,300	961.00	9,898,300
極東開発工業	7,100	1,605.00	11,395,500

トピー工業	3,100	1,448.00	4,488,800
ティラド	1,600	1,849.00	2,958,400
曙ブレーキ工業	20,500	164.00	3,362,000
タチエス	6,300	1,101.00	6,936,300
N O K	18,600	1,473.00	27,397,800
フタバ産業	10,600	540.00	5,724,000
K Y B	4,300	3,010.00	12,943,000
市光工業	5,700	763.00	4,349,100
大同メタル工業	7,200	558.00	4,017,600
プレス工業	18,900	332.00	6,274,800
ミクニ	4,600	287.00	1,320,200
太平洋工業	8,000	1,214.00	9,712,000
河西工業	6,000	418.00	2,508,000
アイシン精機	28,300	3,640.00	103,012,000
マツダ	121,300	859.00	104,196,700
今仙電機製作所	3,900	770.00	3,003,000
本田技研工業	304,600	2,977.50	906,946,500
スズキ	76,800	4,918.00	377,702,400
S U B A R U	110,800	2,035.00	225,478,000
安永	2,000	1,186.00	2,372,000
ヤマハ発動機	54,700	2,410.00	131,827,000
小糸製作所	23,200	7,750.00	179,800,000
T B K	5,300	438.00	2,321,400
エクセディ	5,200	1,645.00	8,554,000
ミツバ	7,000	624.00	4,368,000
豊田合成	12,500	2,856.00	35,700,000
愛三工業	5,900	578.00	3,410,200
盟和産業	500	888.00	444,000
日本プラスト	2,900	596.00	1,728,400
ヨロズ	3,500	1,309.00	4,581,500
エフ・シー・シー	6,300	1,743.00	10,980,900
新家工業	900	1,477.00	1,329,300
シマノ	14,500	25,405.00	368,372,500
テイ・エス テック	9,000	3,050.00	27,450,000
関西みらいフィナンシャルグループ	17,700	611.00	10,814,700
三十三フィナンシャルグループ	3,500	1,369.00	4,791,500
第四北越フィナンシャルグループ	6,600	2,334.00	15,404,400
ひろぎんホールディングス	56,200	650.00	36,530,000
ダイレクトマーケティングミックス	1,600	3,315.00	5,304,000
ポピンズホールディングス	700	3,215.00	2,250,500
ジャムコ	2,600	888.00	2,308,800
小野建	3,300	1,323.00	4,365,900
はるやまホールディングス	1,600	713.00	1,140,800
南陽	900	1,652.00	1,486,800
ノジマ	6,800	2,911.00	19,794,800
佐鳥電機	3,000	807.00	2,421,000
カップ・クリエイト	5,300	1,511.00	8,008,300
エコートレーディング	1,000	693.00	693,000
伯東	2,500	1,282.00	3,205,000

コンドーテック	3,400	1,068.00	3,631,200
中山福	2,300	517.00	1,189,100
ライトオン	3,200	634.00	2,028,800
ナガイレーベン	5,000	2,785.00	13,925,000
ジーンズメイト	1,300	289.00	375,700
三菱食品	4,200	2,962.00	12,440,400
良品計画	50,600	2,515.00	127,259,000
三城ホールディングス	4,900	303.00	1,484,700
松田産業	2,700	1,941.00	5,240,700
第一興商	5,700	4,115.00	23,455,500
メディカルホールディングス	38,100	2,236.00	85,191,600
アドヴァン	3,800	1,119.00	4,252,200
S P K	1,800	1,268.00	2,282,400
萩原電気ホールディングス	1,600	2,585.00	4,136,000
アルビス	1,400	2,456.00	3,438,400
アズワン	2,700	14,760.00	39,852,000
スズデン	1,500	1,268.00	1,902,000
尾家産業	1,200	1,397.00	1,676,400
シモジマ	2,300	1,399.00	3,217,700
ドウシシャ	3,500	1,832.00	6,412,000
小津産業	1,000	1,919.00	1,919,000
コナカ	4,200	364.00	1,528,800
高速	2,200	1,544.00	3,396,800
ハウス オブ ローゼ	600	1,700.00	1,020,000
G - 7ホールディングス	2,200	2,315.00	5,093,000
たけびし	1,400	1,540.00	2,156,000
イオン北海道	4,900	1,154.00	5,654,600
コジマ	7,100	645.00	4,579,500
ヒマラヤ	1,200	973.00	1,167,600
コーナン商事	5,400	3,015.00	16,281,000
ネットワンシステムズ	15,500	3,300.00	51,150,000
エコス	1,600	1,955.00	3,128,000
ワタミ	4,400	1,007.00	4,430,800
マルシェ	700	515.00	360,500
リックス	1,000	1,544.00	1,544,000
システムソフト	9,500	135.00	1,282,500
パン・パシフィック・インターナショナルホ	76,100	2,550.00	194,055,000
丸文	3,600	529.00	1,904,400
西松屋チェーン	8,300	1,542.00	12,798,600
ゼンショーホールディングス	20,400	2,885.00	58,854,000
ハピネット	3,100	1,535.00	4,758,500
幸楽苑ホールディングス	2,400	1,799.00	4,317,600
ハークスレイ	800	904.00	723,200
橋本総業ホールディングス	800	2,597.00	2,077,600
日本ライフライン	11,200	1,320.00	14,784,000
サイゼリヤ	5,600	2,195.00	12,292,000
タカショー	1,900	806.00	1,531,400
V Tホールディングス	15,600	424.00	6,614,400
マルカ	1,200	2,017.00	2,420,400



アルゴグラフィックス	3,200	3,050.00	9,760,000
魚力	1,200	1,878.00	2,253,600
I D O M	10,100	634.00	6,403,400
日本エム・ディ・エム	2,200	2,006.00	4,413,200
ポプラ	700	340.00	238,000
フジ・コーポレーション	1,100	2,235.00	2,458,500
ユナイテッドアローズ	3,900	2,032.00	7,924,800
進和	2,200	2,147.00	4,723,400
エスケイジャパン	900	464.00	417,600
ダイトロン	1,800	1,567.00	2,820,600
ハイデイ日高	5,500	1,802.00	9,911,000
シークス	4,800	1,756.00	8,428,800
京都きもの友禅	2,200	251.00	552,200
コロワイド	12,600	1,994.00	25,124,400
ピーシーデポコーポレーション	5,500	532.00	2,926,000
田中商事	1,600	702.00	1,123,200
オーハシテクニカ	2,100	1,445.00	3,034,500
壱番屋	2,700	4,990.00	13,473,000
白銅	1,500	1,393.00	2,089,500
トップカルチャー	1,700	352.00	598,400
P L A N T	700	769.00	538,300
スギホールディングス	7,600	7,450.00	56,620,000
ダイコー通産	300	1,518.00	455,400
薬王堂ホールディングス	1,600	2,716.00	4,345,600
島津製作所	49,800	4,365.00	217,377,000
J M S	3,200	983.00	3,145,600
クボテック	1,100	372.00	409,200
長野計器	3,200	1,006.00	3,219,200
ブイ・テクノロジー	1,800	5,940.00	10,692,000
スター精密	5,900	1,618.00	9,546,200
東京計器	2,600	927.00	2,410,200
愛知時計電機	600	4,395.00	2,637,000
インターアクション	2,300	2,691.00	6,189,300
オーバル	4,300	305.00	1,311,500
東京精密	6,500	5,130.00	33,345,000
マニー	15,400	2,695.00	41,503,000
ニコン	59,100	919.00	54,312,900
トプコン	19,500	1,270.00	24,765,000
オリンパス	214,500	2,240.50	480,587,250
理研計器	3,400	2,791.00	9,489,400
S C R E E Nホールディングス	6,700	9,370.00	62,779,000
キヤノン電子	3,500	1,692.00	5,922,000
タムロン	3,100	1,969.00	6,103,900
H O Y A	76,700	13,060.00	1,001,702,000
シード	2,300	656.00	1,508,800
ノーリツ鋼機	2,600	2,385.00	6,201,000
エー・アンド・デイ	3,800	1,223.00	4,647,400
朝日インテック	40,700	3,280.00	133,496,000
キヤノン	192,600	2,338.50	450,395,100

リコー	98,500	948.00	93,378,000
シチズン時計	45,100	388.00	17,498,800
リズム	1,200	790.00	948,000
大研医器	3,300	573.00	1,890,900
メニコン	5,500	6,810.00	37,455,000
シンシア	400	772.00	308,800
中本ボックス	1,100	1,758.00	1,933,800
スノーピーク	2,400	3,170.00	7,608,000
パラマウントベッドホールディングス	3,700	4,540.00	16,798,000
トランザクション	2,000	1,168.00	2,336,000
粧美堂	1,600	404.00	646,400
ニホンフラッシュ	3,500	1,226.00	4,291,000
前田工織	4,200	2,966.00	12,457,200
永大産業	5,400	302.00	1,630,800
アートネイチャー	4,800	670.00	3,216,000
バンダイナムコホールディングス	32,000	8,744.00	279,808,000
アイフィスジャパン	900	707.00	636,300
共立印刷	6,000	126.00	756,000
SHOEI	3,400	4,260.00	14,484,000
フランスベッドホールディングス	5,400	962.00	5,194,800
マーベラス	5,700	947.00	5,397,900
パイロットコーポレーション	6,800	3,305.00	22,474,000
萩原工業	2,100	1,496.00	3,141,600
エイベックス	6,400	1,493.00	9,555,200
トッパン・フォームズ	8,200	1,040.00	8,528,000
フジシールインターナショナル	8,600	2,149.00	18,481,400
タカラトミー	17,300	999.00	17,282,700
廣済堂	2,900	936.00	2,714,400
エステールホールディングス	1,000	646.00	646,000
レック	4,100	1,356.00	5,559,600
タカノ	1,700	609.00	1,035,300
三光合成	4,700	444.00	2,086,800
プロネクサス	3,200	1,208.00	3,865,600
ホクシン	3,100	118.00	365,800
ウッドワン	1,400	1,075.00	1,505,000
大建工業	2,600	2,012.00	5,231,200
きもと	6,100	197.00	1,201,700
凸版印刷	58,700	1,681.00	98,674,700
大日本印刷	46,700	1,943.00	90,738,100
共同印刷	1,200	3,100.00	3,720,000
N I S S H A	7,900	1,441.00	11,383,900
光村印刷	300	1,790.00	537,000
藤森工業	3,500	4,630.00	16,205,000
ヴィア・ホールディングス	5,400	220.00	1,188,000
TAKARA & COMPANY	1,800	1,745.00	3,141,000
前澤化成工業	2,800	968.00	2,710,400
未来工業	2,000	1,736.00	3,472,000
アシックス	34,200	1,777.00	60,773,400
ツツミ	1,300	2,094.00	2,722,200

ウェーブロックホールディングス	1,900	734.00	1,394,600
J S P	2,200	1,815.00	3,993,000
ニチハ	5,400	3,045.00	16,443,000
ローランド	2,200	3,500.00	7,700,000
エフピコ	7,100	4,250.00	30,175,000
小松ウオール工業	1,400	1,934.00	2,707,600
ヤマハ	23,000	5,770.00	132,710,000
河合楽器製作所	1,200	3,650.00	4,380,000
クリナップ	4,100	510.00	2,091,000
ビジョン	24,900	4,090.00	101,841,000
天馬	2,500	2,150.00	5,375,000
オリバー	900	2,573.00	2,315,700
兼松サステック	400	1,759.00	703,600
キングジム	3,700	887.00	3,281,900
象印マホービン	10,400	1,824.00	18,969,600
リンテック	8,200	2,415.00	19,803,000
信越ポリマー	6,900	1,027.00	7,086,300
東リ	11,100	245.00	2,719,500
イトーキ	7,400	364.00	2,693,600
任天堂	22,100	68,030.00	1,503,463,000
三菱鉛筆	6,300	1,400.00	8,820,000
松風	1,700	1,808.00	3,073,600
タカラスタンダード	7,900	1,571.00	12,410,900
コクヨ	18,500	1,423.00	26,325,500
ナカバヤシ	4,400	620.00	2,728,000
ニフコ	14,200	3,795.00	53,889,000
立川ブラインド工業	1,800	1,271.00	2,287,800
グローブライド	1,700	4,060.00	6,902,000
オカムラ	13,400	1,073.00	14,378,200
バルカー	3,100	2,123.00	6,581,300
MUTOHホールディングス	500	1,590.00	795,000
伊藤忠商事	267,000	3,250.00	867,750,000
丸紅	375,600	786.60	295,446,960
スクロール	6,300	1,251.00	7,881,300
高島	700	1,713.00	1,199,100
ヨンドシーホールディングス	3,800	1,957.00	7,436,600
三陽商会	2,300	728.00	1,674,400
長瀬産業	21,400	1,740.00	37,236,000
ナイガイ	1,200	330.00	396,000
蝶理	2,400	1,581.00	3,794,400
豊田通商	38,300	4,605.00	176,371,500
オンワードホールディングス	22,300	276.00	6,154,800
三共生興	5,600	499.00	2,794,400
兼松	14,200	1,388.00	19,709,600
美津濃	3,500	2,228.00	7,798,000
ツカモトコーポレーション	900	1,511.00	1,359,900
ルックホールディングス	1,300	1,155.00	1,501,500
三井物産	309,300	2,214.50	684,944,850
日本紙パルプ商事	2,100	3,665.00	7,696,500

東京エレクトロン	22,700	46,300.00	1,051,010,000
カメイ	4,900	1,193.00	5,845,700
東都水産	500	3,890.00	1,945,000
OUGホールディングス	600	2,821.00	1,692,600
スターゼン	1,400	4,310.00	6,034,000
セイコーホールディングス	5,400	1,680.00	9,072,000
山善	14,800	1,010.00	14,948,000
椿本興業	800	3,780.00	3,024,000
住友商事	240,800	1,565.50	376,972,400
日本ユニシス	13,100	3,245.00	42,509,500
内田洋行	1,500	4,555.00	6,832,500
三菱商事	232,000	2,982.50	691,940,000
第一実業	1,800	4,145.00	7,461,000
キヤノンマーケティングジャパン	9,400	2,387.00	22,437,800
西華産業	2,300	1,398.00	3,215,400
佐藤商事	3,600	999.00	3,596,400
菱洋エレクトロ	2,900	2,831.00	8,209,900
東京産業	3,700	673.00	2,490,100
ユアサ商事	3,600	3,080.00	11,088,000
神鋼商事	1,100	1,919.00	2,110,900
トルク	2,600	257.00	668,200
阪和興業	7,100	2,857.00	20,284,700
正栄食品工業	2,400	3,910.00	9,384,000
カナデン	3,000	1,266.00	3,798,000
菱電商事	2,700	1,573.00	4,247,100
ニプロ	26,700	1,388.00	37,059,600
フルサト工業	2,400	1,322.00	3,172,800
岩谷産業	9,100	6,360.00	57,876,000
ナイス	1,800	1,794.00	3,229,200
昭光通商	1,300	752.00	977,600
ニチモウ	700	1,934.00	1,353,800
極東貿易	1,200	1,415.00	1,698,000
イワキ	5,700	620.00	3,534,000
兼松エレクトロニクス	2,000	3,655.00	7,310,000
三愛石油	9,300	1,077.00	10,016,100
稲畑産業	8,300	1,532.00	12,715,600
G S Iクレオス	900	2,511.00	2,259,900
明和産業	4,100	472.00	1,935,200
クワザワホールディングス	1,300	672.00	873,600
キムラタン	14,500	25.00	362,500
ヤマエ久野	3,100	1,063.00	3,295,300
ゴールドウイン	6,300	7,380.00	46,494,000
ユニ・チャーム	82,200	4,644.00	381,736,800
デザート	6,400	1,771.00	11,334,400
キング	1,700	570.00	969,000
ワキタ	8,100	1,018.00	8,245,800
ヤマトインターナショナル	4,100	336.00	1,377,600
東邦ホールディングス	12,200	1,969.00	24,021,800
サンゲツ	10,200	1,604.00	16,360,800

ミツウロコグループホールディングス	5,600	1,252.00	7,011,200
シナネンホールディングス	1,500	3,230.00	4,845,000
伊藤忠エネクス	8,300	1,033.00	8,573,900
サンリオ	10,700	1,722.00	18,425,400
サンワテクノス	2,900	1,047.00	3,036,300
リョーサン	4,200	2,274.00	9,550,800
新光商事	6,300	777.00	4,895,100
トーホー	1,700	1,830.00	3,111,000
三信電気	2,000	2,029.00	4,058,000
東陽テクニカ	4,500	1,131.00	5,089,500
モスフードサービス	5,000	3,120.00	15,600,000
加賀電子	3,800	2,388.00	9,074,400
三益半導体工業	3,000	2,649.00	7,947,000
都築電気	1,300	1,536.00	1,996,800
ソーダニッカ	4,500	541.00	2,434,500
立花エレテック	2,800	1,574.00	4,407,200
木曽路	5,000	2,454.00	12,270,000
S R Sホールディングス	4,400	870.00	3,828,000
千趣会	7,900	373.00	2,946,700
タカキュー	3,300	146.00	481,800
リテールパートナーズ	5,000	1,483.00	7,415,000
ケーヨー	7,700	756.00	5,821,200
上新電機	4,500	3,100.00	13,950,000
日本瓦斯	6,000	5,020.00	30,120,000
ロイヤルホールディングス	6,600	1,885.00	12,441,000
東天紅	300	940.00	282,000
いなげや	4,700	1,685.00	7,919,500
チヨダ	3,900	1,001.00	3,903,900
ライフコーポレーション	2,900	3,310.00	9,599,000
リンガーハット	4,700	2,405.00	11,303,500
Mr Max HD	5,600	768.00	4,300,800
テンアライド	4,900	353.00	1,729,700
A O K Iホールディングス	8,400	653.00	5,485,200
オークワ	5,900	1,195.00	7,050,500
コメリ	5,900	2,949.00	17,399,100
青山商事	8,700	778.00	6,768,600
しまむら	4,400	11,430.00	50,292,000
はせがわ	2,100	293.00	615,300
高島屋	27,700	1,052.00	29,140,400
松屋	7,600	964.00	7,326,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	17,900	842.00	15,071,800
近鉄百貨店	1,400	3,375.00	4,725,000
丸井グループ	32,200	2,062.00	66,396,400
クレディセゾン	22,200	1,323.00	29,370,600
アクシアル リテイリング	3,100	4,790.00	14,849,000
井筒屋	1,700	264.00	448,800
イオン	146,900	3,550.00	521,495,000
イズミ	7,700	3,910.00	30,107,000
フォーバル	1,900	843.00	1,601,700

平和堂	7,700	2,059.00	15,854,300
フジ	4,600	1,984.00	9,126,400
ヤオコー	4,300	6,670.00	28,681,000
ゼビオホールディングス	4,500	931.00	4,189,500
ケーズホールディングス	33,900	1,523.00	51,629,700
PALTAC	6,100	5,690.00	34,709,000
三谷産業	5,900	432.00	2,548,800
Olympicグループ	1,900	940.00	1,786,000
日産東京販売ホールディングス	5,900	253.00	1,492,700
新生銀行	31,000	1,541.00	47,771,000
あおぞら銀行	22,700	2,301.00	52,232,700
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,610,000	563.30	1,470,213,000
りそなホールディングス	415,400	436.30	181,239,020
三井住友トラスト・ホールディングス	72,200	3,613.00	260,858,600
三井住友フィナンシャルグループ	264,400	3,763.00	994,937,200
千葉銀行	127,400	711.00	90,581,400
群馬銀行	73,100	348.00	25,438,800
武蔵野銀行	5,600	1,609.00	9,010,400
千葉興業銀行	12,000	272.00	3,264,000
筑波銀行	18,300	187.00	3,422,100
七十七銀行	12,800	1,442.00	18,457,600
青森銀行	2,900	2,462.00	7,139,800
秋田銀行	2,400	1,433.00	3,439,200
山形銀行	4,700	1,115.00	5,240,500
岩手銀行	2,500	2,142.00	5,355,000
東邦銀行	33,700	213.00	7,178,100
東北銀行	2,000	1,087.00	2,174,000
みちのく銀行	2,800	1,066.00	2,984,800
ふくおかフィナンシャルグループ	34,400	2,028.00	69,763,200
静岡銀行	93,000	798.00	74,214,000
十六銀行	4,700	2,000.00	9,400,000
スルガ銀行	33,100	361.00	11,949,100
八十二銀行	85,700	366.00	31,366,200
山梨中央銀行	4,300	906.00	3,895,800
大垣共立銀行	7,500	2,077.00	15,577,500
福井銀行	3,200	1,939.00	6,204,800
北國銀行	3,800	2,690.00	10,222,000
清水銀行	1,800	1,657.00	2,982,600
富山銀行	800	2,943.00	2,354,400
滋賀銀行	7,600	2,056.00	15,625,600
南都銀行	6,300	1,836.00	11,566,800
百五銀行	34,100	311.00	10,605,100
京都銀行	13,700	6,610.00	90,557,000
紀陽銀行	13,500	1,446.00	19,521,000
ほくほくフィナンシャルグループ	25,400	976.00	24,790,400
山陰合同銀行	22,500	497.00	11,182,500
中国銀行	32,800	870.00	28,536,000
鳥取銀行	1,400	1,127.00	1,577,800
伊予銀行	50,400	641.00	32,306,400

百十四銀行	4,000	1,599.00	6,396,000
四国銀行	5,700	736.00	4,195,200
阿波銀行	6,200	2,297.00	14,241,400
大分銀行	2,200	2,155.00	4,741,000
宮崎銀行	2,500	2,289.00	5,722,500
佐賀銀行	2,300	1,416.00	3,256,800
沖縄銀行	3,500	2,819.00	9,866,500
琉球銀行	8,700	789.00	6,864,300
セブン銀行	127,300	243.00	30,933,900
みずほフィナンシャルグループ	519,500	1,588.50	825,225,750
高知銀行	1,300	852.00	1,107,600
山口フィナンシャルグループ	47,600	673.00	32,034,800
芙蓉総合リース	4,000	7,190.00	28,760,000
みずほリース	5,900	3,375.00	19,912,500
東京センチュリー	8,900	7,350.00	65,415,000
SBIホールディングス	46,700	3,120.00	145,704,000
日本証券金融	16,700	611.00	10,203,700
アイフル	58,000	279.00	16,182,000
日本アジア投資	4,000	258.00	1,032,000
長野銀行	1,200	1,307.00	1,568,400
名古屋銀行	2,800	2,842.00	7,957,600
北洋銀行	57,200	237.00	13,556,400
愛知銀行	1,400	2,933.00	4,106,200
中京銀行	1,800	1,785.00	3,213,000
大光銀行	1,500	1,379.00	2,068,500
愛媛銀行	5,200	1,001.00	5,205,200
トマト銀行	1,400	1,070.00	1,498,000
京葉銀行	16,100	436.00	7,019,600
栃木銀行	17,900	180.00	3,222,000
北日本銀行	1,300	1,932.00	2,511,600
東和銀行	6,600	695.00	4,587,000
福島銀行	3,400	275.00	935,000
大東銀行	1,800	660.00	1,188,000
リコーリース	3,000	3,300.00	9,900,000
イオンフィナンシャルサービス	23,300	1,397.00	32,550,100
アコム	76,600	473.00	36,231,800
ジャックス	4,200	2,083.00	8,748,600
オリエントコーポレーション	102,600	154.00	15,800,400
日立キャピタル	9,000	2,904.00	26,136,000
オリックス	237,200	1,784.00	423,164,800
三菱UFJリース	85,900	573.00	49,220,700
ジャフコグループ	5,900	6,860.00	40,474,000
九州リースサービス	1,700	643.00	1,093,100
トモニホールディングス	29,300	312.00	9,141,600
大和証券グループ本社	285,600	529.00	151,082,400
野村ホールディングス	582,400	632.10	368,135,040
岡三証券グループ	32,300	418.00	13,501,400
丸三証券	11,200	625.00	7,000,000
東洋証券	14,700	187.00	2,748,900

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	43,600	388.00	16,916,800
光世証券	900	703.00	632,700
水戸証券	12,700	305.00	3,873,500
いちよし証券	6,900	637.00	4,395,300
松井証券	18,600	926.00	17,223,600
S O M P Oホールディングス	67,200	4,124.00	277,132,800
日本取引所グループ	103,000	2,405.50	247,766,500
マネックスグループ	27,800	974.00	27,077,200
極東証券	5,000	831.00	4,155,000
岩井コスモホールディングス	3,500	1,597.00	5,589,500
藍澤證券	6,700	880.00	5,896,000
フィデアホールディングス	36,200	125.00	4,525,000
池田泉州ホールディングス	43,300	163.00	7,057,900
アニコム ホールディングス	10,700	1,078.00	11,534,600
M S & A Dインシュアランスグループホール	92,600	3,133.00	290,115,800
マネーパートナーズグループ	4,400	333.00	1,465,200
スパークス・グループ	17,300	337.00	5,830,100
小林洋行	1,300	283.00	367,900
第一生命ホールディングス	201,500	1,902.00	383,253,000
東京海上ホールディングス	126,500	5,351.00	676,901,500
アドバンテッジリスクマネジメント	2,200	736.00	1,619,200
イー・ギャランティ	4,500	2,172.00	9,774,000
アサックス	2,100	739.00	1,551,900
N E Cキャピタルソリューション	1,800	2,000.00	3,600,000
T & Dホールディングス	114,200	1,467.00	167,531,400
アドバンスクリエイト	900	1,818.00	1,636,200
三井不動産	173,900	2,395.00	416,490,500
三菱地所	250,600	1,849.50	463,484,700
平和不動産	6,500	3,575.00	23,237,500
東京建物	37,700	1,560.00	58,812,000
ダイビル	9,800	1,304.00	12,779,200
京阪神ビルディング	6,100	1,535.00	9,363,500
住友不動産	85,900	3,675.00	315,682,500
太平洋興発	1,500	659.00	988,500
テーオーシー	7,400	780.00	5,772,000
東京楽天地	700	4,430.00	3,101,000
レオパレス21	31,000	130.00	4,030,000
スターツコーポレーション	4,500	2,896.00	13,032,000
フジ住宅	4,300	654.00	2,812,200
空港施設	4,200	524.00	2,200,800
明和地所	2,100	645.00	1,354,500
ゴールドクレスト	3,000	1,719.00	5,157,000
リログループ	20,200	2,572.00	51,954,400
エスリード	1,600	1,594.00	2,550,400
日神グループホールディングス	6,500	441.00	2,866,500
日本エスコン	6,800	769.00	5,229,200
タカラレーベン	17,200	350.00	6,020,000
A V A N T I A	2,000	889.00	1,778,000
イオンモール	19,100	1,863.00	35,583,300



毎日コムネット	1,200	690.00	828,000
ファースト住建	1,900	1,110.00	2,109,000
ランド	239,500	10.00	2,395,000
カチタス	9,400	3,025.00	28,435,000
東祥	2,200	1,990.00	4,378,000
トーセイ	5,200	1,027.00	5,340,400
穴吹興産	1,000	1,725.00	1,725,000
サンフロンティア不動産	5,200	928.00	4,825,600
エフ・ジェー・ネクスト	3,800	1,126.00	4,278,800
インテリックス	1,300	578.00	751,400
ランドビジネス	1,700	368.00	625,600
サンネクスタグループ	1,000	970.00	970,000
グランディハウス	3,400	457.00	1,553,800
東武鉄道	40,400	3,040.00	122,816,000
相鉄ホールディングス	12,400	2,473.00	30,665,200
東急	97,700	1,453.00	141,958,100
京浜急行電鉄	49,700	1,807.00	89,807,900
小田急電鉄	61,900	3,225.00	199,627,500
京王電鉄	21,600	8,380.00	181,008,000
京成電鉄	29,000	3,790.00	109,910,000
富士急行	5,300	5,790.00	30,687,000
新京成電鉄	1,100	2,245.00	2,469,500
東日本旅客鉄道	68,200	7,625.00	520,025,000
西日本旅客鉄道	34,500	6,312.00	217,764,000
東海旅客鉄道	32,200	17,600.00	566,720,000
西武ホールディングス	46,500	1,298.00	60,357,000
鴻池運輸	6,100	1,090.00	6,649,000
西日本鉄道	10,700	3,015.00	32,260,500
ハマキョウレックス	2,900	3,345.00	9,700,500
サカイ引越センター	2,000	4,900.00	9,800,000
近鉄グループホールディングス	36,700	4,560.00	167,352,000
阪急阪神ホールディングス	48,900	3,625.00	177,262,500
南海電気鉄道	17,400	2,611.00	45,431,400
京阪ホールディングス	16,300	4,910.00	80,033,000
神戸電鉄	1,000	3,680.00	3,680,000
名古屋鉄道	30,100	2,763.00	83,166,300
山陽電気鉄道	2,600	1,995.00	5,187,000
トランコム	1,000	8,170.00	8,170,000
日本通運	12,700	7,990.00	101,473,000
ヤマトホールディングス	51,300	2,854.00	146,410,200
山九	9,400	4,470.00	42,018,000
日新	3,500	1,391.00	4,868,500
丸運	2,800	256.00	716,800
丸全昭和運輸	2,900	3,130.00	9,077,000
センコーグループホールディングス	20,100	1,040.00	20,904,000
トナミホールディングス	900	5,440.00	4,896,000
ニッコンホールディングス	12,200	2,154.00	26,278,800
日本石油輸送	400	2,661.00	1,064,400
福山通運	4,700	4,335.00	20,374,500

セイノーホールディングス	27,400	1,534.00	42,031,600
エスライン	1,100	883.00	971,300
神奈川中央交通	900	3,825.00	3,442,500
日立物流	8,000	3,355.00	26,840,000
丸和運輸機関	7,800	2,177.00	16,980,600
C & F ロジホールディングス	3,700	1,796.00	6,645,200
日本郵船	30,700	3,055.00	93,788,500
商船三井	21,700	3,355.00	72,803,500
川崎汽船	11,300	2,065.00	23,334,500
N S ユナイテッド海運	2,300	1,607.00	3,696,100
明治海運	3,700	380.00	1,406,000
飯野海運	17,200	453.00	7,791,600
共栄タンカー	600	1,011.00	606,600
九州旅客鉄道	28,300	2,553.00	72,249,900
S G ホールディングス	69,200	2,655.00	183,726,000
日本航空	89,200	2,416.00	215,507,200
A N A ホールディングス	98,800	2,550.50	251,989,400
パスコ	1,000	1,370.00	1,370,000
西本W i s m e t t a c ホールディングス	900	2,911.00	2,619,900
シルバーライフ	500	2,119.00	1,059,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	400	1,541.00	616,400
一家ダイニングプロジェクト	400	602.00	240,800
Genky Drug Stores	1,700	3,595.00	6,111,500
コア商事ホールディングス	800	1,258.00	1,006,400
国際紙パルプ商事	9,800	244.00	2,391,200
ナルミヤ・インターナショナル	600	1,019.00	611,400
ブックオフグループホールディングス	2,600	886.00	2,303,600
ギフト	400	2,070.00	828,000
三菱倉庫	11,600	3,390.00	39,324,000
三井倉庫ホールディングス	4,100	2,240.00	9,184,000
住友倉庫	13,100	1,463.00	19,165,300
澁澤倉庫	2,000	2,290.00	4,580,000
ヤマタネ	2,200	1,442.00	3,172,400
東陽倉庫	7,600	332.00	2,523,200
乾汽船	2,400	935.00	2,244,000
日本トランスシティ	7,900	569.00	4,495,100
ケイヒン	600	1,367.00	820,200
中央倉庫	2,600	1,183.00	3,075,800
川西倉庫	700	1,198.00	838,600
安田倉庫	3,500	946.00	3,311,000
ファイズホールディングス	1,000	1,002.00	1,002,000
東洋埠頭	1,200	1,428.00	1,713,600
宇徳	3,400	466.00	1,584,400
上組	20,400	2,008.00	40,963,200
サンリツ	1,200	701.00	841,200
キムラユニティー	1,400	1,127.00	1,577,800
キューソー流通システム	1,000	1,573.00	1,573,000
近鉄エクスプレス	6,900	2,771.00	19,119,900
東海運	2,700	320.00	864,000

エーアイティー	2,800	1,072.00	3,001,600
内外トランスライン	1,500	1,293.00	1,939,500
ショーエイコーポレーション	700	1,012.00	708,400
日本コンセプト	1,400	1,653.00	2,314,200
TBSホールディングス	25,100	2,053.00	51,530,300
日本テレビホールディングス	31,700	1,417.00	44,918,900
朝日放送グループホールディングス	4,300	723.00	3,108,900
テレビ朝日ホールディングス	10,400	2,164.00	22,505,600
スカパーJSAホールディングス	24,800	460.00	11,408,000
テレビ東京ホールディングス	3,100	2,482.00	7,694,200
日本BS放送	1,400	1,168.00	1,635,200
ビジョン	4,600	989.00	4,549,400
スマートバリュー	1,000	912.00	912,000
USEN-NEXT HOLDINGS	1,700	1,952.00	3,318,400
ワイヤレスゲート	2,200	519.00	1,141,800
コネクシオ	2,100	1,396.00	2,931,600
日本通信	29,100	258.00	7,507,800
クロップス	800	795.00	636,000
日本電信電話	444,000	2,818.50	1,251,414,000
KDDI	304,400	3,391.00	1,032,220,400
ソフトバンク	345,600	1,448.00	500,428,800
光通信	4,500	21,200.00	95,400,000
エムティーアイ	4,000	859.00	3,436,000
GMOインターネット	13,600	3,645.00	49,572,000
ファイバーゲート	1,400	2,132.00	2,984,800
アйдママーケティングコミュニケーション	1,400	485.00	679,000
KADOKAWA	10,200	4,180.00	42,636,000
学研ホールディングス	5,000	1,585.00	7,925,000
ゼンリン	7,500	1,355.00	10,162,500
昭文社ホールディングス	1,500	468.00	702,000
インプレスホールディングス	3,200	197.00	630,400
東京電力ホールディングス	327,900	358.00	117,388,200
中部電力	118,500	1,322.50	156,716,250
関西電力	146,800	1,072.50	157,443,000
中国電力	55,800	1,304.00	72,763,200
北陸電力	35,300	674.00	23,792,200
東北電力	90,500	945.00	85,522,500
四国電力	32,000	761.00	24,352,000
九州電力	85,300	930.00	79,329,000
北海道電力	36,000	465.00	16,740,000
沖縄電力	7,500	1,457.00	10,927,500
電源開発	30,800	1,761.00	54,238,800
エフオン	2,200	1,048.00	2,305,600
イーレックス	5,600	1,735.00	9,716,000
レノバ	6,500	3,375.00	21,937,500
東京瓦斯	74,500	2,313.00	172,318,500
大阪瓦斯	70,000	1,964.00	137,480,000
東邦瓦斯	19,100	6,470.00	123,577,000
北海道瓦斯	2,000	1,607.00	3,214,000

広島ガス	9,100	381.00	3,467,100
西部瓦斯	4,300	2,936.00	12,624,800
静岡ガス	10,900	957.00	10,431,300
メタウォーター	3,700	2,180.00	8,066,000
アイネット	1,900	1,508.00	2,865,200
松竹	2,500	15,630.00	39,075,000
東宝	22,400	4,230.00	94,752,000
エイチ・アイ・エス	5,300	2,353.00	12,470,900
東映	1,200	21,300.00	25,560,000
ラックランド	1,200	2,366.00	2,839,200
エヌ・ティ・ティ・データ	101,200	1,617.00	163,640,400
共立メンテナンス	6,100	3,890.00	23,729,000
イチネンホールディングス	4,100	1,330.00	5,453,000
建設技術研究所	2,600	2,384.00	6,198,400
スペース	2,800	883.00	2,472,400
長大	1,600	1,532.00	2,451,200
アインホールディングス	5,500	7,140.00	39,270,000
燦ホールディングス	1,800	1,121.00	2,017,800
ピー・シー・エー	600	4,230.00	2,538,000
スバル興業	200	8,230.00	1,646,000
東京テアトル	1,600	1,305.00	2,088,000
タナベ経営	700	1,395.00	976,500
ビジネスブレイン太田昭和	1,400	1,709.00	2,392,600
ナガワ	1,200	10,480.00	12,576,000
東京都競馬	2,400	4,810.00	11,544,000
常磐興産	1,700	1,404.00	2,386,800
カナモト	6,500	2,398.00	15,587,000
D T S	8,500	2,406.00	20,451,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	16,200	6,510.00	105,462,000
シーイーシー	4,000	1,465.00	5,860,000
カブコン	16,300	6,700.00	109,210,000
西尾レントオール	3,400	2,704.00	9,193,600
アイ・エス・ピー	2,000	1,239.00	2,478,000
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	29,000	26.00	754,000
日本空港ビルデング	12,200	5,230.00	63,806,000
トランス・コスモス	3,500	2,772.00	9,702,000
乃村工藝社	15,800	822.00	12,987,600
ジャステック	2,400	1,252.00	3,004,800
S C S K	8,800	6,560.00	57,728,000
藤田観光	1,400	1,825.00	2,555,000
K N T - C Tホールディングス	2,500	1,117.00	2,792,500
日本管財	3,900	2,127.00	8,295,300
トーカイ	3,500	2,232.00	7,812,000
白洋舎	400	2,355.00	942,000
セコム	36,400	9,677.00	352,242,800
日本システムウエア	1,400	2,053.00	2,874,200
セントラル警備保障	1,800	3,435.00	6,183,000
アイネス	3,700	1,397.00	5,168,900
丹青社	6,900	823.00	5,678,700

メイテック	4,500	5,830.00	26,235,000
TKC	3,200	6,660.00	21,312,000
富士ソフト	4,000	5,620.00	22,480,000
応用地質	4,700	1,267.00	5,954,900
船井総研ホールディングス	7,600	2,299.00	17,472,400
NSD	12,200	1,914.00	23,350,800
進学会ホールディングス	1,400	472.00	660,800
丸紅建材リース	400	1,870.00	748,000
オオバ	2,800	742.00	2,077,600
コナミホールディングス	13,800	7,460.00	102,948,000
いであ	800	1,729.00	1,383,200
学究社	1,300	1,329.00	1,727,700
ベネッセホールディングス	12,300	2,149.00	26,432,700
イオンディライト	4,500	3,135.00	14,107,500
ナック	2,400	979.00	2,349,600
福井コンピュータホールディングス	1,500	3,625.00	5,437,500
ダイセキ	6,200	3,465.00	21,483,000
ステップ	1,500	1,505.00	2,257,500
日鉄物産	2,700	3,935.00	10,624,500
泉州電業	1,200	3,675.00	4,410,000
元気寿司	1,100	2,516.00	2,767,600
トラスコ中山	8,700	2,667.00	23,202,900
ヤマダホールディングス	127,500	542.00	69,105,000
オートバックスセブン	14,100	1,431.00	20,177,100
モリト	3,000	614.00	1,842,000
アークランドサカモト	5,900	1,613.00	9,516,700
ニトリホールディングス	15,100	20,685.00	312,343,500
グルメ杵屋	3,100	985.00	3,053,500
愛眼	3,800	230.00	874,000
ケーユーホールディングス	2,100	873.00	1,833,300
吉野家ホールディングス	12,500	2,205.00	27,562,500
加藤産業	5,500	3,695.00	20,322,500
北恵	700	909.00	636,300
イノテック	1,900	1,243.00	2,361,700
イエローハット	7,200	1,745.00	12,564,000
松屋フーズホールディングス	1,800	3,675.00	6,615,000
JBCホールディングス	2,500	1,459.00	3,647,500
JKホールディングス	3,300	813.00	2,682,900
サガミホールディングス	5,000	1,167.00	5,835,000
日伝	3,400	2,199.00	7,476,600
関西スーパーマーケット	3,100	1,145.00	3,549,500
ミロク情報サービス	3,300	2,246.00	7,411,800
北沢産業	4,000	270.00	1,080,000
杉本商事	2,000	2,424.00	4,848,000
因幡電機産業	10,800	2,550.00	27,540,000
王将フードサービス	2,500	5,850.00	14,625,000
ブレナス	4,200	1,923.00	8,076,600
ミニストップ	2,800	1,429.00	4,001,200
アークス	7,800	2,404.00	18,751,200

パローホールディングス	8,400	2,347.00	19,714,800
東テク	1,400	2,781.00	3,893,400
ミスミグループ本社	47,800	3,455.00	165,149,000
藤久	1,000	722.00	722,000
アルテック	2,400	290.00	696,000
ベルク	1,900	5,710.00	10,849,000
大庄	2,200	1,035.00	2,277,000
タキヒヨー	1,200	1,889.00	2,266,800
ファーストリテイリング	5,100	104,900.00	534,990,000
ソフトバンクグループ	301,200	10,530.00	3,171,636,000
蔵王産業	1,000	1,390.00	1,390,000
スズケン	16,100	4,265.00	68,666,500
サンドラッグ	14,300	4,060.00	58,058,000
サックスパー ホールディングス	3,700	639.00	2,364,300
ジェコス	3,000	960.00	2,880,000
ヤマザワ	800	1,749.00	1,399,200
やまや	900	2,245.00	2,020,500
グローセル	4,400	509.00	2,239,600
ベルーナ	8,100	1,037.00	8,399,700
合計	40,668,200		102,630,639,840

株式以外の有価証券  
該当する事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

「日本債券インデックス・マザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2020年 2月20日現在)	(2021年 2月22日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		2,193,267	480,027
コール・ローン		808,902,078	537,238,230
国債証券		135,081,132,800	131,463,667,900
地方債証券		9,700,662,103	9,657,449,106
特殊債券		13,708,471,504	13,188,803,752
社債券		4,978,917,600	5,377,069,500
未収利息		411,280,355	398,230,776
前払費用		4,045,662	4,603,376
流動資産合計		164,695,605,369	160,627,542,667
資産合計		164,695,605,369	160,627,542,667
負債の部			

流動負債			
未払解約金		127,274,325	116,223,662
未払利息		2,233	1,467
その他未払費用		463	449
流動負債合計		127,277,021	116,225,578
負債合計		127,277,021	116,225,578
純資産の部			
元本等			
元本	1	126,399,340,034	125,544,496,076
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		38,168,988,314	34,966,821,013
元本等合計		164,568,328,348	160,511,317,089
純資産合計		164,568,328,348	160,511,317,089
負債純資産合計		164,695,605,369	160,627,542,667

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

## （2）注記表

### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

### （貸借対照表に関する注記）

区 分	（2020年 2月20日現在）	（2021年 2月22日現在）
1 期首元本額	121,137,400,893円	126,399,340,034円
期中追加設定元本額	31,973,219,496円	26,451,548,900円
期中一部解約元本額	26,711,280,355円	27,306,392,858円
元本の内訳		
ファンド名		
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	1,193,048,988円	2,571,141,239円
日本債券インデックス・ファンド（年金1）＜適格機関投資家限定＞	3,652,715,270円	3,871,359,299円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	13,498,572円	10,676,170円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	409,816,976円	357,638,147円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	455,834円	468,118円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	13,844,979円	10,979,168円

バランスファンドVA50A<適格機関投資家限定>	24,333,460円	34,477,913円
バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	13,849,417,700円	13,113,361,295円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	11,829,829円	6,695,414円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	6,149,913,498円	5,563,179,910円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	2,302,327,332円	2,171,224,162円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	16,955,879円	15,063,032円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	1,778,372,272円	1,604,024,819円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	7,173,592,737円	6,919,420,511円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	2,012,903,862円	1,792,997,772円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	6,628,702,462円	6,025,578,625円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	173,169,953円	157,078,081円
日本債券インデックス・ファンドVA1<適格機関投資家限定>	135,809,695円	91,251,969円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	72,808,304円	74,700,763円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	39,196,026円	38,790,804円
日本債券インデックス・ファンドVA2<適格機関投資家限定>	9,967,102,172円	13,977,472,080円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	68,580,632円	64,180,659円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	3,557,977,951円	3,950,442,911円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	21,916,306円	19,594,067円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	13,785,032円	12,233,807円
日本債券インデックス・ファンドVA3<適格機関投資家限定>	9,561,789,554円	1,947,793,322円
日本債券インデックス・ファンド<適格機関投資家限定>	187,968,773円	757,728,345円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	2,813,649,761円	2,661,470,507円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	10,275,351,870円	10,519,759,389円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	14,633,603円	15,881,612円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド(ステイブル)年金<適格機関投資家限定>	494,605,521円	788,219,500円



債券マルチ・ファクター戦略ファンド (年金) < 適格機関投資家限定 >	719,264,443円	552,279,862円
T a dリスクバジェット型マルチ配分 戦略ファンド(ステイブル) < 適格機 関投資家限定 >	429,392,051円	436,094,205円
ステート・ストリート日本債券イン デックス・オープン	1,733,364,130円	1,866,281,311円
日本債券インデックス・ファンドF < 適格機関投資家限定 >	38,562,909,056円	38,484,657,457円
世界バランス40VA < 適格機関投資 家限定 >	円	43,193,295円
世界バランス60VA < 適格機関投資 家限定 >	円	171,276,395円
グローバルバランス40VA < 適格機 関投資家限定 >	2,958,334円	3,017,858円
グローバルバランス40VA2 < 適格 機関投資家限定 >	2,159,488,345円	4,149,548,243円
グローバルバランス40VA3 < 適格 機関投資家限定 >	116,609,472円	102,436,216円
グローバルバランス50VA < 適格機 関投資家限定 >	45,279,400円	47,471,449円
世界株式VCファンド < 適格機関投資 家限定 >	円	543,356,375円
計	126,399,340,034円	125,544,496,076円
2 受益権の総数	126,399,340,034口	125,544,496,076口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2020年 2月20日現在)	(2021年 2月22日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。	同左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

	(2020年 2月20日現在)	(2021年 2月22日現在)
--	-----------------	-----------------

種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額	当期間の損益に 含まれた評価差額
国債証券	924,499,900	4,027,401,200
地方債証券	2,888,315	146,837,637
特殊債券	3,120,658	215,757,079
社債券	29,488,900	118,137,400
合計	954,221,143	4,508,133,316

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

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

該当する事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当する事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	（2020年 2月20日現在）	（2021年 2月22日現在）
1口当たり純資産額	1.3020円	1.2785円
（1万口当たり純資産額）	（13,020円）	（12,785円）

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	第100回利付国債（20年）	200,000,000	231,170,000	
	第101回利付国債（20年）	100,000,000	116,999,000	
	第102回利付国債（20年）	200,000,000	234,952,000	
	第103回利付国債（20年）	200,000,000	233,490,000	
	第104回利付国債（20年）	150,000,000	172,924,500	
	第105回利付国債（20年）	100,000,000	115,721,000	
	第106回利付国債（20年）	200,000,000	232,954,000	
	第107回利付国債（20年）	100,000,000	116,147,000	
	第108回利付国債（20年）	100,000,000	114,587,000	
	第109回利付国債（20年）	200,000,000	229,908,000	
	第10回利付国債（40年）	100,000,000	106,064,000	
	第110回利付国債（20年）	200,000,000	233,124,000	
	第111回利付国債（20年）	200,000,000	235,618,000	
	第112回利付国債（20年）	200,000,000	233,960,000	
	第113回利付国債（20年）	200,000,000	234,886,000	
	第114回利付国債（20年）	300,000,000	353,532,000	
	第115回利付国債（20年）	500,000,000	593,605,000	
	第116回利付国債（20年）	500,000,000	595,670,000	
第118回利付国債（20年）	300,000,000	352,947,000		

第111回利付国債(40年)	110,000,000	113,236,200	
第122回利付国債(20年)	500,000,000	580,570,000	
第123回利付国債(20年)	300,000,000	357,993,000	
第126回利付国債(20年)	300,000,000	356,091,000	
第127回利付国債(20年)	400,000,000	470,812,000	
第128回利付国債(20年)	500,000,000	589,800,000	
第12回利付国債(30年)	300,000,000	368,985,000	
第12回利付国債(40年)	1,050,000,000	976,605,000	
第130回利付国債(20年)	400,000,000	468,916,000	
第131回利付国債(5年)	1,100,000,000	1,102,519,000	
第132回利付国債(20年)	400,000,000	465,756,000	
第132回利付国債(5年)	1,500,000,000	1,504,350,000	
第133回利付国債(20年)	500,000,000	587,520,000	
第133回利付国債(5年)	1,500,000,000	1,505,190,000	
第134回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,003,910,000	
第135回利付国債(20年)	400,000,000	466,724,000	
第135回利付国債(5年)	1,900,000,000	1,908,246,000	
第136回利付国債(20年)	450,000,000	520,173,000	
第136回利付国債(5年)	1,700,000,000	1,708,279,000	
第137回利付国債(20年)	400,000,000	467,696,000	
第137回利付国債(5年)	1,550,000,000	1,558,385,500	
第139回利付国債(20年)	300,000,000	347,442,000	
第139回利付国債(5年)	1,200,000,000	1,207,740,000	
第13回利付国債(30年)	300,000,000	366,120,000	
第13回利付国債(40年)	460,000,000	426,539,600	
第140回利付国債(20年)	300,000,000	351,483,000	
第140回利付国債(5年)	1,300,000,000	1,308,866,000	
第141回利付国債(20年)	300,000,000	352,161,000	
第141回利付国債(5年)	900,000,000	906,444,000	
第142回利付国債(20年)	300,000,000	355,626,000	
第142回利付国債(5年)	1,200,000,000	1,208,736,000	
第143回利付国債(20年)	400,000,000	465,700,000	
第143回利付国債(5年)	900,000,000	906,786,000	
第144回利付国債(20年)	400,000,000	460,988,000	
第144回利付国債(5年)	1,900,000,000	1,914,801,000	
第145回利付国債(20年)	450,000,000	530,190,000	
第145回利付国債(5年)	2,100,000,000	2,117,325,000	
第146回利付国債(20年)	520,000,000	613,756,000	
第147回利付国債(20年)	560,000,000	655,121,600	
第148回利付国債(20年)	500,000,000	579,440,000	
第149回利付国債(20年)	400,000,000	464,144,000	
第14回利付国債(30年)	200,000,000	254,888,000	
第150回利付国債(20年)	470,000,000	539,517,700	
第151回利付国債(20年)	550,000,000	617,320,000	
第152回利付国債(20年)	550,000,000	617,639,000	
第153回利付国債(20年)	750,000,000	852,960,000	
第154回利付国債(20年)	940,000,000	1,056,616,400	
第155回利付国債(20年)	600,000,000	657,258,000	
第156回利付国債(20年)	620,000,000	624,879,400	

第157回利付国債(20年)	400,000,000	390,708,000	
第158回利付国債(20年)	570,000,000	581,331,600	
第159回利付国債(20年)	600,000,000	620,154,000	
第15回利付国債(30年)	200,000,000	258,164,000	
第160回利付国債(20年)	550,000,000	576,207,500	
第161回利付国債(20年)	550,000,000	566,846,500	
第162回利付国債(20年)	100,000,000	102,947,000	
第163回利付国債(20年)	500,000,000	514,135,000	
第164回利付国債(20年)	500,000,000	505,160,000	
第165回利付国債(20年)	450,000,000	453,978,000	
第166回利付国債(20年)	410,000,000	426,687,000	
第167回利付国債(20年)	500,000,000	502,465,000	
第168回利付国債(20年)	400,000,000	394,352,000	
第169回利付国債(20年)	270,000,000	260,936,100	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	258,890,000	
第170回利付国債(20年)	420,000,000	405,379,800	
第171回利付国債(20年)	400,000,000	385,576,000	
第172回利付国債(20年)	300,000,000	294,009,000	
第173回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,076,823,000	
第174回利付国債(20年)	1,280,000,000	1,251,596,800	
第175回利付国債(20年)	100,000,000	99,640,000	
第17回利付国債(30年)	200,000,000	256,922,000	
第18回利付国債(30年)	200,000,000	254,844,000	
第19回利付国債(30年)	200,000,000	255,438,000	
第1回利付国債(30年)	300,000,000	369,924,000	
第1回利付国債(40年)	160,000,000	229,193,600	
第20回利付国債(30年)	100,000,000	130,894,000	
第21回利付国債(30年)	200,000,000	256,570,000	
第22回利付国債(30年)	200,000,000	263,042,000	
第23回利付国債(30年)	100,000,000	131,832,000	
第24回利付国債(30年)	320,000,000	422,832,000	
第25回利付国債(30年)	100,000,000	129,423,000	
第26回メキシコ合衆国円貨債券(2018)	100,000,000	98,473,000	
第26回利付国債(30年)	150,000,000	196,771,500	
第27回利付国債(30年)	320,000,000	426,748,800	
第28回利付国債(30年)	300,000,000	401,604,000	
第29回利付国債(30年)	200,000,000	265,446,000	
第2回利付国債(30年)	380,000,000	459,089,400	
第2回利付国債(40年)	500,000,000	694,665,000	
第30回利付国債(30年)	350,000,000	460,099,500	
第31回利付国債(30年)	400,000,000	520,856,000	
第321回利付国債(10年)	300,000,000	303,567,000	
第322回利付国債(10年)	700,000,000	707,581,000	
第323回利付国債(10年)	200,000,000	202,678,000	
第324回利付国債(10年)	400,000,000	404,828,000	
第325回利付国債(10年)	500,000,000	507,195,000	
第326回利付国債(10年)	300,000,000	304,428,000	
第327回利付国債(10年)	700,000,000	711,606,000	
第328回利付国債(10年)	500,000,000	507,350,000	

第329回利付国債(10年)	500,000,000	510,510,000	
第32回利付国債(30年)	500,000,000	662,420,000	
第330回利付国債(10年)	800,000,000	818,656,000	
第331回利付国債(10年)	500,000,000	509,080,000	
第332回利付国債(10年)	600,000,000	611,958,000	
第333回利付国債(10年)	900,000,000	919,512,000	
第334回利付国債(10年)	700,000,000	716,310,000	
第335回利付国債(10年)	800,000,000	817,048,000	
第336回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,022,410,000	
第337回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,014,750,000	
第338回利付国債(10年)	650,000,000	662,720,500	
第339回利付国債(10年)	900,000,000	918,711,000	
第33回利付国債(30年)	400,000,000	510,136,000	
第340回利付国債(10年)	1,480,000,000	1,512,574,800	
第341回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,323,257,000	
第342回利付国債(10年)	800,000,000	806,496,000	
第343回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,209,912,000	
第344回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,209,708,000	
第345回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,008,160,000	
第346回利付国債(10年)	800,000,000	806,560,000	
第347回利付国債(10年)	750,000,000	755,925,000	
第348回利付国債(10年)	900,000,000	907,101,000	
第349回利付国債(10年)	1,260,000,000	1,269,891,000	
第34回利付国債(30年)	550,000,000	725,131,000	
第350回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,007,420,000	
第351回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,509,870,000	
第352回利付国債(10年)	1,160,000,000	1,167,006,400	
第353回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,508,190,000	
第354回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,105,302,000	
第355回利付国債(10年)	930,000,000	933,850,200	
第356回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,153,921,500	
第357回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,102,882,000	
第358回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,502,700,000	
第359回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,150,529,000	
第35回利付国債(30年)	520,000,000	667,971,200	
第360回利付国債(10年)	2,100,000,000	2,098,992,000	
第361回利付国債(10年)	500,000,000	499,270,000	
第36回利付国債(30年)	480,000,000	618,398,400	
第37回利付国債(30年)	330,000,000	419,951,400	
第38回利付国債(30年)	200,000,000	251,170,000	
第39回利付国債(30年)	330,000,000	421,485,900	
第3回利付国債(30年)	300,000,000	361,038,000	
第3回利付国債(40年)	250,000,000	349,430,000	
第40回利付国債(30年)	350,000,000	440,489,000	
第410回利付国債(2年)	700,000,000	701,561,000	
第416回利付国債(2年)	1,000,000,000	1,003,420,000	
第418回利付国債(2年)	1,800,000,000	1,806,822,000	
第41回利付国債(30年)	300,000,000	371,832,000	
第42回利付国債(30年)	330,000,000	409,355,100	

第43回利付国債(30年)	400,000,000	496,608,000	
第44回利付国債(30年)	350,000,000	434,889,000	
第45回利付国債(30年)	420,000,000	504,029,400	
第46回利付国債(30年)	350,000,000	420,217,000	
第47回利付国債(30年)	500,000,000	611,950,000	
第48回利付国債(30年)	500,000,000	590,070,000	
第49回利付国債(30年)	440,000,000	519,402,400	
第4回利付国債(40年)	250,000,000	351,435,000	
第50回利付国債(30年)	350,000,000	364,854,000	
第51回利付国債(30年)	250,000,000	231,227,500	
第52回利付国債(30年)	400,000,000	388,120,000	
第53回利付国債(30年)	400,000,000	396,892,000	
第54回利付国債(30年)	410,000,000	426,080,200	
第55回利付国債(20年)	500,000,000	511,310,000	
第55回利付国債(30年)	390,000,000	404,964,300	
第56回利付国債(30年)	320,000,000	332,003,200	
第57回利付国債(20年)	800,000,000	821,272,000	
第57回利付国債(30年)	340,000,000	352,450,800	
第58回利付国債(30年)	480,000,000	497,140,800	
第59回利付国債(30年)	400,000,000	404,168,000	
第5回利付国債(30年)	100,000,000	120,965,000	
第5回利付国債(40年)	130,000,000	176,961,200	
第60回利付国債(20年)	700,000,000	719,264,000	
第60回利付国債(30年)	340,000,000	359,873,000	
第61回利付国債(20年)	350,000,000	358,043,000	
第61回利付国債(30年)	120,000,000	120,843,600	
第62回利付国債(30年)	250,000,000	238,830,000	
第63回利付国債(20年)	500,000,000	522,130,000	
第63回利付国債(30年)	250,000,000	232,000,000	
第64回利付国債(30年)	310,000,000	287,171,600	
第65回利付国債(20年)	400,000,000	422,676,000	
第65回利付国債(30年)	310,000,000	286,663,200	
第66回利付国債(30年)	290,000,000	268,015,100	
第67回利付国債(30年)	550,000,000	536,618,500	
第68回利付国債(20年)	500,000,000	535,445,000	
第68回利付国債(30年)	800,000,000	780,400,000	
第69回利付国債(20年)	300,000,000	320,343,000	
第69回利付国債(30年)	100,000,000	100,123,000	
第6回利付国債(30年)	180,000,000	222,795,000	
第6回利付国債(40年)	150,000,000	201,355,500	
第70回利付国債(20年)	600,000,000	649,932,000	
第72回利付国債(20年)	600,000,000	647,172,000	
第74回利付国債(20年)	300,000,000	325,116,000	
第76回利付国債(20年)	200,000,000	216,152,000	
第77回利付国債(20年)	300,000,000	325,452,000	
第78回利付国債(20年)	250,000,000	271,387,500	
第7回利付国債(30年)	300,000,000	370,431,000	
第7回利付国債(40年)	160,000,000	206,848,000	
第80回利付国債(20年)	100,000,000	109,421,000	

第81回利付国債（20年）	200,000,000	219,030,000		
第83回利付国債（20年）	300,000,000	331,398,000		
第85回利付国債（20年）	200,000,000	221,950,000		
第88回利付国債（20年）	400,000,000	450,240,000		
第89回利付国債（20年）	400,000,000	448,104,000		
第8回利付国債（30年）	300,000,000	355,272,000		
第8回利付国債（40年）	50,000,000	60,458,500		
第90回利付国債（20年）	300,000,000	337,605,000		
第91回利付国債（20年）	300,000,000	339,282,000		
第92回利付国債（20年）	340,000,000	382,438,800		
第93回利付国債（20年）	300,000,000	337,110,000		
第94回利付国債（20年）	300,000,000	338,931,000		
第95回利付国債（20年）	150,000,000	172,068,000		
第96回利付国債（20年）	100,000,000	113,446,000		
第97回利付国債（20年）	150,000,000	171,906,000		
第98回利付国債（20年）	100,000,000	113,946,000		
第99回利付国債（20年）	200,000,000	228,874,000		
第9回利付国債（30年）	100,000,000	113,855,000		
第9回利付国債（40年）	1,730,000,000	1,564,058,400		
国債証券 小計	123,540,000,000	131,463,667,900		
地方債証券	第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,490,000	
	第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,516,000	
	第10回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	117,114,000	
	第10回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	115,955,000	
	第111回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,153,000	
	第115回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,294,000	
	第119回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,553,000	
	第11回川崎市公募公債（30年）	100,000,000	101,727,000	
	第120回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	100,000,000	101,515,000	
	第129回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,943,000	
	第12回東京都公募公債（20年）	100,000,000	114,238,000	
	第130回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,147,000	
	第135回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	101,129,000	
	第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,002,000	
	第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,891,000	
	第13回大阪市公募公債（20年）	50,000,000	58,593,500	
	第13回東京都公募公債（20年）	100,000,000	113,670,000	
	第147回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,244,000	
	第14回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	115,334,000	
	第14回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	116,336,000	
	第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,948,000	
	第181回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,250,000	
	第184回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,150,000	
	第188回共同発行市場公募地方債	30,000,000	30,215,700	
	第188回神奈川県公募公債	100,000,000	101,091,000	
	第24回千葉県公募公債	100,000,000	100,686,000	
	第26回東京都公募公債（20年）	100,000,000	116,146,000	
第2回横浜市公募公債（30年）	100,000,000	128,620,000		
第2回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	117,480,000		



第2回兵庫県公募公債(30年)	100,000,000	132,104,000	
第30回2号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	101,850,000	
第368回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,529,000	
第36回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	101,931,000	
第374回大阪府公募公債(10年)	134,000,000	136,917,180	
第387回大阪府公募公債(10年)	44,040,000	44,782,954	
第392回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,237,000	
第3回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	133,255,000	
第3回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	112,499,000	
第3回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	107,701,000	
第480回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	101,260,000	
第4回横浜市公募公債(30年)	100,000,000	131,604,000	
第4回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	115,993,000	
第4回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	103,402,000	
第5回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	117,348,000	
第6回京都市公募公債(20年)	200,000,000	229,388,000	
第6回札幌市公募公債(20年)	100,000,000	116,997,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	108,006,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	108,699,000	
第739回東京都公募公債	100,000,000	100,993,000	
第746回東京都公募公債	100,000,000	102,025,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	101,637,000	
第759回東京都公募公債	100,000,000	99,889,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	100,338,000	
第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,728,000	
第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,107,000	
平成23年度第2回北九州市公募公債	11,000,000	11,093,060	
平成23年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	100,529,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,413,000	
平成24年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	101,560,000	
平成24年度第12回愛知県公募公債(30年)	10,000,000	12,963,700	
平成24年度第14回愛知県公募公債(15年)	100,000,000	107,953,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	101,201,000	
平成24年度第1回滋賀県公募公債	30,600,000	31,014,018	
平成24年度第1回福井県公募公債	100,000,000	101,296,000	
平成24年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	101,539,000	
平成24年度第4回北海道公募公債	100,000,000	101,158,000	
平成24年度第5回京都府公募公債	30,000,000	30,375,600	
平成24年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,226,000	
平成24年度第8回京都府公募公債	30,000,000	30,385,200	
平成24年度第8回福岡市公募公債	100,000,000	101,363,000	
平成24年度第9回北海道公募公債	7,400,000	7,493,610	
平成25年度第10回京都府公募公債(15年)	100,000,000	107,398,000	
平成25年度第1回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	102,129,000	
平成25年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	101,206,000	
平成25年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,994,000	
平成26年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	113,572,000	
平成26年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	102,008,000	
平成26年度第9回静岡県公募公債	20,000,000	20,386,400	

	平成27年度第13回北海道公募公債	100,000,000	102,047,000	
	平成27年度第1回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	101,798,000	
	平成27年度第2回京都府公募公債（15年）	100,000,000	104,766,000	
	平成27年度第4回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,072,000	
	平成27年度第9回北海道公募公債	100,000,000	102,062,000	
	平成28年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,947,000	
	平成28年度第5回広島市公募公債	100,000,000	100,866,000	
	平成28年度第6回福岡県公募公債	100,000,000	100,463,000	
	平成29年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,590,000	
	平成29年度第1回秋田県公募公債	145,900,000	146,512,780	
	平成29年度第22回兵庫県公募公債	100,000,000	100,273,000	
	平成29年度第3回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,651,000	
	平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,401,000	
	平成29年度第5回広島県公募公債	100,000,000	100,719,000	
	平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,569,000	
	平成30年度第1回熊本市公募公債	100,000,000	100,720,000	
	平成30年度第2回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	102,373,000	
	平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	100,599,000	
	平成30年度第6回広島市公募公債	100,000,000	99,809,000	
	令和2年度第3回長崎県公募公債（10年）	12,400,000	12,303,404	
地方債証券	小計	9,155,340,000	9,657,449,106	
特殊債券	F116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	108,395,000	
	F181回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,521,000	
	F190回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,804,000	
	F308回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,378,000	
	い第803号商工債	100,000,000	100,023,000	
	第101回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,877,000	68,074,656	
	第106回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,419,000	
	第106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,886,000	73,792,701	
	第108回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,269,000	
	第10回株式会社日本政策金融公庫社債（一般担保付）	100,000,000	117,268,000	
	第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,996,000	156,991,145	
	第112回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,591,000	
	第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,392,000	81,689,894	
	第118回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,716,000	
	第119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,417,000	83,008,754	
	第11回公営企業債券（20年）	100,000,000	108,460,000	
	第11回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,563,000	
	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,007,000	
	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,880,000	85,219,520	
	第125回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,931,000	
	第12回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,900,000	
	第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,113,000	87,304,648	
	第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,812,000	88,123,732	
	第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,639,000	
	第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,752,000	88,845,189	
	第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,883,000	90,536,449	
	第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,228,000	91,077,045	
	第139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,945,000	90,526,944	

第13回公営企業債券(20年)	10,000,000	10,917,500	
第146回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,126,000	
第149回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,050,000	
第157回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,527,000	
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,119,000	12,256,550	
第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,603,000	
第172回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	125,595,000	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,179,000	12,327,827	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,357,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,156,000	
第18回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	101,366,000	
第18回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,142,000	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,127,000	12,256,152	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	148,559,000	
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	101,349,000	
第19回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,904,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,927,000	31,130,190	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000	1,020,560	
第203回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,814,000	
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,825,000	
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,943,000	
第20回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	116,120,000	
第215回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,706,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2,000,000	2,041,620	
第21回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	101,745,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,829,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	144,155,000	
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,792,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	13,000,000	13,222,690	
第236号商工債(3年)	100,000,000	99,968,000	
第23回国際協力銀行債券	100,000,000	109,815,000	
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	137,317,200	
第240回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,038,000	
第25回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,370,000	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,778,000	44,738,389	
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	101,480,000	
第26回日本高速道路保有・債務返済機構債券	10,000,000	13,398,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,474,000	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,434,000	23,845,547	
第28回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	112,346,000	
第28回道路債券	200,000,000	261,054,000	
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	24,500,000	24,660,965	
第29回西日本高速道路株式会社社債 (一般担保付、独立行政法人)	200,000,000	202,178,000	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,316,000	11,509,616	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,330,000	27,104,366	
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	20,900,000	21,049,853	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,658,000	27,583,032	
第30回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,789,000	

第30回政府保証地方公共団体金融機構債券	74,000,000	74,543,160	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,872,000	26,616,273	
第312回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,088,000	
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	14,000,000	14,125,300	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,457,000	27,179,675	
第321回信金中金債（5年）	100,000,000	99,999,000	
第326回信金中金債（5年）	100,000,000	100,022,000	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,579,000	26,085,446	
第331回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,329,000	
第337回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,649,000	
第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,134,000	
第342回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	13,000,000	13,032,110	
第342回東京交通債券	30,000,000	30,942,600	
第343回信金中金債（5年）	100,000,000	100,163,000	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,270,000	14,777,013	
第352回信金中金債（5年）	100,000,000	100,077,000	
第358回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,843,000	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,152,000	26,593,712	
第36回中日本高速道路株式会社債 （一般担保付、独立行政法人）	100,000,000	100,596,000	
第379回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,085,000	
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,189,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,248,000	
第38回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,192,000	12,494,727	
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,307,000	28,797,689	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,253,000	28,607,201	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,000,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	65,036,000	64,954,054	
第3回都市再生債券	100,000,000	109,411,000	
第40回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,296,000	
第42回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,218,000	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,940,000	34,641,680	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,416,000	69,301,710	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,638,000	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,224,000	28,850,089	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	33,000,000	33,447,810	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,146,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,901,000	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,651,000	
第4回公営企業債券（30年）	100,000,000	132,534,000	
第50回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,899,000	
第51回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,176,000	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	162,000,000	162,957,420	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,020,000	42,236,707	
第5回国際協力機構債券	100,000,000	115,847,000	
第60回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,089,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,692,000	42,796,997	
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,079,000	
第65回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,069,000	

第66回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,780,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,191,000	46,054,976	
第68回政府保証地方公共団体金融機構債券	14,000,000	14,164,080	
第68回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	99,518,000	
第68回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,898,000	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,679,000	48,001,777	
第6回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,353,000	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,243,000	11,454,031	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,638,000	41,492,662	
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,706,000	40,198,890	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,842,000	
第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債 (社債間限定同順位)	100,000,000	100,699,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,667,000	42,257,079	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	108,529,000	
第7回道路債券	50,000,000	51,776,500	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	109,394,000	
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,347,000	46,131,079	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,836,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	141,868,000	
第85回中日本高速道路株式会社社債 (一般担保付、独立行政法人)	100,000,000	99,999,000	
第89回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,858,000	
第8回公営企業債券(30年)	10,000,000	12,866,700	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,092,000	13,479,915	
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	116,511,000	
第96回株式会社日本政策投資銀行無担保社債 (社債間限定同順位)	100,000,000	100,114,000	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,874,000	66,456,276	
第96回都市再生債券	100,000,000	102,014,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,376,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,350,000	
第9回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	108,029,000	
第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,165,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,690,000	24,282,250	
第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,545,000	14,067,430	
特殊債券 小計	12,507,531,000	13,188,803,752	

社債券	第107回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 （社債間限定同）	200,000,000	225,118,000	
	第10回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債 （201）	100,000,000	100,109,000	
	第11回電源開発株式会社無担保社債 （社債間限定同順位特約付）	100,000,000	107,584,000	
	第127回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 （社債間限定同）	100,000,000	100,597,000	
	第13回東京地下鉄株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	114,140,000	
	第14回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（2017）	100,000,000	99,400,000	
	第14回トヨタ自動車株式会社無担保社債（社債間限定同 等特約付）	100,000,000	101,783,000	
	第152回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 （社債間限定同）	100,000,000	99,781,000	
	第15回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債 （社債間）	100,000,000	99,049,000	
	第17回東日本旅客鉄道株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,990,000	
	第18回イオンモール株式会社無担保社債 （社債間限定同順位特約）	100,000,000	97,523,000	
	第18回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債 （2018）	100,000,000	99,516,000	
	第1回エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエル シー円貨	100,000,000	100,083,000	
第22回三菱瓦斯化学株式会社無担保社債 （社債間限定同順位特約）	100,000,000	100,052,000		
第245回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,669,000		
第25回日本郵船株式会社無担保社債 （社債間限定同順位特約付）	100,000,000	108,299,000		
第26回東京電力パワーグリッド株式会社社債 （一般担保付）	100,000,000	104,203,000		
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債 （社債間限）	100,000,000	101,783,000		
第28回リコーリース株式会社無担保社債 （社債間限定同順位特約）	100,000,000	99,627,000		
第28回東京瓦斯株式会社無担保社債 （社債間限定同順位特約付）	100,000,000	112,915,000		
第298回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,934,000		
第30回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債 （201）	100,000,000	99,324,000		
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債 （一般担保付）	100,000,000	102,140,000		
第323回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,001,000		
第32回ANAホールディングス株式会社無担保社債 （社債間限定）	100,000,000	89,966,000		
第32回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債	100,000,000	106,657,000		
第350回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,502,000		
第3回NTTファイナンス株式会社無担保社債 （社債間限定同順位）	100,000,000	100,621,000		

第3回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債 （社債間）	100,000,000	101,382,000	
第422回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,864,000	
第426回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,633,000	
第45回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 （社債間限定同順位）	100,000,000	116,651,000	
第465回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,365,000	
第47回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債 （阪急電鉄）	100,000,000	106,987,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 （社債間限定同順位）	100,000,000	128,533,000	
第489回九州電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	200,888,000	
第4回東京地下鉄株式会社社債（一般担保付）	10,000,000	11,168,500	
第506回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,390,000	
第510回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,127,000	
第517回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,243,000	
第521回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,623,000	
第524回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,960,000	
第52回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債 （社債間限定同順位特）	100,000,000	104,822,000	
第54回日立キャピタル株式会社無担保社債 （社債間限定同順位特）	100,000,000	100,205,000	
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（特定）	100,000,000	103,592,000	
第58回電源開発株式会社無担保社債 （社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,043,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券 （一般担保付）	100,000,000	101,282,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債 （担保提供制限等財務上特約）	100,000,000	116,237,000	
第6回東京電力パワーグリッド株式会社社債 （一般担保付）	100,000,000	101,890,000	
第7回東京電力パワーグリッド株式会社社債 （一般担保付）	100,000,000	100,546,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債 （劣後特約付）	100,000,000	100,272,000	
社債券 小計	5,210,000,000	5,377,069,500	
合計	150,412,871,000	159,686,990,258	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当する事項はありません。

「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2020年 2月20日現在)	(2021年 2月22日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		1,695,227,576	938,867,363
金銭信託		6,626,223	549,323
コール・ローン		2,703,707,060	712,950,439
株式		168,473,154,465	167,983,926,515
投資証券		4,770,696,178	3,658,871,131
派生商品評価勘定		143,206,165	75,222,683
未収入金		4,618,949	593,235
未収配当金		216,759,376	183,590,687
差入委託証拠金		1,220,044,411	879,525,962
流動資産合計		179,234,040,403	174,434,097,338
資産合計		179,234,040,403	174,434,097,338
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		8,225,934	2,154,822
未払解約金		238,282,000	396,904,700
未払利息		7,464	1,947
その他未払費用		576	55
流動負債合計		246,515,974	399,061,524
負債合計		246,515,974	399,061,524
純資産の部			
元本等			
元本	1	56,526,014,844	49,551,945,295
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		122,461,509,585	124,483,090,519
元本等合計		178,987,524,429	174,035,035,814
純資産合計		178,987,524,429	174,035,035,814
負債純資産合計		179,234,040,403	174,434,097,338

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

## (2) 注記表

### (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
-------------------	--



2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>外国先物の評価においては、個別法に基づき、原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。</p>
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	(2020年 2月20日現在)	(2021年 2月22日現在)
1 期首元本額	57,955,317,361円	56,526,014,844円
期中追加設定元本額	15,995,619,384円	16,720,868,331円
期中一部解約元本額	17,424,921,901円	23,694,937,880円
元本の内訳		
ファンド名		
ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン	6,003,611,958円	5,576,571,210円
ステート・ストリートDC外国株式インデックス・オープン	6,551,816,920円	6,332,118,187円
ステート・ストリートDCグローバル株式インデックス・オープン	57,521,321円	64,335,681円
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン (ステイブル)	75,976,909円	73,584,902円
外国株式インデックス・ファンドVA1 (適格機関投資家専用)	1,612,608,652円	1,570,973,014円

外国株式インデックス・ファンドVA2 (適格機関投資家専用)	46,274,788円	41,545,913円
バランスファンドVA30A<適格機関投資家限定>	1,176,058円	878,687円
バランスファンドVA30B<適格機関投資家限定>	73,800,114円	56,407,364円
バランスファンドVA40A<適格機関投資家限定>	65,804円	62,473円
バランスファンドVA40B<適格機関投資家限定>	4,161,936円	2,925,442円
バランスファンドVA50A<適格機関投資家限定>	5,385,473円	6,675,997円
バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	5,917,163,909円	5,090,361,978円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	2,223,731円	1,148,238円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	645,087,295円	513,754,778円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	568,566,840円	480,192,247円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	58,822,589円	45,764,215円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	190,621,273円	149,026,914円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	2,075,091,527円	1,843,084,679円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	366,889,020円	297,277,842円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	1,192,714,226円	999,902,745円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	49,541,493円	40,774,505円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	31,508,730円	29,495,917円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	34,662,062円	31,802,987円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	19,838,550円	17,267,699円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	195,969,409円	206,701,315円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	760,778円	628,755円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	1,190,738円	943,567円
外国株式インデックス・ファンドVA3<適格機関投資家限定>	8,368,955,146円	1,522,054,177円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	201,790,544円	167,893,887円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	30,227,266円	28,344,188円

T a dリスクバジェット型マルチ配分 戦略ファンド（ステイブル）年金＜適 格機関投資家限定＞	26,391,279円	23,956,376円
T a dリスクバジェット型マルチ配分 戦略ファンド（ステイブル）＜適格機 関投資家限定＞	23,311,813円	13,432,765円
ステート・ストリート先進国株式イン デックス・オープン	178,152,583円	222,467,876円
ステート・ストリート先進国株式イン デックス・オープン（為替ヘッジあ り）	2,991,369,467円	3,745,579,689円
全世界株式インデックス・ファンド 世界バランス40VA＜適格機関投資 家限定＞	399,026,824円	699,297,276円
世界バランス60VA＜適格機関投資 家限定＞	円	20,449,789円
世界バランス60VA＜適格機関投資 家限定＞	円	224,746,309円
グローバルバランス40VA＜適格機 関投資家限定＞	1,578,722円	1,456,834円
グローバルバランス40VA2＜適格 機関投資家限定＞	696,429,616円	1,205,737,914円
グローバルバランス40VA3＜適格 機関投資家限定＞	58,886,433円	47,100,555円
グローバルバランス50VA＜適格機 関投資家限定＞	26,251,030円	25,249,624円
ワールドエクイティ・ファンドVL＜ 適格機関投資家限定＞	17,740,592,018円	18,129,970,785円
計	56,526,014,844円	49,551,945,295円
2 受益権の総数	56,526,014,844口	49,551,945,295口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2020年 2月20日現在)	(2021年 2月22日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p>

<p>3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p> <p>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>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	<p>(3)デリバティブ取引 同左</p> <p>同左</p>
----------------------------------	--	-------------------------------------

## (有価証券関係に関する注記)

## 売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(2020年 2月20日現在)	(2021年 2月22日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	11,117,521,239	11,395,433,238
投資証券	264,450,332	81,210,328
合計	11,381,971,571	11,476,643,566

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

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## 株式関連

(単位：円)

区 分	種 類	(2020年 2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MINI S&P 500	3,823,589,145		3,901,200,822	77,611,677
	S&P 60	211,420,961		215,670,576	4,249,615
	SPI 200	191,286,674		197,542,560	6,255,886
	FTSE100INDEX	367,079,690		362,144,509	4,935,181
	FSMI INDEX	205,235,043		215,069,935	9,834,892
	EURO STOXX 50	625,145,924		640,594,769	15,448,845
	合 計	5,423,757,437		5,532,223,171	108,465,734

(単位：円)

区 分	種 類	(2021年 2月22日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MINI S&P 500	1,447,421,485		1,502,909,209	55,487,724
	S&P 60	105,591,512		109,495,711	3,904,199
	SPI 200	82,021,180		84,005,262	1,984,082
	FTSE100INDEX	87,128,909		87,973,366	844,457
	FSMI INDEX	86,685,385		87,502,983	817,598
	EURO STOXX 50	213,218,291		223,277,136	10,058,845
	合 計	2,022,066,762		2,095,163,667	73,096,905

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

## 通貨関連

(単位：円)

区 分	種 類	(2020年 2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	1,984,256,790		2,010,522,600	26,265,810
	カナダ・ドル	85,030,545		86,633,300	1,602,755
	オーストラリア・ドル	47,341,815		47,526,400	184,585
	イギリス・ポンド	131,447,030		132,662,790	1,215,760
	ユーロ	366,966,787		365,742,400	1,224,387
	売建				
	アメリカ・ドル	247,830,320		249,220,000	1,389,680
	カナダ・ドル	10,942,360		10,944,700	2,340
	イギリス・ポンド	30,070,980		30,199,300	128,320
	ユーロ	34,874,414		34,884,100	9,686
	合 計	2,938,761,041		2,968,335,590	26,514,497

(単位：円)

区 分	種 類	(2021年 2月22日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		

市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	453,869,765		453,564,000	305,765
	カナダ・ドル	7,507,670		7,533,000	25,330
	オーストラリア・ドル	8,213,864		8,318,000	104,136
	イギリス・ポンド	14,711,284		14,796,000	84,716
	ユーロ	33,212,061		33,259,200	47,139
	売建				
	アメリカ・ドル	360,974,200		360,775,800	198,400
	カナダ・ドル	14,203,600		14,230,700	27,100
	オーストラリア・ドル	18,195,800		18,299,600	103,800
	イギリス・ポンド	36,945,500		36,992,500	47,000
	スイス・フラン	12,951,800		12,940,400	11,400
	香港・ドル	5,441,600		5,440,000	1,600
	シンガポール・ドル	4,782,600		4,784,400	1,800
	スウェーデン・クローナ	5,102,400		5,100,000	2,400
	ユーロ	49,866,200		49,884,900	18,700
	合 計	1,025,978,344		1,025,918,500	29,044

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

4. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	(2020年 2月20日現在)	(2021年 2月22日現在)
1口当たり純資産額	3.1665円	3.5122円
(1万口当たり純資産額)	(31,665円)	(35,122円)

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	

アメリカ・ドル	BAKER HUGHES COMPANY	20,549	23.40	480,846.60
	CABOT OIL GAS CORP	13,621	18.56	252,805.76
	CHENIERE ENERGY INC	7,611	69.10	525,920.10
	CHEVRON CORPORATION	63,495	95.80	6,082,821.00
	CONOCOPHILLIPS	44,588	48.42	2,158,950.96
	DEVON ENERGY CORPORATION	19,900	20.83	414,517.00
	ENBRIDGE INC	3,950	34.66	136,907.00
	EOG RESOURCES INC	18,706	62.51	1,169,312.06
	EXXON MOBIL CORPORATION	139,551	52.37	7,308,285.87
	HALLIBURTON CO	28,814	20.20	582,042.80
	HESS CORP	9,200	63.58	584,936.00
	KINDER MORGAN INC	65,472	14.96	979,461.12
	MARATHON PETROLEUM CORP	20,830	53.00	1,103,990.00
	OCCIDENTAL PETROLEUM	30,024	25.42	763,210.08
	ONEOK INC NEW	14,200	45.82	650,644.00
	PHILLIPS 66	14,083	82.31	1,159,171.73
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	6,724	133.94	900,612.56
	SCHLUMBERGER LTD	45,962	26.12	1,200,527.44
	VALERO ENERGY CORP	13,603	71.53	973,022.59
	WILLIAMS COS	40,141	22.64	908,792.24
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	7,347	263.88	1,938,726.36
	ALBEMARLE CORP	3,400	156.17	530,978.00
	AMCOR PLC	21,100	11.42	240,962.00
	AVERY DENNISON CORP	2,657	175.41	466,064.37
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	7,400	28.46	210,604.00
	BALL CORP	10,804	90.48	977,545.92
	CELANESE CORPORATION	3,772	135.22	510,049.84
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,200	45.76	329,472.00
	CORTEVA INC	23,968	45.47	1,089,824.96
	CROWN HOLDINGS INC	4,500	101.01	454,545.00
	DOW INC	24,535	60.39	1,481,668.65
	DUPONT DE NEMOURS INC	17,569	69.79	1,226,140.51
	EASTMAN CHEMICAL CO	4,355	111.92	487,411.60
	ECOLAB INC	8,526	208.08	1,774,090.08
	FMC CORP	4,300	105.25	452,575.00
	FREEMONT MCMORAN INC	48,166	37.49	1,805,743.34
	INT'L FLAVORS FRAGRANCES	7,239	139.50	1,009,840.50
	INT'L PAPER CO	11,890	48.95	582,015.50
	LINDE PLC	13,073	250.88	3,279,754.24
	LYONDELLBASELL INDU CL A	8,545	100.22	856,379.90
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,100	336.34	706,314.00	
MOSAIC CO/THE	13,101	29.08	380,977.08	
NEWMONT CORPORATION	21,947	56.67	1,243,736.49	
NUCOR CORP	10,171	58.04	590,324.84	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,200	134.08	429,056.00	
PPG INDUSTRIES	7,847	136.67	1,072,449.49	
RPM INTERNATIONAL INC	4,300	83.11	357,373.00	
SEALED AIR CORP	5,303	43.66	231,528.98	



SHERWIN-WILLIAMS CO	2,663	716.91	1,909,131.33
STEEL DYNAMICS INC	6,700	40.84	273,628.00
VULCAN MATERIALS CO	4,356	164.38	716,039.28
WESTROCK COMPANY	8,725	43.95	383,463.75
3M CO	18,982	176.54	3,351,082.28
ALLEGION PLC W/I	3,200	109.06	348,992.00
AMETEK INC	7,600	120.86	918,536.00
BOEING CO	17,670	217.47	3,842,694.90
CARRIER GLOBAL CORP	27,356	37.64	1,029,679.84
CATERPILLAR	17,871	209.91	3,751,301.61
CUMMINS ENGINE CO	4,812	246.76	1,187,409.12
DEERE & CO	9,795	330.00	3,232,350.00
DOVER CORP	4,614	122.25	564,061.50
EATON CORP PLC	13,261	127.80	1,694,755.80
EMERSON ELECTRIC CO	19,649	85.45	1,679,007.05
FASTENAL CO	19,000	47.23	897,370.00
FORTIVE CORPORATION	9,734	67.19	654,027.46
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	4,400	87.55	385,220.00
GENERAC HOLDINGS INC	2,100	363.47	763,287.00
GENERAL DYNAMICS CORP	7,960	164.78	1,311,648.80
GENERAL ELECTRIC CO	289,202	12.02	3,476,208.04
GRAINGER (WW)	1,467	379.40	556,579.80
HEICO CORP	1,400	132.16	185,024.00
HEICO CORP-CLASS A	2,300	121.14	278,622.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	23,117	203.56	4,705,696.52
HOWMET AEROSPACE INC	13,829	28.68	396,615.72
HUNTINGTON INGALLS IND	1,400	182.13	254,982.00
IDEX CORP	2,400	196.75	472,200.00
ILLINOIS TOOL WORKS	10,318	201.40	2,078,045.20
INGERSOLL-RAND INC	11,627	43.89	510,309.03
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,500	112.41	505,845.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,900	49.60	342,240.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	7,700	24.60	189,420.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	24,524	56.02	1,373,834.48
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,070	189.09	1,336,866.30
LENNOX INTERNATIONAL	1,200	293.68	352,416.00
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	8,298	335.42	2,783,315.16
MASCO CORP	8,890	54.60	485,394.00
NORDSON CORP	1,800	187.88	338,184.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,140	297.24	1,527,813.60
OTIS WORLDWIDE CORP	13,178	63.04	830,741.12
OWENS CORNING	3,400	85.08	289,272.00
PACCAR INC	11,106	95.19	1,057,180.14
PARKER HANNIFIN CORP	4,228	279.73	1,182,698.44
PENTAIR PLC	5,834	56.65	330,496.10
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	50,463	74.26	3,747,382.38
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,722	248.23	923,912.06

ROPER TECHNOLOGIES INC	3,400	388.91	1,322,294.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	5,500	59.31	326,205.00
SMITH (A.O.) CORP	4,300	59.64	256,452.00
SNAP-ON	1,804	194.96	351,707.84
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,260	175.07	920,868.20
SUNRUN INC	3,800	68.50	260,300.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,200	405.91	487,092.00
TEXTRON	7,152	50.81	363,393.12
TRANE TECHNOLOGIES PLC	7,931	153.96	1,221,056.76
TRANSDIGM GROUP INC	1,700	600.50	1,020,850.00
UNITED RENTALS INC	2,396	290.01	694,863.96
WABTEC CORPORATION	5,806	73.96	429,411.76
XYLEM INC	5,754	99.74	573,903.96
CINTAS CORP	2,899	343.49	995,777.51
COPART INC	7,000	117.07	819,490.00
COSTAR GROUP	1,300	913.25	1,187,225.00
EQUIFAX INC	4,003	176.54	706,689.62
IHS MARKIT LIMITED	12,202	93.20	1,137,226.40
REPUBLIC SERVICES INC	7,102	90.59	643,370.18
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	4,040	78.43	316,857.20
ROLLINS	7,725	35.81	276,632.25
TRANSUNION	6,300	89.27	562,401.00
VERISK ANALYTICS INC	5,100	190.49	971,499.00
WASTE CONNECTIONS INC	8,463	99.80	844,607.40
WASTE MANAGEMENT (NEW)	13,720	111.63	1,531,563.60
AMERCO	300	536.01	160,803.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,400	90.78	399,432.00
CSX CORP	25,105	92.09	2,311,919.45
DELTA AIR LINES INC	4,900	45.67	223,783.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,384	93.44	503,080.96
FEDEX CORP	8,240	254.64	2,098,233.60
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,857	146.56	418,721.92
KANSAS CITY SOUTHERN	3,049	212.59	648,186.91
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	4,500	44.12	198,540.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,469	258.03	2,185,256.07
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,150	215.64	679,266.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,310	52.81	227,611.10
UBER TECHNOLOGIES INC	31,900	58.39	1,862,641.00
UNION PACIFIC CORP	22,366	209.06	4,675,835.96
UNITED PARCEL SERVICE -CL B	23,297	160.54	3,740,100.38
XPO LOGISTICS INC	3,000	119.49	358,470.00
APTIV PLC	8,912	153.80	1,370,665.60
AUTOLIV INC	2,600	93.51	243,126.00
BORGWARNER INC	8,200	43.56	357,192.00
FORD MOTOR COMPANY	128,925	11.58	1,492,951.50
GENERAL MOTORS CO	42,599	52.57	2,239,429.43
LEAR CORP	2,050	167.66	343,703.00

TESLA INC	24,600	781.30	19,219,980.00
DR HORTON INC	11,166	79.21	884,458.86
GARMIN LTD	4,500	128.01	576,045.00
HASBRO INC	4,300	90.00	387,000.00
LENNAR CORP-CL A	9,112	87.46	796,935.52
LULULEMON ATHLETICA INC	4,100	332.23	1,362,143.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,100	171.90	360,990.00
NEWELL BRANDS INC	13,344	24.32	324,526.08
NIKE B	41,104	142.02	5,837,590.08
NVR INC	110	4,705.45	517,599.50
PELTON INTERACTIVE INC-A	6,500	139.71	908,115.00
PULTE GROUP INC	8,563	46.39	397,237.57
VF CORP	11,098	80.40	892,279.20
WHIRLPOOL CORP	1,974	195.34	385,601.16
ARAMARK	7,300	38.01	277,473.00
CARNIVAL CORP	17,666	24.59	434,406.94
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	901	1,473.09	1,327,254.09
DARDEN RESTAURANTS	4,419	134.01	592,190.19
DOMINO'S PIZZA INC	1,300	371.46	482,898.00
DRAFTKINGS INC - CL A	5,800	60.91	353,278.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	9,017	116.91	1,054,177.47
LAS VEGAS SANDS CORP	11,000	60.18	661,980.00
MARRIOTT INT'L A	9,144	136.28	1,246,144.32
MCDONALD'S CORP	24,528	212.24	5,205,822.72
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	7,636	18.68	142,640.48
MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,200	36.42	553,584.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5,800	78.87	457,446.00
STARBUCKS CORP	38,552	103.37	3,985,120.24
VAIL RESORTS	1,400	304.26	425,964.00
WYNN RESORTS LTD	3,000	123.66	370,980.00
YUM! BRANDS INC	9,958	105.13	1,046,884.54
ACTIVISION BLIZZARD INC	25,500	100.80	2,570,400.00
ALPHABET INC-CL A	9,912	2,088.81	20,704,284.72
ALPHABET INC-CL C	9,881	2,101.14	20,761,364.34
ALTICE USA INC- A	10,900	33.83	368,747.00
CABLE ONE INC	200	2,037.05	407,410.00
CHARTER COMMUNICATION-A	4,725	607.29	2,869,445.25
COMCAST CORP-CL A	150,412	52.10	7,836,465.20
DISCOVERY INC-A	5,145	50.79	261,314.55
DISCOVERY INC-C	10,951	42.80	468,702.80
DISH NETWORK CORP-A	7,873	33.67	265,083.91
DISNEY (WALT) CO NEW	59,564	183.65	10,938,928.60
ELECTRONIC ARTS	9,324	145.95	1,360,837.80
FACEBOOK INC-A	79,252	261.56	20,729,153.12
FOX CORP	6,038	32.37	195,450.06
FOX CORPORATION-CLASS A	11,869	33.78	400,934.82
IAC/INTERACTIVECORP	2,700	262.15	707,805.00

INTERPUBLIC GROUP OF COS	13,639	25.56	348,612.84
LIBERTY BROADBAND CORP-C	5,200	148.99	774,748.00
LIBERTY BROADBAND-A	800	145.89	116,712.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	6,900	45.20	311,880.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	3,073	43.98	135,150.54
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	6,062	43.25	262,181.50
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	5,400	88.09	475,686.00
MATCH GROUP INC	8,194	160.95	1,318,824.30
NETFLIX INC	14,507	540.22	7,836,971.54
NEWS CORP - CLASS A	13,556	22.50	305,010.00
OMNICOM GROUP	6,888	67.65	465,973.20
PINTEREST INC- CLASS A	15,400	85.90	1,322,860.00
ROKU INC	3,500	467.31	1,635,585.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	35,664	6.01	214,340.64
SNAP INC - A	30,100	65.52	1,972,152.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	3,800	194.86	740,468.00
TWITTER INC	25,547	72.28	1,846,537.16
VIACOMCBS INC	17,915	62.69	1,123,091.35
ZILLOW GROUP INC-A	2,000	191.46	382,920.00
ZILLOW GROUP INC-C	4,800	181.22	869,856.00
ADOVANCE AUTO PARTS	2,150	165.98	356,857.00
AMAZON COM INC	13,988	3,249.90	45,459,601.20
AUTOZONE INC	781	1,205.73	941,675.13
BEST BUY COMPANY INC	7,686	118.00	906,948.00
BOOKING HOLDINGS INC	1,343	2,293.05	3,079,566.15
BURLINGTON STORES INC	2,200	264.81	582,582.00
CARMAX INC	5,350	121.32	649,062.00
CARVANA CO	2,100	308.74	648,354.00
CHEWY INC - CLASS A	2,600	113.95	296,270.00
DOLLAR GENERAL CORP	8,209	201.16	1,651,322.44
DOLLAR TREE INC	7,803	107.90	841,943.70
EBAY INC	22,622	61.98	1,402,111.56
ETSY INC	4,000	227.27	909,080.00
EXPEDIA GROUP INC	4,527	158.92	719,430.84
GENUINE PARTS CO	4,600	102.36	470,856.00
HOME DEPOT	35,539	279.64	9,938,125.96
LKQ CORP	10,165	38.79	394,300.35
LOWE'S COMPANIES	24,906	177.54	4,421,811.24
MERCADOLIBRE	1,500	1,910.39	2,865,585.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,428	460.41	1,117,875.48
POOL CORP	1,300	326.08	423,904.00
ROSS STORES INC	11,512	118.95	1,369,352.40
TARGET CORP	16,505	188.82	3,116,474.10
TJX COMPANIES INC	39,622	67.69	2,682,013.18
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,744	171.34	641,496.96
ULTA BEAUTY INC	1,816	321.79	584,370.64
WAYFAIR INC- CLASS A	2,100	292.73	614,733.00
COSTCO WHOLESALE CORP	14,587	354.77	5,175,029.99

KROGER CO	25,692	34.02	874,041.84
SYSCO CORP	16,003	76.71	1,227,590.13
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	24,229	48.86	1,183,828.94
WALMART INC	46,716	138.34	6,462,691.44
ALTRIA GROUP INC	61,432	43.80	2,690,721.60
ARCHER-DANIELS-MIDLAND	17,884	56.12	1,003,650.08
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,880	75.43	745,248.40
BUNGE LIMITED	4,675	76.38	357,076.50
CAMPBELL SOUP CO (US)	5,510	46.32	255,223.20
COCA-COLA CO	134,607	50.11	6,745,156.77
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	1,500	52.30	78,450.00
CONAGRA BRANDS INC	15,527	34.10	529,470.70
CONSTELLATION BRANDS INC-A	5,516	223.21	1,231,226.36
GENERAL MILLS	20,261	56.50	1,144,746.50
HORMEL FOODS CORP	9,900	47.10	466,290.00
JM SMUCKER CO	3,888	113.76	442,298.88
KELLOGG CO	8,187	57.91	474,109.17
KEURIG DR PEPPER INC	18,800	31.24	587,312.00
LAMB WESTON HOLDINGS INC	5,000	78.09	390,450.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,898	84.12	664,379.76
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	6,400	44.40	284,160.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	47,161	54.31	2,561,313.91
MONSTER BEVERAGE CORP	12,940	89.65	1,160,071.00
PEPSICO INC	45,636	132.51	6,047,226.36
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC- W/I	51,451	85.45	4,396,487.95
THE HERSHEY COMPANY	4,700	148.85	699,595.00
THE KRAFT HEINZ CO/THE	21,555	37.48	807,881.40
TYSON FOODS INC-CL A	9,426	67.52	636,443.52
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,900	81.45	643,455.00
CLOROX CO	4,183	187.05	782,430.15
COLGATE-PALMOLIVE CO	26,962	77.20	2,081,466.40
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	7,413	285.16	2,113,891.08
KIMBERLY-CLARK CORP	11,257	130.63	1,470,501.91
PROCTER & GAMBLE CO	82,139	127.12	10,441,509.68
ABBOTT LABORATORIES	58,377	123.04	7,182,706.08
ABIOMED INC	1,400	331.97	464,758.00
ALIGN TECHNOLOGY	2,500	599.25	1,498,125.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,942	105.87	523,209.54
ANTHEM INC	8,355	294.97	2,464,474.35
BAXTER INTERNATIONAL	16,443	78.44	1,289,788.92
BECTON DICKINSON	9,609	247.93	2,382,359.37
BOSTON SCIENTIFIC CORP	47,348	38.03	1,800,644.44
CARDINAL HEALTH INC	9,271	52.00	482,092.00
CENTENE CORP	18,822	57.97	1,091,111.34
CERNER CORP	9,988	71.56	714,741.28
CIGNA CORP	12,028	204.26	2,456,839.28
CVS HEALTH CORPORATION	43,221	70.42	3,043,622.82

DANAHER CORP	21,069	231.24	4,871,995.56
DAVITA INC	2,800	102.07	285,796.00
DENTSPLY SIRONA INC	7,600	52.76	400,976.00
DEXCOM INC	3,200	418.94	1,340,608.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	20,200	84.31	1,703,062.00
HCA HEALTHCARE INC	8,933	177.37	1,584,446.21
HENRY SCHEIN INC	4,500	63.75	286,875.00
HOLOGIC INC	8,416	75.69	637,007.04
HUMANA	4,349	376.91	1,639,181.59
IDEXX LABORATORIES	2,800	544.13	1,523,564.00
INSULET CORP	2,200	274.03	602,866.00
INTUITIVE SURGICAL INC COM NEW	3,838	750.15	2,879,075.70
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,244	246.38	799,256.72
MASIMO CORP	1,700	259.35	440,895.00
MCKESSON CORP	5,358	177.62	951,687.96
MEDTRONIC PLC	44,305	113.33	5,021,085.65
MOLINA HEALTHCARE INC	2,000	220.83	441,660.00
NOVOCURE LTD	2,900	190.17	551,493.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,246	119.23	506,250.58
RESMED INC	4,833	201.18	972,302.94
STERIS PLC	2,700	178.73	482,571.00
STRYKER CORP	11,167	242.09	2,703,419.03
TELADOC HEALTH INC	3,700	292.51	1,082,287.00
TELEFLEX	1,500	390.43	585,645.00
THE COOPER COS INC	1,731	388.51	672,510.81
UNITED HEALTH GROUP INC	31,291	324.58	10,156,432.78
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,720	129.67	352,702.40
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3,060	176.35	539,631.00
VEEVA SYSTEMS A	4,500	313.82	1,412,190.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,400	281.55	675,720.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	6,831	156.67	1,070,212.77
10X GENOMICS INC-CLASS A	2,100	190.73	400,533.00
ABBVIE INC	58,257	105.01	6,117,567.57
AGILENT TECHNOLOGIES INC	10,020	126.87	1,271,237.40
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	7,063	155.51	1,098,367.13
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,900	155.06	604,734.00
AMGEN INC	19,314	231.69	4,474,860.66
AVANTOR INC	17,400	28.69	499,206.00
BIOGEN INC	5,201	278.35	1,447,698.35
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5,721	81.76	467,748.96
BIO-RAD LABORATORIES-A	700	637.01	445,907.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	74,376	60.60	4,507,185.60
CATALENT INC	5,500	117.99	648,945.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	13,456	30.10	405,025.60
EXACT SCIENCES CORP	5,300	147.81	783,393.00
GILEAD SCIENCES INC	41,410	64.37	2,665,561.70
HORIZON THERAPEUTICS PLC	7,400	88.87	657,638.00
ILLUMINA INC	4,800	486.26	2,334,048.00

INCYTE CORP	5,908	80.54	475,830.32
IONIS PHARMACEUTICALS INC	4,200	57.69	242,298.00
IQIVA HOLDINGS INC	6,232	188.70	1,175,978.40
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,901	160.60	305,300.60
JOHNSON & JOHNSON	86,825	162.98	14,150,738.50
LILLY (ELI) & CO	28,409	200.92	5,707,936.28
MERCK & CO	83,460	74.31	6,201,912.60
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	807	1,165.45	940,518.15
MODERNA INC	9,000	174.74	1,572,660.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,900	113.24	328,396.00
PERKINELMER INC	3,500	136.79	478,765.00
PERRIGO CO PLC	4,279	42.10	180,145.90
PFIZER	183,288	34.44	6,312,438.72
PPD INC	4,200	36.90	154,980.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,477	470.37	1,635,476.49
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	3,900	47.51	185,289.00
SAREPTA THERAPEUTICS INC	2,400	85.38	204,912.00
SEAGEN INC/WA	3,900	157.75	615,225.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	10,200	11.04	112,608.00
THERMO ELECTRON CORP	13,071	478.86	6,259,179.06
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	8,610	207.02	1,782,442.20
VIATRIS INC	39,471	18.21	718,766.91
WATERS CORPORATION	2,027	281.72	571,046.44
ZOETIS INC	15,695	160.00	2,511,200.00
BANK OF AMERICA CORP	257,187	34.54	8,883,238.98
CITIGROUP INC	68,751	65.78	4,522,440.78
CITIZENS FINANCIAL GROUP	14,000	42.51	595,140.00
FIFTH THIRD BANCORP	23,320	34.54	805,472.80
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5,506	166.94	919,171.64
HUNTINGTON BANCSHARES INC	35,415	15.30	541,849.50
JPMORGAN CHASE & CO	100,490	148.02	14,874,529.80
KEYCORP	31,791	20.15	640,588.65
M & T BANK CORP	4,191	149.97	628,524.27
PNC BANK CORP	13,887	170.41	2,366,483.67
REGIONS FINANCIAL CORP	31,945	20.37	650,719.65
SVB FINANCIAL GROUP	1,700	540.40	918,680.00
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	44,538	57.58	2,564,498.04
US BANCORP	44,135	50.02	2,207,632.70
WELLS FARGO COMPANY	129,297	37.83	4,891,305.51
ALLY FINANCIAL INC.	12,575	42.80	538,210.00
AMERICAN EXPRESS	22,615	131.71	2,978,621.65
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,096	224.49	919,511.04
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	5,700	51.83	295,431.00
BANK NEW YORK MELLO CORP	25,757	42.32	1,090,036.24
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	46,234	241.85	11,181,692.90
BLACKROCK INC	4,990	710.11	3,543,448.90
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	21,700	69.97	1,518,349.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15,099	119.56	1,805,236.44

CARLYLE GROUP INC/THE	4,400	36.50	160,600.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,500	96.22	336,770.00
CME GROUP INC	11,889	195.07	2,319,187.23
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,332	93.92	970,381.44
EQUITABLE HOLDINGS INC	13,600	28.69	390,184.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,200	313.68	376,416.00
FRANKLIN RESOURCES INC	10,405	27.51	286,241.55
GOLDMAN SACHS GROUP INC	10,784	315.62	3,403,646.08
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	17,825	113.35	2,020,463.75
INVESCO LTD	13,380	22.47	300,648.60
KKR & CO INC	16,600	46.77	776,382.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,300	550.21	715,273.00
MOODY'S CORPORATION	5,549	280.42	1,556,050.58
MORGAN STANLEY	46,199	76.00	3,511,124.00
MSCI INC	2,770	432.97	1,199,326.90
NASDAQ INC	3,640	144.43	525,725.20
NORTHERN TRUST CORP	6,305	96.31	607,234.55
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4,215	118.25	498,423.75
S&P GLOBAL INC	7,978	339.24	2,706,456.72
SCHWAB (CHARLES) CORP	50,535	61.91	3,128,621.85
SEI INVESTMENTS CO COM	4,200	58.02	243,684.00
STATE STREET CORP	11,731	71.93	843,810.83
SYNCHRONY FINANCIAL	16,715	38.08	636,507.20
T ROWE PRICE GROUP INC	7,493	162.77	1,219,635.61
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	2,600	69.30	180,180.00
VOYA FINANCIAL INC	4,554	58.43	266,090.22
AFLAC	22,710	48.08	1,091,896.80
ALLEGHANY CORP	448	609.03	272,845.44
ALLSTATE CORP	10,128	103.45	1,047,741.60
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,800	107.49	300,972.00
AMERICAN INT'L GROUP	28,617	42.58	1,218,511.86
AON PLC	7,634	228.34	1,743,147.56
ARCH CAPITAL GROUP LTD	13,650	35.09	478,978.50
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6,300	120.18	757,134.00
ASSURANT INC	2,100	123.31	258,951.00
ATHENE HLDG LTD CLASS A	4,800	45.39	217,872.00
BROWN & BROWN INC	8,200	45.59	373,838.00
CHUBB LTD	14,884	164.70	2,451,394.80
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,937	96.26	475,235.62
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	800	256.16	204,928.00
EVEREST RE GROUP LTD	1,400	239.30	335,020.00
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	9,402	40.47	380,498.94
GLOBE LIFE INC	3,550	95.30	338,315.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS	12,109	49.86	603,754.74
LINCOLN NATIONAL CORP	6,115	55.56	339,749.40
LOEWS CORP	8,505	48.06	408,750.30
MARKEL CORP	465	1,091.18	507,398.70
MARSH & MCLENNAN COS	16,775	117.07	1,963,849.25



METLIFE INC	24,971	56.07	1,400,123.97
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,286	55.10	511,658.60
PROGRESSIVE CORP	19,389	87.06	1,688,006.34
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	13,135	84.10	1,104,653.50
REINSURANCE GRP AMERICA	2,300	123.42	283,866.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,728	158.55	273,974.40
TRAVELERS COS INC/THE ST.PAUL TRAVELERS	8,234	145.91	1,201,422.94
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,228	224.98	951,215.44
WR BERKLEY CORP	4,915	67.88	333,630.20
CBRE GROUP INC-A	10,684	72.74	777,154.16
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	39,400	4.57	180,058.00
ACCENTURE PLC-CL A	20,997	254.29	5,339,327.13
ADOBE INC	15,828	479.12	7,583,511.36
AKAMA I TECHNOLOGIES	5,172	98.86	511,303.92
ANSYS INC	2,800	395.37	1,107,036.00
AUTODESK INC	7,237	305.40	2,210,179.80
AUTOMATIC DATA PROCESS	14,163	169.29	2,397,654.27
AVALARA INC	2,700	175.66	474,282.00
BLACK KNIGHT INC	5,000	81.73	408,650.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	4,400	78.71	346,324.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	3,700	149.54	553,298.00
CADENCE DESIGN SYS INC	9,000	139.66	1,256,940.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	4,500	96.23	433,035.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	3,703	115.88	429,103.64
CITRIX SYSTEMS INC	3,870	132.96	514,555.20
CLOUDFLARE INC - CLASS A	5,200	82.17	427,284.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	17,655	73.64	1,300,114.20
COUPA SOFTWARE INC	2,200	369.64	813,208.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	4,800	239.20	1,148,160.00
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,200	163.76	196,512.00
DATADOG INC - CLASS A	5,100	105.05	535,755.00
DOCUSIGN INC	5,800	265.16	1,537,928.00
DROPBOX INC-CLASS A	10,800	23.46	253,314.00
DYNATRACE INC	6,200	52.88	327,856.00
EPAM SYSTEMS INC	1,800	376.00	676,800.00
FAIR ISAAC CORP	900	473.82	426,438.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	20,496	130.99	2,684,771.04
FISERV INC	18,602	111.36	2,071,518.72
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,781	273.38	760,269.78
FORTINET INC	4,400	171.93	756,492.00
GARTNER INC	2,800	183.95	515,060.00
GLOBAL PAYMENTS INC	9,878	194.18	1,918,110.04
GODADDY INC-CLASS A	5,500	84.61	465,355.00
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,800	125.96	352,688.00
HUBSPOT INC	1,400	543.49	760,886.00
IBM CORP	29,361	118.99	3,493,665.39

INTUIT CORP	8,626	411.35	3,548,305.10
JACK HENRY & ASSOCIATES, INC.	2,500	150.89	377,225.00
LEIDOS HOLDINGS INC	4,500	103.76	466,920.00
MASTERCARD INC-CLASS A	29,414	333.17	9,799,862.38
MICROSOFT CORP	236,932	240.97	57,093,504.04
MONGODB INC	1,600	418.30	669,280.00
NORTONLIFELOCK INC	18,700	20.46	382,602.00
OKTA INC	4,000	288.36	1,153,440.00
ORACLE CORP	66,159	61.13	4,044,299.67
PALO ALTO NETWORKS INC	3,140	396.90	1,246,266.00
PAYCHEX INC	10,351	90.25	934,177.75
PAYCOM SOFTWARE INC	1,600	400.13	640,208.00
PAYPAL HOLDINGS INC	36,822	286.92	10,564,968.24
PTC INC	3,600	146.73	528,228.00
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,400	427.39	1,025,736.00
SALESFORCE COM INC COM	29,979	246.56	7,391,622.24
SERVICENOW INC	6,384	570.73	3,643,540.32
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	13,000	43.30	562,900.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,100	290.00	319,000.00
SPLUNK INC	5,300	169.66	899,198.00
SQUARE INC - A	12,300	276.57	3,401,811.00
SS&C TECHNOLOGIES HLDGS	7,800	66.44	518,232.00
SYNOPSIS INC	5,015	268.07	1,344,371.05
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,400	903.35	1,264,690.00
TWILIO INC - A	4,300	425.55	1,829,865.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,300	473.88	616,044.00
VERISIGN INC	3,399	197.95	672,832.05
VISA INC-CLASS A SHARES	55,595	204.73	11,381,964.35
VMWARE INC	2,800	144.68	405,104.00
WESTERN UNION CO	14,116	23.91	337,513.56
WIX.COM LTD	1,800	353.09	635,562.00
WORKDAY INC CLASS A	5,872	276.34	1,622,668.48
ZENDESK INC	3,900	157.69	614,991.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	5,700	417.26	2,378,382.00
ZSCALER INC	2,300	226.03	519,869.00
AMPHENOL CORP-CL A	9,900	132.43	1,311,057.00
APPLE INC	563,668	129.87	73,203,563.16
ARISTA NETWORKS	1,800	310.95	559,710.00
ARROW ELECTRONICS INC	2,800	105.35	294,980.00
CDW CORP/DE	4,800	160.75	771,600.00
CISCO SYSTEMS	139,282	45.68	6,362,401.76
COGNEX CORP	5,700	87.43	498,351.00
CORNING	24,428	38.06	929,729.68
DELL TECHNOLOGIES INC-C	7,677	80.77	620,071.29
FS NETWORKS INC	2,100	198.81	417,501.00
HEWLETT-PACKARD CO	47,503	27.10	1,287,331.30
HP ENTERPRISE CO	43,576	14.13	615,728.88
IPG PHOTONICS CORP	1,300	234.56	304,928.00

JUNIPER NETWORKS INC	11,408	23.97	273,449.76
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,000	142.19	853,140.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,443	182.75	994,708.25
NETAPP INC	7,248	71.35	517,144.80
SEAGATE TECHNOLOGY	7,478	73.14	546,940.92
TE CONNECTIVITY LTD	10,762	132.22	1,422,951.64
TRIMBLE INC	8,543	72.99	623,553.57
WESTERN DIGITAL CORP	9,492	68.88	653,808.96
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,800	490.94	883,692.00
AT & T INC	235,083	29.00	6,817,407.00
LIBERTY GLOBAL PLC A	5,899	26.57	156,736.43
LIBERTY GLOBAL PLC SERIES C	13,880	26.26	364,488.80
LUMEN TECHNOLOGIES INC	30,289	11.94	361,650.66
T MOBILE US INC	18,390	120.10	2,208,639.00
VERIZON COMMUNICATIONS	136,484	56.45	7,704,521.80
AES CORPORATION	21,062	28.31	596,265.22
ALLIANT ENERGY CORP	8,290	47.63	394,852.70
AMEREN CORPORATION	7,877	72.33	569,743.41
AMERICAN ELECTRIC POWER	16,485	79.08	1,303,633.80
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,800	156.66	908,628.00
ATMOS ENERGY CORP	4,058	93.56	379,666.48
CENTERPOINT ENERGY INC	18,256	21.43	391,226.08
CMS ENERGY CORP	9,100	55.98	509,418.00
CONSOLIDATED EDISON	11,159	68.18	760,820.62
DOMINION ENERGY INC	27,760	71.15	1,975,124.00
DTE ENERGY	6,366	120.18	765,065.88
DUKE ENERGY CORP	24,365	88.43	2,154,596.95
EDISON INTERNATIONAL	12,616	55.22	696,655.52
ENTERGY CORP	6,620	93.18	616,851.60
ESSENTIAL UTILITIES INC	7,400	45.57	337,218.00
EVERGY INC	7,700	54.23	417,571.00
EVERSOURCE ENERGY	11,371	81.46	926,281.66
EXELON CORP	32,309	41.38	1,336,946.42
FIRSTENERGY CORP	17,916	34.03	609,681.48
NEXTERA ENERGY INC	64,660	78.10	5,049,946.00
NISOURCE INC	12,800	22.84	292,352.00
NRG ENERGY INC	8,100	39.58	320,598.00
OGE ENERGY CORP	6,612	31.92	211,055.04
P G & E CORP	48,600	11.64	565,704.00
PINNACLE WEST CAPITAL	3,797	76.26	289,559.22
PPL CORPORATION	24,466	27.68	677,218.88
PUBLIC SV ENTERPRISE CO	16,702	57.75	964,540.50
SEMPRA ENERGY	9,441	124.57	1,176,065.37
SOUTHERN CO	34,939	59.31	2,072,232.09
UGI CORP	6,500	40.29	261,885.00
VISTRA CORP	14,900	22.91	341,359.00
WEC ENERGY GROUP INC	10,486	83.23	872,749.78
XCEL ENERGY INC	17,444	62.07	1,082,749.08

	ADVANCED MICRO DEVICES	38,800	89.58	3,475,704.00	
	ANALOG DEVICES	12,248	163.80	2,006,222.40	
	APPLIED MATERIALS	30,141	119.46	3,600,643.86	
	BROADCOM INC	13,246	489.96	6,490,010.16	
	ENPHASE ENERGY INC	4,000	189.74	758,960.00	
	INTEL CORP	140,328	63.01	8,842,067.28	
	KLA CORPORATION	5,048	330.67	1,669,222.16	
	LAM RESEARCH CORP	4,800	598.41	2,872,368.00	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	22,300	51.89	1,157,147.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	8,600	98.15	844,090.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	8,410	162.35	1,365,363.50	
	MICRON TECHNOLOGY	36,730	90.96	3,340,960.80	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,400	393.75	551,250.00	
	NVIDIA CORP	20,300	597.06	12,120,318.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	9,291	191.59	1,780,062.69	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	13,000	41.87	544,310.00	
	QORVO INC	3,625	179.39	650,288.75	
	QUALCOMM	37,218	144.94	5,394,376.92	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC.	5,451	192.17	1,047,518.67	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	1,700	321.99	547,383.00	
	TERADYNE INC	5,300	142.59	755,727.00	
	TEXAS INSTRUMENTS	30,186	178.35	5,383,673.10	
	XILINX INC	8,110	138.71	1,124,938.10	
	アメリカ・ドル 小計	10,226,023		1,139,425,579.69 (120,209,398,657)	
カナダ・ドル	CAMECO CORP	13,622	20.92	284,972.24	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	39,190	34.98	1,370,866.20	
	CENOVUS ENERGY INC	32,348	8.72	282,074.56	
	ENBRIDGE INC	63,071	43.70	2,756,202.70	
	IMPERIAL OIL LTD	8,285	26.70	221,209.50	
	INTER PIPELINE LTD	14,689	17.91	263,079.99	
	KEYERA CORP	6,842	26.23	179,465.66	
	PARKLAND CORPORATION	5,300	37.50	198,750.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	18,049	34.36	620,163.64	
	SUNCOR ENERGY INC	49,030	23.94	1,173,778.20	
	TC ENERGY CORP	31,107	56.39	1,754,123.73	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	7,655	75.47	577,722.85	
	B2GOLD CORP	33,500	5.99	200,665.00	
	BARRICK GOLD CORP	58,880	24.93	1,467,878.40	
	CCL INDUSTRIES INC	4,700	65.15	306,205.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	18,528	29.08	538,794.24	
	FRANCO NEV CORP	6,362	140.38	893,097.56	
	KINROSS GOLD CORP	40,963	8.28	339,173.64	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	8,800	45.09	396,792.00	
	LUNDIN MINING CORP	23,000	15.21	349,830.00	
	NEWMONT CORPORATION	4,088	71.56	292,537.28	
	NUTRIEN LTD	18,853	71.27	1,343,653.31	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	6,800	41.01	278,868.00	

SSR MINING INC	7,100	19.01	134,971.00
TECK RESOURCES LTD	16,408	29.01	475,996.08
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,800	87.68	245,504.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	14,300	47.46	678,678.00
YAMANA GOLD INC	30,600	5.56	170,136.00
CAE Inc.	9,550	32.45	309,897.50
TOROMONT INDUSTRIES LTD	2,800	92.10	257,880.00
WSP GLOBAL INC	3,500	119.03	416,605.00
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	6,500	37.78	245,570.00
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,500	67.06	234,710.00
THOMSON REUTERS CORPORATION	5,762	103.51	596,424.62
AIR CANADA	4,800	24.02	115,296.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	23,425	137.85	3,229,136.25
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4,413	463.75	2,046,528.75
MAGNA INTERNATIONAL INC	9,538	105.12	1,002,634.56
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,015	34.84	209,562.60
RESTAURANT BRANDS INTERN	9,333	76.92	717,894.36
QUEBECOR INC -CL B	5,900	32.16	189,744.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	16,056	22.16	355,800.96
CANADIAN TIRE CORP.	1,831	179.04	327,822.24
DOLLARAMA INC	9,385	48.20	452,357.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	27,900	38.09	1,062,711.00
EMPIRE CO LTD 'A'	5,266	36.77	193,630.82
LOBLAW COMPANIES LTD	6,072	61.88	375,735.36
METRO INC	8,018	54.32	435,537.76
WESTON (GEORGE)	2,590	94.03	243,537.70
SAPUTO INC	8,307	36.96	307,026.72
BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	9,891	40.29	398,508.39
CANOPY GROWTH CORP	7,300	48.77	356,021.00
BANK OF MONTREAL	21,294	101.25	2,156,017.50
BANK OF NOVA SCOTIA	40,122	71.51	2,869,124.22
CANADIAN IMPERIAL BANK	14,814	114.76	1,700,054.64
NATIONAL BANK OF CANADA	10,746	75.13	807,346.98
ROYAL BANK OF CANADA	46,942	109.77	5,152,823.34
TRONTO-DOMINION BANK	59,248	76.38	4,525,362.24
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	43,045	54.94	2,364,892.30
CI FINANCIAL CORP	6,353	18.00	114,354.00
IGM FINANCIAL INC	2,833	34.93	98,956.69
ONEX CORPORATION	3,009	72.52	218,212.68
TMX GROUP LTD	1,800	125.75	226,350.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	857	514.90	441,269.30
GREAT-WEST LIFECO INC	9,846	31.36	308,770.56
IA FINANCIAL CORP INC	3,293	64.75	213,221.75
INTACT FINANCIAL CORP	4,700	144.33	678,351.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	64,320	24.91	1,602,211.20
POWER CORP OF CANADA	18,433	31.02	571,791.66
SUN LIFE FINANCIAL INC	18,791	62.93	1,182,517.63
FIRSTSERVICE CORP	1,300	194.40	252,720.00

	BLACKBERRY LTD	18,500	13.75	254,375.00	
	CGI INC	7,684	96.54	741,813.36	
	CONSTELLATION SOFTWARE	655	1,724.27	1,129,396.85	
	OPEN TEXT CORP	9,084	58.92	535,229.28	
	SHOPIFY INC - CLASS A	3,600	1,810.58	6,518,088.00	
	BCE INC	5,115	55.00	281,325.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	11,304	55.77	630,424.08	
	TELUS CORP	13,164	26.06	343,053.84	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	20,000	21.80	436,000.00	
	ALTAGAS LTD	9,613	19.64	188,799.32	
	ATCO LTD -CLASS I	2,614	37.76	98,704.64	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	4,050	62.19	251,869.50	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	4,700	31.69	148,943.00	
	EMERA	8,200	50.12	410,984.00	
	FORTIS INC	15,200	50.31	764,712.00	
	HYDRO ONE	10,900	28.04	305,636.00	
	NORTHLAND POWER INC	6,500	48.41	314,665.00	
	カナダ・ドル 小計	1,305,151		70,714,127.93 (5,920,186,790)	
オーストラリア・ドル	AMPOL LIMITED	9,013	26.49	238,754.37	
	OIL SEARCH LTD	61,696	4.05	249,868.80	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	61,786	4.45	274,947.70	
	SANTOS	59,797	6.82	407,815.54	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,774	28.75	108,502.50	
	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	31,655	24.00	759,720.00	
	AMCOR PLC-CDI	30,150	14.68	442,602.00	
	BHP GROUP LIMITED	97,341	47.32	4,606,176.12	
	BLUESCOPE STEEL LTD	17,361	17.28	299,998.08	
	EVOLUTION MINING LTD	52,484	4.13	216,758.92	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	56,354	23.97	1,350,805.38	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	15,082	39.10	589,706.20	
	NEWCREST MINING	25,883	24.24	627,403.92	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	24,066	10.38	249,805.08	
	ORICA	13,202	14.94	197,237.88	
	RIO TINTO LTD	11,912	123.26	1,468,273.12	
	SOUTH32 LTD	167,610	2.68	449,194.80	
	CIMIC GROUP LTD	3,202	21.26	68,074.52	
	BRAMBLES LTD	52,140	10.20	531,828.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	66,360	3.99	264,776.40	
	QANTAS AIRWAYS LTD	26,005	4.62	120,143.10	
	SYDNEY AIRPORT	44,367	5.50	244,018.50	
	TRANSURBAN GROUP	87,753	12.77	1,120,605.81	
	ARISTOCRAT LEISURE LIMITED	19,160	32.80	628,448.00	
	CROWN RESORTS LTD	13,347	10.25	136,806.75	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	78,049	4.59	358,244.91	
	REA GROUP LTD	1,843	153.60	283,084.80	
	SEEK LTD	10,386	30.37	315,422.82	
	WESFARMERS LIMITED	37,355	54.01	2,017,543.55	

COLES GROUP LTD	44,526	16.41	730,671.66	
WOOLWORTHS GROUP LTD	41,613	39.52	1,644,545.76	
COCA-COLA AMATIL	17,597	13.38	235,447.86	
TREASURY WINE ESTATES LTD	23,596	11.18	263,803.28	
COCHLEAR LIMITED	2,169	221.68	480,823.92	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,676	62.16	352,820.16	
SONIC HEALTHCARE LIMITED	15,433	34.22	528,117.26	
CSL LIMITED	15,008	274.43	4,118,645.44	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	93,905	26.61	2,498,812.05	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	58,463	82.51	4,823,782.13	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	110,134	25.11	2,765,464.74	
WESTPAC BANKING	119,518	24.09	2,879,188.62	
AMP LTD	113,241	1.35	152,875.35	
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	6,483	69.13	448,169.79	
MACQUARIE GROUP LIMITED	11,391	142.26	1,620,483.66	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,485	44.99	201,780.15	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	79,212	4.95	392,099.40	
MEDIBANK PRIVATE LTD.	90,832	2.79	253,421.28	
QBE INSURANCE GROUP	44,856	8.99	403,255.44	
SUNCORP GROUP LTD	39,755	9.80	389,599.00	
LENLEASE GROUP	22,675	11.89	269,605.75	
AFTERPAY LTD	6,922	151.92	1,051,590.24	
COMPUTERSHARE LIMITED	15,738	14.00	220,332.00	
WISETECH GLOBAL LTD	4,977	31.30	155,780.10	
XERO LTD	4,077	124.70	508,401.90	
TELSTRA CORP	139,345	3.31	461,231.95	
TPG TELECOM LTD	12,694	6.91	87,715.54	
AGL ENERGY LIMITED	20,123	10.10	203,242.30	
APA GROUP	37,312	9.25	345,136.00	
AUSNET SERVICES	58,686	1.69	98,885.91	
オーストラリア・ドル 小計	2,439,575		47,212,296.21 (3,927,590,921)	
イギリス・ポンド				
BP PLC	669,917	2.72	1,824,518.94	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	135,574	13.97	1,894,239.92	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	122,567	13.40	1,642,888.06	
ANGLO AMERICAN PLC	40,676	28.70	1,167,401.20	
ANTOFAGASTA PLC	12,248	18.38	225,118.24	
BHP GROUP PLC	69,926	22.78	1,592,564.65	
CRODA INTERNATIONAL PLC	4,297	64.62	277,672.14	
EVRAZ PLC	20,049	5.57	111,592.73	
FRESNILLO PLC	6,579	9.84	64,737.36	
GLENORE PLC	330,273	3.00	991,314.40	
JOHNSON MATTHEY PLC	6,545	31.28	204,727.60	
MONDI PLC	16,619	18.16	301,801.04	
RIO TINTO PLC REG	37,090	63.52	2,355,956.80	
ASHTED GROUP PLC	14,379	39.95	574,441.05	
BAE SYSTEMS PLC	106,026	4.65	493,338.97	
BUNZL PLC	11,485	22.82	262,087.70	

DCC (GB)	3,108	59.96	186,355.68
FERGUSON PLC	7,445	87.38	650,544.10
MELROSE INDUSTRIES PLC	166,713	1.70	283,745.52
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	275,677	0.99	271,982.92
SMITHS GROUP PLC	13,428	14.92	200,278.62
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,332	113.30	264,215.60
EXPERIAN PLC	30,193	24.89	751,503.77
INTERTEK GROUP PLC	5,408	56.94	307,931.52
RELX PLC	48,945	17.61	861,676.72
RENTOKIL INITIAL PLC	61,931	4.99	308,726.03
BARRATT DEVELOPMENTS	34,799	6.84	238,164.35
BURBERRY GROUP PLC	12,728	18.40	234,131.56
PERSIMMON PLC	10,113	27.73	280,433.49
TAYLOR WIMPEY PLC	117,244	1.62	190,404.25
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	3,958	43.40	171,777.20
COMPASS GROUP PLC	59,184	14.26	843,963.84
ENTAIN PLC	18,250	13.66	249,203.75
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	1,734	136.25	236,257.50
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	5,909	51.10	301,949.90
WHITBREAD PLC	6,304	34.18	215,470.72
AUTO TRADER GROUP PLC	32,875	6.08	199,748.50
INFORMA PLC	50,547	5.09	257,284.23
PEARSON	25,886	7.50	194,145.00
WPP PLC	39,152	8.43	329,973.05
JD SPORTS FASHION PLC	15,740	8.50	133,790.00
KINGFISHER PLC	73,039	2.76	201,733.71
NEXT PLC	4,436	76.70	340,241.20
OCADO GROUP PLC	16,275	25.59	416,477.25
MORRISON SUPERMARKETS	84,769	1.72	146,056.98
SAINSBURY (J) PLC	58,445	2.31	134,949.50
TESCO PLC	248,049	2.28	564,559.52
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	12,196	23.71	289,167.16
BRITISH AMERICAN TOBACCO	75,815	25.62	1,942,380.30
COCA COLA HBC AG CDI	7,095	23.25	164,958.75
DIAGEO	77,221	29.97	2,313,927.26
IMPERIAL BRANDS PLC	31,268	13.94	435,875.92
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	23,525	60.72	1,428,438.00
UNILEVER PLC	39,665	39.05	1,548,918.25
SMITH&NEOHEW PLC	27,959	14.74	411,975.86
ASTRAZENECA PLC	43,318	72.26	3,130,158.68
GLAXOSMITHKLINE PLC	165,750	12.15	2,014,194.00
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,911	23.61	139,558.71
BARCLAYS PLC	571,521	1.54	878,084.86
HSBC HOLDINGS PLC	672,572	4.24	2,851,368.99
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,347,896	0.38	896,661.48
NATWEST GROUP PLC	165,473	1.80	298,099.60
STANDARD CHARTERED PLC	86,660	4.93	426,800.50



3I GROUP PLC	32,494	11.36	369,131.84	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,488	15.16	158,998.08	
LONDON STOCK EXCAHNGE GROUP	10,421	97.22	1,013,129.62	
M&G PLC	81,141	1.90	153,924.47	
SCHRODERS PLC	3,844	34.93	134,270.92	
ST JAMES'S PLACE PLC	17,672	12.14	214,538.08	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	73,327	3.27	239,412.65	
ADMIRAL GROUP PLC	6,324	30.67	193,957.08	
AVIVA PLC	131,858	3.65	480,622.41	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	46,389	3.13	145,104.79	
LEGAL & GENERAL GROUP	190,576	2.65	504,264.09	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	18,827	7.06	132,956.27	
PRUDENTIAL PLC	86,439	14.16	1,223,976.24	
RSA INSURANCE GROUP PLC	36,701	6.76	248,172.16	
AVEVA GROUP PLC	4,094	37.56	153,770.64	
SAGE GROUP PLC/THE	36,430	5.96	216,977.08	
HALMA PLC	12,716	24.66	313,576.56	
BT GROUP PLC	283,272	1.31	372,219.40	
VODAFONE GROUP PLC	888,482	1.31	1,165,332.99	
NATIONAL GRID PLC	116,651	8.45	985,234.34	
SEVERN TRENT PLC	7,949	22.56	179,329.44	
SSE PLC	33,965	14.13	479,755.62	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	21,451	9.12	195,633.12	
イギリス・ポンド 小計	9,644,222		52,396,932.99 (7,753,698,144)	
スイス・フラン				
CLARIANT AG-REG	7,136	19.72	140,686.24	
EMS CHEMIE HOLDING AG RE	257	854.50	219,606.50	
GIVAUDAN-REG	297	3,565.00	1,058,805.00	
LAFARGEHOLCIM LTD	17,047	49.95	851,497.65	
SIKA AG-BEARER	4,702	248.60	1,168,917.20	
ABB LTD	61,014	27.08	1,652,259.12	
GEBERIT AG-REG	1,185	555.60	658,386.00	
SCHINDLER HLDG AG	730	253.40	184,982.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,366	258.70	353,384.20	
ADECCO GROUP AG-REG	5,149	57.60	296,582.40	
SGS S.A.	191	2,705.00	516,655.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,708	210.10	358,850.80	
CIE FINANCIERE RICHEMON REG	17,291	88.52	1,530,599.32	
THE SWATCH GROUP	1,897	51.60	97,885.20	
THE SWATCH GROUP AG-B	904	267.80	242,091.20	
BARRY CALLEBAUT AG REG	99	1,974.00	195,426.00	
LINDTSPRUENGLI PTG CERT CHF10	34	8,055.00	273,870.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	3	85,200.00	255,600.00	
NESTLE SA-REG	95,007	98.21	9,330,637.47	
ALCON INC	16,317	64.48	1,052,120.16	
SONOVA HOLDING AG-REG	1,849	242.20	447,827.80	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	337	1,154.00	388,898.00	
LOMZA AG-REG	2,466	600.80	1,481,572.80	

	NOVARTIS AG-REG SHS	73,254	79.25	5,805,379.50	
	ROCHE HOLDING AG GENUSS	23,175	303.15	7,025,501.25	
	VIFOR PHARMA AG	1,479	115.50	170,824.50	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	940	98.50	92,590.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	80,329	12.59	1,010,940.46	
	JULIUS BAER GROUP LTD	7,316	54.18	396,380.88	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	629	1,096.00	689,384.00	
	UBS GROUP AG	121,331	13.91	1,687,714.21	
	BALOISE HOLDING AG REG	1,503	154.70	232,514.10	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,047	443.70	464,553.90	
	SWISS RE LTD	9,742	82.52	803,909.84	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,977	375.00	1,866,375.00	
	SWISS PRIME SITE REG	2,672	87.40	233,532.80	
	TEMENOS GROUP AG-REG	2,144	134.15	287,617.60	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	5,383	104.60	563,061.80	
	SWISSCOM	825	464.80	383,460.00	
	スイス・フラン 小計	573,732		44,470,879.90 (5,231,554,311)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED	90,123	55.30	4,983,801.90	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	45,000	127.50	5,737,500.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	64,000	21.95	1,404,800.00	
	MTR CORP	48,246	45.20	2,180,719.20	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	71,000	66.90	4,749,900.00	
	SANDS CHINA LTD	76,944	35.45	2,727,664.80	
	SJM HOLDINGS LTD	67,000	9.88	661,960.00	
	WYNN MACAU LTD	46,961	14.06	660,271.66	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	53,700	27.20	1,460,640.00	
	WH GROUP LIMITED	320,000	6.49	2,076,800.00	
	BANK EAST ASIA	42,243	18.10	764,598.30	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	121,489	24.30	2,952,182.70	
	HANG SENG BANK	24,300	150.60	3,659,580.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	39,841	567.00	22,589,847.00	
	AIA GROUP LTD	399,084	101.50	40,507,026.00	
	CK ASSET HOLDINGS LIMITED	82,633	42.60	3,520,165.80	
	ESR CAYMAN LTD	57,800	27.80	1,606,840.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	65,000	21.65	1,407,250.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	48,308	32.15	1,553,102.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT COMPANY LIMITED	48,293	37.10	1,791,670.30	
	SINO LAND	104,997	11.82	1,241,064.54	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	43,608	113.90	4,966,951.20	
	SWIRE PACIFIC A	17,500	56.00	980,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,877	23.35	977,827.95	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	52,125	45.85	2,389,931.25	
	HKT TRUST AND HKT LTD	126,000	10.58	1,333,080.00	
	PCCW LIMITED	143,000	4.56	652,080.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	20,000	42.85	857,000.00	

	CLP HOLDINGS	54,817	72.20	3,957,787.40	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS AND HK ELECTRIC	92,161	7.58	698,580.38	
	HONGKONG CHINA GAS	352,426	11.10	3,911,928.60	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	46,500	41.65	1,936,725.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	10,000	117.80	1,178,000.00	
香港・ドル 小計		2,916,976		132,077,276.18 (1,797,571,729)	
シンガポール・ドル	KEPPEL CORP LTD	48,200	5.03	242,446.00	
	SINGAPORE TECH ENGR.	47,700	3.75	178,875.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	46,000	4.35	200,100.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	190,500	0.84	160,020.00	
	WILMAR INTERL LTD SGDO.5	64,800	5.57	360,936.00	
	DBS GROUP HOLDING	60,001	25.63	1,537,825.63	
	OVERSEA-CHINESE BANKING	108,113	10.54	1,139,511.02	
	UNITED OVERSEAS BANK	37,543	23.60	886,014.80	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	26,600	9.83	261,478.00	
	CAPITALAND LIMITED	86,375	3.11	268,626.25	
	CITY DEVELOPMENTS	15,700	7.13	111,941.00	
	UOL GROUP LIMITED	16,200	7.31	118,422.00	
	VENTURE CORP LTD	8,400	20.21	169,764.00	
	SINGAPORE TELECOM	260,374	2.35	611,878.90	
シンガポール・ドル 小計		1,016,506		6,247,838.60 (498,265,128)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	34,695	6.75	234,191.25	
	A2 MILK CO LTD	23,311	11.17	260,383.87	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	18,298	32.95	602,919.10	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	13,260	15.05	199,563.00	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	62,058	4.67	289,810.86	
	MERCURY NZ LTD	23,232	6.40	148,684.80	
	MERIDIAN ENERGY LTD	44,665	5.80	259,057.00	
ニュージーランド・ドル 小計		219,519		1,994,609.88 (153,704,637)	
スウェーデン・クローナ	LUNDIN ENERGY AB	5,953	259.20	1,543,017.60	
	BOLIDEN AB	8,595	333.20	2,863,854.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	19,699	153.70	3,027,736.30	
	ALFA LAVAL AB	9,881	257.30	2,542,381.30	
	ASSA ABLOY AB-B	33,143	216.80	7,185,402.40	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	22,275	510.40	11,369,160.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	12,454	436.70	5,438,661.80	
	EPIROC AB-A	21,890	181.50	3,973,035.00	
	EPIROC AB-B	13,399	167.00	2,237,633.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	4,596	201.20	924,715.20	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	10,112	289.20	2,924,390.40	
	SANDVIK AB	37,530	226.00	8,481,780.00	
	SKANSKA AB-B	11,564	206.90	2,392,591.60	
	SKF AB-B SHARES	12,333	228.20	2,814,390.60	
VOLVO AB-B SHS	47,700	216.50	10,327,050.00		

	SECURITAS B	9,662	127.20	1,229,006.40	
	ELECTROLUX AB-SER B	6,943	208.60	1,448,309.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	14,367	103.55	1,487,702.85	
	EVOLUTION GAMING GROUP	5,366	1,078.00	5,784,548.00	
	HENNES & MAURITZ B	26,930	189.00	5,089,770.00	
	ICA GRUPPEN AB	3,139	411.20	1,290,756.80	
	SWEDISH MATCH	5,703	591.00	3,370,473.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	20,289	258.00	5,234,562.00	
	NORDEA BANK ABP	107,629	75.05	8,077,556.45	
	SKAND. ENSKILDA BANKEN A	51,974	97.00	5,041,478.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	51,266	87.00	4,460,142.00	
	SWEDBANK AB	28,875	146.00	4,215,750.00	
	EQT AB	7,564	253.20	1,915,204.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	3,752	294.00	1,103,088.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,002	278.80	1,394,557.60	
	INVESTOR AB SER B NPV	15,118	634.00	9,584,812.00	
	KINNEVIK AB-B SHS	8,122	412.05	3,346,670.10	
	LUNDBERGFÖRETAGEN B	2,461	427.80	1,052,815.80	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	3,479	401.40	1,396,470.60	
	"ERICSSON (LM) TEL, SEK1 SER B"	96,789	107.35	10,390,299.15	
	HEXAGON AB B SHS	9,048	730.00	6,605,040.00	
	TELE2 AB-B SHS	15,684	107.15	1,680,540.60	
	TELIA COMPANY AB	82,425	34.65	2,856,026.25	
	スウェーデン・クローネ 小計	852,711		156,101,379.40 (1,991,853,601)	
ノルウェー・クローネ	EQUINOR ASA	33,023	151.85	5,014,542.55	
	NORSK HYDRO	43,394	43.98	1,908,468.12	
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,562	417.70	2,323,247.40	
	ADEVINTA ASA	7,366	130.00	957,580.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,292	303.00	997,476.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	2,663	359.30	956,815.90	
	MOWI ASA	14,700	200.00	2,940,000.00	
	ORKLA ASA	23,588	79.16	1,867,226.08	
	DNB ASA	31,653	168.40	5,330,365.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6,150	202.80	1,247,220.00	
	TELENOR ASA	23,651	139.85	3,307,592.35	
	ノルウェー・クローネ 小計	195,042		26,850,533.60 (335,363,164)	
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,531	548.20	1,935,694.20	
	NOVOZYMES A/S B SHARES	6,794	389.90	2,648,980.60	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	285	2,300.00	655,500.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	6,527	1,274.50	8,318,661.50	
	A P MOLLER MAERSK A/S	206	12,830.00	2,642,980.00	
	A.P. MOLLER-MAERSK A DKK1000	108	11,900.00	1,285,200.00	
	DSV PANALPINA A S	6,867	1,135.00	7,794,045.00	
	PANDORA A/S	3,247	639.60	2,076,781.20	
	CARLSBERG B	3,413	1,005.50	3,431,771.50	
	AMBU A/S-B	5,261	299.90	1,577,773.90	

	COLOPLAST B	3,802	973.80	3,702,387.60	
	DEMANT A/S	3,906	258.60	1,010,091.60	
	GN STORE NORD A/S	4,155	548.80	2,280,264.00	
	GENMAB A/S	2,086	2,460.00	5,131,560.00	
	H. LUNDBECK A/S	2,404	252.60	607,250.40	
	NOVO NORDISK A/S-B	56,857	455.25	25,884,149.25	
	DANSKE BANK A/S	22,094	113.15	2,499,936.10	
	TRYG A/S	4,095	199.00	814,905.00	
	ORSTED A/S	6,276	1,019.00	6,395,244.00	
デンマーク・クローネ 小計		141,914		80,693,175.85 (1,387,922,624)	
イスラエル・シェケル	ICL GROUP LIMITED	22,497	19.39	436,216.83	
	ELBIT SYSTEMS LTD	786	455.90	358,337.40	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	25,793	36.70	946,603.10	
	BANK HAPOLIM BM	38,617	24.03	927,966.51	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	46,155	20.73	956,793.15	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	40,239	12.80	515,059.20	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,799	80.88	388,143.12	
	AZRIELI GROUP	1,403	208.00	291,824.00	
	NICE LTD	2,099	814.00	1,708,586.00	
イスラエル・シェケル 小計		182,388		6,529,529.31 (210,446,729)	
ユーロ	ENI SPA	81,597	9.20	750,529.20	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	16,564	9.49	157,258.61	
	NESTE OYJ	14,051	56.12	788,542.12	
	OMV AG	4,950	38.96	192,852.00	
	REPSOL SA	48,789	9.94	484,962.66	
	TENARIS SA	14,277	7.24	103,308.37	
	TOTAL SE	83,227	36.95	3,075,237.65	
	VOPAK	2,526	40.85	103,187.10	
	AIR LIQUIDE	15,650	132.15	2,068,147.50	
	AKZO NOBEL	6,385	86.24	550,642.40	
	ARKEMA	2,227	90.50	201,543.50	
	BASF SE	30,371	68.00	2,065,228.00	
	COVESTRO	5,886	58.66	345,272.76	
	CRH	26,014	36.16	940,666.24	
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,767	28.06	189,882.02	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	2,442	47.00	114,774.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	4,703	65.60	308,516.80	
	KONINKLIJKE DSM N.V	5,740	142.40	817,376.00	
	LANXESS AG	2,652	62.76	166,439.52	
	LINDE PLC	4,241	206.00	873,646.00	
	NLG) ARCELORMITTAL	22,598	19.77	446,807.65	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	7,686	41.60	319,737.60	
	SOLVAY	2,509	96.42	241,917.78	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	18,288	16.37	299,374.56	
SYMRISE AG	4,107	101.05	415,012.35		
UMICORE	6,243	48.02	299,788.86		

UPM-KYMMENE	17,018	31.97	544,065.46
VOESTALPINE AG	3,551	32.19	114,306.69
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,557	25.22	215,807.54
ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	8,557	0.40	3,391.99
AIRBUS SE	19,449	91.77	1,784,834.73
ALSTOM	8,375	41.00	343,375.00
BOUYGUES SA	7,635	33.39	254,932.65
BRENNTAG SE	5,248	66.08	346,787.84
CIE DE SAINT-GOBAIN	16,974	43.25	734,125.50
CNH INDUSTRIAL NV	34,574	12.27	424,050.11
DASSAULT AVIATION	90	899.00	80,910.00
EIFFAGE EUR4 (POST SUBDIV ISIO	2,587	82.40	213,168.80
FERROVIAL SA	16,095	20.26	326,084.70
GEA GROUP AG NPV	5,542	29.97	166,093.74
HOCHTIEF	729	74.95	54,638.55
KINGSPAN GROUP PLC	5,133	62.70	321,839.10
KION GROUP AG	2,608	74.38	193,983.04
KNORR-BREMSE AG	2,449	107.24	262,630.76
KONE OYJ	11,291	69.14	780,659.74
LEGRAND PROMESSES EUR4	8,549	74.64	638,097.36
MTU AERO ENGINES AG	1,680	191.55	321,804.00
PRYSMIAN SPA EURO.10	7,952	26.74	212,636.48
RATIONAL AG	177	813.00	143,901.00
SAFRAN SA	10,611	112.05	1,188,962.55
SCHNEIDER ELECTRIC SE	17,818	128.60	2,291,394.80
SIEMENS AG	25,266	132.48	3,347,239.68
SIEMENS ENERGY AG	12,340	32.32	398,828.80
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	8,477	33.23	281,690.71
THALES SA	3,552	76.74	272,580.48
VINCI SA	17,226	85.02	1,464,554.52
WARTSILA OYJ	13,590	8.69	118,069.92
BUREAU VERITAS	9,218	22.10	203,717.80
RANDSTAD NV	3,926	54.90	215,537.40
RELX PLC	14,697	20.33	298,790.01
TELEPERFORMANCE	1,874	286.10	536,151.40
WOLTERS KLUWER CVA	8,746	69.50	607,847.00
ADP	1,095	95.70	104,791.50
AENA SME SA	2,135	130.80	279,258.00
ATLANTIA SPA	16,144	15.06	243,047.92
DEUTSCHE POST AG-REG	32,754	42.41	1,389,097.14
GETLINK SE	15,401	13.44	206,989.44
LUFTHANSA	9,306	11.04	102,738.24
BAYER MOTOREN WERKEUR1	10,943	71.58	783,299.94
BAYER MOTOREN WERKNON-VTG PRF EUR1	1,799	56.75	102,093.25
CONTINENTAL	3,491	120.35	420,141.85
DAIMLER AG	28,316	67.22	1,903,401.52
FAURECIA	2,768	46.65	129,127.20

FERRARI NV	4,189	163.75	685,948.75	
MICHELIN B	5,426	119.05	645,965.30	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE (PREF)	4,993	64.94	324,245.42	
RENAULT SA	5,976	38.04	227,297.16	
STELLANTIS NV	33,366	13.38	446,437.08	
STELLANTIS NV	36,689	13.38	490,898.82	
VALEO SA	7,345	32.18	236,362.10	
VOLKSWAGEN STAMM	1,150	189.10	217,465.00	
VOLKSWAGEN VORZUG	6,159	170.54	1,050,355.86	
ADIDAS AG	6,298	295.60	1,861,688.80	
ESSILORLUXOTTICA	9,425	136.45	1,286,041.25	
HERMES INTERNATIONAL	1,051	963.60	1,012,743.60	
KERING	2,507	528.00	1,323,696.00	
LVMH	9,161	541.80	4,963,429.80	
MONCLER SPA	5,995	53.32	319,653.40	
PUMA SE	3,307	89.04	294,455.28	
SEB	731	164.80	120,468.80	
ACCOR SA	6,256	31.46	196,813.76	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	2,671	37.60	100,429.60	
PADDY POWER BETFAIR PLC	3,408	158.10	538,804.80	
SODEXO	3,014	75.24	226,773.36	
BOLLORE	30,462	4.08	124,406.80	
PUBLICIS GROUPE	7,480	47.71	356,870.80	
SCOUT24 AG	3,509	67.50	236,857.50	
SES	13,477	6.88	92,694.80	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,988	73.32	219,080.16	
VIVENDI SA	27,596	29.34	809,666.64	
DELIVERY HERO SE	4,329	121.70	526,839.30	
HELLOFRESH SE	4,995	72.60	362,637.00	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	36,170	25.90	936,803.00	
JUST EAT TAKEAWAY	4,237	86.68	367,263.16	
PROSUS NV	16,129	108.20	1,745,157.80	
ZALANDO SE	5,119	97.36	498,385.84	
CARREFOUR	19,162	15.05	288,388.10	
COLRUYT NV	1,986	50.16	99,617.76	
JERONIMO MARTINS	8,284	13.00	107,692.00	
KESKO OYJ-B SHS	9,281	21.22	196,942.82	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	35,360	22.38	791,356.80	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	25,103	53.36	1,339,496.08	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	5,200	43.20	224,640.00	
DANONE	20,484	56.82	1,163,900.88	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,069	9.68	184,664.19	
HEINEKEN HOLDING EUR1.6	3,863	75.15	290,304.45	
HEINEKEN NV	8,312	86.36	717,824.32	
JDE PEET'S BV	2,655	32.58	86,499.90	
KERRY GROUP A	5,491	103.40	567,769.40	
PERNOD RICARD	6,824	163.35	1,114,700.40	

REMY COINTREAU	802	165.90	133,051.80
BEIERSDORF	3,202	85.08	272,426.16
HENKEL AG & CO KGAA (PREF)	5,694	84.78	482,737.32
HENKEL KGAA	3,548	75.20	266,809.60
L'OREAL	8,314	316.10	2,628,055.40
UNILEVER PLC	47,103	45.23	2,130,233.17
AMPLIFON SPA	4,287	34.94	149,787.78
BIOMERIEUX	1,392	113.70	158,270.40
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,341	132.40	177,548.40
DIASORIN SPA	813	169.50	137,803.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO KGAA	6,815	59.10	402,766.50
FRESENIUS SE & CO KGaA	13,386	36.00	481,896.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	30,015	46.66	1,400,349.82
ORPEA	1,671	108.65	181,554.15
SARTORIUS AG-VORZUG	1,189	466.00	554,074.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	8,684	46.80	406,411.20
ARGENX SE	1,414	302.80	428,159.20
BAYER AG	32,502	53.91	1,752,182.82
EUROFINS SCIENTIFIC	4,463	81.11	361,993.93
GALAPAGOS NV	1,373	70.88	97,318.24
GRIFOLS SA	9,432	22.02	207,692.64
IPSEN	1,163	70.25	81,700.75
MERCK KGAA	4,128	139.00	573,792.00
ORION OYJ	3,271	35.89	117,396.19
QIAGEN N.V.	7,755	45.97	356,497.35
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,263	43.80	142,919.40
SANOFI	37,412	77.01	2,881,098.12
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	873	387.60	338,374.80
UCB SA	4,037	83.62	337,573.94
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,708	9.29	145,927.32
BANCA INTESA SPA	548,198	2.11	1,155,875.48
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT	213,796	4.51	963,150.98
BANCO ESPIRITO SANTO SA-REG	141,192		
BANCO SANTANDER SA	575,863	2.98	1,713,480.35
BNP PARIBAS	37,211	48.33	1,798,221.57
CAIXABANK	116,252	2.35	273,192.20
COMMERZBANK AG	31,163	5.33	166,036.46
CREDIT AGRICOLE SA	38,635	11.33	437,541.37
ERSTE GROUP BANK AG	9,018	26.41	238,165.38
FINECOBANK SPA	19,256	14.85	285,951.60
ING GROUP N.V.	128,508	8.95	1,150,146.60
KBC BANCASSURANCE HOLDING NV	8,214	58.86	483,476.04
MEDIOBANCA	20,774	9.08	188,627.92
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	4,445	17.08	75,920.60
SOCIETE GENERALE-A	25,847	19.81	511,925.68
UNICREDIT SPA	69,493	8.35	579,988.57
AMUNDI SA	2,166	65.60	142,089.60



DEUTSCHE BANK AG-REG	62,825	9.56	600,607.00
DEUTSCHE BOERSE AG	6,307	136.70	862,166.90
EURAZEO	1,267	62.10	78,680.70
EXOR NV	3,686	66.10	243,644.60
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	3,576	83.82	299,740.32
NATIXIS	34,559	4.06	140,274.98
SOFINA	490	286.50	140,385.00
WENDEL	971	94.05	91,322.55
AEGON NV	57,225	3.94	225,294.82
AGEAS	5,607	46.17	258,875.19
ALLIANZ	13,779	195.38	2,692,141.02
ASSICURAZIONI GENERALI	36,229	15.58	564,447.82
AXA SA	64,059	19.86	1,271,955.50
CNP ASSURANCES	6,177	14.20	87,713.40
HANNOVER RUECK SE	2,066	140.20	289,653.20
MUENCHENER RUECK AG-REG	4,642	236.00	1,095,512.00
NN GROUP NV	10,228	36.67	375,060.76
POSTE ITALIANE	16,160	9.40	151,871.68
SAMPO INSURANCE CO A	15,697	36.64	575,138.08
SCOR SE	5,621	27.76	156,038.96
AROUNDTOWN SA	32,616	5.84	190,412.20
BGP HOLDINGS PLC	1,671,480		
DEUTSCHE WOHNEN SE	11,268	39.86	449,142.48
LEG IMMOBILIEN AG	2,254	116.48	262,545.92
VONOVIA SE	17,295	53.82	930,816.90
ADYEN NV	598	2,211.00	1,322,178.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	14,950	55.16	824,642.00
ATOS SE	3,338	62.96	210,160.48
BECHTLE AG	933	165.20	154,131.60
CAPGEMINI SA	5,148	140.05	720,977.40
DASSAULT SYSTEMES	4,350	188.45	819,757.50
EDENRED	7,742	47.89	370,764.38
NEMETSCHEK SE	1,844	55.50	102,342.00
NEXI SPA	14,878	15.52	230,906.56
SAP SE	34,475	104.94	3,617,806.50
TEAMVIEWER AG	5,129	49.13	251,987.77
WORLDLINE SA	7,970	77.08	614,327.60
NOKIA OYJ	188,164	3.39	638,722.69
CELLNEX TELECOM SA	10,097	43.81	442,349.57
DEUTSCHE TELEKOM	110,253	14.83	1,635,051.99
ELISA CORP-A SHARES	4,492	50.52	226,935.84
ILIAD SA	483	152.50	73,657.50
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	11,662	8.71	101,576.02
KPN (KON. PTT NEDERLAND	122,031	2.84	345,957.88
ORANGE S.A.	63,980	9.76	624,700.72
PROXIMUS	4,987	17.71	88,294.83
TELECOM ITALIA SPA	298,493	0.38	112,710.95
TELECOM ITALIA-RNC	206,844	0.42	87,143.37

TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	27,651	2.40	66,307.09	
TELEFONICA S.A.	170,042	3.73	634,936.82	
UNITED INTERNET	3,527	39.03	137,658.81	
E.ON SE	72,040	8.68	625,595.36	
EDP ELERGIAS DE PORTUGAL	88,432	4.76	421,113.18	
ELEC DE FRANCE EURO.5	20,792	10.20	212,078.40	
ELIA GROUP SA/NV	978	94.30	92,225.40	
ENAGAS	8,038	17.11	137,530.18	
ENDESA SA	10,330	21.71	224,264.30	
ENEL SPA	268,769	8.20	2,202,830.72	
ENGIE	60,411	12.90	778,999.84	
FORTUM OYJ	14,041	21.36	299,915.76	
IBERDROLA SA	202,194	10.51	2,125,058.94	
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,992	20.61	205,935.12	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	14,750	14.82	218,595.00	
RWE AG	21,351	32.47	693,266.97	
SNAM SPA	64,627	4.36	281,967.60	
SUEZ	11,156	17.00	189,652.00	
TERNA SPA	47,159	5.93	279,841.50	
UNIPER SE	6,674	29.86	199,285.64	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	18,122	22.38	405,570.36	
VERBUND AG	2,339	67.05	156,829.95	
ASML HOLDING NV	14,044	494.00	6,937,736.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	43,249	36.60	1,582,913.40	
STMICROELECTRONICS NV	21,041	34.62	728,439.42	
ユーロ 小計	8,079,240		145,151,826.13 (18,566,370,080)	
合計	37,792,999		167,983,926,515 (167,983,926,515)	

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

#### 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	17,000	279,820.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	4,200	698,208.00	
		AMERICAN TOWER CORP	14,692	3,325,828.04	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	49,100	409,494.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,515	803,715.15	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,850	447,364.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,206	337,046.78	
		CROWN CASTLE INTL CORP	14,266	2,365,302.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,900	1,214,405.00	
		DUKE REALTY CORP	11,700	479,583.00	
		EQUINIX INC	2,927	1,991,003.94	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5,800	360,702.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	12,343	826,610.71	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,237	590,321.93	

		EXTRA SPACE STORAGE INC	4,100	490,483.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	18,000	536,040.00	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	24,548	410,933.52	
		INVITATION HOMES INC	18,700	560,626.00	
		IRON MOUNTAIN INC	9,557	307,448.69	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	17,300	378,178.00	
		MID AMERICA APARTMENT COMM	3,637	500,342.09	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	8,000	298,400.00	
		PROLOGIS INC	24,461	2,575,743.30	
		PUBLIC STORAGE	5,230	1,227,481.00	
		REALTY INCOME CORP	11,474	700,946.66	
		REGENCY CENTERS CORP	5,300	279,840.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,600	942,372.00	
		SIMON PPTY (SIMON DEBART	10,780	1,179,655.40	
		SUN COMMUNITIES INC	3,300	503,283.00	
		UDR INC	10,100	426,422.00	
		VENTAS INC COM	12,300	644,397.00	
		VEREIT INC	6,758	247,072.48	
		VICI PROPERTIES INC	17,900	500,484.00	
		VORNADO REALTY TRUST	5,659	210,797.75	
		WELLTOWER INC	13,891	950,005.49	
		WEYERHAEUSER CO	23,860	834,861.40	
		WP CAREY INC	5,500	375,815.00	
		アメリカ・ドル 小計	419,691	29,211,033.13 (3,081,763,995)	
	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,800	137,816.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,000	90,400.00	
		カナダ・ドル 小計	7,800	228,216.00 (19,106,243)	
	オーストラ	DEXUS	38,558	329,670.90	
	リア・ドル	GOODMAN GROUP	52,603	905,823.66	
		GPT GROUP	69,421	286,708.73	
		MIRVAC GROUP	140,592	309,302.40	
		SCENTRE GROUP	165,017	450,496.41	
		STOCKLAND	81,079	358,369.18	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD-CDI	140	613.20	
		VINCINITY CENTERS	117,781	181,971.64	
		オーストラリア・ドル 小計	665,191	2,822,956.12 (234,841,719)	
	イギリス・	BRITISH LAND CO	30,603	142,916.01	
	ボンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	23,970	147,655.20	
		SEGRO PLC	37,447	366,006.97	
		イギリス・ボンド 小計	92,020	656,578.18 (97,160,439)	
	香港・ドル	LINK REIT	68,187	4,783,318.05	
		香港・ドル 小計	68,187	4,783,318.05 (65,100,958)	

シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	101,885	310,749.25	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	154,162	317,573.72	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	71,600	141,768.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	85,697	163,681.27	
	SUNTEC REAL ESTAITIE INVESTMENT TRUST	57,300	83,658.00	
シンガポール・ドル 小計		470,644	1,017,430.24 (81,140,061)	
ユーロ	COVIVIO	1,463	92,973.65	
	GECINA SA	1,560	177,528.00	
	KLEPIERRE	6,452	111,135.70	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,354	241,908.24	
ユーロ 小計		13,829	623,545.59 (79,757,716)	
投資証券 小計			3,658,871,131 (3,658,871,131)	
合計			3,658,871,131 (3,658,871,131)	

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

3. 投資証券における券面総額は、証券数です。

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の合計 額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 593銘柄	97.5%		71.8%
	投資証券 37銘柄		2.5%	
カナダ・ドル	株式 88銘柄	99.7%		3.5%
	投資証券 2銘柄		0.3%	
オーストラリア・ドル	株式 59銘柄	94.4%		2.4%
	投資証券 8銘柄		5.6%	
イギリス・ポンド	株式 86銘柄	98.8%		4.6%
	投資証券 3銘柄		1.2%	
スイス・フラン	株式 39銘柄	100.0%		3.0%
香港・ドル	株式 33銘柄	96.5%		1.1%
	投資証券 1銘柄		3.5%	
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	86.0%		0.3%
	投資証券 5銘柄		14.0%	
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	100.0%		0.1%
スウェーデン・クローナ	株式 38銘柄	100.0%		1.2%
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	100.0%		0.2%
デンマーク・クローネ	株式 19銘柄	100.0%		0.8%
イスラエル・シェケル	株式 9銘柄	100.0%		0.1%
ユーロ	株式 240銘柄	99.6%		10.9%
	投資証券 4銘柄		0.4%	

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

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### (1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2020年 2月20日現在)	(2021年 2月22日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		697,986,436	261,226,148
金銭信託		584,006	49,454
コール・ローン		238,292,886	64,184,472
国債証券		176,496,966,424	138,129,530,256
派生商品評価勘定			105,000
未収入金			391,445,888
未収利息		1,265,355,099	941,126,587
前払費用		61,335,996	32,892,599
流動資産合計		178,760,520,847	139,820,560,404
資産合計		178,760,520,847	139,820,560,404
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定			128,000
未払解約金		205,554,722	263,144,116
未払利息		657	175
その他未払費用		39	4
流動負債合計		205,555,418	263,272,295
負債合計		205,555,418	263,272,295
純資産の部			
元本等			
元本	1	73,334,845,875	56,125,021,105
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		105,220,119,554	83,432,267,004
元本等合計		178,554,965,429	139,557,288,109
純資産合計		178,554,965,429	139,557,288,109
負債純資産合計		178,760,520,847	139,820,560,404

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

#### (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

--	--

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	（2020年 2月20日現在）	（2021年 2月22日現在）
1 期首元本額	64,007,469,031円	73,334,845,875円
期中追加設定元本額	30,359,812,025円	13,977,898,071円
期中一部解約元本額	21,032,435,181円	31,187,722,841円
元本の内訳		
ファンド名		
ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン	6,291,104,333円	6,452,831,744円
ステート・ストリートDCグローバル債券インデックス・オープン	20,853,801円	26,257,605円
AMC /ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	763,843,839円	88,566,395円
外国債券インデックス・ファンド / 為替ヘッジ付き（年金1）＜適格機関投資家限定＞	5,417,830,174円	4,747,875,742円
外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,882,203,113円	1,307,563,720円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	2,943,162円	2,175,827円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	222,084,839円	183,758,012円

バランスファンドVA40A<適格機関投資家限定>	82,574円	78,138円
バランスファンドVA40B<適格機関投資家限定>	7,586,051円	5,656,170円
バランスファンドVA50A<適格機関投資家限定>	3,234,093円	4,384,806円
バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	7,581,001,007円	6,797,722,184円
外国債券インデックス・ファンドVA1<適格機関投資家限定>	98,318,990円	91,789,915円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	2,756,436円	1,478,376円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	2,916,006,429円	2,499,101,282円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	1,360,263,266円	1,220,574,038円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	37,193,740円	31,271,771円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	968,304,960円	825,024,786円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	3,940,399,378円	3,569,958,212円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	1,090,922,090円	933,979,159円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	3,081,102,256円	2,678,768,938円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	93,891,388円	81,154,270円
外国債券インデックス・ファンド(年金)<適格機関投資家限定>	148,430,810円	158,208,287円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	100,195,272円	97,480,808円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	57,189,023円	54,679,175円
外国債券インデックス・ファンドVA2<適格機関投資家限定>	5,387,130,583円	7,101,345,280円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	49,611,848円	44,247,215円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	585,825,671円	624,624,601円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	2,792,788円	2,339,798円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	2,279,440円	1,903,450円
外国債券インデックス・ファンドVA3<適格機関投資家限定>	17,394,564,903円	3,486,611,388円
外国債券インデックス・ファンドA<適格機関投資家限定>	106,385,803円	円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	1,026,672,004円	914,770,303円

世界分散ファンドV A 2 5 A < 適格機関投資家限定 >	1,699,795,288円	1,655,521,939円
外国債券インデックス・ファンドA / 為替ヘッジ付き < 適格機関投資家限定 >	795,004,028円	1,062,611,625円
4資産インデックスバランスV A 5 0 < 適格機関投資家限定 >	32,704,740円	33,554,864円
T a dリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）年金 < 適格機関投資家限定 >	97,375,498円	円
債券マルチ・ファクター戦略ファンド（年金） < 適格機関投資家限定 >	394,501,692円	292,329,694円
フレックス資産配分戦略ファンド < 適格機関投資家限定 >	143,565,053円	91,235,383円
T a dリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル） < 適格機関投資家限定 >	83,959,379円	円
ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン	63,005,172円	88,152,516円
ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	4,477,268,418円	3,832,211,540円
世界国債タームスプレッド・プレミア戦略ファンド / 為替ヘッジ付 < 適格機関投資家限定 >	4,211,046,152円	3,702,495,339円
世界バランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	円	31,267,872円
世界バランス6 0 V A < 適格機関投資家限定 >	円	148,264,459円
グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	2,260,911円	2,191,947円
グローバルバランス4 0 V A 2 < 適格機関投資家限定 >	586,796,983円	1,058,247,755円
グローバルバランス4 0 V A 3 < 適格機関投資家限定 >	87,955,166円	74,604,035円
グローバルバランス5 0 V A < 適格機関投資家限定 >	16,603,331円	16,150,742円
計	73,334,845,875円	56,125,021,105円
2 受益権の総数	73,334,845,875口	56,125,021,105口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

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



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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2020年 2月20日現在)	(2021年 2月22日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありませ	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p>

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。	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。 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
---------------------------	---	---

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(2020年 2月20日現在)	(2021年 2月22日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	8,381,760,440	1,483,758,046
合計	8,381,760,440	1,483,758,046

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

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

(2020年2月20日現在)

該当する事項はありません。

(単位：円)

区 分	種 類	(2021年 2月22日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	52,850,000		52,745,000	105,000
	ユーロ	204,528,000		204,656,000	128,000
	合 計	257,378,000		257,401,000	23,000

(注) 1 . 時価の算定方法

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

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

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

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

・為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

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

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当する事項はありません。

( 1口当たり情報に関する注記 )

	( 2020年 2月20日現在 )	( 2021年 2月22日現在 )
1口当たり純資産額 ( 1万口当たり純資産額 )	2.4348円 ( 24,348円 )	2.4865円 ( 24,865円 )

( 3 ) 附属明細表

第 1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY N/B 5.25% 29/02/15	500,000	659,375.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 22/11/30	9,300,000	9,610,968.75	
		US TREASURY N/B 1.63% 23/05/31	6,300,000	6,511,640.62	
		US TREASURY N/B 2.0% 26/11/15	5,000,000	5,351,562.50	
		US TREASURY N/B 3.75% 43/11/15	2,400,000	3,164,906.25	
		US TREASURY N/B 2.5% 46/05/15	2,000,000	2,158,671.88	
		US TREASURY N/B 4.5% 36/02/15	900,000	1,244,109.37	
		US TREASURY N/B 6.25% 30/05/15	900,000	1,298,425.77	
		US TREASURY N/B 2.0% 22/02/15	7,700,000	7,844,375.00	
		US TREASURY N/B 1.75% 22/02/28	5,650,000	5,745,785.12	
		US TREASURY N/B 2.38% 22/03/15	5,800,000	5,940,015.59	
		US TREASURY N/B 1.75% 22/03/31	5,500,000	5,600,546.87	
		US TREASURY N/B 1.88% 22/04/30	5,500,000	5,616,445.34	
		US TREASURY N/B 1.75% 22/05/15	4,600,000	4,693,796.85	
		US TREASURY N/B 1.75% 22/05/31	3,300,000	3,369,093.75	
		US TREASURY N/B 2.13% 22/06/30	4,300,000	4,417,578.12	
		US TREASURY N/B 1.75% 22/07/15	4,500,000	4,603,359.37	
		US TREASURY N/B 1.88% 22/07/31	4,500,000	4,614,609.37	
		US TREASURY N/B 1.63% 22/08/15	5,000,000	5,112,500.00	
		US TREASURY N/B 1.63% 22/08/31	6,900,000	7,058,484.37	
		US TREASURY N/B 1.75% 22/09/30	3,000,000	3,078,750.00	
		US TREASURY N/B 1.88% 22/10/31	3,500,000	3,603,906.25	
		US TREASURY N/B 1.63% 22/11/15	10,000,000	10,260,546.90	
		US TREASURY N/B 2.13% 22/12/31	4,500,000	4,667,343.75	
US TREASURY N/B 1.75% 23/01/31	4,900,000	5,055,421.87			
US TREASURY N/B 2.0% 23/02/15	6,000,000	6,222,890.64			

US TREASURY N/B 2.63% 23/02/28	5,500,000	5,776,718.75	
US TREASURY N/B 1.5% 23/03/31	4,000,000	4,115,312.48	
US TREASURY N/B 1.75% 23/05/15	5,800,000	6,007,984.40	
US TREASURY N/B 1.38% 23/06/30	2,500,000	2,572,070.30	
US TREASURY N/B 2.75% 23/07/31	4,000,000	4,253,125.00	
US TREASURY N/B 6.25% 23/08/15	1,200,000	1,381,968.74	
US TREASURY N/B 2.5% 23/08/15	5,300,000	5,607,855.48	
US TREASURY N/B 2.75% 23/08/31	3,640,000	3,876,884.35	
US TREASURY N/B 1.38% 23/09/30	5,000,000	5,157,812.50	
US TREASURY N/B 2.88% 23/09/30	5,200,000	5,566,437.49	
US TREASURY N/B 1.63% 23/10/31	5,000,000	5,195,312.50	
US TREASURY N/B 2.75% 23/11/15	4,300,000	4,601,335.91	
US TREASURY N/B 2.13% 23/11/30	4,000,000	4,215,312.48	
US TREASURY N/B 2.25% 23/12/31	2,500,000	2,646,484.37	
US TREASURY N/B 2.25% 24/01/31	3,000,000	3,180,234.36	
US TREASURY N/B 2.75% 24/02/15	5,000,000	5,378,125.00	
US TREASURY N/B 2.13% 24/02/29	4,000,000	4,229,687.52	
US TREASURY N/B 2.13% 24/03/31	4,300,000	4,551,953.12	
US TREASURY N/B 2.0% 24/04/30	3,500,000	3,694,960.92	
US TREASURY N/B 2.5% 24/05/15	2,500,000	2,681,640.62	
US TREASURY N/B 2.0% 24/05/31	5,000,000	5,283,203.10	
US TREASURY N/B 2.0% 24/06/30	3,000,000	3,173,437.50	
US TREASURY N/B 2.13% 24/07/31	5,500,000	5,846,113.29	
US TREASURY N/B 2.38% 24/08/15	6,500,000	6,969,726.53	
US TREASURY N/B 1.88% 24/08/31	4,500,000	4,747,148.46	
US TREASURY N/B 2.13% 24/09/30	5,200,000	5,536,578.11	
US TREASURY N/B 2.25% 24/11/15	6,200,000	6,637,875.00	
US TREASURY N/B 2.25% 24/12/31	4,500,000	4,823,964.85	
US TREASURY N/B 2.5% 25/01/31	4,500,000	4,873,886.73	
US TREASURY N/B 2.0% 25/02/15	8,000,000	8,510,624.96	
US TREASURY N/B 2.75% 25/02/28	5,100,000	5,578,722.66	
US TREASURY N/B 2.63% 25/03/31	6,300,000	6,866,015.62	
US TREASURY N/B 2.13% 25/05/15	6,100,000	6,531,289.03	
US TREASURY N/B 2.75% 25/06/30	4,900,000	5,382,535.14	
US TREASURY N/B 2.88% 25/07/31	4,600,000	5,083,898.42	
US TREASURY N/B 2.0% 25/08/15	4,500,000	4,803,046.87	
US TREASURY N/B 0.25% 25/08/31	5,000,000	4,942,968.75	
US TREASURY N/B 3.0% 25/09/30	4,300,000	4,785,933.58	
US TREASURY N/B 2.25% 25/11/15	5,900,000	6,372,460.90	
US TREASURY N/B 2.88% 25/11/30	4,800,000	5,325,000.00	
US TREASURY N/B 2.63% 25/12/31	2,500,000	2,746,582.02	
US TREASURY N/B 2.63% 26/01/31	2,600,000	2,858,578.11	
US TREASURY N/B 1.63% 26/02/15	3,000,000	3,152,226.57	
US TREASURY N/B 2.5% 26/02/28	3,800,000	4,156,843.75	
US TREASURY N/B 2.25% 26/03/31	3,500,000	3,786,835.92	
US TREASURY N/B 1.63% 26/05/15	4,500,000	4,726,582.02	
US TREASURY N/B 1.5% 26/08/15	8,000,000	8,345,937.52	
US TREASURY N/B 1.5% 27/01/31	2,000,000	2,082,812.50	

US TREASURY N/B 2.25% 27/02/15	6,200,000	6,731,843.75	
US TREASURY N/B 2.38% 27/05/15	5,500,000	6,016,699.20	
US TREASURY N/B 0.5% 27/06/30	5,500,000	5,374,316.42	
US TREASURY N/B 0.38% 27/07/31	4,200,000	4,065,468.75	
US TREASURY N/B 2.25% 27/08/15	3,900,000	4,236,984.37	
US TREASURY N/B 0.38% 27/09/30	6,000,000	5,790,234.36	
US TREASURY N/B 0.5% 27/10/31	1,900,000	1,846,265.62	
US TREASURY N/B 2.25% 27/11/15	3,400,000	3,695,242.19	
US TREASURY N/B 0.63% 27/11/30	2,000,000	1,957,500.00	
US TREASURY N/B 0.63% 27/12/31	1,800,000	1,759,500.00	
US TREASURY N/B 2.75% 28/02/15	5,000,000	5,605,273.45	
US TREASURY N/B 2.88% 28/05/15	4,300,000	4,862,527.33	
US TREASURY N/B 5.5% 28/08/15	1,100,000	1,455,265.62	
US TREASURY N/B 2.88% 28/08/15	3,500,000	3,963,203.12	
US TREASURY N/B 3.13% 28/11/15	3,900,000	4,493,226.58	
US TREASURY N/B 2.63% 29/02/15	5,000,000	5,578,906.25	
US TREASURY N/B 2.38% 29/05/15	2,500,000	2,741,601.55	
US TREASURY N/B 1.63% 29/08/15	2,500,000	2,590,917.97	
US TREASURY N/B 1.75% 29/11/15	3,000,000	3,137,929.68	
US TREASURY N/B 1.5% 30/02/15	2,440,000	2,494,328.11	
US TREASURY N/B 0.63% 30/05/15	5,400,000	5,092,031.25	
US TREASURY N/B 0.63% 30/08/15	8,000,000	7,513,750.00	
US TREASURY N/B 0.88% 30/11/15	7,100,000	6,808,234.37	
US TREASURY N/B 4.5% 38/05/15	500,000	704,589.84	
US TREASURY N/B 3.5% 39/02/15	1,900,000	2,395,929.67	
US TREASURY N/B 4.25% 39/05/15	1,200,000	1,655,625.00	
US TREASURY N/B 4.38% 39/11/15	1,150,000	1,613,998.04	
US TREASURY N/B 4.38% 40/05/15	1,000,000	1,408,515.62	
US TREASURY N/B 1.13% 40/05/15	3,200,000	2,770,000.00	
US TREASURY N/B 3.88% 40/08/15	900,000	1,194,257.80	
US TREASURY N/B 1.13% 40/08/15	3,150,000	2,716,382.81	
US TREASURY N/B 4.25% 40/11/15	1,000,000	1,391,367.19	
US TREASURY N/B 1.38% 40/11/15	3,000,000	2,704,218.75	
US TREASURY N/B 4.75% 41/02/15	1,000,000	1,479,453.12	
US TREASURY N/B 3.75% 41/08/15	800,000	1,047,968.75	
US TREASURY N/B 3.13% 41/11/15	1,200,000	1,441,921.87	
US TREASURY N/B 3.13% 42/02/15	1,700,000	2,044,515.62	
US TREASURY N/B 2.75% 42/08/15	1,400,000	1,587,085.93	
US TREASURY N/B 2.75% 42/11/15	1,400,000	1,586,156.25	
US TREASURY N/B 3.13% 43/02/15	2,000,000	2,403,593.76	
US TREASURY N/B 2.88% 43/05/15	3,000,000	3,467,460.92	
US TREASURY N/B 3.63% 43/08/15	1,400,000	1,812,945.31	
US TREASURY N/B 3.63% 44/02/15	2,600,000	3,370,046.88	
US TREASURY N/B 3.13% 44/08/15	2,500,000	3,005,371.10	
US TREASURY N/B 2.5% 45/02/15	2,500,000	2,702,441.40	
US TREASURY N/B 3.0% 45/05/15	2,300,000	2,711,843.75	
US TREASURY N/B 2.88% 45/08/15	2,400,000	2,772,281.25	
US TREASURY N/B 3.0% 45/11/15	1,600,000	1,889,500.00	

	US TREASURY N/B 2.25% 46/08/15	2,300,000	2,366,394.53	
	US TREASURY N/B 2.88% 46/11/15	1,800,000	2,080,968.75	
	US TREASURY N/B 3.0% 47/02/15	2,000,000	2,367,109.38	
	US TREASURY N/B 3.0% 47/05/15	1,400,000	1,658,179.68	
	US TREASURY N/B 2.75% 47/08/15	1,500,000	1,698,574.21	
	US TREASURY N/B 2.75% 47/11/15	1,900,000	2,151,824.21	
	US TREASURY N/B 3.0% 48/02/15	2,550,000	3,024,738.29	
	US TREASURY N/B 3.13% 48/05/15	2,600,000	3,153,921.88	
	US TREASURY N/B 3.0% 48/08/15	2,700,000	3,206,671.87	
	US TREASURY N/B 3.38% 48/11/15	3,000,000	3,809,648.43	
	US TREASURY N/B 3.0% 49/02/15	2,800,000	3,332,109.36	
	US TREASURY N/B 2.88% 49/05/15	3,350,000	3,898,169.91	
	US TREASURY N/B 2.25% 49/08/15	3,000,000	3,079,687.50	
	US TREASURY N/B 2.38% 49/11/15	2,900,000	3,057,800.77	
	US TREASURY N/B 2.0% 50/02/15	2,840,000	2,758,350.00	
	US TREASURY N/B 1.25% 50/05/15	3,600,000	2,893,921.87	
	US TREASURY N/B 1.38% 50/08/15	4,500,000	3,738,515.62	
	US TREASURY N/B 1.63% 50/11/15	5,000,000	4,428,906.24	
	US TREASURY N/B 4.38% 38/02/15	400,000	555,390.62	
	US TREASURY N/B 5.0% 37/05/15	500,000	734,902.34	
	US TREASURY N/B 6.0% 26/02/15	2,000,000	2,530,468.76	
	US TREASURY N/B 5.38% 31/02/15	500,000	692,402.34	
	US TREASURY N/B 6.13% 27/11/15	300,000	402,644.53	
	アメリカ・ドル 小計	529,370,000	563,437,175.16 (59,442,621,979)	
カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 29/06/01	900,000	1,237,140.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.0% 27/06/01	750,000	759,045.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 22/06/01	6,700,000	6,917,817.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/06/01	3,850,000	3,957,684.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 24/03/01	1,100,000	1,162,689.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.5% 24/06/01	2,600,000	2,777,398.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 25/06/01	3,300,000	3,530,406.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 26/06/01	1,550,000	1,610,326.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 28/06/01	700,000	754,579.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 30/06/01	3,000,000	3,035,040.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 45/12/01	950,000	1,286,879.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 48/12/01	1,050,000	1,277,157.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 51/12/01	1,200,000	1,262,340.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 64/12/01	400,000	517,092.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/06/01	500,000	747,940.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 41/06/01	660,000	927,946.80	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 37/06/01	650,000	977,060.50	
	カナダ・ドル 小計	29,860,000	32,738,540.30 (2,740,870,593)	

オーストラ リア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 22/07/15	2,250,000	2,427,825.01	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 23/04/21	2,700,000	3,012,532.66	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 24/04/21	2,400,000	2,598,599.61	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 25/04/21	3,800,000	4,254,719.28	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 26/04/21	4,200,000	4,990,159.81	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 27/04/21	1,800,000	2,233,121.85	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 27/11/21	1,800,000	2,019,310.32	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 28/05/21	2,400,000	2,612,343.86	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 28/11/21	1,580,000	1,777,000.23	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 29/04/21	3,200,000	3,727,508.83	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.5% 30/05/21	4,300,000	4,748,416.85	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.0% 30/12/21	3,900,000	3,760,763.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 32/05/21	1,700,000	1,651,745.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 33/04/21	1,250,000	1,658,209.25	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 35/06/21	750,000	843,070.88	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 39/06/21	700,000	828,695.24	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 41/05/21	420,000	461,172.46	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 47/03/21	1,000,000	1,136,021.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 51/06/21	930,000	802,609.47	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 37/04/21	900,000	1,133,546.13	
オーストラリア・ドル 小計		41,980,000	46,677,372.44 (3,883,090,613)	
イギリス・ ボンド	UK GILT BOND 4.25% 49/12/07	1,400,000	2,422,280.00	
	UK GILT BOND 4.5% 42/12/07	1,600,000	2,617,616.00	
	UK GILT BOND 4.5% 34/09/07	1,100,000	1,599,978.16	
	UK GILT BOND 4.25% 39/09/07	1,000,000	1,525,939.00	
	UK GILT BOND 4.0% 60/01/22	1,000,000	1,875,240.00	
	UK GILT BOND 5.0% 25/03/07	1,500,000	1,791,785.40	
	UK GILT BOND 2.25% 23/09/07	3,100,000	3,273,427.02	
	UK GILT BOND 2.0% 25/09/07	2,100,000	2,270,872.80	
	UK GILT BOND 1.5% 26/07/22	1,800,000	1,918,207.44	
	UK GILT BOND 4.25% 40/12/07	950,000	1,471,265.00	
	UK GILT BOND 3.5% 45/01/22	1,500,000	2,206,602.00	
	UK GILT BOND 3.75% 52/07/22	1,400,000	2,317,994.00	
	UK GILT BOND 4.25% 36/03/07	1,650,000	2,395,800.00	
	UK GILT BOND 4.75% 30/12/07	1,500,000	2,077,351.20	
	UK GILT BOND 6.0% 28/12/07	500,000	708,463.00	
	UK GILT BOND 0.38% 30/10/22	600,000	581,580.96	
	UK GILT BOND 0.88% 29/10/22	1,300,000	1,328,384.20	
	UK GILT BOND 1.25% 27/07/22	1,500,000	1,581,687.00	
	UK GILT BOND 1.63% 28/10/22	1,550,000	1,681,539.20	
	UK GILT BOND 1.63% 71/10/22	790,000	954,854.04	
	UK GILT BOND 1.0% 24/04/22	1,500,000	1,543,207.20	
	UK GILT BOND 1.75% 22/09/07	2,650,000	2,722,470.61	
	UK GILT BOND 1.75% 49/01/22	1,000,000	1,120,659.20	
	UK GILT BOND 1.75% 57/07/22	1,300,000	1,507,740.00	
	UK GILT BOND 2.5% 65/07/22	900,000	1,313,964.00	
	UK GILT BOND 2.75% 24/09/07	1,200,000	1,311,931.20	

		UK GILT BOND 3.5% 68/07/22	1,000,000	1,855,630.00	
		UK GILT BOND 3.25% 44/01/22	1,450,000	2,039,932.50	
		UK GILT BOND 4.0% 22/03/07	800,000	833,505.60	
		UK GILT BOND 4.25% 46/12/07	1,600,000	2,664,784.00	
		UK GILT BOND 4.25% 32/06/07	1,700,000	2,331,337.84	
		UK GILT BOND 4.25% 27/12/07	1,100,000	1,383,415.00	
		UK GILT BOND 4.25% 55/12/07	1,250,000	2,322,875.00	
		UK GILT BOND 4.75% 38/12/07	900,000	1,435,302.00	
		UK GILT BOND 1.75% 37/09/07	1,900,000	2,087,549.00	
		イギリス・ポンド 小計	48,090,000	63,075,169.57 (9,333,863,592)	
	シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.38% 25/06/01	1,250,000	1,345,868.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.88% 30/09/01	700,000	806,536.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.38% 33/09/01	350,000	427,776.73	
		SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.38% 39/07/01	250,000	281,455.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 42/04/01	350,000	418,663.93	
		SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 46/03/01	540,000	659,607.88	
		SINGAPORE GOVERNMENT BOND 1.88% 50/03/01	360,000	378,622.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.13% 22/09/01	2,100,000	2,190,352.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.5% 27/03/01	1,000,000	1,155,212.18	
		シンガポール・ドル 小計	6,900,000	7,664,096.02 (611,211,657)	
	マレーシア・リングgit	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 27/05/31	1,000,000	1,051,821.44	
		MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.07% 50/06/15	2,300,000	2,247,809.05	
		MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.42% 22/08/15	3,000,000	3,067,492.92	
		MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.48% 23/03/15	5,300,000	5,466,550.21	
		MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.96% 25/09/15	4,400,000	4,721,237.31	
		MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.9% 26/11/30	2,000,000	2,146,784.94	
		MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 30/04/15	1,700,000	1,896,445.48	
		MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.94% 43/09/30	1,300,000	1,485,970.34	
		MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.74% 46/03/15	1,550,000	1,708,588.43	
		MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.92% 48/07/06	1,700,000	1,918,978.88	
		マレーシア・リングgit 小計	24,250,000	25,711,679.00 (671,589,055)	
	スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT BOND 1.0% 26/11/12	6,000,000	6,362,373.90	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.5% 22/06/01	8,000,000	8,391,576.00	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/11/13	9,000,000	9,443,637.00	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/05/12	4,200,000	4,400,760.00	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND 0.75% 29/11/12	2,200,000	2,302,916.00	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.5% 39/03/30	4,300,000	6,410,986.69	
		スウェーデン・クローナ 小計	33,700,000	37,312,249.59 (476,104,304)	
	ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 26/02/19	3,500,000	3,612,350.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 24/03/14	4,000,000	4,296,040.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 27/02/17	4,500,000	4,698,954.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 29/09/06	5,300,000	5,525,700.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.38% 30/08/19	1,500,000	1,511,152.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 23/05/24	5,800,000	6,001,289.00	



	ノルウェー・クローネ 小計		24,600,000	25,645,486.00 (320,312,120)	
デンマーク・クローネ	DANISH GOVERNMENT BOND 0.25% 22/11/15		1,600,000	1,621,999.32	
	DANISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/11/15		6,300,000	6,657,462.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 1.75% 25/11/15		6,500,000	7,189,564.20	
	DANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 27/11/15		4,000,000	4,228,328.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/11/15		4,000,000	4,248,240.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 4.5% 39/11/15		9,200,000	16,626,401.92	
	DANISH GOVERNMENT BOND 0.25% 52/11/15		1,350,000	1,310,634.00	
	デンマーク・クローネ 小計		32,950,000	41,882,629.44 (720,381,226)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 31/05/29		12,500,000	14,161,837.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 6.75% 23/03/09		22,000,000	23,130,360.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 23/12/07		39,000,000	42,823,170.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 24/12/05		30,000,000	35,644,500.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.5% 27/06/03		19,600,000	21,977,040.37	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 29/05/31		19,000,000	22,559,463.80	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 34/11/23		6,500,000	7,352,160.85	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 36/11/20		9,000,000	12,060,998.55	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 38/11/18		10,700,000	12,638,020.91	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 42/11/13		8,500,000	9,280,512.67	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 47/11/07		10,800,000	12,036,060.00	
	メキシコ・ペソ 小計		187,600,000	213,664,124.15 (1,100,370,239)	
イスラエル・シェケル	ISRAEL FIXED BOND 5.5% 2022/1/31		1,500,000	1,582,725.00	
	ISRAEL FIXED BOND 1.25% 2022/11/30		2,980,000	3,049,285.00	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5% 2023/11/30		3,250,000	3,381,300.00	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75% 2025/8/31		1,600,000	1,712,560.00	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0% 2027/3/31		2,800,000	3,087,000.00	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25% 2028/9/28		1,200,000	1,338,300.00	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0% 2030/3/31		1,300,000	1,308,710.00	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5% 2042/1/31		1,350,000	2,217,307.50	
	イスラエル・シェケル 小計		17,540,000	19,799,957.50 (638,152,630)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 4.0% 23/10/25		3,500,000	3,855,845.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25% 25/07/25		3,400,000	3,802,934.56	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5% 26/07/25		2,300,000	2,518,376.95	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 29/04/25		7,400,000	10,116,910.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 1.25% 30/10/25		1,600,000	1,588,022.46	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 22/09/23		9,300,000	10,144,626.00	
	ポーランド・ズロチ 小計		27,500,000	32,026,714.97 (913,722,178)	

ユーロ				
	ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/01	1,900,000	2,325,657.00	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 22/09/28	1,000,000	1,079,082.00	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.25% 23/06/22	1,600,000	1,709,044.00	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.6% 24/06/22	1,700,000	1,883,370.50	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 25/06/22	1,700,000	1,799,964.08	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/28	1,000,000	1,257,520.00	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.0% 26/06/22	1,100,000	1,187,166.20	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 27/06/22	900,000	967,954.50	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 28/06/22	550,000	594,767.80	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.9% 29/06/22	900,000	983,719.80	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.1% 30/06/22	300,000	306,200.16	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.0% 31/06/22	900,000	997,650.00	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 32/03/28	700,000	1,012,279.10	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.25% 33/04/22	500,000	571,518.00	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.0% 34/06/22	600,000	826,529.28	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.45% 37/06/22	400,000	471,975.20	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.9% 38/06/22	600,000	755,862.00	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.4% 40/06/22	160,000	158,383.20	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 41/03/28	1,200,000	2,069,258.40	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.75% 45/06/22	620,000	1,061,601.20	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.6% 47/06/22	750,000	917,997.75	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.7% 50/06/22	500,000	629,886.50	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.25% 57/06/22	410,000	595,078.92	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.15% 66/06/22	430,000	629,379.82	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 22/03/28	370,000	388,946.22	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.5% 28/03/28	1,500,000	2,129,808.85	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.0% 35/03/28	1,200,000	2,010,556.80	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 0.4% 22/04/30	1,800,000	1,819,953.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 0.45% 22/10/31	1,500,000	1,524,369.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.4% 23/01/31	1,500,000	1,671,990.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.4% 23/10/31	2,500,000	2,829,940.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.8% 24/01/31	1,800,000	2,079,972.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 3.8% 24/04/30	2,200,000	2,498,172.02	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 2.75% 24/10/31	2,400,000	2,677,160.28	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.6% 25/04/30	1,650,000	1,783,135.20	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.65% 25/07/30	1,800,000	2,197,702.80	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.3% 26/10/31	2,000,000	2,168,027.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.5% 27/04/30	1,900,000	2,090,304.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 27/10/31	2,000,000	2,198,900.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.4% 28/04/30	1,400,000	1,539,521.23	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.4% 28/07/30	1,200,000	1,322,130.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 29/04/30	1,400,000	1,551,977.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 0.6% 29/10/31	1,400,000	1,452,385.90	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 30/04/30	1,500,000	1,537,283.92	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.95% 30/07/30	2,800,000	3,245,670.40	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 2.35% 33/07/30	1,400,000	1,711,259.20	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.85% 35/07/30	1,300,000	1,515,416.50	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.7% 41/07/30	1,550,000	2,645,366.40	

SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15% 44/10/31	900,000	1,682,955.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.7% 48/10/31	900,000	1,233,489.60	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.0% 50/10/31	950,000	903,501.30	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/02/01	1,900,000	2,717,503.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 34/08/01	2,100,000	3,195,187.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 7.25% 26/11/01	800,000	1,124,160.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 25/02/15	3,000,000	3,143,202.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.0% 25/08/15	3,200,000	3,441,440.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 27/02/15	2,000,000	2,102,140.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 27/08/15	2,500,000	2,675,125.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 42/07/04	1,250,000	2,114,253.75	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 46/08/15	1,900,000	3,041,553.11	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.75% 22/07/04	3,350,000	3,461,236.75	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 22/09/04	4,350,000	4,497,138.75	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/02/15	1,600,000	1,670,624.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/05/15	3,100,000	3,253,869.02	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.0% 23/08/15	3,100,000	3,310,373.75	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 24/05/15	2,600,000	2,787,119.40	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.0% 24/08/15	3,200,000	3,392,022.40	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 26/02/15	2,000,000	2,115,116.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 28/08/15	2,200,000	2,324,806.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 29/02/15	1,500,000	1,586,500.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 29/08/15	1,200,000	1,243,669.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 30/02/15	1,600,000	1,656,563.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 30/08/15	1,500,000	1,557,184.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 35/05/15	1,350,000	1,370,505.15	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 44/07/04	1,800,000	2,819,223.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.25% 48/08/15	1,850,000	2,388,529.45	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 50/08/15	1,000,000	942,900.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 9.0% 23/11/01	1,700,000	2,125,517.32	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 39/08/01	1,700,000	2,784,584.85	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.25% 29/11/01	2,000,000	2,817,206.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/02/01	1,200,000	1,882,374.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 6.0% 31/05/01	2,700,000	4,132,309.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 22/03/01	1,700,000	1,793,680.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.9% 22/08/01	2,800,000	2,851,102.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 22/09/01	2,800,000	3,049,279.66	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 22/11/01	3,500,000	3,844,774.71	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.95% 23/03/15	2,500,000	2,566,121.25	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 23/08/01	2,500,000	2,811,125.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.65% 23/10/15	2,100,000	2,151,765.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 24/03/01	2,000,000	2,285,156.70	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.85% 24/05/15	1,700,000	1,812,198.77	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 24/09/01	2,200,000	2,502,302.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.35% 25/02/01	2,300,000	2,342,106.10	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 25/03/01	2,500,000	3,013,262.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 25/06/01	2,800,000	2,987,068.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 25/12/01	1,800,000	1,972,629.00	

ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.6% 26/06/01	2,100,000	2,269,929.27	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 26/12/01	1,900,000	2,023,091.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.2% 27/06/01	1,700,000	1,912,619.45	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.05% 27/08/01	2,700,000	3,015,356.65	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 28/02/01	3,100,000	3,465,800.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/09/01	1,600,000	2,120,528.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.8% 28/12/01	1,400,000	1,659,905.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 30/03/01	2,400,000	3,035,500.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.35% 30/04/01	2,500,000	2,688,285.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.65% 30/12/01	1,250,000	1,376,872.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.65% 32/03/01	1,840,000	2,026,255.84	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.45% 33/09/01	1,000,000	1,192,684.78	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.35% 35/03/01	1,000,000	1,316,615.71	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 36/09/01	1,400,000	1,649,993.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.95% 38/09/01	1,200,000	1,547,220.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 40/09/01	2,000,000	3,305,620.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.8% 41/03/01	520,000	567,818.58	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 44/09/01	1,200,000	2,015,750.04	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 46/09/01	1,100,000	1,529,099.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.7% 47/03/01	1,100,000	1,400,438.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.45% 48/03/01	1,050,000	1,515,746.56	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.85% 49/09/01	850,000	1,314,802.10	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.45% 50/09/01	900,000	1,097,962.61	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.7% 51/09/01	120,000	124,582.56	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.8% 67/03/01	1,000,000	1,297,760.98	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/07/04	1,800,000	2,514,150.45	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.63% 28/01/04	1,200,000	1,720,806.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/04	1,700,000	2,821,753.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.25% 39/07/04	1,200,000	2,154,150.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 34/07/04	1,600,000	2,681,203.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 40/07/04	1,290,000	2,490,806.82	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.5% 31/01/04	2,100,000	3,344,071.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.25% 24/01/04	1,450,000	1,742,884.05	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.25% 30/01/04	1,250,000	2,009,166.25	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.5% 27/07/04	1,000,000	1,460,431.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 26/08/15	2,000,000	2,068,396.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/04/15	520,000	544,429.60	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.0% 24/04/15	700,000	758,932.64	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.0% 24/09/15	500,000	511,137.50	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 26/04/15	430,000	452,719.05	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 27/09/15	370,000	392,478.89	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.75% 28/07/04	500,000	615,875.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 28/09/15	150,000	159,359.25	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/09/15	220,000	233,929.74	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.75% 31/04/15	380,000	414,211.78	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.13% 34/04/15	500,000	570,085.25	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.13% 36/04/15	350,000	348,758.20	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.63% 42/07/04	265,000	394,569.36	

FINNISH GOVERNMENT BOND 1.38% 47/04/15	280,000	351,910.72	
FINNISH GOVERNMENT BOND 4.0% 25/07/04	920,000	1,107,127.08	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.5% 41/04/25	2,400,000	4,301,745.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 60/04/25	1,250,000	2,599,237.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.0% 22/04/25	3,000,000	3,128,376.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.25% 22/10/25	3,600,000	3,775,021.23	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 23/03/25	2,800,000	2,837,184.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 23/05/25	2,800,000	2,951,410.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 24/03/25	2,100,000	2,138,775.55	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.25% 24/05/25	3,200,000	3,499,089.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 25/05/25	4,150,000	4,335,256.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.5% 26/04/25	3,200,000	3,868,665.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 26/05/25	2,800,000	2,943,726.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 27/05/25	2,300,000	2,501,710.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.75% 27/10/25	2,900,000	3,510,885.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/05/25	2,500,000	2,691,920.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/11/25	2,500,000	2,696,775.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/05/25	2,000,000	2,117,358.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 29/11/25	3,000,000	3,041,130.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.5% 30/05/25	3,900,000	4,857,395.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 30/11/25	1,000,000	1,006,848.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.25% 34/05/25	2,200,000	2,518,351.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.25% 36/05/25	2,350,000	2,702,469.45	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 39/06/25	1,460,000	1,822,496.10	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 40/05/25	650,000	657,501.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.0% 48/05/25	2,050,000	2,752,395.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.5% 50/05/25	1,800,000	2,192,018.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.75% 35/04/25	1,900,000	3,128,445.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.5% 29/04/25	2,600,000	3,838,364.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/10/25	2,100,000	3,511,987.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 6.0% 25/10/25	2,700,000	3,537,071.55	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 25/11/25	2,500,000	2,681,062.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.5% 31/05/25	3,300,000	3,825,099.30	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.25% 45/05/25	1,700,000	2,750,083.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 38/10/25	1,650,000	2,699,327.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 8.5% 23/04/25	1,200,000	1,440,064.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 55/04/25	1,750,000	3,473,916.25	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.25% 23/10/25	3,700,000	4,188,365.03	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 24/11/25	3,200,000	3,481,788.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.25% 26/11/25	3,600,000	3,740,500.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 66/05/25	1,200,000	1,604,702.40	
IRISH GOVERNMENT BOND 5.4% 25/03/13	1,000,000	1,241,968.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.7% 37/05/15	450,000	549,566.10	
IRISH GOVERNMENT BOND 3.9% 23/03/20	800,000	874,915.67	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.4% 35/05/15	190,000	194,869.13	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.9% 28/05/15	520,000	564,250.44	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.0% 26/05/15	900,000	967,609.08	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.1% 29/05/15	650,000	718,383.90	

IRISH GOVERNMENT BOND 1.3% 33/05/15	450,000	515,713.95	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.35% 31/03/18	650,000	741,393.90	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.5% 50/05/15	330,000	402,052.20	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.0% 45/02/18	580,000	772,812.30	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.4% 30/05/15	1,000,000	1,232,330.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 3.4% 24/03/18	600,000	673,311.12	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.15% 25/10/31	2,200,000	2,451,680.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.9% 46/10/31	1,100,000	1,546,657.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.75% 42/01/15	1,080,000	1,891,492.56	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/15	1,050,000	1,720,863.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 1.75% 23/07/15	2,000,000	2,117,324.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.0% 24/07/15	1,500,000	1,636,435.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.25% 25/07/15	1,100,000	1,141,411.48	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.5% 26/07/15	1,200,000	1,267,988.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.75% 27/07/15	1,100,000	1,186,807.38	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.75% 28/07/15	1,000,000	1,085,977.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.25% 29/07/15	900,000	943,447.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 30/07/15	750,000	767,660.25	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.5% 33/01/15	750,000	988,080.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.5% 40/01/15	600,000	645,036.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.75% 47/01/15	1,050,000	1,728,436.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 52/01/15	440,000	402,729.71	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.75% 23/01/15	520,000	564,056.27	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 5.5% 28/01/15	900,000	1,275,376.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 7.5% 23/01/15	800,000	925,425.60	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.5% 86/11/02	230,000	323,506.96	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.1% 17/09/20	270,000	486,010.80	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.85% 20/06/30	170,000	171,297.95	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.65% 22/04/20	800,000	839,800.00	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.4% 22/11/22	650,000	696,146.75	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.75% 23/10/20	1,300,000	1,382,431.70	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.65% 24/10/21	950,000	1,029,139.75	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.2% 25/10/20	950,000	1,028,338.90	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.85% 26/03/15	750,000	957,641.25	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 26/10/20	1,250,000	1,337,673.75	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 28/02/20	750,000	809,304.75	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.5% 29/02/20	800,000	849,870.40	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.0% 30/02/20	480,000	487,599.36	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.4% 34/05/23	550,000	721,530.28	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.15% 44/06/20	450,000	737,333.78	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.5% 47/02/20	480,000	609,138.72	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 51/03/20	220,000	236,578.10	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.8% 62/01/26	380,000	828,333.50	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.15% 37/03/15	950,000	1,557,058.04	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 6.25% 27/07/15	850,000	1,218,255.70	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.2% 37/01/31	1,300,000	1,989,949.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.9% 40/07/30	1,570,000	2,710,375.78	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.9% 26/07/30	2,300,000	3,064,724.88	

	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15% 28/10/31	1,400,000	1,945,566.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 3.45% 66/07/30	870,000	1,421,878.41	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 6.0% 29/01/31	1,500,000	2,201,662.11	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/07/30	1,800,000	2,875,733.21	
	ユーロ 小計	368,435,000	447,793,292.71 (57,277,240,070)	
国債証券	小計		138,129,530,256 (138,129,530,256)	
合計			138,129,530,256 (138,129,530,256)	

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計 額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 145銘柄	100.0%	43.0%
カナダ・ドル	国債証券 17銘柄	100.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券 20銘柄	100.0%	2.8%
イギリス・ポンド	国債証券 35銘柄	100.0%	6.8%
シンガポール・ドル	国債証券 9銘柄	100.0%	0.4%
マレーシア・リンギット	国債証券 10銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6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%
メキシコ・ペソ	国債証券 11銘柄	100.0%	0.8%
イスラエル・シェケル	国債証券 9銘柄	100.0%	0.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 244銘柄	100.0%	41.5%

(注) 組入債券時価比率は時価の合計額に対する通貨毎の比率であります。

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

(2021年3月31日現在)

資産総額	4,770,551,163円
負債総額	4,053,028円
純資産総額( - )	4,766,498,135円
発行済口数	3,732,012,354口
1口当たり純資産額( / )	1.2772円

## &lt;参考情報&gt;

## 親投資信託受益証券（日本株式インデックス・マザーファンド）

(2021年3月31日現在)

資産総額	103,075,058,991円
負債総額	248,908,337円
純資産総額( - )	102,826,150,654円
発行済口数	30,220,594,786口
1口当たり純資産額( / )	3.4025円

## &lt;参考情報&gt;

## 親投資信託受益証券（日本債券インデックス・マザーファンド）

(2021年3月31日現在)

資産総額	162,077,697,123円
負債総額	751,478,241円
純資産総額( - )	161,326,218,882円
発行済口数	125,737,141,137口
1口当たり純資産額( / )	1.2830円

## &lt;参考情報&gt;

## 親投資信託受益証券（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

(2021年3月31日現在)

資産総額	180,530,518,095円
負債総額	257,937,477円
純資産総額( - )	180,272,580,618円
発行済口数	48,683,018,421口
1口当たり純資産額( / )	3.7030円

## &lt;参考情報&gt;

## 親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

(2021年3月31日現在)

資産総額	139,525,929,508円
負債総額	308,831,203円
純資産総額( - )	139,217,098,305円
発行済口数	54,946,909,790口
1口当たり純資産額( / )	2.5337円



## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

### (1) 受益証券の名義書換等

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

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

### (2) 受益者等名簿の閉鎖の時期

該当事項はありません。

### (3) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

### (4) 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容

#### < 受益権の譲渡 >

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

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

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

#### < 受益権の譲渡の対抗要件 >

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

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

#### < 受益権の再分割 >

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

#### < 償還金 >

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

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

< 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて >

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額（本書提出日現在）

###### 資本金の額

委託会社の資本金の額は金3億1千万円です。

###### 発行する株式の総数

委託会社の発行する株式の総数は6,200株です。

###### 発行済株式の総数

委託会社の発行済株式総数は6,200株です。

最近5年間ににおける主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

##### (2) 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1) 運用基本方針の決定

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

###### 2) 運用実施計画の作成

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

###### 3) 運用の実行

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年3月31日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、127本であり、その純資産総額は2,231,184百万円です（親投資信託を除く、公募投資信託および私募投資信託の合計値です。）。

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。  
また、委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規制」（昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という）ならびに同規則第38条第1項及び第57条第1項の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第23期事業年度（2019年4月1日から2020年3月31日まで）の財務諸表ならびに第24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）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

## 1. 財務諸表

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2019年3月31日現在)		当事業年度 (2020年3月31日現在)	
	金 額	構成比	金 額	構成比
(資産の部)		%		%
流動資産				
預金	2,933,318		3,114,127	
有価証券	44,368		21,254	
前払金	42,741		39,342	
前払費用	15,949		9,920	
未収入金	500,748		902,862	
未収還付法人税等	2,367		-	
未収委託者報酬	617,227		660,964	
未収収益	122,922		40,244	
流動資産計	4,279,642	60.3	4,788,718	65.6
固定資産				
有形固定資産	84,968		69,492	
建物附属設備	66,820		59,016	
器具備品	18,147		10,475	
無形固定資産	0		0	
ソフトウェア	0		0	
投資その他の資産	2,732,068		2,445,819	
長期差入保証金	63,377		69,819	
繰延税金資産	2,662,416		2,369,725	
その他投資	6,275		6,275	
固定資産計	2,817,037	39.7	2,515,312	34.4
資産合計	7,096,680	100.0	7,304,030	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	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)	
	金 額	構成比	金 額	構成比
(負債の部)		%		%
流動負債				
預り金	134,522		137,851	
未払金	286,607		350,943	
未払手数料	123,825		140,557	
その他未払金	162,781		210,386	
未払費用	1,928		11,122	
未払法人税等	1,181		3,635	
未払消費税等	27,995		72,142	
賞与引当金	57,088		67,981	
流動負債計	509,323	7.2	643,675	8.8
固定負債				
退職給付引当金	67,644		96,989	
固定負債計	67,644	1.0	96,989	1.3
負債合計	576,968	8.1	740,665	10.1
(純資産の部)		%		%

株主資本		6,519,711	91.9		6,563,364	89.9
資本金	310,000			310,000		
利益剰余金						
利益準備金	77,500			77,500		
その他利益剰余金						
別途積立金	31,620			31,620		
繰越利益剰余金	6,100,591			6,144,244		
純資産合計		6,519,711	91.9		6,563,364	89.9
負債・純資産合計		7,096,680	100.0		7,304,030	100.0

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

期 別 科 目	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		
	金 額	構成比		金 額	構成比	
営業収益			%			%
委託者報酬		2,337,607		2,392,782		
投資顧問収入		2,367,856		2,907,674		
その他営業収益		17,873		66,452		
営業収益計		4,723,337	100.0	5,366,908	100.0	
営業費用						
支払手数料		502,719		520,256		
広告宣伝費		39,808		30,443		
公告費		1,140		1,140		
調査費		585,088		632,099		
調査費	353,007			369,545		
委託調査費	230,952			261,450		
図書費	1,129			1,102		
委託計算費		153,098		265,563		
営業雑経費		44,871		39,755		
通信費	4,783			4,801		
印刷費	9,076			15,648		
協会費	8,632			16,300		
諸会費	6,374			-		
その他	16,005			3,005		
営業費用計		1,326,726	28.1	1,489,258	27.7	
一般管理費						
給料		1,315,296		1,322,366		
役員報酬	211,622			197,080		
給料・手当	876,471			848,305		
賞与	192,102			253,121		
賞与引当金繰入額	35,098			23,858		
交際費		3,029		10,725		
旅費交通費		21,095		8,872		
租税公課		6,373		8,801		
不動産賃借料		104,671		97,021		
退職給付費用		79,897		106,349		
固定資産減価償却費		21,600		22,666		

福利厚生費		116,798			126,755	
事務手数料		773,947			1,057,318	
諸経費		190,123			186,258	
一般管理費計		2,632,834	55.7		2,947,135	54.9
営業利益		763,777	16.2		930,515	17.3
営業外収益						
為替差益		-			166	
有価証券運用益		1,711			3,384	
雑収入		50			63	
営業外収益計		1,762	0.0		3,614	0.1
営業外費用						
支払利息		-			-	
為替差損		46			289	
有価証券運用損		-			4,123	
雑損失		277			490	
営業外費用計		324	0.0		4,903	0.1
経常利益		765,215	16.2		929,225	17.3
特別利益						
事業再構築費用戻入		5,262			-	
特別利益計		5,262	0.1		-	0.0
特別損失						
事業再構築費用		6,296			102,351	
事務処理損失		714			-	
ゴルフ会員権売却損		2,800			-	
特別損失計		9,811	0.2		102,351	1.9
税引前当期純利益		760,665	16.1		826,874	15.4
法人税、住民税及び事業税		530	0.0		530	0.0
法人税等調整額		269,303	5.7		292,691	5.5
当期純利益		490,831	10.4		533,652	9.9

## (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：千円）

	株 主 資 本					株主資本 合計	純資産合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計		
			その他利益 剰余金				
			別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	77,500	31,620	5,609,759	5,718,879	6,028,879	6,028,879
当期変動額							
当期純利益	-	-	-	490,831	490,831	490,831	490,831
当期変動額合計	-	-	-	490,831	490,831	490,831	490,831
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,100,591	6,209,711	6,519,711	6,519,711

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本					株主資本 合計	純資産合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計		
			その他利益 剰余金				
			別途積立金	繰越利益 剰余金			

当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,100,591	6,209,711	6,519,711	6,519,711
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	(490,000)	(490,000)	(490,000)	(490,000)
当期純利益	-	-	-	533,652	533,652	533,652	533,652
当期変動額合計	-	-	-	43,652	43,652	43,652	43,652
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,144,244	6,253,364	6,563,364	6,563,364

## [ 重要な会計方針 ]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	有価証券 売買目的有価証券 決算期末日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定）を採用しております。
2. 固定資産の減価償却方法	(1) 有形固定資産 リース資産以外の有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物附属設備                      9～10年 器具備品                              3～7年
3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
4. 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当期に負担すべき金額を計上しております。  (2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、必要額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。 数理計算上の差異 発生の翌事業年度に一括損益処理しております。
5. その他 財務諸表作成のための重要な事項	消費税等の処理方法 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。

## (追加情報)

(新型コロナウイルス感染症（COVID-19）の影響に関する仮定について）

新型コロナウイルス感染症（COVID-19）の感染拡大やそれに伴う経済活動停滞による影響は今後1年程度続くものと想定し、当社が顧客から収受する投資顧問料等に一定の影響があるとの仮定を置いております。かかる仮定に基づいた今後の業績見通し及び将来収益力等を勘案し、「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」に基づき、繰延税金資産の回収可能性について慎重に検討し、繰延税金資産を計上しています。



## 注記事項

## （貸借対照表関係）

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)
1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 54,843千円 器具備品 38,003千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 68,147千円 器具備品 46,953千円
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左

## （損益計算書関係）

前事業年度 自 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
移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額17,341千円は、損益計算書のその他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額773,947千円は、損益計算書の事務手数料に含まれております。	移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額65,925千円は、損益計算書のその他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額1,057,318千円は、損益計算書の事務手数料に含まれております。
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左

## （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. 発行済株式の総数に関する事項

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

## 2. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

該当ありません。

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

（決議）	株式の種類	配当金の総額	配当の原資	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2019年6月26日 定時株主総会	普通株式	490,000千円	利益剰余金	79,032.25円	2019年3月31日	2019年6月27日

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

## 1. 発行済株式の総数に関する事項

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

## 2. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

（決議）	株式の種類	配当金の総額	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2019年6月26日 定時株主総会	普通株式	490,000千円	79,032.25円	2019年3月31日	2019年6月27日

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

（決議）	株式の種類	配当金の総額	配当の原資	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2020年6月24日 定時株主総会	普通株式	533,000千円	利益剰余金	85,967.74円	2020年3月31日	2020年6月25日

## （金融商品関係）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## （1）金融商品に対する取組方針

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

## （2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。

2019年3月31日現在

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 預金	2,933,318	2,933,318	
(2) 未収入金	500,748	500,748	
(3) 未収委託者報酬	617,227	617,227	
(4) 預り金	134,522	134,522	
(5) 未払手数料	123,825	123,825	
(6) その他未払金	162,781	162,781	

## （注1）金融商品の時価の算定方法に関する事項

## （1）預金

預金は、すべて満期のない預金であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

## （2）未収入金、(3)未収委託者報酬、(4)預り金、(5)未払手数料及び(6)その他未払金

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## （注2）金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものはありません。

## （注3）社債、長期借入金、リース債務およびその他の有利子負債の決算日後の返済予定額

記載すべき事項はありません。

2020年3月31日現在

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
--	----------	----	----

(1)預金	3,114,127	3,114,127	
(2)未収入金	902,862	902,862	
(3)未収委託者報酬	660,964	660,964	
(4)預り金	137,851	137,851	
(5)未払手数料	140,557	140,557	
(6)その他未払金	210,386	210,386	

## (注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

## (1) 預金

預金は、すべて満期のない預金であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

## (2) 未収入金、(3)未収委託者報酬、(4)預り金、(5)未払手数料及び(6)その他未払金

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## (注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものはありません。

## (注3) 社債、長期借入金、リース債務およびその他の有利子負債の決算日後の返済予定額

記載すべき事項はありません。

## (有価証券関係)

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)	
売買目的の有価証券		売買目的の有価証券	
貸借対照表計上額	44,368千円	貸借対照表計上額	21,254千円
当事業年度の損益		当事業年度の損益	
に含まれた評価差額	1,704千円	に含まれた評価差額	4,123千円

## (デリバティブ取引関係)

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
該当事項はありません。	同左

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

前事業年度 自 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
2011年4月1日に確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）、確定拠出年金制度を導入いたしました。 また、2000年9月29日より退職給付信託を設定しております。	同左

## 2. 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日

退職給付債務の期首残高	473,087
勤務費用	51,555
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	52,891
退職給付の支払額	<u>75,129</u>
退職給付債務の期末残高	502,405

(単位：千円)

	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	502,405
勤務費用	57,391
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	53,802
退職給付の支払額	<u>85,470</u>
退職給付債務の期末残高	420,524

## 3. 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
年金資産の期首残高	380,344
期待運用収益	2,814
数理計算上の差異の発生額	32,480
事業主からの拠出額	56,396
退職給付の支払額	<u>75,129</u>
年金資産の期末残高	396,905

(単位：千円)

	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
年金資産の期首残高	396,905
期待運用収益	2,938
数理計算上の差異の発生額	28,742
事業主からの拠出額	54,241
退職給付の支払額	<u>85,470</u>
年金資産の期末残高	339,872

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

(単位：千円)

	前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
--	---------------------------------------

積立型制度の退職給付債務	502,405
年金資産	396,905
	<hr/>
	105,499
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	105,499
未認識数理計算上の差異	20,411
未認識過去勤務費用	17,443
	<hr/>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	67,644

(単位：千円)

	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
積立型制度の退職給付債務	420,524
年金資産	339,872
	<hr/>
	80,651
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	80,651
未認識数理計算上の差異	25,059
未認識過去勤務費用	8,721
	<hr/>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	96,989

## 5. 退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	58,810
(1)勤務費用	51,555
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益（減算）	2,814
(4)過去勤務費用の費用処理額	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	1,347

(単位：千円)

	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	86,784
(1)勤務費用	57,391
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益（減算）	2,938
(4)過去勤務費用の費用処理額	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	20,411

(6)その他

## 6. 年金資産に関する事項

前事業年度（2019年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 98.1%

その他 1.9%

合計 100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

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

当事業年度（2020年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 97.7%

その他 2.3%

合計 100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

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

## 7. 退職給付債務等の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (2019年3月31日現在)
(1)割引率	0.0%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年

	当事業年度 (2020年3月31日現在)
(1)割引率	0.0%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年

## 8. 確定拠出制度

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,720千円であります。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は19,564千円であります。

(税効果会計関係)

前事業年度	当事業年度
自 2018年4月 1日	自 2019年4月 1日
至 2019年3月31日	至 2020年3月31日

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 (単位：千円)		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 (単位：千円)	
繰延税金資産		繰延税金資産	
連結納税適用に伴う影響額	1,225,179	連結納税適用に伴う影響額	612,589
賞与引当金繰入超過額	14,373	賞与引当金繰入超過額	17,497
退職給付引当金	21,778	退職給付引当金	31,083
繰越欠損金	1,372,856	(注) 繰越欠損金	1,652,186
その他	28,228	その他	56,367
繰延税金資産 合計	2,662,416	繰延税金資産 合計	2,369,725
繰延税金負債との相殺	-	繰延税金負債との相殺	-
繰延税金資産の純額	2,662,416	繰延税金資産の純額	2,369,725

(注) 税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

前事業年度(2019年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超 2年以内 (千円)	2年超 3年以内 (千円)	3年超 4年以内 (千円)	4年超 5年以内 (千円)	5年超 (千円)	合計 (千円)
税務上の繰越欠損金 (*1)	-	-	-	-	-	1,372,856	1,372,856
繰延税金資産	-	-	-	-	-	1,372,856	1,372,856 (*2)

(\*1) 税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額であります。

(\*2) 税務上の繰越欠損金1,372,856千円(法定実効税率を乗じた金額)について、繰延税金資産1,372,856千円を計上しております。当該税務上の繰越欠損金に係る繰延税金資産については、将来の課税所得の見込等により回収可能と判断しております。

当事業年度(2020年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超 2年以内 (千円)	2年超 3年以内 (千円)	3年超 4年以内 (千円)	4年超 5年以内 (千円)	5年超 (千円)	合計 (千円)
税務上の繰越欠損金 (*1)	-	-	-	-	-	1,652,186	1,652,186
繰延税金資産	-	-	-	-	-	1,652,186	1,652,186 (*2)

(\*1) 税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額であります。

(\*2) 税務上の繰越欠損金1,652,186千円(法定実効税率を乗じた金額)について、繰延税金資産1,652,186千円を計上しております。当該税務上の繰越欠損金に係る繰延税金資産については、将来の課税所得の見込等により回収可能と判断しております。

前事業年度(2019年3月31日現在)	当事業年度(2020年3月31日現在)
---------------------	---------------------

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間の差異の原因となった主要な項目別内訳		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間の差異の原因となった主要な項目別内訳	
法定実効税率	30.6%	法定実効税率	30.6%
交際費等永久に損金に 算入されない項目	5.3%	交際費等永久に損金に 算入されない項目	5.1%
その他	0.5%	その他	0.3%
税効果会計適用後の 法人税等の負担率	35.4%	税効果会計適用後の 法人税等の負担率	35.4%
	=====		=====

（資産除去債務関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

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

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

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

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は35,341千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、変動は有りません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

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

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

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

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は35,341千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、変動は有りません。

（セグメント情報）

1.セグメント情報



当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

## 2. セグメント関連情報

### 1. 商品及びサービスに関する情報

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

### 2. 地域に関する情報

#### 営業収益

本邦に所在している顧客への収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

なお、委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、集計対象より除外しております。

#### 有形固定資産

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

### 3. 主要な顧客に関する情報

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

また、投資顧問料については、顧客との守秘義務契約により、開示が出来ないため、記載を省略しております。

#### （報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

#### （報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

#### （報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

#### （関連当事者情報）

##### 関連当事者との取引

#### (1) 親会社及び法人主要株主等

該当事項はありません。

#### (2) 同一の親会社を持つ会社

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

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	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権の 所有(被所 有)割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の関係				

同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・オブ・ニューヨーク・トラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ ソフトウェアの使用契約 人件費等及び事務手数料の支払	ソフトウェア使用料の支払 投資顧問料の支払 人件費等の支払 事務手数料の受取 事務手数料の支払	229,260 164,709 135,677 17,341 773,947	前払金 未払金	8,051 30,899
	ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ 兼職社員の人件費支払等	投資信託計理業務委託 人件費等の支払	35,235 159,558	前払金	34,689
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インテグリティ	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ	投資顧問料の支払	16,146	-	-
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ及びETF商品の紹介	紹介料の受取 投資顧問料の支払	531 19,937	-	-

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

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権の 所有(被所 有)割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の関係				
同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ	ソフトウェア使用料の支払	309,576	前払金	694
								投資顧問料の支払	189,363		
								ソフトウェアの使用契約	129,383	未払金	
								人件費等及び事務手数料の受取	65,925		
						事務手数料の支払	1,057,318				
	ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ	投資信託計理業務委託	37,991	前払金	38,648
								兼職社員の人件費支払等	138,065		
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・リミテッド・キングダム	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ	投資顧問料の支払	13,752	-	-
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ及びETF商品の紹介	紹介料の受取	526	-	-
								投資顧問料の支払	22,050		

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

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

#### 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

ステート・ストリート・コーポレーション（ニューヨーク証券取引所に上場）  
 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インク（非上場）  
 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インターナショナル・ホールディングス（非上場）  
 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社（非上場）

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

前事業年度 自 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	1,051,566円42銭	1株当たり純資産	1,058,607円22銭
1株当たり当期純利益	79,166円44銭	1株当たり当期純利益	86,073円06銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。		なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。	

(注) 1株当たり当期純利益の算定基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 自 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（千円）	490,831	533,652
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式にかかる当期純利益（千円）	490,831	533,652
期中平均株式数（株）	6,200	6,200

## (重要な後発事象)

前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
該当事項はありません。

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

科 目	第24期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)	
	金 額	構成比
(資産の部)		%
流動資産		
預金	3,412,150	
有価証券	22,205	

前払金			50,496	
前払費用			15,233	
未収入金			681,858	
未収委託者報酬			625,087	
未収収益			356,269	
		流動資産計	5,163,300	68.8
固定資産				
有形固定資産			59,326	
建物附属設備	1	52,073		
器具備品	1	7,252		
無形固定資産			0	
ソフトウェア		0		
投資その他の資産			2,287,499	
長期差入保証金		67,230		
繰延税金資産		2,213,993		
その他投資		6,275		
固定資産計			2,346,825	31.2
		資産合計	7,510,126	100.0
		(負債の部)		%
流動負債				
預り金			30,857	
未払金			774,451	
未払手数料		147,653		
その他未払金		626,798		
未払費用			11,165	
未払法人税等			1,831	
未払消費税等	2		90,325	
賞与引当金			202,413	
流動負債計			1,111,044	14.8
固定負債				
退職給付引当金			89,098	
固定負債計			89,098	1.2
		負債合計	1,200,143	16.0
		(純資産の部)		%
株主資本			6,309,982	84.0
資本金		310,000		
利益剰余金		5,999,982		
利益準備金		77,500		
その他利益剰余金				
別途積立金		31,620		
繰越利益剰余金		5,890,862		
		純資産合計	6,309,982	84.0
		負債・純資産合計	7,510,126	100.0

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

科 目	期 別	第24期中間会計期間 自 2020年4月 1日 至 2020年9月30日	
		金 額	構成比
営業収益			%
委託者報酬		1,202,593	
投資顧問収入		1,410,901	
その他営業収益	1	38,003	
営業収益計		2,651,497	100.0

営業費用・一般管理費				
営業費用			686,141	
支払手数料	299,305			
その他営業費用	386,836			
一般管理費		2	1,525,243	
営業費用・一般管理費計			2,211,385	83.4
営業利益			440,111	16.6
営業外収益			1,052	0.0
営業外費用			838	0.0
経常利益			440,325	16.6
特別損失			4,711	0.2
税引前中間純利益			435,613	16.4
法人税,住民税及び事業税			265	0.0
法人税等調整額			155,731	5.9
中間純利益			279,617	10.5

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

（単位：千円）

	株 主 資 本					株主資本 合計	純資産合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計		
			その他利益 剰余金				
			別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,144,244	6,253,364	6,563,364	6,563,364
当中間期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	-533,000	-533,000	-533,000	-533,000
中間純利益	-	-	-	279,617	279,617	279,617	279,617
当中間期変動額合計	-	-	-	-253,382	-253,382	-253,382	-253,382
当中間期末残高	310,000	77,500	31,620	5,890,862	5,999,982	6,309,982	6,309,982

## [重要な会計方針]

	第24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	有価証券 売買目的有価証券 中間決算日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定）を採用しております。
2. 固定資産の減価償却方法	(1) 有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物附属設備 9～10年 器具備品 3～7年
3. 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、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

4. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち中間会計期間に負担すべき金額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異 発生翌事業年度に一括費用処理しております。</p>
5. 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	<p>消費税等の処理方法 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。</p>

## (追加情報)

(新型コロナウイルス感染症（COVID-19）の影響に関する仮定について)

新型コロナウイルス感染症（COVID-19）の感染拡大やそれに伴う経済活動停滞による影響は今後1年程度続くものと想定し、当社が顧客から收受する投資顧問料等に一定の影響があるとの仮定を置いております。かかる仮定に基づいた今後の業績見通し及び将来収益力等を勘案し、「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」に基づき、繰延税金資産の回収可能性について慎重に検討し、繰延税金資産を計上しております。

## 注 記 事 項

(中間貸借対照表関係)

第24期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)					
1. 有形固定資産の減価償却累計額	<table border="0"> <tr> <td>建物附属設備</td> <td>75,090千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>50,177千円</td> </tr> </table>	建物附属設備	75,090千円	器具備品	50,177千円
建物附属設備	75,090千円				
器具備品	50,177千円				
2. 消費税等の取扱い	<p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。</p>				

(中間損益計算書関係)

第24期中間会計期間	
自	2020年4月1日
至	2020年9月30日

1. 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当中間会計期間に、ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額37,877千円は、損益計算書のその他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額610,748千円は、損益計算書の事務手数料に含まれております。	
2. 減価償却実施額	
有形固定資産	10,422千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第24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 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)	
普通株式	6,200			6,200	
2. 当中間会計期間中に行った剰余金の配当に関する事項					
決議	株式の種類	配当金の総額	1株あたりの配当 額	基準日	効力発生日
2020年6月24日 定時株主総会	普通株式	533,000千円	85,967.74円	2020年3月31日	2020年6月25日

## (金融商品関係)

第24期中間会計期間 自 2020年4月 1日 至 2020年9月30日			
1. 金融商品の時価等に関する事項 2020年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。			
(単位：千円)			
	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)預金	3,412,150	3,412,150	
(2)未収入金	681,858	681,858	
(3)未収委託者報酬	625,087	625,087	
(4)未収収益	356,269	356,269	
(5)未払手数料	147,653	147,653	
(6)その他未払金	626,798	626,798	



## (注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

## (1) 預金

預金は、すべて満期のない預金であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

## (2) 未収入金、(3) 未収委託者報酬、(4) 未収収益、(5) 未払手数料及び(6) その他未払金

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券関係)

第24期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)	
売買目的の有価証券	
貸借対照表計上額	22,205千円
当中間会計期間の損益に含まれた評価差額	950千円

## (資産除去債務関係)

第24期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)	
資産除去債務の総額の期中における増減はありません。	

## (デリバティブ取引関係)

第24期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)	
当社はデリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。	

## (セグメント情報等)

第24期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)	

## （セグメント情報）

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

## （セグメント関連情報）

## 1. 商品およびサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

また、投資顧問料については、顧客との守秘義務契約により、開示が出来ないため、記載を省略しております。

## （報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

## （報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

## （報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

## 第24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 1,017,739円12銭

1株当たり中間純利益 45,099円63銭

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

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24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（千円）	279,617
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式にかかる中間純利益（千円）	279,617
期中平均株式数（株）	6,200

## (重要な後発事象)

第24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。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更

委託会社の定款変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

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

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名 称

三井住友信託銀行株式会社

資本金の額

342,037百万円（2020年3月末現在）

事業の内容

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

#### （参考）再信託受託会社

名 称：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2020年9月末現在）

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

#### (2) 販売会社

名 称	資本金の額	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円 (2020年3月末現在)	銀行法に基づく銀行業および金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づく信託業を営むとともに、金融商品取引法に基づく登録を受けて投資信託証券の募集の取扱い等を行っています。
楽天証券株式会社	7,495百万円 (2020年12月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323百万円 (2020年3月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	10,077百万円 (2020年3月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

### 2【関係業務の概要】

#### (1) 受託会社

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

#### (2) 販売会社

当ファンドの販売会社として受益権の募集の取扱い等を行います。

### 3【資本関係】

#### (1) 受託会社

該当事項はありません。

#### (2) 販売会社

該当事項はありません。

### 第3【その他】

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

## 独立監査人の監査報告書

2020年6月29日

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

### EY新日本 有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

伊藤雅人

#### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第23期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の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役の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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、監査役に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

---

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



独立監査人の監査報告書

2021年4月7日

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

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太  
業務執行社員**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているAMC/ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）の2020年2月21日から2021年2月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、AMC/ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）の2021年2月22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、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記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. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2020年12月18日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 雅人  
業務執行社員

#### 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第24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、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の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役の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

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

#### 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

(注) 上記は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。