

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)

追加型投信／内外／資産複合／インデックス型

投資信託説明書 (請求目論見書)

本書は金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
課税上は株式投資信託として取扱われます。

2023年11月21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

1. 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）の受益権の募集については、発行者であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（委託会社）は金融商品取引法（昭和23年法第25号）第5条の規定により、有価証券届出書を2023年5月19日に関東財務局長に提出しており、2023年5月20日にその効力が発生しております。
2. この投資信託説明書（請求目論見書）は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書のうち、同法第15条第3項の規定に基づき投資者がファンドを取得する時までに投資者から請求があった場合に交付を行う目論見書です。
3. 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）の受益権の価額は、同ファンドに組入れられている有価証券の値動きのほか、為替変動による影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資者の皆様に帰属します。
4. 当ファンドは元金が保証されているものではありません。

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
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	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】

2023年5月20日から2024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】

① 申込証拠金

該当事項はありません。

② 本邦以外の地域での発行

該当事項はありません。

③ 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】

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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 追加型	国内 海外 内外	株式 債券 不動産投信 その他資産 () 資産複合	インデックス型 特殊型

(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 年2回 年4回	グローバル (日本を含む) 日本 北米	ファミリー ファンド	あり ()	日経 225
債券 一般 国債 社債	年6回 (隔月)	欧州 アジア			

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

■ 当ファンドが該当する属性区分

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

※商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「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。

④ ファンドの特色

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

<株式会社トータルアセットデザインの概要>

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

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

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

投資対象とするマザーファンドのベンチマークについては「マザーファンドの概要」をご参照ください。

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

- 投資対象国の通貨と円との間の為替変動により基準価額は変動します。

※資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

投資対象とするマザーファンドの概要

日本株式インデックス・マザーファンド

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

日本債券インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、NOMURA-BPI総合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。

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。

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。

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

NOMURA-BPI総合指数

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

MSCI コクサイ指数

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

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本)

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

(2) 【ファンドの沿革】

2012年3月9日 投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

- ① 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。



② 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。）

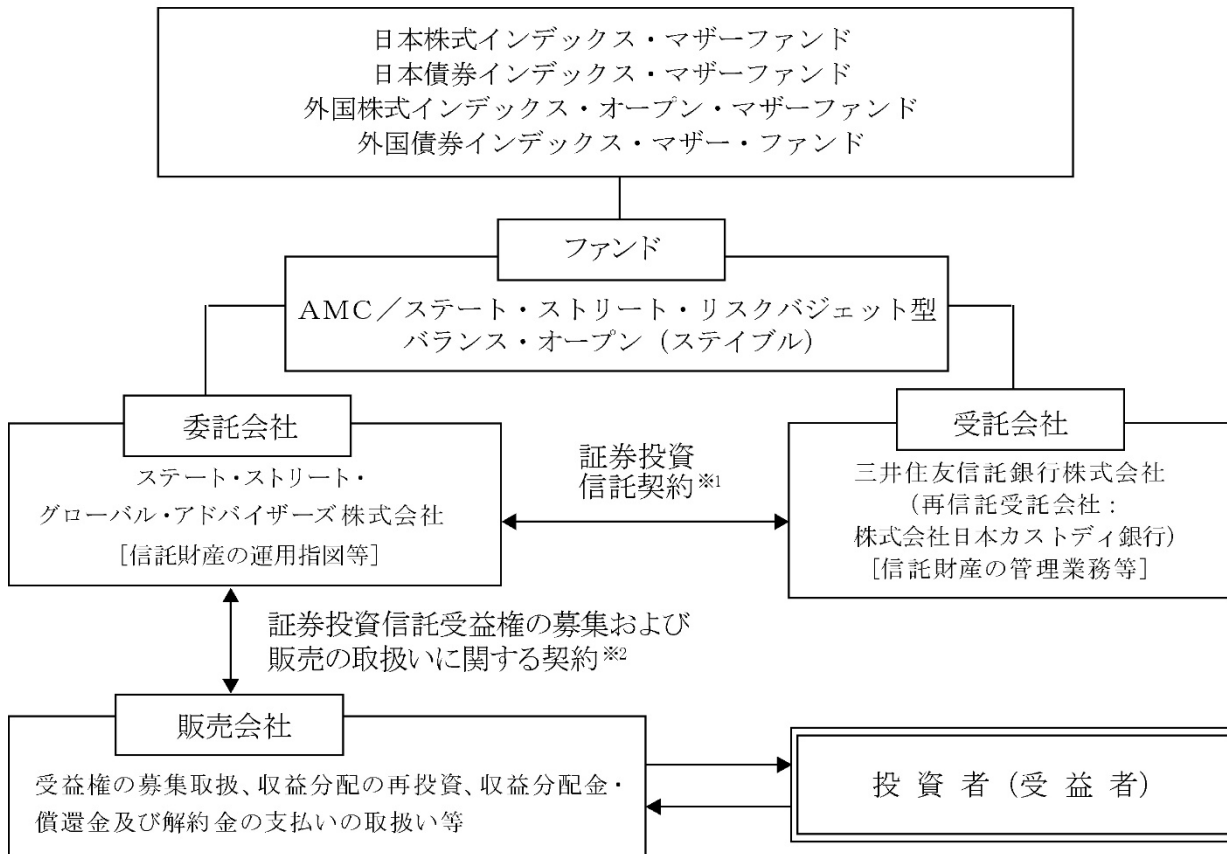
（再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行）

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。

③ 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。

- ① 「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。
- ② 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）^{※1}]

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）^{※2}]

^{※1} 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。

^{※2} 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。

- ③ 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。
- ④ 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）②の3）4）5）に定めるものに限りません。以下同じ。）を行うことができます。
- ⑤ 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。

- ⑥ 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。
- ⑦ 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】

① 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

② 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。

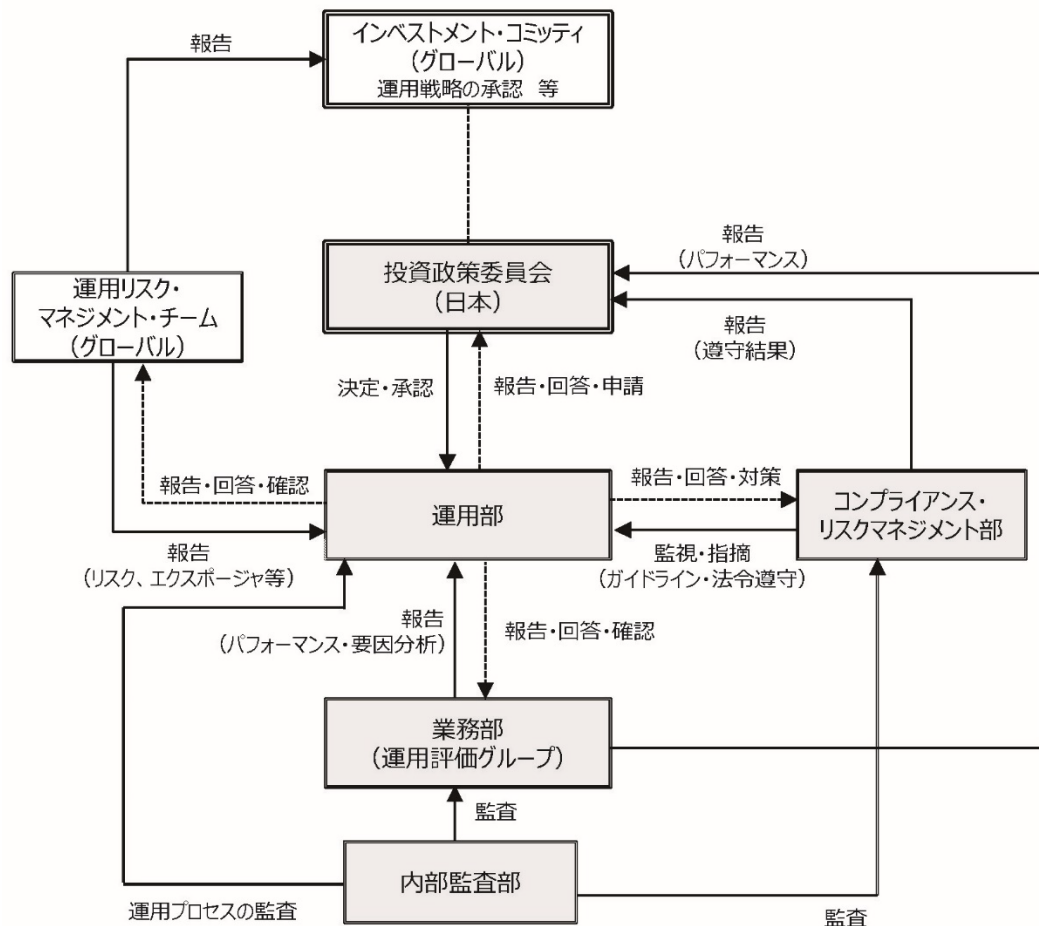
- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）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

- ③ 委託会社は、信託金を、上記②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
- ④ 上記②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③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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 上記⑤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】

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。

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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】

- ① 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②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。

- ② 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るものとします。

(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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 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たときは、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。

③ 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委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。

- ① TOPIX（東証株価指数配当込み）をベンチマークとします。
- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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

① 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

② 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ます。）
- 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 16) 貸付債権信託受益権であつて金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 18) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

- ③ 委託会社は、信託金を、上記②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
- ④ 上記②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③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。
- ⑤ 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。

- ⑥ 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

- ① 株式への投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資は行いません。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 信用取引の指図は、信託約款第15条の範囲で行います。
- ⑥ 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。
- ⑦ スワップ取引は、信託約款第17条の範囲で行います。
- ⑧ 金利先渡取引は、信託約款第18条の範囲で行います。
- ⑨ 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。
- ⑩ 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。

- ① NOMURA-BPI総合指数をベンチマークとします。
- ② 債券組入比率は原則として高位を維持します。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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

① 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

② 投資の対象とする有価証券の指図範囲等

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

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

③ 委託会社は、信託金を、上記②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

- ④ 上記②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③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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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。
- ⑦ 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

- ① 公社債の投資割合には制限を設けません。
- ② 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ます。）の行使により取得可能なもの限り、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。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 外貨建資産への投資は行いません。
- ⑥ 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。
- ⑦ スワップ取引は、信託約款第16条の範囲で行います。
- ⑧ 金利先渡取引は、信託約款第17条の範囲で行います。
- ⑨ 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。
- ⑩ 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。

- ① 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。
- ② 株式の組入率は、原則として高位を維持します。
- ③ 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。
- ④ 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という。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。
- ⑤ 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

① 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

② 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つ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。

- ③ 委託会社は、信託金を、上記②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
- ④ 上記②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③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。
- ⑤ 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

(3) 主な投資制限

- ① 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。
- ② 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。
- ③ 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④ 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ⑤ 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。
- ⑥ スワップ取引は、信託約款第18条の範囲で行います。
- ⑦ 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。
- ⑧ 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。

⑨ 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先進国の国債、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。

- ① 公社債への投資は原則として高位を維持します。
- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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

① 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
- ② 投資の対象とする有価証券の指図範囲等

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

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

③ 委託会社は、信託金を、上記②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

- ④ 上記②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③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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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

- ① 公社債の投資割合には制限を設けません。
- ② 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。
- ③ 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ④ 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。
- ⑤ 有価証券先物取引等は、信託約款15条の範囲で行います。
- ⑥ スワップ取引は、信託約款16条の範囲で行います。
- ⑦ 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。
- ⑧ 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。
- ⑨ 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。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。

① 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。

② 株価変動リスク

株式の価格は、一般に個々の企業の活動および業績、経営方針、ならびに法令順守の状況等に反応して変動するほか、投資対象国の経済情勢および景気見通し、ならびに金利変動、為替相場およびそれらの見通し等にも反応して変動します。したがって、マザーファンドに組み入れられる株式の価格は短期的または長期的に下落する可能性があります。

③ 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。

④ 金利変動リスク

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

⑤ 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。

⑥ 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。

⑦ 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。

⑧ 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。

⑨ パッシブ運用のリスク

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

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

⑩ ファミリーファンド方式のリスク

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

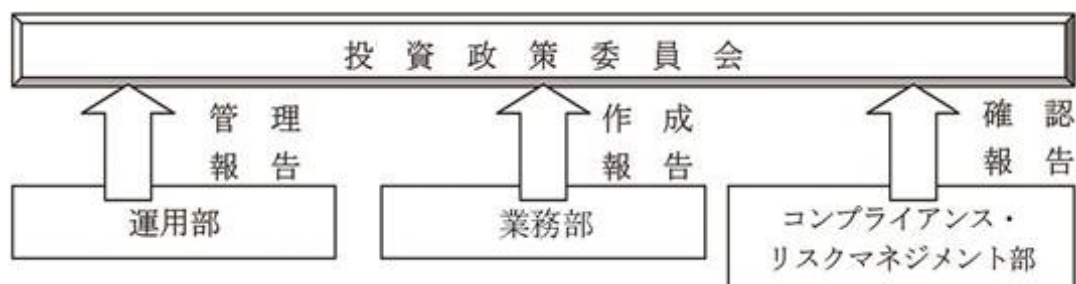
(2) その他の留意点

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

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

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

(3) リスク管理体制



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

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

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

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

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

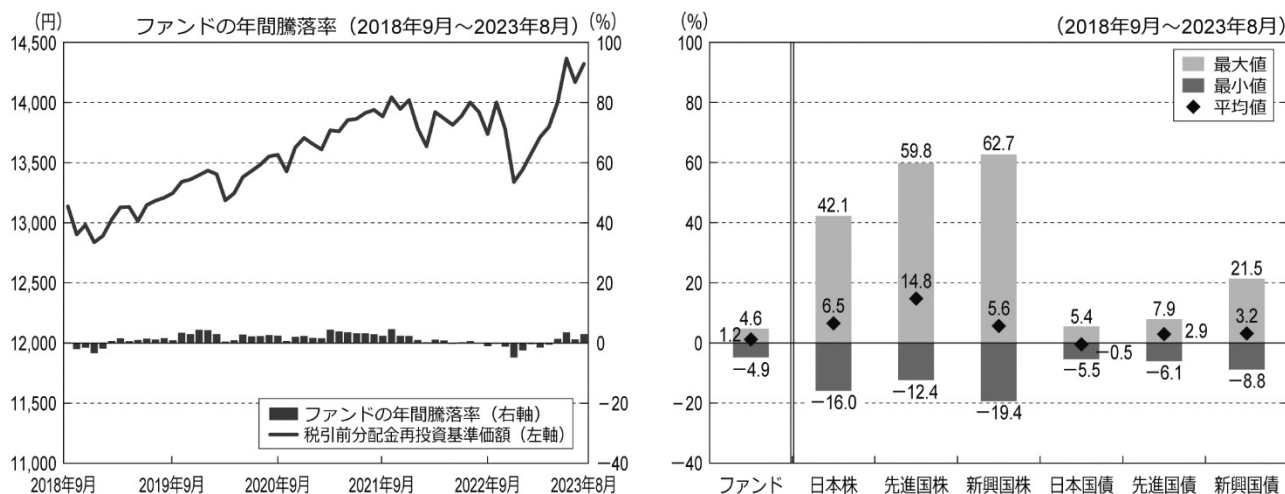
取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

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:TOPIX(東証株価指数、配当込み)

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

先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

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

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

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

日本国債:NOMURA-BPI国債

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

先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

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

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

- ① 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。
- ② 「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合の購入時手数料は、無手数料とします。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

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

(3) 【信託報酬等】

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

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

<信託報酬率の配分（税抜）>

支払先	信託報酬率（年率）	役務の内容
委託会社	0.60%	委託した資金の運用、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	0.10%	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】

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 上記①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。
- ④ 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。

す。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

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

■個人、法人別の課税について■

◆個人の投資家に対する課税

<収益分配金に対する課税>

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

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

<換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税>

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

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

※税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度です。

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及び譲渡所得が一定期間非課税となりますが、2024年1月1日以降は、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

また、2024年1月1日以降は、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

◆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

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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

- ① 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。
- ② 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、2023年8月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

(2023年8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	4,290,059,578	84.99
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		757,896,071	15.01
純資産総額		5,047,955,649	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 (日本株式インデックス・マザーファンド)

(2023年8月31日現在)

種類	国/地域名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	55,339,574,784	98.48
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		852,803,648	1.52
純資産総額		56,192,378,432	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 (日本債券インデックス・マザーファンド)

(2023年8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	115,378,960,150	82.60
特殊債券	日本	9,427,892,715	6.75
地方債証券	日本	7,898,351,733	5.65
社債券	日本	6,617,998,000	4.74
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		364,333,707	0.26
純資産総額		139,687,536,305	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。

<参考情報>

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)

(2023年8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	172,677,804,313	70.43
	イギリス	9,962,890,052	4.06
	フランス	8,403,072,768	3.43
	カナダ	7,935,458,280	3.24
	スイス	6,931,792,705	2.83
	ドイツ	5,828,749,672	2.38
	オーストラリア	4,702,069,503	1.92
	オランダ	3,022,289,041	1.23
	デンマーク	2,249,187,212	0.92
	スウェーデン	2,132,375,638	0.87
	スペイン	1,815,990,049	0.74
	イタリア	1,795,120,122	0.73
	香港	1,549,315,105	0.63
	シンガポール	848,053,547	0.35
	ベルギー	643,877,115	0.26

	フィンランド	596,190,451	0.24
	アイルランド	573,510,304	0.23
	ノルウェー	452,856,110	0.19
	イスラエル	443,028,646	0.18
	ポルトガル	146,186,309	0.06
	ニュージーランド	129,501,934	0.05
	オーストリア	124,481,676	0.05
	小計	232,963,800,552	95.02
投資証券	アメリカ	4,130,497,166	1.69
	オーストラリア	274,556,375	0.11
	シンガポール	92,906,784	0.04
	イギリス	88,619,809	0.04
	フランス	83,737,561	0.03
	香港	56,310,464	0.02
	カナダ	25,443,936	0.01
	ベルギー	18,617,651	0.01
	小計	4,770,689,746	1.95
	コール・ローン、その他資産（負債控除後）	7,431,167,829	3.03
	純資産総額	245,165,658,127	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）

（2023年8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	49,936,063,970	48.12
	フランス	8,582,984,763	8.27
	イタリア	7,865,761,155	7.58
	ドイツ	6,832,088,582	6.58
	中国	6,315,343,501	6.09
	スペイン	5,109,983,279	4.93
	イギリス	5,108,818,393	4.92
	カナダ	2,071,492,401	2.00
	ベルギー	1,892,703,201	1.82
	オランダ	1,532,398,641	1.48
	オーストラリア	1,506,656,431	1.45
	オーストリア	1,247,220,906	1.20
	メキシコ	1,045,738,832	1.01
	アイルランド	612,308,778	0.59
	フィンランド	532,689,007	0.51
	ポーランド	531,495,309	0.51
	マレーシア	525,323,013	0.51
	シンガポール	456,113,230	0.44
	デンマーク	334,335,619	0.32
	イスラエル	306,910,641	0.30
	ニュージーランド	209,885,860	0.20
	スウェーデン	209,298,406	0.20
	ノルウェー	175,968,693	0.17
	小計	102,941,582,611	99.20

コール・ローン、その他資産（負債控除後）	831,534,526	0.80
純資産総額	103,773,117,137	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】

①【投資有価証券の主要銘柄】

（2023年8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	外国債券インデックス・ マザー・ファンド	—	824,779,794	2.5315	2,087,930,049	2.7784	2,291,568,179	45.40
2	日本	親投資信託 受益証券	日本債券インデックス・ マザーファンド	—	1,208,128,068	1.2213	1,475,567,508	1.2238	1,478,507,129	29.29
3	日本	親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・オ ーブン・マザーファンド	—	47,329,431	4.6707	221,061,574	5.5292	261,693,889	5.18
4	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	—	60,246,870	3.6240	218,334,657	4.2872	258,290,381	5.12

（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	—	84.99
合計		84.99

（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。

②【投資不動産物件】

該当する事項はありません。

③【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）

①投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2023年8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	916,300	1,906.87	1,747,265,175	2,515.00	2,304,494,500	4.10
2	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	118,000	11,844.07	1,397,601,147	12,145.00	1,433,110,000	2.55
3	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル グループ	銀行業	1,029,300	973.07	1,001,583,748	1,163.50	1,197,590,550	2.13
4	日本	株式	キーエンス	電気機器	16,700	60,984.33	1,018,438,466	60,520.00	1,010,684,000	1.80
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	5,361,100	159.16	853,300,116	168.30	902,273,130	1.61
6	日本	株式	日立製作所	電気機器	82,000	7,177.63	588,565,974	9,694.00	794,908,000	1.41
7	日本	株式	三井住友フィナンシャルグ ループ	銀行業	116,800	6,056.00	707,340,800	6,681.00	780,340,800	1.39
8	日本	株式	三菱商事	卸売業	107,600	5,035.68	541,839,866	7,196.00	774,289,600	1.38
9	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	35,300	16,213.35	572,331,459	21,575.00	761,597,500	1.36
10	日本	株式	三井物産	卸売業	125,300	4,223.78	529,239,675	5,432.00	680,629,600	1.21
11	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	148,100	4,276.16	633,300,075	4,508.00	667,634,800	1.19
12	日本	株式	リクルートホールディング ス	サービス業	127,000	3,694.66	469,221,826	5,220.00	662,940,000	1.18
13	日本	株式	任天堂	その他製品	105,400	5,182.46	546,232,158	6,267.00	660,541,800	1.18
14	日本	株式	信越化学工業	化学	138,900	4,057.46	563,582,401	4,659.00	647,135,100	1.15

15	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	135,600	3,621.30	491,049,187	4,703.00	637,726,800	1.13
16	日本	株式	第一三共	医薬品	145,800	4,429.91	645,882,252	4,299.00	626,794,200	1.12
17	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	108,800	4,307.69	468,677,690	5,472.00	595,353,600	1.06
18	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	237,700	2,153.85	511,971,970	2,410.00	572,857,000	1.02
19	日本	株式	HOYA	精密機器	35,400	14,110.27	499,503,699	16,155.00	571,887,000	1.02
20	日本	株式	KDDI	情報・通信業	129,300	4,052.68	524,011,575	4,325.00	559,222,500	1.00
21	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	82,600	5,713.05	471,898,267	6,545.00	540,617,000	0.96
22	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	162,400	2,869.04	465,932,552	3,227.00	524,064,800	0.93
23	日本	株式	ダイキン工業	機械	20,100	23,754.06	477,456,628	25,225.00	507,022,500	0.90
24	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	90,800	4,297.86	390,245,959	5,249.00	476,609,200	0.85
25	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	269,000	1,541.07	414,550,277	1,670.00	449,230,000	0.80
26	日本	株式	村田製作所	電気機器	50,600	7,666.04	387,901,959	8,185.00	414,161,000	0.74
27	日本	株式	SMC	機械	5,500	72,775.57	400,265,654	70,600.00	388,300,000	0.69
28	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	60,800	6,268.57	381,129,656	5,981.00	363,644,800	0.65
29	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	158,100	1,909.15	301,837,023	2,214.50	350,112,450	0.62
30	日本	株式	デンソー	輸送用機器	34,400	7,566.70	260,294,809	9,959.00	342,589,600	0.61

(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	17.04
	輸送用機器	8.23
	情報・通信業	7.98
	卸売業	6.73
	銀行業	6.50
	化学	5.88
	機械	5.43
	医薬品	5.05
	サービス業	4.85
	小売業	4.32
	食料品	3.33
	陸運業	2.92
	精密機器	2.36
	その他製品	2.25
	保険業	2.22
	建設業	2.07
	不動産業	1.86
	電気・ガス業	1.36
	その他金融業	1.14
	鉄鋼	0.97
	証券、商品先物取引業	0.73
	ゴム製品	0.68
	ガラス・土石製品	0.67
	非鉄金属	0.65
	海運業	0.65
	金属製品	0.51
空運業	0.48	
石油・石炭製品	0.45	
繊維製品	0.41	
鉱業	0.36	

	パルプ・紙	0.17
	倉庫・運輸関連業	0.14
	水産・農林業	0.09
合 計		98.48

(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。

②投資不動産物件

該当する事項はありません。

③その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	TOPIX (先物) (2023年9月限)	大阪取引所	買建	33	753,289,280	769,065,000	1.37

(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)

①投資有価証券の主要銘柄 (上位30銘柄)

(2023年8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370回利付国債 (10年)	0.500	2033/03/20	1,830,000,000	100.90	1,846,577,000	98.96	1,811,004,600	1.30
2	日本	国債証券	第145回利付国債 (5年)	0.100	2025/09/20	1,800,000,000	100.34	1,806,174,000	100.17	1,803,132,000	1.29
3	日本	国債証券	第350回利付国債 (10年)	0.100	2028/03/20	1,800,000,000	99.37	1,788,786,000	99.61	1,793,088,000	1.28
4	日本	国債証券	第362回利付国債 (10年)	0.100	2031/03/20	1,700,000,000	96.49	1,640,483,000	97.40	1,655,953,000	1.19
5	日本	国債証券	第364回利付国債 (10年)	0.100	2031/09/20	1,700,000,000	96.01	1,632,272,000	96.90	1,647,351,000	1.18
6	日本	国債証券	第359回利付国債 (10年)	0.100	2030/06/20	1,650,000,000	97.78	1,613,424,000	98.17	1,619,904,000	1.16
7	日本	国債証券	第150回利付国債 (5年)	0.005	2026/12/20	1,600,000,000	99.73	1,595,760,000	99.73	1,595,776,000	1.14
8	日本	国債証券	第149回利付国債 (5年)	0.005	2026/09/20	1,500,000,000	99.85	1,497,870,000	99.80	1,497,030,000	1.07
9	日本	国債証券	第153回利付国債 (5年)	0.005	2027/06/20	1,500,000,000	99.42	1,491,360,000	99.54	1,493,190,000	1.07
10	日本	国債証券	第340回利付国債 (10年)	0.400	2025/09/20	1,460,000,000	101.10	1,476,060,000	100.78	1,471,519,400	1.05
11	日本	国債証券	第341回利付国債 (10年)	0.300	2025/12/20	1,300,000,000	100.89	1,311,596,000	100.62	1,308,060,000	0.94
12	日本	国債証券	第353回利付国債 (10年)	0.100	2028/12/20	1,300,000,000	98.83	1,284,829,000	99.21	1,289,795,000	0.92
13	日本	国債証券	第352回利付国債 (10年)	0.100	2028/09/20	1,260,000,000	99.01	1,247,626,800	99.35	1,251,810,000	0.90
14	日本	国債証券	第343回利付国債 (10年)	0.100	2026/06/20	1,200,000,000	100.27	1,203,348,000	100.11	1,201,332,000	0.86
15	日本	国債証券	第344回利付国債 (10年)	0.100	2026/09/20	1,200,000,000	100.19	1,202,328,000	100.09	1,201,092,000	0.86

16	日本	国債証券	第360回利付国債 (10年)	0.100	2030/09/20	1,200,000,000	97.12	1,165,440,000	97.94	1,175,304,000	0.84
17	日本	国債証券	第144回利付国債 (5年)	0.100	2025/06/20	1,100,000,000	100.33	1,103,652,000	100.18	1,101,980,000	0.79
18	日本	国債証券	第361回利付国債 (10年)	0.100	2030/12/20	1,100,000,000	96.81	1,065,009,000	97.66	1,074,293,000	0.77
19	日本	国債証券	第365回利付国債 (10年)	0.100	2031/12/20	1,100,000,000	95.90	1,054,900,000	96.65	1,063,227,000	0.76
20	日本	国債証券	第336回利付国債 (10年)	0.500	2024/12/20	1,000,000,000	101.02	1,010,210,000	100.71	1,007,160,000	0.72
21	日本	国債証券	第142回利付国債 (5年)	0.100	2024/12/20	1,000,000,000	100.30	1,003,040,000	100.19	1,001,950,000	0.72
22	日本	国債証券	第157回利付国債 (5年)	0.200	2028/03/20	1,000,000,000	100.59	1,005,963,000	100.06	1,000,670,000	0.72
23	日本	国債証券	第345回利付国債 (10年)	0.100	2026/12/20	1,000,000,000	100.09	1,000,940,000	100.04	1,000,490,000	0.72
24	日本	国債証券	第160回利付国債 (5年)	0.200	2028/06/20	1,000,000,000	99.90	999,040,000	99.90	999,050,000	0.72
25	日本	国債証券	第351回利付国債 (10年)	0.100	2028/06/20	1,000,000,000	99.21	992,100,000	99.47	994,770,000	0.71
26	日本	国債証券	第366回利付国債 (10年)	0.200	2032/03/20	1,000,000,000	96.77	967,700,000	97.26	972,610,000	0.70
27	日本	国債証券	第173回利付国債 (20年)	0.400	2040/06/20	1,100,000,000	88.29	971,223,000	88.01	968,165,000	0.69
28	日本	国債証券	第158回利付国債 (5年)	0.100	2028/03/20	950,000,000	100.11	951,045,500	99.61	946,352,000	0.68
29	日本	国債証券	第371回利付国債 (10年)	0.400	2033/06/20	950,000,000	97.83	929,444,500	97.74	928,539,500	0.66
30	日本	国債証券	第339回利付国債 (10年)	0.400	2025/06/20	900,000,000	101.01	909,171,000	100.72	906,480,000	0.65

(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	—	82.60
特殊債券	—	6.75
地方債証券	—	5.65
社債券	—	4.74
合計		99.74

(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。

②投資不動産物件

該当する事項はありません。

③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（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

①投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2023年8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	478,268	20,643.46	9,873,109,183	27,434.42	13,121,009,967	5.35
2	アメ リカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	213,732	35,207.46	7,524,962,694	48,069.09	10,273,904,454	4.19
3	アメ リカ	株式	AMAZON COM INC	一般消費財・サービス流 通・小売り	279,060	13,564.84	3,785,404,289	19,747.23	5,510,663,120	2.25
4	アメ リカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	74,700	23,211.73	1,733,916,649	72,023.96	5,380,190,410	2.19
5	アメ リカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	180,040	13,926.34	2,507,299,861	19,865.65	3,576,612,706	1.46
6	アメ リカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	162,320	13,953.32	2,264,904,201	20,019.16	3,249,511,025	1.33
7	アメ リカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	86,200	26,714.54	2,302,793,970	37,558.78	3,237,566,836	1.32
8	アメ リカ	株式	META PLATFORMS INC-A	メディア・娯楽	66,952	16,003.05	1,071,436,337	43,143.61	2,888,551,646	1.18
9	アメ リカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	39,234	46,085.50	1,808,118,510	52,786.97	2,071,044,059	0.84
10	アメ リカ	株式	UNITED HEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービ ス	28,191	77,192.96	2,176,146,758	71,861.68	2,025,852,790	0.83
11	アメ リカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	122,651	16,160.94	1,982,156,433	16,210.65	1,988,253,169	0.81
12	アメ リカ	株式	ELI LILLY AND COMPANY	医薬品・バイオテクノロ ジー・ライフサイエンス	24,409	53,296.51	1,300,914,581	80,116.13	1,955,554,812	0.80
13	アメ リカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	88,590	19,967.15	1,768,889,831	21,660.99	1,918,947,281	0.78
14	アメ リカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	49,095	30,568.13	1,500,742,700	35,998.82	1,767,362,362	0.72
15	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	73,066	25,745.82	1,881,144,085	23,937.32	1,749,004,662	0.71
16	アメ リカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	12,626	76,914.15	971,118,089	130,451.33	1,647,078,568	0.67
17	アメ リカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用 品	71,339	21,267.95	1,517,234,685	22,520.64	1,606,600,508	0.66
18	アメ リカ	株式	MASTERCARD INC- CLASS A	金融サービス	25,714	50,165.60	1,289,958,392	60,513.64	1,556,047,790	0.63
19	アメ リカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流 通・小売り	30,639	46,196.27	1,415,407,701	48,338.10	1,481,031,230	0.60
20	スイ ス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	83,121	18,518.11	1,539,243,958	17,700.15	1,471,254,467	0.60
21	デン マー ク	株式	NOVO NORDISK A/S- B	医薬品・バイオテクノロ ジー・ライフサイエンス	50,037	18,915.13	946,456,533	27,627.59	1,382,402,221	0.56
22	アメ リカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	54,795	26,443.40	1,448,966,540	23,418.31	1,283,206,625	0.52
23	アメ リカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロ ジー・ライフサイエンス	76,660	15,916.70	1,220,174,878	16,112.70	1,235,199,735	0.50
24	オラ ンダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	12,185	89,588.57	1,091,636,846	97,614.28	1,189,430,099	0.49
25	アメ リカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロ ジー・ライフサイエンス	53,357	23,117.10	1,233,459,524	21,684.38	1,157,013,677	0.47
26	アメ リカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	13,828	47,775.23	660,635,963	79,731.63	1,102,529,007	0.45
27	アメ リカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	41,636	26,697.48	1,111,576,545	26,473.89	1,102,267,134	0.45

28	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	124,207	9,132.45	1,134,315,377	8,840.71	1,098,078,564	0.45
29	フランス	株式	LVMH	耐久消費財・アパレル	8,346	112,346.36	937,642,794	128,511.36	1,072,555,811	0.44
30	アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	13,387	77,326.19	1,035,165,740	79,278.41	1,061,300,101	0.43

(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) 2023年8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	9.13
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.32
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.73
	資本財	6.49
	金融サービス	6.37
	半導体・半導体製造装置	6.05
	メディア・娯楽	5.90
	銀行	5.10
	エネルギー	4.98
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.39
	ヘルスケア機器・サービス	4.32
	素材	3.92
	食品・飲料・タバコ	3.78
	保険	2.97
	公益事業	2.67
	自動車・自動車部品	2.14
	消費者サービス	2.05
	運輸	1.79
	家庭用品・パーソナル用品	1.69
	生活必需品流通・小売り	1.66
耐久消費財・アパレル	1.59	
商業・専門サービス	1.51	
電気通信サービス	1.13	
不動産管理・開発	0.34	
	小計	95.02
投資証券	—	1.95
	合計	96.97

(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) 2023年8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。

②投資不動産物件

該当する事項はありません。

③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	161	35,226,475.08	36,420,212.50	5,324,635,059	2.17
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	105	4,572,328.28	4,543,350.00	726,209,058	0.30
	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	1,822,805.00	1,796,160.00	333,995,952	0.14
	S&P 60	モントリオール取引所	買建	カナダ・ドル	12	2,886,087.13	2,924,880.00	315,887,040	0.13
	F50 INDEX	ユーレックス・チューリッヒ取引所	買建	スイス・フラン	12	1,349,860.00	1,333,080.00	221,931,156	0.09
	SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア・ドル	12	2,134,549.48	2,177,700.00	206,402,405	0.08

(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（2023年8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）

①投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2023年8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	2.375	2024/08/15	8,300,000	14,094.59	1,169,851,281	14,208.24	1,179,284,039	1.14
2	中国	国債証券	CHINESE GOVERNMENT BOND	2.910	2028/10/14	56,500,000	2,028.72	1,146,228,874	2,052.48	1,159,653,666	1.12
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2024/11/15	7,700,000	14,019.78	1,079,523,092	14,102.01	1,085,855,380	1.05
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.500	2025/03/31	7,500,000	13,443.54	1,008,266,015	13,609.16	1,020,687,310	0.98
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2029/08/15	8,000,000	12,743.24	1,019,459,453	12,638.87	1,011,110,065	0.97
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2027/11/30	7,300,000	12,494.78	912,119,525	12,510.37	913,257,711	0.88
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.875	2025/04/30	5,800,000	14,466.37	839,049,794	14,345.30	832,027,628	0.80
8	中国	国債証券	CHINESE GOVERNMENT BOND	2.690	2026/08/12	39,100,000	2,011.39	786,454,028	2,030.41	793,892,992	0.77
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2024/09/30	5,300,000	14,019.20	743,018,096	14,124.86	748,617,669	0.72
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2025/05/15	5,200,000	13,878.72	721,693,459	13,927.26	724,217,691	0.70
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2025/03/31	5,000,000	14,056.33	702,816,522	14,072.32	703,616,053	0.68

12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2025/02/15	5,000,000	13,900.42	695,021,093	13,977.51	698,875,978	0.67
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2025/07/31	4,600,000	14,093.45	648,298,775	14,070.60	647,247,962	0.62
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2029/02/15	4,800,000	13,546.89	650,250,816	13,438.40	645,043,539	0.62
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2027/01/31	4,800,000	13,208.82	634,023,710	13,248.23	635,915,178	0.61
16	中国	国債証券	CHINESE GOVERNMENT BOND	2.260	2025/02/24	31,300,000	1,999.17	625,742,199	2,009.71	629,041,271	0.61
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.750	2032/08/15	4,800,000	13,368.16	641,671,800	13,102.60	628,924,989	0.61
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2028/11/30	4,900,000	12,741.10	624,313,980	12,714.83	623,026,731	0.60
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2025/08/15	4,500,000	13,789.62	620,533,332	13,829.60	622,332,281	0.60
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2026/11/15	4,550,000	13,514.36	614,903,494	13,521.78	615,241,293	0.59
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2027/05/15	4,200,000	13,623.44	572,184,539	13,586.32	570,625,455	0.55
22	中国	国債証券	CHINESE GOVERNMENT BOND	2.890	2031/11/18	27,800,000	2,007.79	558,166,039	2,049.19	569,676,490	0.55
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2025/11/15	4,000,000	13,824.46	552,978,658	13,839.88	553,595,435	0.53
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.750	2025/02/28	3,900,000	14,103.73	550,045,518	14,119.72	550,669,152	0.53
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2031/08/15	4,600,000	11,975.02	550,851,334	11,790.23	542,350,599	0.52
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	4,000,000	13,459.53	538,381,500	13,508.65	540,346,065	0.52
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2031/05/15	4,400,000	12,374.45	544,476,213	12,224.83	537,892,647	0.52
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2024/08/31	3,800,000	13,975.80	531,080,638	14,122.00	536,636,238	0.52
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/09/30	4,000,000	13,368.73	534,749,342	13,413.85	536,554,000	0.52
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2027/02/28	4,100,000	13,134.62	538,519,707	13,055.77	535,286,742	0.52

(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) 2023年8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	—	99.20
合計		99.20

(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) 2023年8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。

②投資不動産物件

該当する事項はありません。

③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】

① 【純資産の推移】

2023年8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2期	(2014年 2月20日)	分配付： 1,623,142,054	分配落： 1,616,135,543	分配付： 1.1583 分配落： 1.1533
第3期	(2015年 2月20日)	分配付： 1,749,455,838	分配落： 1,726,925,712	分配付： 1.2424 分配落： 1.2264
第4期	(2016年 2月22日)	分配付： 2,799,520,026	分配落： 2,783,188,603	分配付： 1.1999 分配落： 1.1929
第5期	(2017年 2月20日)	分配付： 3,353,263,422	分配落： 3,315,305,934	分配付： 1.2368 分配落： 1.2228
第6期	(2018年 2月20日)	分配付： 4,218,203,352	分配落： 4,167,563,611	分配付： 1.2495 分配落： 1.2345
第7期	(2019年 2月20日)	分配付： 4,251,424,588	分配落： 4,213,813,566	分配付： 1.2434 分配落： 1.2324
第8期	(2020年 2月20日)	分配付： 4,636,953,719	分配落： 4,582,572,120	分配付： 1.2790 分配落： 1.2640
第9期	(2021年 2月22日)	分配付： 4,734,124,014	分配落： 4,697,113,247	分配付： 1.2791 分配落： 1.2691
第10期	(2022年 2月21日)	分配付： 4,854,785,226	分配落： 4,835,634,300	分配付： 1.2675 分配落： 1.2625
第11期	(2023年 2月20日)	分配付： 4,805,659,775	分配落： 4,774,926,222	分配付： 1.2509 分配落： 1.2429
	2022年 8月末日	4,945,262,474		1.2861
	9月末日	4,875,833,344		1.2692
	10月末日	4,970,745,058		1.2936
	11月末日	4,891,904,699		1.2732
	12月末日	4,731,360,568		1.2324
	2023年 1月末日	4,771,220,953		1.2419
	2月末日	4,816,575,654		1.2467
	3月末日	4,842,743,456		1.2589
	4月末日	4,869,575,911		1.2666
	5月末日	4,935,137,797		1.2853
	6月末日	5,065,783,375		1.3188
	7月末日	5,000,770,157		1.3008
	8月末日	5,047,955,649		1.3147

② 【分配の推移】

計算期間		一口当たりの分配金
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
第10期	自2021年 2月23日 至2022年 2月21日	0.0050円
第11期	自2022年 2月22日 至2023年 2月20日	0.0080円

③【収益率の推移】

計算期間		収益率
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%
第10期	自2021年 2月23日 至2022年 2月21日	△0.1%
第11期	自2022年 2月22日 至2023年 2月20日	△0.9%
	自2023年 2月21日 至2023年 8月20日	4.7%

(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を控除した額を、前期末の分配落基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数です。

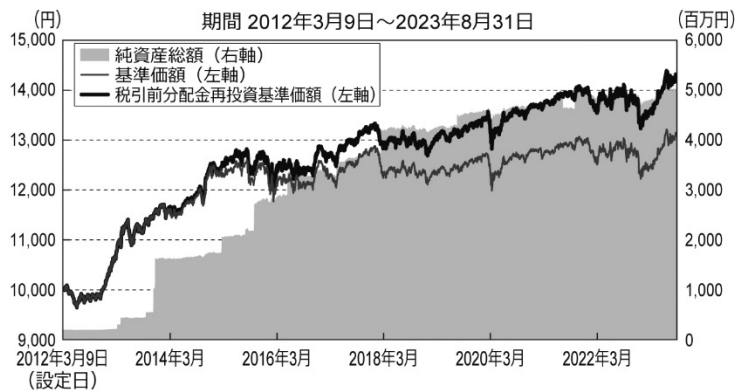
(4) 【設定及び解約の実績】

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
第10期	自2021年 2月23日 至2022年 2月21日	321,813,640	192,705,055	3,830,185,356
第11期	自2022年 2月22日 至2023年 2月20日	50,649,746	39,140,907	3,841,694,195
	自2023年 2月21日 至2023年 8月20日	46,832,882	50,270,197	3,838,256,880

(注) 日本国外における設定、解約はありません。

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	13,147円
純資産総額	5,048百万円

分配の推移

決算期	分配金
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
第10期 (2022年2月21日)	50円
第11期 (2023年2月20日)	80円
設定来累計	1,060円

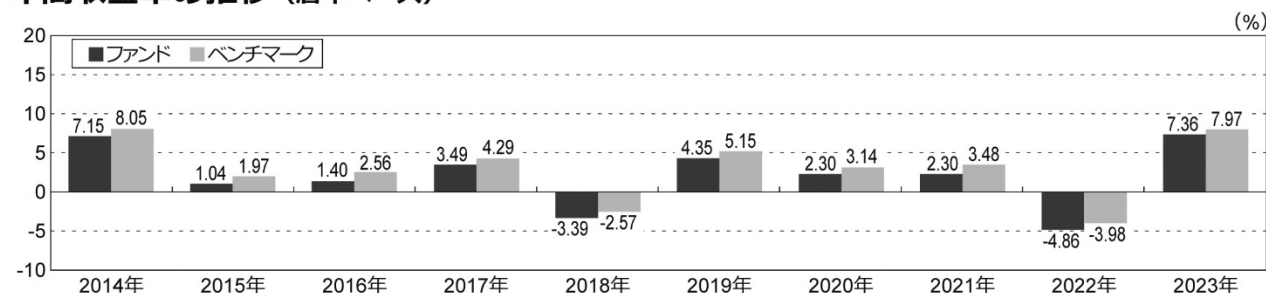
※分配金は1万口当たり、税引前です。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	投資銘柄 (上位3銘柄)	国/ 地域名	種類	業種	利率	償還日	投資比率
外国債券 インデックス・マザー・ファンド	45.40%	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	2.375%	2024/08/15	1.14%
		CHINESE GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	—	2.910%	2028/10/14	1.12%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	2.250%	2024/11/15	1.05%
日本債券 インデックス・マザー・ファンド	29.29%	第370回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	0.500%	2033/03/20	1.30%
		第145回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.100%	2025/09/20	1.29%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	0.100%	2028/03/20	1.28%
外国株式 インデックス・オープン・ マザー・ファンド	5.18%	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	—	—	5.35%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・ サービス	—	—	4.19%
		AMAZON COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス 流通・小売り	—	—	2.25%
日本株式 インデックス・マザー・ファンド	5.12%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	4.10%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	—	—	2.55%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	—	—	2.13%

※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。

※2023年のファンドとベンチマークの年間収益率は年初から8月末までで算出しています。

※年間収益率の推移は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- 1) 当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社に所定の方法で取引口座を開設のうえ、当ファンドの取得申込みを行ってください。なお、確定拠出年金制度のご利用による取得申込みの場合は、確定拠出年金制度にかかる手続きが必要となります。
- 2) 当ファンドには「分配金再投資コース」と「分配金受取コース」があります。なお、取扱い可能なコースおよびコース名については異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。その際、「分配金再投資コース」をお申し込みいただく方は、ご購入に際して、当ファンドに係る「自動けいぞく投資契約」（別の名称で同様の内容を有する契約を含みます。）を販売会社との間で結んでいただきます。ただし、「分配金再投資コース」を申し込まれた場合でも、分配金を定期的に受け取る旨の契約を締結することもできます。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- 3) 当ファンドの取得申込みの申込受付締切時間は、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 手数料等及び税金（1）申込手数料」をご参照ください。
- 9) 購入申込不可日は、原則として、米国もしくは英国の取引所または銀行の休業日、またはフランスおよびドイツ両国の取引所または銀行の休業日に該当する日です。
- 10) 取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更、クーデター等政変、テロリズム、戦争、天災地変等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）があるときは、委託会社の判断により、受益権の取得申込の受付を中止することおよび既に受付けた受益権の取得申込の受け取りを取り消すことがあります。
- 11) 当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社に取得申込と同時にまたはあらかじめ、当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。販売会社は、当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

2【換金（解約）手続等】

- 1) 受益者（当ファンドの受益権を取得した者）は、自己に帰属する受益権につき、取得申込みを行った販売会社を通じ、委託会社に一部解約の実行の請求を行うことにより、当ファンドを換金することができます。
- 2) 当ファンドの換金申込みの申込受付締切時間は、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、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。投資対象とするマザーファンド受益証券は、当該マザーファンド受益証券の基準価額で評価します。

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

<主要投資対象の評価方法>

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

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

2) 基準価額の算出頻度

基準価額は原則として委託会社の営業日において日々算出されます。

3) 基準価額の公表

基準価額は、販売会社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せん。

(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、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該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。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、後記6)の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- (b) 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

6) 信託約款の変更等

- (a) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本6)に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- (b) 委託会社は、上記(a)の事項(信託約款の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2

週間前までに、当ファンドに係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

- (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、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (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、知れ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）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。

① 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、）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。

② 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、）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。

③ 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。

④ 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行行使することができます。

⑤ 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11期計算期間（2022年2月22日から2023年2月20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。

(3) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(4) 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、当中間計算期間（2023年2月21日から2023年8月20日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2023年4月28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

業務執行社員

公認会計士 榎原 康太

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2022年2月22日から2023年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、AMC／ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）の2023年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査

手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

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10期 (2022年2月21日現在)	第11期 (2023年2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	3,124,559	1,572,657
コール・ローン	748,260,273	731,293,434
親投資信託受益証券	4,123,840,284	4,093,196,702
流動資産合計	4,875,225,116	4,826,062,793
資産合計		
	4,875,225,116	4,826,062,793
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	19,150,926	30,733,553
未払解約金	21,780	1,947
未払受託者報酬	1,343,159	1,342,033
未払委託者報酬	18,804,127	18,788,444
未払利息	2,020	1,956
その他未払費用	268,804	268,638
流動負債合計	39,590,816	51,136,571
負債合計		
	39,590,816	51,136,571
純資産の部		
元本等		
元本	※1 3,830,185,356	※1 3,841,694,195
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,005,448,944	933,232,027
（分配準備積立金）	256,422,903	255,741,063
元本等合計	4,835,634,300	4,774,926,222
純資産合計		
	4,835,634,300	4,774,926,222
負債純資産合計		
	4,875,225,116	4,826,062,793

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期 自 2021年2月23日 至 2022年2月21日	第11期 自 2022年2月22日 至 2023年2月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	34,105,649	△2,843,582
営業収益合計	34,105,649	△2,843,582
営業費用		
支払利息	709,822	723,621
受託者報酬	2,638,797	2,682,988
委託者報酬	36,943,057	37,561,617
その他費用	532,685	545,277
営業費用合計	40,824,361	41,513,503
営業利益又は営業損失(△)	△6,718,712	△44,357,085
経常利益又は経常損失(△)	△6,718,712	△44,357,085
当期純利益又は当期純損失(△)	△6,718,712	△44,357,085
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(△)	3,662,626	365,699
期首剰余金又は期首欠損金(△)	996,036,476	1,005,448,944
剰余金増加額又は欠損金減少額	90,749,436	13,496,656
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	90,749,436	13,496,656
剰余金減少額又は欠損金増加額	51,804,704	10,257,236
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	51,804,704	10,257,236
分配金	※1 19,150,926	※1 30,733,553
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,005,448,944	933,232,027

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第10期 (2022年2月21日現在)	第11期 (2023年2月20日現在)
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第10期 (2022年2月21日現在)	第11期 (2023年2月20日現在)
1 期首元本額	3,701,076,771円	3,830,185,356円
期中追加設定元本額	321,813,640円	50,649,746円
期中一部解約元本額	192,705,055円	39,140,907円
2 受益権の総数	3,830,185,356口	3,841,694,195口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第10期 自 2021年2月23日 至 2022年2月21日	第11期 自 2022年2月22日 至 2023年2月20日
1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(21,423,171円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(749,026,041円)及び分配準備積立金(254,150,658円)より分配対象収益は1,024,599,870円(1万口当たり2,675円)であり、うち19,150,926円(1万口当たり50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(32,629,734円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(677,490,964円)及び分配準備積立金(253,844,882円)より分配対象収益は963,965,580円(1万口当たり2,509円)であり、うち30,733,553円(1万口当たり80円)を分配金額としております。

(金融商品に関する注記)

I 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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第10期 (2022年2月21日現在)	第11期 (2023年2月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありませ	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(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 該当する事項はありません。	(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	金融商品の時価の算定においては	同左

に関する事項についての補足説明	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。
-----------------	---

(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10期 (2022年2月21日現在)	第11期 (2023年2月20日現在)
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額	当計算期間の損益に 含まれた評価差額
親投資信託受益証券	22,350,431	△8,832,681
合計	22,350,431	△8,832,681

(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10期 (2022年2月21日現在)	第11期 (2023年2月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2625円 (12,625円)	1.2429円 (12,429円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

① 株式

該当する事項はありません。

② 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受 益証券	外国株式インデックス・オープン・マザーファンド	53,544,059	250,088,236	
	外国債券インデックス・マザー・ファンド	858,207,630	2,172,552,615	
	日本株式インデックス・マザーファンド	68,981,331	249,988,343	
	日本債券インデックス・マザーファンド	1,164,208,743	1,420,567,508	
合計		2,144,941,763	4,093,196,702	

(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	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		8,316,271	2,716,528
コール・ローン		1,991,556,633	1,263,199,054
株式		83,096,381,980	52,071,981,740
派生商品評価勘定		3,419,580	11,415,120
未収入金		—	166,180
未収配当金		132,421,098	94,775,972
前払金		43,753,000	—
差入委託証拠金		88,245,000	55,890,000
流動資産合計		85,364,093,562	53,500,144,594
資産合計		85,364,093,562	53,500,144,594
負債の部			
流動負債			
前受金		—	4,392,500
派生商品評価勘定		56,572,520	—
未払金		714,640	—
未払解約金		80,762,000	33,915,000
未払利息		5,377	3,378
その他未払費用		799	493
流動負債合計		138,055,336	38,311,371
負債合計		138,055,336	38,311,371
純資産の部			
元本等			
元本	1	25,294,590,585	14,752,340,035
剰余金			
剰余金又は欠損金(△)		59,931,447,641	38,709,493,188
元本等合計		85,226,038,226	53,461,833,223
純資産合計		85,226,038,226	53,461,833,223
負債純資産合計		85,364,093,562	53,500,144,594

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
1 期首元本額	30,837,565,787円	25,294,590,585円
期中追加設定元本額	2,872,328,195円	1,753,907,266円
期中一部解約元本額	8,415,303,397円	12,296,157,816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）	68,904,278円	68,981,331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＞	859,722,220円	710,778,676円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	1,114,502円	2,911,390円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	41,611,804円	23,988,398円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	101,750円	95,561円
バランスファンドVA40B＜適格機関投	2,929,213円	2,369,752円

資家限定>		
バランスファンドVA50A<適格機関投資家限定>	9,020,758円	4,168,214円
バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	4,714,525,381円	4,061,655,987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>	325,274,735円	293,758,056円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	2,688,492円	2,111,954円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	675,167,737円	529,744,420円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	516,333,400円	439,072,406円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	33,446,008円	31,673,865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>	74,771,376円	73,118,849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>	8,228,214,822円	76,780,705円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	129,494,025円	95,893,393円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	1,698,014,258円	1,452,987,603円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	255,626,431円	198,988,819円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	1,176,319,740円	954,113,869円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	36,795,063円	32,221,168円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	13,711,613円	10,627,900円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	15,816,264円	14,305,109円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	7,558,463円	5,287,440円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	415,348,450円	341,221,323円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	1,503,156円	1,210,294円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	2,349,417円	2,213,592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>	77,848,054円	41,848,936円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	230,562,712円	203,449,609円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	1,078,407,897円	890,829,665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>	72,763,467円	68,530,913円
フレックス資産配分戦略ファンド<適	67,019,425円	430,650,499円

格機関投資家限定> 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>	48,862,230円	45,838,046円
ステート・ストリート日本株式インデ ックス・オープン	3,993,393,519円	3,320,174,162円
世界バランス40VA<適格機関投資 家限定>	4,150,810円	2,834,577円
世界バランス60VA<適格機関投資 家限定>	25,623,020円	3,825,689円
グローバルバランス40VA<適格機 関投資家限定>	212,618円	200,823円
グローバルバランス40VA2<適格 機関投資家限定>	370,701,614円	299,633,386円
グローバルバランス40VA3<適格 機関投資家限定>	13,814,006円	10,512,704円
グローバルバランス50VA<適格機 関投資家限定>	4,867,857円	3,730,952円
計	25,294,590,585円	14,752,340,035円
2 受益権の総数	25,294,590,585口	14,752,340,035口

(金融商品に関する注記)

I 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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありませ ん。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(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	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
	当期間の損益に 含まれた評価差額	当期間の損益に 含まれた評価差額
株式	688,704,466	5,264,641,195
合計	688,704,466	5,264,641,195

(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	(2022年2月21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)	2,137,161,000	—	2,084,080,000	△53,081,000
	合 計	2,137,161,000	—	2,084,080,000	△53,081,000

(単位：円)

区 分	種 類	(2023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)	1,347,860,000	—	1,359,320,000	11,460,000
	合 計	1,347,860,000	—	1,359,320,000	11,460,000

(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)

	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
1口当たり純資産額	3.3693円	3.6240円
(1万口当たり純資産額)	(33,693円)	(36,240円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

① 株式

銘柄	株数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	1,000	3,630.00	3,630,000	
ニッスイ	25,200	544.00	13,708,800	
マルハニチロ	3,700	2,443.00	9,039,100	
雪国まいたけ	2,100	1,007.00	2,114,700	
カネコ種苗	800	1,670.00	1,336,000	
サカタのタネ	2,900	4,045.00	11,730,500	
ホクト	2,300	1,881.00	4,326,300	
ホクリョウ	200	850.00	170,000	
ショーボンドホールディングス	3,500	5,260.00	18,410,000	
ミライト・ワン	8,900	1,504.00	13,385,600	
タマホーム	1,600	3,215.00	5,144,000	
サンヨーホームズ	600	747.00	448,200	
日本アクア	900	950.00	855,000	
ファーストコーポレーション	900	748.00	673,200	
ベステラ	400	916.00	366,400	
Robot Home	4,600	205.00	943,000	
キャンディル	600	509.00	305,400	
住石ホールディングス	3,300	383.00	1,263,900	
日鉄鉱業	1,000	3,530.00	3,530,000	
三井松島ホールディングス	1,200	3,790.00	4,548,000	
INPEX	93,900	1,426.00	133,901,400	
石油資源開発	2,900	4,845.00	14,050,500	
K&Oエナジーグループ	1,200	2,198.00	2,637,600	
ダイセキ環境ソリューション	700	934.00	653,800	
第一カッター興業	700	1,089.00	762,300	
明豊ファシリティワークス	900	807.00	726,300	
安藤・間	14,600	872.00	12,731,200	
東急建設	7,300	671.00	4,898,300	
コムシスホールディングス	8,700	2,486.00	21,628,200	
ビーアールホールディングス	3,700	342.00	1,265,400	
高松コンストラクショングループ	1,700	1,982.00	3,369,400	
東建コーポレーション	700	7,600.00	5,320,000	
ソネック	200	958.00	191,600	
ヤマウラ	1,300	1,052.00	1,367,600	
オリエンタル白石	9,600	316.00	3,033,600	
大成建設	17,700	4,375.00	77,437,500	
大林組	63,400	978.00	62,005,200	
清水建設	53,300	733.00	39,068,900	
飛島建設	1,800	1,065.00	1,917,000	
長谷工コーポレーション	18,300	1,539.00	28,163,700	
松井建設	1,400	642.00	898,800	
銭高組	300	2,959.00	887,700	
鹿島建設	39,300	1,607.00	63,155,100	
不動テトラ	1,400	1,623.00	2,272,200	

大末建設	700	1,174.00	821,800	
鉄建建設	1,400	1,788.00	2,503,200	
西松建設	3,000	3,555.00	10,665,000	
三井住友建設	14,100	421.00	5,936,100	
大豊建設	800	3,900.00	3,120,000	
佐田建設	1,300	513.00	666,900	
ナカノフドー建設	800	329.00	263,200	
奥村組	2,800	3,235.00	9,058,000	
東鉄工業	2,400	2,761.00	6,626,400	
イチケン	500	1,813.00	906,500	
富士ピー・エス	1,200	452.00	542,400	
浅沼組	1,400	3,255.00	4,557,000	
戸田建設	22,100	710.00	15,691,000	
熊谷組	3,100	2,751.00	8,528,100	
北野建設	400	2,956.00	1,182,400	
植木組	400	1,381.00	552,400	
矢作建設工業	2,300	819.00	1,883,700	
ピーエス三菱	2,100	642.00	1,348,200	
日本ハウスホールディングス	3,400	398.00	1,353,200	
大東建託	6,500	12,580.00	81,770,000	
新日本建設	2,800	871.00	2,438,800	
東亜道路工業	300	6,440.00	1,932,000	
日本道路	400	6,760.00	2,704,000	
東亜建設工業	1,600	2,606.00	4,169,600	
日本国土開発	5,200	552.00	2,870,400	
若築建設	800	2,998.00	2,398,400	
東洋建設	5,600	908.00	5,084,800	
五洋建設	25,100	660.00	16,566,000	
世紀東急工業	2,300	800.00	1,840,000	
福田組	700	4,415.00	3,090,500	
日本ドライケミカル	500	1,652.00	826,000	
住友林業	13,600	2,640.00	35,904,000	
日本基礎技術	800	536.00	428,800	
巴コーポレーション	1,500	411.00	616,500	
大和ハウス工業	49,600	3,114.00	154,454,400	
ライト工業	3,300	1,974.00	6,514,200	
積水ハウス	55,600	2,545.50	141,529,800	
日特建設	1,300	931.00	1,210,300	
北陸電気工事	1,300	768.00	998,400	
ユアテック	3,800	758.00	2,880,400	
日本リーテック	1,300	870.00	1,131,000	
四電工	700	1,848.00	1,293,600	
中電工	2,700	2,129.00	5,748,300	
関電工	10,000	877.00	8,770,000	
きんでん	12,700	1,509.00	19,164,300	
東京エネシス	1,700	906.00	1,540,200	
トーエネック	600	3,405.00	2,043,000	
住友電設	1,600	2,394.00	3,830,400	
日本電設工業	2,900	1,501.00	4,352,900	

エクシオグループ	8,300	2,399.00	19,911,700	
新日本空調	1,000	1,905.00	1,905,000	
日本工営	1,100	3,240.00	3,564,000	
九電工	4,400	3,405.00	14,982,000	
三機工業	3,900	1,486.00	5,795,400	
日揮ホールディングス	17,500	1,758.00	30,765,000	
中外炉工業	600	1,783.00	1,069,800	
ヤマト	1,200	805.00	966,000	
太平電業	1,100	3,825.00	4,207,500	
高砂熱学工業	4,200	2,032.00	8,534,400	
三晃金属工業	200	3,840.00	768,000	
NEC ネットエスアイ	6,000	1,629.00	9,774,000	
朝日工業社	800	2,104.00	1,683,200	
明星工業	3,000	789.00	2,367,000	
大気社	2,100	3,515.00	7,381,500	
ダイダン	1,100	2,252.00	2,477,200	
日比谷総合設備	1,600	2,009.00	3,214,400	
ニッポン	4,900	1,596.00	7,820,400	
日清製粉グループ本社	16,400	1,561.00	25,600,400	
日東富士製粉	300	4,455.00	1,336,500	
昭和産業	1,500	2,490.00	3,735,000	
鳥越製粉	1,700	591.00	1,004,700	
中部飼料	2,300	1,036.00	2,382,800	
フィード・ワン	2,700	683.00	1,844,100	
東洋精糖	500	892.00	446,000	
日本甜菜製糖	1,100	1,638.00	1,801,800	
DM三井製糖ホールディングス	1,900	2,046.00	3,887,400	
塩水港精糖	1,400	198.00	277,200	
ウェルネオシュガー	1,000	1,675.00	1,675,000	
L I F U L L	6,000	194.00	1,164,000	
M I X I	4,300	2,631.00	11,313,300	
ジェイエイシーリクルートメント	1,600	2,279.00	3,646,400	
日本M&Aセンターホールディングス	31,900	1,199.00	38,248,100	
メンバーズ	600	1,453.00	871,800	
中広	500	399.00	199,500	
UTグループ	2,700	2,421.00	6,536,700	
アイティメディア	700	1,504.00	1,052,800	
E・Jホールディングス	1,100	1,352.00	1,487,200	
オープンアップグループ	5,500	1,877.00	10,323,500	
コシダカホールディングス	5,400	919.00	4,962,600	
アルトナー	600	1,084.00	650,400	
パソナグループ	2,200	1,924.00	4,232,800	
CDS	500	1,804.00	902,000	
リンクアンドモチベーション	5,300	600.00	3,180,000	
エス・エム・エス	7,100	3,330.00	23,643,000	
サニーサイドアップグループ	800	586.00	468,800	
パーソルホールディングス	20,800	2,793.00	58,094,400	
リニカル	1,100	711.00	782,100	
クックパッド	6,200	222.00	1,376,400	

エスクリ	1,200	355.00	426,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	900	637.00	573,300	
森永製菓	3,300	3,905.00	12,886,500	
中村屋	500	3,050.00	1,525,000	
江崎グリコ	5,100	3,490.00	17,799,000	
名糖産業	600	1,685.00	1,011,000	
井村屋グループ	1,100	2,212.00	2,433,200	
不二家	1,200	2,493.00	2,991,600	
山崎製パン	11,900	1,587.00	18,885,300	
第一屋製パン	500	398.00	199,000	
モロゾフ	500	3,410.00	1,705,000	
亀田製菓	1,200	4,320.00	5,184,000	
寿スピリッツ	1,900	8,630.00	16,397,000	
カルビー	8,100	2,924.00	23,684,400	
森永乳業	3,300	4,820.00	15,906,000	
六甲バター	1,500	1,351.00	2,026,500	
ヤクルト本社	12,700	9,240.00	117,348,000	
明治ホールディングス	11,000	6,420.00	70,620,000	
雪印メグミルク	4,400	1,801.00	7,924,400	
プリマハム	2,400	2,161.00	5,186,400	
日本ハム	6,900	3,770.00	26,013,000	
林兼産業	300	458.00	137,400	
丸大食品	2,000	1,482.00	2,964,000	
S Foods	1,900	2,750.00	5,225,000	
柿安本店	700	2,044.00	1,430,800	
伊藤ハム米久ホールディングス	13,800	716.00	9,880,800	
学情	1,000	1,384.00	1,384,000	
スタジオアリス	900	2,100.00	1,890,000	
クロスキャット	1,000	1,273.00	1,273,000	
シミックホールディングス	1,100	1,760.00	1,936,000	
エプロ	500	718.00	359,000	
システナ	30,000	345.00	10,350,000	
NJS	400	2,200.00	880,000	
デジタルアーツ	1,100	5,430.00	5,973,000	
日鉄ソリューションズ	3,100	3,360.00	10,416,000	
総合警備保障	6,900	3,510.00	24,219,000	
キューブシステム	1,000	1,117.00	1,117,000	
いちご	20,900	288.00	6,019,200	
日本駐車場開発	22,200	256.00	5,683,200	
コア	900	1,523.00	1,370,700	
カカクコム	13,900	1,925.00	26,757,500	
アイロムグループ	700	1,993.00	1,395,100	
セントケア・ホールディング	1,300	785.00	1,020,500	
サイネックス	400	558.00	223,200	
ルネサンス	1,400	892.00	1,248,800	
ディップ	3,200	3,660.00	11,712,000	
SBSホールディングス	1,600	3,235.00	5,176,000	
デジタルホールディングス	1,400	1,166.00	1,632,400	
新日本科学	2,100	2,671.00	5,609,100	

キャリアデザインセンター	300	1,977.00	593,100	
ベネフィット・ワン	8,700	2,084.00	18,130,800	
エムスリー	36,800	3,305.00	121,624,000	
ツカダ・グローバルホールディング	1,100	408.00	448,800	
プラス	200	1,169.00	233,800	
アウトソーシング	11,000	1,259.00	13,849,000	
ウェルネット	1,100	661.00	727,100	
ワールドホールディングス	800	2,691.00	2,152,800	
ディー・エヌ・エー	8,000	1,797.00	14,376,000	
博報堂DYホールディングス	23,700	1,504.00	35,644,800	
ぐるなび	3,100	370.00	1,147,000	
タカミヤ	2,300	434.00	998,200	
ジャパンベストレスキューシステム	1,200	789.00	946,800	
ファンコミュニケーションズ	3,500	410.00	1,435,000	
ライク	700	1,901.00	1,330,700	
ビジネス・ブレークスルー	600	380.00	228,000	
エスプール	5,300	690.00	3,657,000	
WDBホールディングス	900	2,013.00	1,811,700	
手間いらず	300	4,965.00	1,489,500	
ティア	1,100	428.00	470,800	
CDG	400	1,176.00	470,400	
アドウェイズ	3,000	650.00	1,950,000	
バリューコマース	1,400	1,711.00	2,395,400	
インフォマート	19,200	328.00	6,297,600	
サッポロホールディングス	5,800	3,135.00	18,183,000	
アサヒグループホールディングス	41,200	4,711.00	194,093,200	
麒麟ホールディングス	80,400	2,006.50	161,322,600	
宝ホールディングス	12,300	1,067.00	13,124,100	
オエノンホールディングス	5,800	267.00	1,548,600	
養命酒製造	600	1,829.00	1,097,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	13,900	1,419.00	19,724,100	
サントリー食品インターナショナル	12,500	4,740.00	59,250,000	
ダイドーグループホールディングス	1,000	4,800.00	4,800,000	
伊藤園	6,000	4,450.00	26,700,000	
キーコーヒー	2,000	2,074.00	4,148,000	
ユニカフェ	400	888.00	355,200	
ジャパンフーズ	400	1,097.00	438,800	
日清オイリオグループ	2,600	3,305.00	8,593,000	
不二製油グループ本社	4,200	1,998.00	8,391,600	
かどや製油	200	3,545.00	709,000	
J-オイルミルズ	2,000	1,559.00	3,118,000	
ローソン	4,800	5,420.00	26,016,000	
サンエー	1,500	4,160.00	6,240,000	
カワチ薬品	1,600	2,323.00	3,716,800	
エービーシー・マート	2,800	6,780.00	18,984,000	
ハードオフコーポレーション	900	1,300.00	1,170,000	
高千穂交易	600	2,407.00	1,444,200	
アスクル	3,900	1,733.00	6,758,700	
ゲオホールディングス	2,100	1,767.00	3,710,700	

アダストリア	2,300	2,273.00	5,227,900	
ジーフット	1,800	299.00	538,200	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	800	416.00	332,800	
オルバヘルスケアホールディングス	200	1,623.00	324,600	
伊藤忠食品	400	4,970.00	1,988,000	
くら寿司	2,200	3,180.00	6,996,000	
キャンドウ	800	2,313.00	1,850,400	
エレマテック	1,700	1,734.00	2,947,800	
I Kホールディングス	800	368.00	294,400	
パルグループホールディングス	1,800	2,761.00	4,969,800	
エディオン	7,500	1,319.00	9,892,500	
あらた	1,500	4,035.00	6,052,500	
サーラコーポレーション	4,200	712.00	2,990,400	
ワッツ	700	688.00	481,600	
トーマンデバイス	300	6,770.00	2,031,000	
ハローズ	900	3,365.00	3,028,500	
J Pホールディングス	5,000	343.00	1,715,000	
フジオフードグループ本社	1,700	1,356.00	2,305,200	
あみやき亭	500	2,982.00	1,491,000	
東京エレクトロン デバイス	600	7,930.00	4,758,000	
ひらまつ	5,200	191.00	993,200	
円谷フィールズホールディングス	1,600	4,045.00	6,472,000	
双日	20,300	2,576.00	52,292,800	
アルフレッサ ホールディングス	19,200	1,641.00	31,507,200	
大黒天物産	600	4,930.00	2,958,000	
ハニーズホールディングス	1,400	1,453.00	2,034,200	
ファーマライズホールディングス	800	611.00	488,800	
キッコーマン	11,800	6,520.00	76,936,000	
味の素	43,600	4,123.00	179,762,800	
ブルドックソース	800	1,905.00	1,524,000	
キューピー	9,700	2,248.00	21,805,600	
ハウス食品グループ本社	5,400	2,689.00	14,520,600	
カゴメ	8,400	3,030.00	25,452,000	
焼津水産化学工業	900	993.00	893,700	
アリアケジャパン	1,600	4,885.00	7,816,000	
ピエトロ	300	1,828.00	548,400	
エバラ食品工業	500	3,040.00	1,520,000	
やまみ	200	1,413.00	282,600	
ニチレイ	8,100	2,720.00	22,032,000	
横浜冷凍	5,100	997.00	5,084,700	
東洋水産	9,000	5,570.00	50,130,000	
イトアンドホールディングス	800	2,325.00	1,860,000	
大冷	100	1,894.00	189,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	1,021.00	1,021,000	
日清食品ホールディングス	6,300	11,380.00	71,694,000	
永谷園ホールディングス	900	2,095.00	1,885,500	
一正蒲鉾	800	706.00	564,800	
フジッコ	1,800	1,868.00	3,362,400	
ロック・フィールド	1,900	1,579.00	3,000,100	

日本たばこ産業	117,400	2,788.50	327,369,900	
ケンコーマヨネーズ	1,100	1,289.00	1,417,900	
わらべや日洋ホールディングス	1,300	1,885.00	2,450,500	
なとり	1,200	2,045.00	2,454,000	
イフジ産業	200	913.00	182,600	
ファーマフーズ	2,700	1,513.00	4,085,100	
北の達人コーポレーション	7,200	334.00	2,404,800	
ユーグレナ	11,000	958.00	10,538,000	
紀文食品	1,300	961.00	1,249,300	
ピクルスホールディングス	1,000	1,243.00	1,243,000	
スター・マイカ・ホールディングス	1,500	663.00	994,500	
SREホールディングス	900	3,470.00	3,123,000	
ADワークスグループ	3,800	163.00	619,400	
片倉工業	1,600	1,746.00	2,793,600	
グンゼ	1,300	4,365.00	5,674,500	
ヒューリック	41,500	1,083.00	44,944,500	
神栄	400	913.00	365,200	
ラサ商事	1,000	1,386.00	1,386,000	
アルペン	1,500	1,950.00	2,925,000	
ハブ	400	755.00	302,000	
ラクーンホールディングス	1,400	1,128.00	1,579,200	
クオールホールディングス	2,600	1,190.00	3,094,000	
アルコニックス	2,600	1,346.00	3,499,600	
神戸物産	14,800	3,610.00	53,428,000	
ソリトンシステムズ	1,000	1,013.00	1,013,000	
ジンズホールディングス	1,100	3,520.00	3,872,000	
ビックカメラ	12,900	1,181.00	15,234,900	
DCMホールディングス	11,800	1,193.00	14,077,400	
ペッパーフードサービス	2,800	172.00	481,600	
ハイパー	600	440.00	264,000	
MonotaRO	27,100	1,908.00	51,706,800	
東京一番フーズ	700	492.00	344,400	
DDホールディングス	1,000	774.00	774,000	
あいホールディングス	3,000	2,133.00	6,399,000	
ディーブイエックス	700	1,030.00	721,000	
きちりホールディングス	300	586.00	175,800	
アークランドサービスホールディングス	1,500	2,187.00	3,280,500	
J. フロント リテイリング	23,700	1,284.00	30,430,800	
ドトール・日レスホールディングス	3,500	1,879.00	6,576,500	
マツキヨココカラ&カンパニー	11,600	6,620.00	76,792,000	
ブロンコビリー	1,000	2,411.00	2,411,000	
ZOZO	12,600	3,075.00	38,745,000	
トレジャー・ファクトリー	600	2,414.00	1,448,400	
物語コーポレーション	1,000	7,130.00	7,130,000	
三越伊勢丹ホールディングス	32,200	1,411.00	45,434,200	
東洋紡	7,700	1,047.00	8,061,900	
ユニチカ	5,600	230.00	1,288,000	
富士紡ホールディングス	700	3,100.00	2,170,000	
日清紡ホールディングス	14,800	990.00	14,652,000	

倉敷紡績	1,300	2,447.00	3,181,100	
ダイワボウホールディングス	7,800	2,064.00	16,099,200	
シキボウ	1,000	1,018.00	1,018,000	
日東紡績	2,300	2,109.00	4,850,700	
トヨタ紡織	7,700	2,090.00	16,093,000	
マクニカホールディングス	4,700	3,540.00	16,638,000	
H a m e e	900	840.00	756,000	
マーケットエンタープライズ	200	1,028.00	205,600	
ラクト・ジャパン	700	1,992.00	1,394,400	
ウエルシアホールディングス	9,900	3,025.00	29,947,500	
クリエイトSDホールディングス	3,100	3,380.00	10,478,000	
グリムス	900	2,481.00	2,232,900	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,800	866.00	2,424,800	
八洲電機	1,500	1,119.00	1,678,500	
メディアスホールディングス	1,200	759.00	910,800	
レスターホールディングス	1,800	2,215.00	3,987,000	
ジュテックホールディングス	400	1,240.00	496,000	
丸善CHIホールディングス	2,400	350.00	840,000	
大光	1,100	660.00	726,000	
OCHIホールディングス	400	1,335.00	534,000	
TOKAIホールディングス	9,500	862.00	8,189,000	
黒谷	700	607.00	424,900	
ミサワ	500	615.00	307,500	
ティーライフ	200	1,281.00	256,200	
C o m i n i x	200	770.00	154,000	
エー・ピーホールディングス	800	777.00	621,600	
三洋貿易	2,000	1,139.00	2,278,000	
チムニー	400	1,158.00	463,200	
シュッピン	1,300	906.00	1,177,800	
ビューティガレージ	300	3,825.00	1,147,500	
オイシックス・ラ・大地	2,600	2,512.00	6,531,200	
ウイン・パートナーズ	1,500	1,057.00	1,585,500	
ネクステージ	4,300	3,175.00	13,652,500	
ジョイフル本田	5,600	1,766.00	9,889,600	
鳥貴族ホールディングス	700	2,049.00	1,434,300	
ホットランド	1,500	1,379.00	2,068,500	
すかいらくホールディングス	26,100	1,599.00	41,733,900	
SFPホールディングス	1,000	1,768.00	1,768,000	
綿半ホールディングス	1,500	1,416.00	2,124,000	
日本毛織	4,700	958.00	4,502,600	
ダイトウボウ	5,000	83.00	415,000	
トーア紡コーポレーション	1,400	354.00	495,600	
ダイドーリミテッド	2,700	276.00	745,200	
ヨシックスホールディングス	400	2,120.00	848,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	6,100	1,122.00	6,844,200	
三栄建築設計	800	1,493.00	1,194,400	
野村不動産ホールディングス	11,100	2,921.00	32,423,100	
三重交通グループホールディングス	4,200	499.00	2,095,800	
サムティ	2,800	2,046.00	5,728,800	

ディア・ライフ	2,600	619.00	1,609,400	
コーセーアールイー	500	743.00	371,500	
地主	1,300	1,901.00	2,471,300	
プレサンスコーポレーション	2,300	1,677.00	3,857,100	
フィル・カンパニー	500	1,072.00	536,000	
THEグローバル社	1,700	205.00	348,500	
ハウスコム	400	1,115.00	446,000	
JPMC	1,000	998.00	998,000	
サンセイランディック	300	818.00	245,400	
エストラスト	600	600.00	360,000	
フージャースホールディングス	2,600	827.00	2,150,200	
オープンハウスグループ	6,500	4,840.00	31,460,000	
東急不動産ホールディングス	53,500	639.00	34,186,500	
飯田グループホールディングス	15,600	2,199.00	34,304,400	
イーグランド	200	1,528.00	305,600	
ムゲンエステート	800	519.00	415,200	
帝国繊維	2,000	1,593.00	3,186,000	
日本コークス工業	17,800	88.00	1,566,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,000	977.00	977,000	
ミタチ産業	400	1,288.00	515,200	
BEENOS	1,000	2,503.00	2,503,000	
あさひ	1,700	1,363.00	2,317,100	
日本調剤	1,200	1,173.00	1,407,600	
コスモス薬品	1,900	12,630.00	23,997,000	
シップヘルスケアホールディングス	7,000	2,494.00	17,458,000	
トーエル	900	793.00	713,700	
ソフトクリエイトホールディングス	700	3,530.00	2,471,000	
セブン&アイ・ホールディングス	66,000	6,134.00	404,844,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	14,600	960.00	14,016,000	
明治電機工業	600	1,140.00	684,000	
ツルハホールディングス	4,000	9,490.00	37,960,000	
デリカフーズホールディングス	500	528.00	264,000	
スターティアホールディングス	600	1,041.00	624,600	
サンマルクホールディングス	1,600	1,788.00	2,860,800	
フェリシモ	400	1,000.00	400,000	
トリドールホールディングス	4,700	2,696.00	12,671,200	
帝人	17,400	1,449.00	25,212,600	
東レ	121,400	801.90	97,350,660	
クラレ	28,700	1,209.00	34,698,300	
旭化成	113,200	954.10	108,004,120	
TOKYO BASE	2,700	457.00	1,233,900	
稲葉製作所	1,100	1,406.00	1,546,600	
宮地エンジニアリンググループ	500	3,680.00	1,840,000	
トーカロ	5,100	1,239.00	6,318,900	
アルファCo	700	987.00	690,900	
SUMCO	35,500	1,873.00	66,491,500	
川田テクノロジーズ	400	3,520.00	1,408,000	
RS Technologies	1,200	3,550.00	4,260,000	
ジェイテックコーポレーション	300	2,774.00	832,200	

信和	1,200	742.00	890,400	
ビーロット	1,400	591.00	827,400	
ファーストブラザーズ	500	878.00	439,000	
A n d D oホールディングス	1,000	889.00	889,000	
シーアールイー	800	1,090.00	872,000	
プロパティエージェント	200	1,226.00	245,200	
ケイアイスター不動産	900	4,105.00	3,694,500	
アグレ都市デザイン	400	1,626.00	650,400	
グッドコムアセット	1,800	844.00	1,519,200	
ジェイ・エス・ビー	400	3,795.00	1,518,000	
ロードスターキャピタル	700	1,561.00	1,092,700	
テンポイノベーション	500	1,194.00	597,000	
グローバル・リンク・マネジメント	300	1,242.00	372,600	
フェイスネットワーク	200	1,706.00	341,200	
住江織物	400	1,909.00	763,600	
日本フェルト	600	414.00	248,400	
イチカワ	200	1,341.00	268,200	
エコナックホールディングス	4,500	91.00	409,500	
日東製網	100	1,526.00	152,600	
芦森工業	400	1,449.00	579,600	
アツギ	1,500	386.00	579,000	
ウイルプラスホールディングス	400	1,160.00	464,000	
JMホールディングス	1,400	1,872.00	2,620,800	
コメダホールディングス	4,600	2,360.00	10,856,000	
サツドラホールディングス	900	812.00	730,800	
アレンザホールディングス	1,500	1,015.00	1,522,500	
串カツ田中ホールディングス	500	1,603.00	801,500	
バロックジャパンリミテッド	1,400	839.00	1,174,600	
クスリのアオキホールディングス	1,700	7,100.00	12,070,000	
ダイニック	700	777.00	543,900	
共和レザー	700	507.00	354,900	
ピーバンドットコム	400	531.00	212,400	
力の源ホールディングス	900	1,392.00	1,252,800	
FOOD & LIFE COMPANIE	11,000	3,500.00	38,500,000	
アセンテック	1,000	521.00	521,000	
セーレン	3,600	2,519.00	9,068,400	
ソトー	400	797.00	318,800	
東海染工	300	1,077.00	323,100	
小松マテーレ	2,600	722.00	1,877,200	
ワコールホールディングス	3,500	2,335.00	8,172,500	
ホギメディカル	2,500	3,225.00	8,062,500	
クラウディアホールディングス	100	363.00	36,300	
T S Iホールディングス	6,700	568.00	3,805,600	
マツオカコーポレーション	400	1,387.00	554,800	
ワールド	2,300	1,336.00	3,072,800	
T I S	20,400	3,435.00	70,074,000	
J N Sホールディングス	800	339.00	271,200	
グリー	4,700	737.00	3,463,900	
GMOペパボ	300	1,850.00	555,000	

コーエーテクモホールディングス	11,300	2,370.00	26,781,000	
三菱総合研究所	900	5,180.00	4,662,000	
ボルテージ	900	317.00	285,300	
電算	200	1,860.00	372,000	
AGS	900	703.00	632,700	
ファインデックス	1,700	607.00	1,031,900	
ブレインパッド	1,700	654.00	1,111,800	
KL a b	3,700	394.00	1,457,800	
ポールトゥウィンホールディングス	3,000	851.00	2,553,000	
ネクソン	46,900	3,070.00	143,983,000	
アイスタイル	5,200	445.00	2,314,000	
エムアップホールディングス	2,400	1,097.00	2,632,800	
エイチーム	1,300	789.00	1,025,700	
エニグモ	2,200	613.00	1,348,600	
テクノスジャパン	1,500	592.00	888,000	
e n i s h	2,000	363.00	726,000	
コロプラ	6,900	597.00	4,119,300	
オルトプラス	2,400	184.00	441,600	
ブロードリーフ	10,300	439.00	4,521,700	
クロス・マーケティンググループ	1,200	639.00	766,800	
デジタルハーツホールディングス	900	1,535.00	1,381,500	
システム情報	1,500	804.00	1,206,000	
メディアドゥ	700	1,524.00	1,066,800	
じげん	5,800	412.00	2,389,600	
ブイキューブ	2,100	643.00	1,350,300	
エンカレッジ・テクノロジー	500	495.00	247,500	
サイバーリンクス	600	890.00	534,000	
ディー・エル・イー	2,200	251.00	552,200	
フィックスターズ	2,100	1,392.00	2,923,200	
CARTA HOLDINGS	800	1,452.00	1,161,600	
オプティム	1,400	976.00	1,366,400	
セレス	800	1,108.00	886,400	
SHIFT	1,300	22,550.00	29,315,000	
特種東海製紙	800	2,947.00	2,357,600	
ティーガイア	1,800	1,650.00	2,970,000	
セック	200	3,475.00	695,000	
テクマトリックス	3,300	1,511.00	4,986,300	
プロシップ	700	1,404.00	982,800	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	5,500	2,328.00	12,804,000	
GMOペイメントゲートウェイ	4,100	11,370.00	46,617,000	
ザッパラス	200	343.00	68,600	
システムリサーチ	600	2,207.00	1,324,200	
インターネットイニシアティブ	10,100	2,677.00	27,037,700	
さくらインターネット	2,200	585.00	1,287,000	
ヴィンクス	600	1,382.00	829,200	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	3,965.00	1,982,500	
SRAホールディングス	1,000	3,025.00	3,025,000	
システムインテグレータ	800	422.00	337,600	
朝日ネット	1,800	586.00	1,054,800	

e B A S E	2,400	662.00	1,588,800	
アバントグループ	2,200	1,353.00	2,976,600	
アドソル日進	700	1,459.00	1,021,300	
ODKソリューションズ	600	595.00	357,000	
フリービット	1,000	1,135.00	1,135,000	
コムチュア	2,300	2,224.00	5,115,200	
サイバーコム	200	1,417.00	283,400	
アステリア	1,500	735.00	1,102,500	
アイル	1,100	1,912.00	2,103,200	
王子ホールディングス	75,400	538.00	40,565,200	
日本製紙	9,300	1,007.00	9,365,100	
三菱製紙	2,700	299.00	807,300	
北越コーポレーション	11,700	786.00	9,196,200	
中越パルプ工業	700	972.00	680,400	
巴川製紙所	600	682.00	409,200	
大王製紙	7,900	1,077.00	8,508,300	
阿波製紙	300	770.00	231,000	
マークライNZ	1,000	2,641.00	2,641,000	
メディカル・データ・ビジョン	2,600	902.00	2,345,200	
g u m i	2,800	862.00	2,413,600	
ショーケース	600	325.00	195,000	
モバイルファクトリー	400	913.00	365,200	
テラスカイ	700	1,955.00	1,368,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	900	1,640.00	1,476,000	
P C Iホールディングス	800	1,008.00	806,400	
アイビーシー	800	403.00	322,400	
ネオジャパン	700	956.00	669,200	
P R T I M E S	600	1,835.00	1,101,000	
ラクス	8,500	1,736.00	14,756,000	
ランドコンピュータ	600	1,000.00	600,000	
ダブルスタンダード	800	2,015.00	1,612,000	
オープンドア	1,200	1,607.00	1,928,400	
マイネット	900	352.00	316,800	
アカツキ	900	2,160.00	1,944,000	
ベネフィットジャパン	200	1,198.00	239,600	
U b i c o mホールディングス	500	1,924.00	962,000	
カナミックネットワーク	2,200	525.00	1,155,000	
ノムラシステムコーポレーション	2,400	114.00	273,600	
レンゴー	16,800	903.00	15,170,400	
トーモク	1,200	1,534.00	1,840,800	
ザ・パック	1,300	2,894.00	3,762,200	
チェンジ	4,400	2,665.00	11,726,000	
シンクロ・フード	800	509.00	407,200	
オークネット	900	1,764.00	1,587,600	
キャピタル・アセット・プランニング	500	603.00	301,500	
セグエグループ	600	776.00	465,600	
エイトレッド	400	1,492.00	596,800	
マクロミル	3,500	1,027.00	3,594,500	
ビーグリー	500	1,254.00	627,000	

オロ	600	1,756.00	1,053,600	
ユーザーローカル	600	1,691.00	1,014,600	
テモナ	500	299.00	149,500	
ニーズウェル	500	886.00	443,000	
マネーフォワード	4,400	4,840.00	21,296,000	
サインポスト	600	582.00	349,200	
レゾナック・ホールディングス	17,500	2,309.00	40,407,500	
住友化学	134,400	477.00	64,108,800	
住友精化	800	4,215.00	3,372,000	
日産化学	8,600	5,890.00	50,654,000	
ラサ工業	700	2,106.00	1,474,200	
クレハ	1,500	8,300.00	12,450,000	
多木化学	700	4,330.00	3,031,000	
テイカ	1,400	1,173.00	1,642,200	
石原産業	3,500	1,065.00	3,727,500	
片倉コープアグリ	300	1,870.00	561,000	
日本曹達	2,000	4,510.00	9,020,000	
東ソー	24,200	1,786.00	43,221,200	
トクヤマ	6,000	2,116.00	12,696,000	
セントラル硝子	3,000	2,908.00	8,724,000	
東亜合成	9,300	1,225.00	11,392,500	
大阪ソーダ	1,100	4,215.00	4,636,500	
関東電化工業	3,800	1,015.00	3,857,000	
Sun Asterisk	900	1,233.00	1,109,700	
デンカ	6,700	2,944.00	19,724,800	
イビデン	10,500	4,490.00	47,145,000	
信越化学工業	30,600	19,210.00	587,826,000	
日本カーバイド工業	500	1,308.00	654,000	
電算システムホールディングス	800	2,507.00	2,005,600	
堺化学工業	1,400	1,801.00	2,521,400	
第一稀元素化学工業	1,900	1,022.00	1,941,800	
エア・ウォーター	17,100	1,620.00	27,702,000	
日本酸素ホールディングス	17,600	2,363.00	41,588,800	
日本化学工業	600	1,977.00	1,186,200	
東邦アセチレン	300	1,258.00	377,400	
日本パーカライジング	8,900	947.00	8,428,300	
高圧ガス工業	2,500	662.00	1,655,000	
チタン工業	200	1,452.00	290,400	
四国化成ホールディングス	2,100	1,283.00	2,694,300	
戸田工業	400	2,514.00	1,005,600	
ステラ ケミファ	1,000	2,518.00	2,518,000	
保土谷化学工業	600	3,120.00	1,872,000	
日本触媒	2,800	5,720.00	16,016,000	
大日精化工業	1,200	1,782.00	2,138,400	
カネカ	4,200	3,445.00	14,469,000	
協和キリン	21,900	2,943.00	64,451,700	
Appier Group	5,100	1,710.00	8,721,000	
三菱瓦斯化学	13,500	1,940.00	26,190,000	
三井化学	14,900	3,250.00	48,425,000	

J S R	16,900	3,105.00	52,474,500	
東京応化工業	3,200	7,240.00	23,168,000	
大阪有機化学工業	1,300	2,000.00	2,600,000	
三菱ケミカルグループ	122,300	812.50	99,368,750	
KHネオケム	3,000	2,625.00	7,875,000	
ダイセル	26,600	938.00	24,950,800	
住友ベークライト	2,700	4,480.00	12,096,000	
積水化学工業	37,100	1,811.00	67,188,100	
日本ゼオン	11,000	1,285.00	14,135,000	
アイカ工業	4,500	3,030.00	13,635,000	
U B E	9,500	2,069.00	19,655,500	
積水樹脂	2,700	1,933.00	5,219,100	
タキロンシーアイ	4,500	497.00	2,236,500	
旭有機材	1,200	2,835.00	3,402,000	
ニチバン	1,200	1,806.00	2,167,200	
リケンテクノス	3,700	553.00	2,046,100	
大倉工業	800	1,890.00	1,512,000	
積水化成品工業	2,600	390.00	1,014,000	
群栄化学工業	400	2,492.00	996,800	
タイガースポリマー	900	421.00	378,900	
ミライアル	400	1,570.00	628,000	
ダイキアクシス	700	681.00	476,700	
ダイキョーニシカワ	4,300	635.00	2,730,500	
竹本容器	700	837.00	585,900	
森六ホールディングス	900	1,828.00	1,645,200	
恵和	1,200	1,544.00	1,852,800	
日本化薬	13,800	1,193.00	16,463,400	
カーリットホールディングス	1,900	724.00	1,375,600	
ソルクシーズ	1,600	360.00	576,000	
C Lホールディングス	600	802.00	481,200	
プレステージ・インターナショナル	7,600	675.00	5,130,000	
フェイス	900	506.00	455,400	
プロトコーポレーション	2,200	1,246.00	2,741,200	
ハイマックス	500	1,422.00	711,000	
アミューズ	1,100	1,765.00	1,941,500	
野村総合研究所	37,200	2,952.00	109,814,400	
ドリームインキュベータ	600	2,808.00	1,684,800	
サイバネットシステム	1,400	980.00	1,372,000	
クイック	1,300	1,834.00	2,384,200	
T A C	300	204.00	61,200	
C Eホールディングス	1,000	563.00	563,000	
日本システム技術	600	1,715.00	1,029,000	
電通グループ	18,300	4,360.00	79,788,000	
インテージホールディングス	2,000	1,680.00	3,360,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,475.00	737,500	
東邦システムサイエンス	700	1,095.00	766,500	
びあ	700	3,115.00	2,180,500	
イオンファンタジー	800	2,845.00	2,276,000	
ソースネクスト	8,800	234.00	2,059,200	

シーティーエス	2,300	787.00	1,810,100	
ネクシィーズグループ	900	657.00	591,300	
インフォコム	2,300	2,361.00	5,430,300	
メディカルシステムネットワーク	1,400	400.00	560,000	
日本精化	1,000	2,468.00	2,468,000	
扶桑化学工業	1,700	3,645.00	6,196,500	
トリケミカル研究所	2,100	2,313.00	4,857,300	
シンプレクス・ホールディングス	3,000	2,360.00	7,080,000	
HEROZ	500	1,071.00	535,500	
ラクスル	4,800	1,354.00	6,499,200	
メルカリ	8,300	2,544.00	21,115,200	
I P S	600	2,625.00	1,575,000	
F I G	1,600	305.00	488,000	
システムサポート	600	1,751.00	1,050,600	
ADEKA	6,400	2,128.00	13,619,200	
日油	5,600	5,900.00	33,040,000	
ミヨシ油脂	600	953.00	571,800	
新日本理化	2,800	214.00	599,200	
ハリマ化成グループ	1,400	886.00	1,240,400	
イーソル	1,200	723.00	867,600	
アルテリア・ネットワークス	1,600	1,288.00	2,060,800	
東海ソフト	100	907.00	90,700	
ウイングアーク1st	1,800	1,819.00	3,274,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	600	1,568.00	940,800	
サーバーワークス	300	2,322.00	696,600	
東名	200	2,450.00	490,000	
ヴィッツ	200	916.00	183,200	
トビラシステムズ	500	864.00	432,000	
S a n s a n	5,900	1,520.00	8,968,000	
L i n k - U	600	971.00	582,600	
ギフトィ	1,800	2,566.00	4,618,800	
花王	44,200	5,116.00	226,127,200	
第一工業製薬	700	1,950.00	1,365,000	
石原ケミカル	1,000	1,309.00	1,309,000	
日華化学	700	846.00	592,200	
ニイタカ	400	2,069.00	827,600	
三洋化成工業	1,100	4,280.00	4,708,000	
メドレー	1,800	4,335.00	7,803,000	
ベース	600	4,720.00	2,832,000	
J M D C	3,000	4,280.00	12,840,000	
武田薬品工業	160,700	4,263.00	685,064,100	
アステラス製薬	174,000	1,886.00	328,164,000	
住友ファーマ	13,200	868.00	11,457,600	
塩野義製薬	23,200	6,160.00	142,912,000	
わかもと製薬	2,200	225.00	495,000	
日本新薬	4,300	6,310.00	27,133,000	
中外製薬	56,800	3,570.00	202,776,000	
科研製薬	3,100	3,640.00	11,284,000	
エーザイ	22,100	7,811.00	172,623,100	

理研ビタミン	1,500	2,034.00	3,051,000	
ロート製薬	17,600	2,582.00	45,443,200	
小野薬品工業	35,000	2,851.00	99,785,000	
久光製薬	4,000	3,915.00	15,660,000	
有機合成薬品工業	1,300	291.00	378,300	
持田製薬	2,200	3,420.00	7,524,000	
参天製薬	34,100	1,006.00	34,304,600	
扶桑薬品工業	700	1,954.00	1,367,800	
日本ケミファ	100	1,743.00	174,300	
ツムラ	5,700	2,630.00	14,991,000	
日医工	6,400	47.00	300,800	
テルモ	56,600	3,705.00	209,703,000	
H. U. グループホールディングス	5,400	2,687.00	14,509,800	
キッセイ薬品工業	2,900	2,519.00	7,305,100	
生化学工業	3,700	817.00	3,022,900	
栄研化学	2,900	1,566.00	4,541,400	
鳥居薬品	1,000	3,255.00	3,255,000	
JCRファーマ	6,000	1,557.00	9,342,000	
東和薬品	2,800	1,908.00	5,342,400	
富士製薬工業	1,200	1,056.00	1,267,200	
ゼリア新薬工業	2,500	2,197.00	5,492,500	
第一三共	158,200	4,277.00	676,621,400	
キョーリン製薬ホールディングス	4,100	1,690.00	6,929,000	
大幸薬品	3,200	425.00	1,360,000	
ダイト	1,200	2,437.00	2,924,400	
大塚ホールディングス	41,500	4,164.00	172,806,000	
大正製薬ホールディングス	4,000	5,430.00	21,720,000	
ペプチドリーム	8,700	1,875.00	16,312,500	
大日本塗料	2,400	840.00	2,016,000	
日本ペイントホールディングス	80,200	1,257.00	100,811,400	
関西ペイント	16,600	1,845.00	30,627,000	
神東塗料	2,000	127.00	254,000	
中国塗料	2,900	1,087.00	3,152,300	
日本特殊塗料	900	920.00	828,000	
藤倉化成	2,500	434.00	1,085,000	
太陽ホールディングス	2,800	2,361.00	6,610,800	
DIC	7,200	2,429.00	17,488,800	
サカタインクス	3,600	1,023.00	3,682,800	
東洋インキSCホールディングス	3,500	1,895.00	6,632,500	
T&K TOKA	1,600	1,272.00	2,035,200	
アルプス技研	1,600	2,398.00	3,836,800	
サニックス	2,300	259.00	595,700	
日本空調サービス	2,100	721.00	1,514,100	
オリエンタルランド	19,700	21,475.00	423,057,500	
フォーカスシステムズ	1,300	1,007.00	1,309,100	
ダスキン	4,100	3,120.00	12,792,000	
パーク24	13,900	2,028.00	28,189,200	
明光ネットワークジャパン	2,300	621.00	1,428,300	
ファルコホールディングス	900	1,964.00	1,767,600	

クレスコ	1,500	1,743.00	2,614,500	
フジ・メディア・ホールディングス	17,400	1,112.00	19,348,800	
秀英予備校	1,000	424.00	424,000	
田谷	800	527.00	421,600	
ラウンドワン	15,900	480.00	7,632,000	
リゾートトラスト	7,300	2,144.00	15,651,200	
オービック	6,100	20,070.00	122,427,000	
ジャストシステム	2,700	3,445.00	9,301,500	
TDCソフト	1,700	1,509.00	2,565,300	
Zホールディングス	258,300	383.00	98,928,900	
ビー・エム・エル	2,300	3,165.00	7,279,500	
トレンドマイクロ	10,500	6,500.00	68,250,000	
りらいあコミュニケーションズ	3,000	1,452.00	4,356,000	
IDホールディングス	1,300	1,003.00	1,303,900	
リソー教育	9,200	354.00	3,256,800	
日本オラクル	3,500	9,350.00	32,725,000	
早稲田アカデミー	1,200	1,207.00	1,448,400	
アルファシステムズ	500	4,235.00	2,117,500	
フューチャー	4,400	1,783.00	7,845,200	
CAC Holdings	1,200	1,612.00	1,934,400	
SBテクノロジー	900	1,972.00	1,774,800	
トーセ	700	756.00	529,200	
ユー・エス・エス	19,100	2,232.00	42,631,200	
オービックビジネスコンサルタント	3,600	4,765.00	17,154,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	9,700	3,060.00	29,682,000	
アイティフォー	2,500	865.00	2,162,500	
東京個別指導学院	1,700	531.00	902,700	
東計電算	200	5,940.00	1,188,000	
サイバーエージェント	44,500	1,200.00	53,400,000	
楽天グループ	86,000	691.00	59,426,000	
エクスネット	500	1,015.00	507,500	
クリーク・アンド・リバー社	1,000	2,268.00	2,268,000	
モーニングスター	3,500	489.00	1,711,500	
テー・オー・ダブリュー	3,300	306.00	1,009,800	
大塚商会	10,300	4,585.00	47,225,500	
サイボウズ	2,400	2,625.00	6,300,000	
山田コンサルティンググループ	1,000	1,536.00	1,536,000	
セントラルスポーツ	700	2,466.00	1,726,200	
バラカ	600	1,949.00	1,169,400	
電通国際情報サービス	2,200	4,890.00	10,758,000	
ACCESS	2,300	990.00	2,277,000	
デジタルガレージ	3,200	4,545.00	14,544,000	
EMシステムズ	3,000	869.00	2,607,000	
ウェザーニューズ	600	6,780.00	4,068,000	
C I J	1,600	1,033.00	1,652,800	
ビジネスエンジニアリング	300	2,725.00	817,500	
日本エンタープライズ	4,000	138.00	552,000	
WOWOW	900	1,251.00	1,125,900	
スカラ	1,700	725.00	1,232,500	

インテリジェント ウェイブ	1,000	714.00	714,000	
フルキャストホールディングス	1,700	2,500.00	4,250,000	
エン・ジャパン	3,400	2,409.00	8,190,600	
あすか製薬ホールディングス	1,800	1,183.00	2,129,400	
サワイグループホールディングス	4,200	3,790.00	15,918,000	
富士フイルムホールディングス	34,800	6,419.00	223,381,200	
コニカミノルタ	40,700	602.00	24,501,400	
資生堂	37,900	6,153.00	233,198,700	
ライオン	21,700	1,476.00	32,029,200	
高砂香料工業	1,200	2,503.00	3,003,600	
マンダム	4,000	1,434.00	5,736,000	
ミルボン	2,700	5,820.00	15,714,000	
ファンケル	7,900	2,561.00	20,231,900	
コーセー	3,700	15,730.00	58,201,000	
コタ	1,500	1,670.00	2,505,000	
シーボン	100	1,600.00	160,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	9,400	1,760.00	16,544,000	
ノエビアホールディングス	1,600	5,560.00	8,896,000	
アジュバンホールディングス	300	1,010.00	303,000	
新日本製薬	900	1,424.00	1,281,600	
エステー	1,300	1,548.00	2,012,400	
アグロ カネショウ	700	1,530.00	1,071,000	
コニシ	3,100	1,777.00	5,508,700	
長谷川香料	3,700	2,935.00	10,859,500	
星光PMC	1,100	540.00	594,000	
小林製薬	5,300	8,320.00	44,096,000	
荒川化学工業	1,600	984.00	1,574,400	
メック	1,500	2,219.00	3,328,500	
日本高純度化学	500	2,454.00	1,227,000	
タカラバイオ	4,800	1,772.00	8,505,600	
JCU	2,100	3,065.00	6,436,500	
新田ゼラチン	1,200	813.00	975,600	
OATアグリオ	600	1,442.00	865,200	
デクセリアルズ	5,200	2,708.00	14,081,600	
アース製薬	1,600	4,860.00	7,776,000	
北興化学工業	1,900	823.00	1,563,700	
大成ラミック	600	2,897.00	1,738,200	
クミアイ化学工業	7,100	872.00	6,191,200	
日本農薬	3,200	696.00	2,227,200	
富士興産	500	1,244.00	622,000	
ニチレキ	2,300	1,386.00	3,187,800	
ユシロ化学工業	1,000	828.00	828,000	
ビーピー・カストロール	700	898.00	628,600	
富士石油	3,300	252.00	831,600	
MORESCO	700	1,218.00	852,600	
出光興産	20,100	3,075.00	61,807,500	
ENEOSホールディングス	328,000	462.60	151,732,800	
コスモエネルギーホールディングス	7,100	3,910.00	27,761,000	
テスホールディングス	1,800	1,076.00	1,936,800	

インフロニア・ホールディングス	18,900	1,037.00	19,599,300	
横浜ゴム	10,300	2,441.00	25,142,300	
TOYO TIRE	10,400	1,599.00	16,629,600	
ブリヂストン	58,000	5,222.00	302,876,000	
住友ゴム工業	17,700	1,230.00	21,771,000	
藤倉コンポジット	1,000	979.00	979,000	
オカモト	1,000	3,910.00	3,910,000	
WOW WORLD GROUP	400	1,497.00	598,800	
アキレス	1,300	1,244.00	1,617,200	
フコク	900	1,049.00	944,100	
ニッタ	1,900	2,929.00	5,565,100	
クリエートメディック	600	885.00	531,000	
住友理工	3,400	710.00	2,414,000	
三ツ星ベルト	2,600	3,870.00	10,062,000	
バンドー化学	2,800	1,015.00	2,842,000	
AGC	18,500	4,980.00	92,130,000	
日本板硝子	9,100	696.00	6,333,600	
石塚硝子	200	1,445.00	289,000	
有沢製作所	3,000	1,400.00	4,200,000	
日本山村硝子	700	639.00	447,300	
日本電気硝子	7,400	2,489.00	18,418,600	
オハラ	800	1,195.00	956,000	
住友大阪セメント	2,500	3,830.00	9,575,000	
太平洋セメント	11,500	2,460.00	28,290,000	
リソルホールディングス	200	4,920.00	984,000	
日本ヒューム	1,900	664.00	1,261,600	
日本コンクリート工業	3,900	232.00	904,800	
三谷セキサン	800	4,395.00	3,516,000	
アジアパイルホールディングス	3,100	635.00	1,968,500	
東海カーボン	15,100	1,298.00	19,599,800	
日本カーボン	1,100	4,160.00	4,576,000	
東洋炭素	1,100	4,270.00	4,697,000	
ノリタケカンパニーリミテド	900	4,470.00	4,023,000	
TOTO	12,000	4,570.00	54,840,000	
日本碍子	21,400	1,794.00	38,391,600	
日本特殊陶業	13,800	2,736.00	37,756,800	
ダントーホールディングス	1,200	401.00	481,200	
MARUWA	700	17,360.00	12,152,000	
品川リフラクトリーズ	500	4,300.00	2,150,000	
黒崎播磨	400	6,590.00	2,636,000	
ヨータイ	1,300	1,495.00	1,943,500	
東京窯業	2,000	309.00	618,000	
ニッカトー	800	574.00	459,200	
フジミインコーポレーテッド	1,400	6,360.00	8,904,000	
クニミネ工業	600	881.00	528,600	
エーアンドエーマテリアル	300	923.00	276,900	
ニチアス	4,600	2,589.00	11,909,400	
日本製鉄	83,600	3,097.00	258,909,200	
神戸製鋼所	37,400	890.00	33,286,000	

中山製鋼所	3,100	1,069.00	3,313,900	
合同製鐵	900	3,415.00	3,073,500	
JFEホールディングス	49,900	1,745.00	87,075,500	
東京製鐵	5,200	1,494.00	7,768,800	
共英製鋼	2,300	1,550.00	3,565,000	
大和工業	3,100	5,270.00	16,337,000	
東京鐵鋼	800	1,794.00	1,435,200	
大阪製鐵	800	1,325.00	1,060,000	
淀川製鋼所	2,100	2,639.00	5,541,900	
中部鋼鉄	1,500	1,958.00	2,937,000	
丸一鋼管	5,700	2,823.00	16,091,100	
モリ工業	400	3,045.00	1,218,000	
大同特殊鋼	2,400	5,310.00	12,744,000	
日本高周波鋼業	1,400	343.00	480,200	
日本冶金工業	1,400	4,485.00	6,279,000	
山陽特殊製鋼	1,800	2,658.00	4,784,400	
愛知製鋼	1,200	2,320.00	2,784,000	
日本金属	500	938.00	469,000	
大平洋金属	1,300	1,987.00	2,583,100	
新日本電工	11,800	374.00	4,413,200	
栗本鐵工所	900	2,019.00	1,817,100	
虹技	500	1,011.00	505,500	
日本鑄鉄管	300	974.00	292,200	
日本製鋼所	5,100	2,625.00	13,387,500	
三菱製鋼	1,300	1,230.00	1,599,000	
日亜鋼業	2,400	274.00	657,600	
日本精線	300	4,635.00	1,390,500	
エンビプロ・ホールディングス	1,400	720.00	1,008,000	
大紀アルミニウム工業所	2,600	1,416.00	3,681,600	
日本軽金属ホールディングス	5,000	1,448.00	7,240,000	
三井金属鉱業	5,500	3,385.00	18,617,500	
東邦亜鉛	1,100	2,084.00	2,292,400	
三菱マテリアル	12,400	2,142.00	26,560,800	
住友金属鉱山	21,600	5,203.00	112,384,800	
DOWAホールディングス	4,200	4,515.00	18,963,000	
古河機械金属	2,900	1,378.00	3,996,200	
エス・サイエンス	19,300	25.00	482,500	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,800	3,065.00	8,582,000	
東邦チタニウム	3,300	2,129.00	7,025,700	
UACJ	2,600	2,508.00	6,520,800	
CKサンエツ	400	4,215.00	1,686,000	
古河電気工業	6,200	2,427.00	15,047,400	
住友電気工業	64,500	1,669.50	107,682,750	
フジクラ	20,300	966.00	19,609,800	
昭和電線ホールディングス	1,800	1,903.00	3,425,400	
タツタ電線	3,600	711.00	2,559,600	
カナレ電気	400	1,303.00	521,200	
平河ヒューテック	1,100	1,373.00	1,510,300	
いよぎんホールディングス	21,500	811.00	17,436,500	

しずおかフィナンシャルグループ	40,200	1,109.00	44,581,800	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	14,900	966.00	14,393,400	
リョービ	1,900	1,451.00	2,756,900	
アーレスティ	1,800	549.00	988,200	
アサヒホールディングス	7,700	1,972.00	15,184,400	
東洋製罐グループホールディングス	12,300	1,738.00	21,377,400	
ホッカホホールディングス	1,100	1,345.00	1,479,500	
コロナ	1,100	915.00	1,006,500	
横浜ブリッジホールディングス	2,600	2,029.00	5,275,400	
駒井ハルテック	300	1,689.00	506,700	
高田機工	100	2,679.00	267,900	
三和ホールディングス	17,100	1,418.00	24,247,800	
文化シヤッター	5,300	1,145.00	6,068,500	
三協立山	2,600	648.00	1,684,800	
アルインコ	1,400	1,065.00	1,491,000	
東洋シヤッター	600	515.00	309,000	
L I X I L	27,200	2,138.00	58,153,600	
日本ファイルコン	1,200	454.00	544,800	
ノーリツ	2,700	1,584.00	4,276,800	
長府製作所	1,800	2,101.00	3,781,800	
リンナイ	3,400	9,690.00	32,946,000	
ユニプレス	3,200	761.00	2,435,200	
ダイニチ工業	700	677.00	473,900	
日東精工	2,500	512.00	1,280,000	
三洋工業	100	1,919.00	191,900	
岡部	2,900	718.00	2,082,200	
ジーテクト	2,100	1,399.00	2,937,900	
東プレ	3,200	1,192.00	3,814,400	
高周波熱錬	3,400	671.00	2,281,400	
東京製綱	1,200	1,235.00	1,482,000	
サンコール	1,300	620.00	806,000	
モリテック スチール	900	331.00	297,900	
パイオラックス	2,500	1,929.00	4,822,500	
エイチワン	1,900	623.00	1,183,700	
日本発條	16,400	898.00	14,727,200	
中央発條	1,000	706.00	706,000	
アドバネクス	200	1,086.00	217,200	
三浦工業	7,600	3,340.00	25,384,000	
タクマ	5,600	1,384.00	7,750,400	
テクノプロ・ホールディングス	11,000	3,470.00	38,170,000	
アトラグループ	700	183.00	128,100	
インターワークス	700	372.00	260,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	900	1,989.00	1,790,100	
Ke e P e r 技研	1,100	3,565.00	3,921,500	
ファーストロジック	400	874.00	349,600	
三機サービス	300	912.00	273,600	
G u n o s y	1,100	652.00	717,200	
デザインワン・ジャパン	600	193.00	115,800	
イー・ガーディアン	800	2,381.00	1,904,800	

リブセンス	500	264.00	132,000	
ジャパンマテリアル	5,700	2,363.00	13,469,100	
ベクトル	2,800	1,360.00	3,808,000	
ウチヤマホールディングス	1,300	269.00	349,700	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,500	1,109.00	1,663,500	
キャリアリンク	700	2,530.00	1,771,000	
I B J	1,000	848.00	848,000	
アサンテ	900	1,644.00	1,479,600	
バリューHR	1,600	1,590.00	2,544,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,700	4,535.00	7,709,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	800	1,121.00	896,800	
E R Iホールディングス	500	1,473.00	736,500	
アビスト	200	2,966.00	593,200	
シグマクシス・ホールディングス	2,400	1,102.00	2,644,800	
ウィルグループ	1,500	1,123.00	1,684,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,800	152.00	273,600	
メドピア	1,500	1,369.00	2,053,500	
レアジョブ	600	999.00	599,400	
リクルートホールディングス	137,800	3,809.00	524,880,200	
エラン	2,400	1,067.00	2,560,800	
ツガミ	4,000	1,468.00	5,872,000	
オークマ	1,800	5,240.00	9,432,000	
芝浦機械	1,800	2,899.00	5,218,200	
アマダ	29,100	1,199.00	34,890,900	
アイダエンジニアリング	3,800	790.00	3,002,000	
TAKI SAWA	600	1,117.00	670,200	
FUJ I	7,900	2,055.00	16,234,500	
牧野フライス製作所	2,000	4,770.00	9,540,000	
オーエスジー	8,700	1,928.00	16,773,600	
ダイジェット工業	400	830.00	332,000	
旭ダイヤモンド工業	5,400	765.00	4,131,000	
DMG森精機	11,000	2,154.00	23,694,000	
ソディック	4,600	740.00	3,404,000	
ディスコ	2,900	40,000.00	116,000,000	
日東工器	800	1,705.00	1,364,000	
日進工具	1,600	1,069.00	1,710,400	
パンチ工業	1,700	447.00	759,900	
富士ダイス	1,000	585.00	585,000	
土木管理総合試験所	1,200	307.00	368,400	
日本郵政	244,000	1,219.50	297,558,000	
ベルシステム24ホールディングス	2,400	1,478.00	3,547,200	
鎌倉新書	2,200	1,091.00	2,400,200	
SMN	400	458.00	183,200	
一蔵	400	496.00	198,400	
グローバルキッズCOMPANY	400	793.00	317,200	
エアトリ	1,300	2,551.00	3,316,300	
アトラエ	1,400	995.00	1,393,000	
ストライク	800	4,080.00	3,264,000	
ソラスト	5,000	679.00	3,395,000	

セラク	600	1,443.00	865,800	
インソース	4,600	1,309.00	6,021,400	
豊田自動織機	13,200	7,730.00	102,036,000	
豊和工業	1,000	988.00	988,000	
ニデックオーケーケー	500	886.00	443,000	
石川製作所	500	1,469.00	734,500	
東洋機械金属	900	564.00	507,600	
津田駒工業	800	516.00	412,800	
エンシュウ	400	711.00	284,400	
島精機製作所	2,900	1,851.00	5,367,900	
オプトラン	2,600	2,100.00	5,460,000	
NCホールディングス	300	1,926.00	577,800	
イワキポンプ	1,300	1,281.00	1,665,300	
フリュー	1,800	1,216.00	2,188,800	
ヤマシンフィルタ	3,800	405.00	1,539,000	
日阪製作所	1,700	929.00	1,579,300	
やまびこ	2,900	1,275.00	3,697,500	
野村マイクロ・サイエンス	600	4,375.00	2,625,000	
平田機工	900	6,470.00	5,823,000	
ペガサスミシン製造	2,100	672.00	1,411,200	
マルマエ	800	1,896.00	1,516,800	
タツモ	1,000	1,674.00	1,674,000	
ナブテスコ	11,500	3,525.00	40,537,500	
三井海洋開発	2,200	1,528.00	3,361,600	
レオン自動機	2,200	1,212.00	2,666,400	
SMC	5,900	66,940.00	394,946,000	
ホソカワミクロン	1,400	2,630.00	3,682,000	
ユニオンツール	800	3,235.00	2,588,000	
オイレス工業	2,500	1,625.00	4,062,500	
日精エー・エス・ビー機械	800	4,340.00	3,472,000	
サトーホールディングス	2,600	2,309.00	6,003,400	
技研製作所	1,900	2,802.00	5,323,800	
日本エアージェット	900	1,095.00	985,500	
カワタ	800	852.00	681,600	
日精樹脂工業	1,400	972.00	1,360,800	
オカダアイオン	600	1,598.00	958,800	
ワイエイシイホールディングス	800	2,300.00	1,840,000	
小松製作所	85,700	3,307.00	283,409,900	
住友重機械工業	10,800	2,946.00	31,816,800	
日立建機	7,300	3,115.00	22,739,500	
日工	2,800	627.00	1,755,600	
巴工業	800	2,427.00	1,941,600	
井関農機	1,800	1,182.00	2,127,600	
TOWA	1,800	1,831.00	3,295,800	
丸山製作所	400	1,730.00	692,000	
北川鉄工所	900	1,104.00	993,600	
シンニッタン	2,400	259.00	621,600	
ローツェ	900	10,270.00	9,243,000	
タカキタ	200	444.00	88,800	

クボタ	96,800	2,086.00	201,924,800	
荏原実業	800	2,924.00	2,339,200	
東洋エンジニアリング	2,700	584.00	1,576,800	
三菱化工機	600	2,221.00	1,332,600	
月島機械	2,600	1,116.00	2,901,600	
帝国電機製作所	1,400	2,594.00	3,631,600	
東京機械製作所	300	556.00	166,800	
新東工業	3,500	754.00	2,639,000	
澁谷工業	1,800	2,408.00	4,334,400	
アイチ コーポレーション	2,500	777.00	1,942,500	
小森コーポレーション	4,300	871.00	3,745,300	
鶴見製作所	1,300	1,983.00	2,577,900	
日本ギア工業	1,200	487.00	584,400	
酒井重工業	200	3,790.00	758,000	
荏原製作所	7,500	5,590.00	41,925,000	
石井鐵工所	300	2,319.00	695,700	
西島製作所	1,500	1,535.00	2,302,500	
北越工業	1,900	1,385.00	2,631,500	
ダイキン工業	21,800	23,350.00	509,030,000	
オルガノ	2,400	3,380.00	8,112,000	
トーヨーカネツ	800	2,638.00	2,110,400	
栗田工業	10,200	6,030.00	61,506,000	
椿本チエイン	2,600	3,095.00	8,047,000	
大同工業	900	751.00	675,900	
日機装	4,500	944.00	4,248,000	
木村化工機	1,700	735.00	1,249,500	
レイズネクスト	2,600	1,348.00	3,504,800	
アネスト岩田	3,300	911.00	3,006,300	
ダイフク	9,400	7,240.00	68,056,000	
サムコ	500	3,485.00	1,742,500	
加藤製作所	900	874.00	786,600	
油研工業	200	2,017.00	403,400	
タダノ	9,700	1,003.00	9,729,100	
フジテック	6,700	3,215.00	21,540,500	
CKD	5,200	2,011.00	10,457,200	
平和	6,000	2,474.00	14,844,000	
理想科学工業	1,600	2,382.00	3,811,200	
SANKYO	3,600	5,570.00	20,052,000	
日本金銭機械	2,100	1,252.00	2,629,200	
マースグループホールディングス	1,000	2,481.00	2,481,000	
フクシマガリレイ	1,400	4,270.00	5,978,000	
オーイズミ	900	477.00	429,300	
ダイコク電機	900	2,676.00	2,408,400	
竹内製作所	3,200	2,966.00	9,491,200	
アマノ	5,300	2,492.00	13,207,600	
JUKI	2,900	634.00	1,838,600	
サンデン	1,900	224.00	425,600	
ジャノメ	1,700	613.00	1,042,100	
ブラザー工業	24,400	2,011.00	49,068,400	

マックス	2,400	2,143.00	5,143,200	
モリタホールディングス	3,400	1,190.00	4,046,000	
グローリー	4,800	2,671.00	12,820,800	
新晃工業	2,000	1,553.00	3,106,000	
大和冷機工業	2,700	1,233.00	3,329,100	
セガサミーホールディングス	14,700	2,348.00	34,515,600	
日本ピストンリング	700	1,319.00	923,300	
リケン	700	2,591.00	1,813,700	
T P R	2,300	1,370.00	3,151,000	
ツバキ・ナカシマ	4,700	1,087.00	5,108,900	
ホシザキ	11,800	4,700.00	55,460,000	
大豊工業	1,700	647.00	1,099,900	
日本精工	33,500	746.00	24,991,000	
N T N	37,000	338.00	12,506,000	
ジェイテクト	16,500	1,018.00	16,797,000	
不二越	1,300	3,860.00	5,018,000	
ミネベアミツミ	31,800	2,381.00	75,715,800	
日本トムソン	4,500	594.00	2,673,000	
T H K	10,500	2,868.00	30,114,000	
ユーシン精機	1,600	729.00	1,166,400	
前澤給装工業	1,500	969.00	1,453,500	
イーグル工業	1,900	1,173.00	2,228,700	
前澤工業	800	628.00	502,400	
日本ピラー工業	1,700	3,340.00	5,678,000	
キッツ	6,700	857.00	5,741,900	
日立製作所	88,900	7,050.00	626,745,000	
東芝	35,200	4,337.00	152,662,400	
三菱電機	189,000	1,549.50	292,855,500	
富士電機	11,100	5,230.00	58,053,000	
東洋電機製造	700	885.00	619,500	
安川電機	21,700	5,150.00	111,755,000	
シンフォニアテクノロジー	2,000	1,633.00	3,266,000	
明電舎	2,800	1,914.00	5,359,200	
オリジン	300	1,273.00	381,900	
山洋電気	800	5,640.00	4,512,000	
デンヨー	1,300	1,583.00	2,057,900	
PHCホールディングス	2,700	1,419.00	3,831,300	
ソシオネクスト	1,900	8,290.00	15,751,000	
ベイクレント・コンサルティング	14,700	5,590.00	82,173,000	
Orchestra Holdings	400	1,875.00	750,000	
アイモバイル	800	1,241.00	992,800	
キャリアインデックス	600	326.00	195,600	
MS - J a p a n	500	1,118.00	559,000	
船場	500	748.00	374,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディン	6,500	2,005.00	13,032,500	
フルテック	400	1,076.00	430,400	
グリーンズ	700	1,248.00	873,600	
ツナググループ・ホールディングス	400	581.00	232,400	
Game With	700	325.00	227,500	

MS&C o n s u l t i n g	500	564.00	282,000	
ウェルビー	1,300	659.00	856,700	
エル・ティー・エス	300	2,478.00	743,400	
ミダックホールディングス	900	2,779.00	2,501,100	
日総工産	1,500	661.00	991,500	
キュービーネットホールディングス	900	1,452.00	1,306,800	
R P Aホールディングス	3,300	340.00	1,122,000	
三櫻工業	2,900	679.00	1,969,100	
マキタ	22,700	3,480.00	78,996,000	
東芝テック	2,700	3,860.00	10,422,000	
芝浦メカトロニクス	300	13,330.00	3,999,000	
マブチモーター	4,600	3,750.00	17,250,000	
日本電産	44,400	6,932.00	307,780,800	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	600	477.00	286,200	
トレックス・セミコンダクター	800	2,520.00	2,016,000	
東光高岳	1,200	2,026.00	2,431,200	
ダブル・スコープ	6,100	1,320.00	8,052,000	
宮越ホールディングス	800	821.00	656,800	
ダイヘン	1,700	4,245.00	7,216,500	
ヤーマン	3,100	1,452.00	4,501,200	
J V Cケンウッド	17,200	385.00	6,622,000	
ミマキエンジニアリング	1,900	557.00	1,058,300	
I - P E X	1,000	1,215.00	1,215,000	
日新電機	4,500	1,696.00	7,632,000	
大崎電気工業	3,700	526.00	1,946,200	
オムロン	16,800	7,239.00	121,615,200	
日東工業	2,500	2,648.00	6,620,000	
I D E C	2,600	3,275.00	8,515,000	
正興電機製作所	600	1,001.00	600,600	
不二電機工業	200	1,116.00	223,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6,000	2,479.00	14,874,000	
サクサホールディングス	300	1,523.00	456,900	
メルコホールディングス	500	3,360.00	1,680,000	
テクノメディカ	500	1,721.00	860,500	
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	600	929.00	557,400	
日本電気	25,900	4,780.00	123,802,000	
富士通	18,200	17,510.00	318,682,000	
沖電気工業	8,500	719.00	6,111,500	
岩崎通信機	600	784.00	470,400	
電気興業	700	2,166.00	1,516,200	
サンケン電気	1,700	8,830.00	15,011,000	
ナカヨ	300	1,173.00	351,900	
アイホン	1,100	1,954.00	2,149,400	
ルネサスエレクトロニクス	119,300	1,710.50	204,062,650	
セイコーエプソン	24,300	1,873.00	45,513,900	
ワコム	14,300	661.00	9,452,300	
アルバック	4,300	5,270.00	22,661,000	
アクセル	600	1,767.00	1,060,200	
E I Z O	1,300	3,700.00	4,810,000	

ジャパンディスプレイ	72,600	42.00	3,049,200	
日本信号	4,100	1,039.00	4,259,900	
京三製作所	4,400	409.00	1,799,600	
能美防災	2,400	1,656.00	3,974,400	
ホーチキ	1,400	1,457.00	2,039,800	
星和電機	400	456.00	182,400	
エレコム	4,500	1,305.00	5,872,500	
パナソニック ホールディングス	216,000	1,180.50	254,988,000	
シャープ	21,900	977.00	21,396,300	
アンリツ	12,800	1,257.00	16,089,600	
富士通ゼネラル	5,200	3,760.00	19,552,000	
ソニーグループ	128,100	11,440.00	1,465,464,000	
TDK	28,900	4,550.00	131,495,000	
帝国通信工業	900	1,450.00	1,305,000	
タムラ製作所	8,000	754.00	6,032,000	
アルプスアルパイン	16,300	1,425.00	23,227,500	
池上通信機	600	608.00	364,800	
日本電波工業	2,100	1,422.00	2,986,200	
鈴木	1,000	1,019.00	1,019,000	
メイコー	2,000	2,752.00	5,504,000	
日本トリム	400	2,841.00	1,136,400	
ローランド ディー. ジー.	1,000	3,115.00	3,115,000	
フォスター電機	2,000	947.00	1,894,000	
SMK	500	2,500.00	1,250,000	
ヨコオ	1,500	2,002.00	3,003,000	
ティアック	3,000	117.00	351,000	
ホシデン	4,500	1,604.00	7,218,000	
ヒロセ電機	3,000	16,950.00	50,850,000	
日本航空電子工業	3,700	2,268.00	8,391,600	
TOA	2,200	791.00	1,740,200	
マクセル	4,100	1,464.00	6,002,400	
古野電気	2,500	944.00	2,360,000	
スミダコーポレーション	1,600	1,641.00	2,625,600	
アイコム	700	2,571.00	1,799,700	
リオン	800	1,853.00	1,482,400	
横河電機	20,000	2,071.00	41,420,000	
新電元工業	700	3,480.00	2,436,000	
アズビル	12,600	3,610.00	45,486,000	
東亜ディーケーケー	1,000	786.00	786,000	
日本光電工業	8,300	3,375.00	28,012,500	
チノー	600	1,924.00	1,154,400	
共和電業	1,700	338.00	574,600	
日本電子材料	1,000	1,515.00	1,515,000	
堀場製作所	4,000	7,000.00	28,000,000	
アドバンテス	14,300	10,070.00	144,001,000	
小野測器	600	409.00	245,400	
エスベック	1,400	2,029.00	2,840,600	
キーエンス	18,100	58,250.00	1,054,325,000	
日置電機	900	7,930.00	7,137,000	

シスメックス	15,600	8,302.00	129,511,200	
日本マイクロニクス	2,900	1,299.00	3,767,100	
メガチップス	1,600	2,836.00	4,537,600	
OBARA GROUP	900	3,840.00	3,456,000	
IMAGICA GROUP	1,600	669.00	1,070,400	
澤藤電機	400	1,141.00	456,400	
デンソー	37,300	7,386.00	275,497,800	
原田工業	600	866.00	519,600	
コーセル	2,300	1,085.00	2,495,500	
イリソ電子工業	1,700	4,685.00	7,964,500	
オプテックスグループ	3,300	2,067.00	6,821,100	
千代田インテグレ	600	2,175.00	1,305,000	
レーザーテック	8,300	22,555.00	187,206,500	
スタンレー電気	12,900	2,834.00	36,558,600	
岩崎電気	700	4,445.00	3,111,500	
ウシオ電機	9,400	1,593.00	14,974,200	
岡谷電機産業	1,300	296.00	384,800	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,500	401.00	601,500	
エノモト	400	1,904.00	761,600	
日本セラミック	1,800	2,696.00	4,852,800	
遠藤照明	600	815.00	489,000	
古河電池	1,500	1,148.00	1,722,000	
双信電機	900	375.00	337,500	
山一電機	1,500	1,793.00	2,689,500	
函研	1,400	3,470.00	4,858,000	
日本電子	4,500	4,015.00	18,067,500	
カシオ計算機	13,700	1,352.00	18,522,400	
ファナック	17,800	22,700.00	404,060,000	
日本シイエムケイ	4,000	497.00	1,988,000	
エンプラス	500	3,955.00	1,977,500	
大真空	2,100	747.00	1,568,700	
ローム	8,400	10,500.00	88,200,000	
浜松ホトニクス	14,500	6,660.00	96,570,000	
三井ハイテック	1,900	6,960.00	13,224,000	
新光電気工業	6,400	3,800.00	24,320,000	
京セラ	28,100	6,689.00	187,960,900	
協栄産業	300	1,806.00	541,800	
太陽誘電	8,800	4,185.00	36,828,000	
村田製作所	54,900	7,403.00	406,424,700	
双葉電子工業	3,600	548.00	1,972,800	
日東電工	13,200	8,390.00	110,748,000	
北陸電気工業	600	1,374.00	824,400	
東海理化電機製作所	5,200	1,533.00	7,971,600	
ニチコン	3,900	1,314.00	5,124,600	
日本ケミコン	1,700	2,115.00	3,595,500	
KOA	2,800	1,856.00	5,196,800	
三井E&Sホールディングス	7,600	427.00	3,245,200	
日立造船	14,900	896.00	13,350,400	
三菱重工業	32,000	5,046.00	161,472,000	

川崎重工業	13,600	3,025.00	41,140,000	
I H I	11,500	3,630.00	41,745,000	
名村造船所	4,600	385.00	1,771,000	
サノヤスホールディングス	1,400	130.00	182,000	
スプリックス	800	856.00	684,800	
マネジメントソリューションズ	1,000	3,690.00	3,690,000	
プロレド・パートナーズ	600	545.00	327,000	
a n d f a c t o r y	300	363.00	108,900	
テノ. ホールディングス	300	988.00	296,400	
フロンティア・マネジメント	600	1,306.00	783,600	
ピアラ	200	524.00	104,800	
コプロ・ホールディングス	200	1,201.00	240,200	
ギークス	400	1,092.00	436,800	
カーブスホールディングス	5,600	782.00	4,379,200	
フォーラムエンジニアリング	1,300	888.00	1,154,400	
F a s t F i t n e s s J a p a n	500	1,371.00	685,500	
日本車輛製造	700	1,952.00	1,366,400	
三菱ロジスネクスト	2,800	838.00	2,346,400	
近畿車輛	100	1,170.00	117,000	
一家ホールディングス	400	609.00	243,600	
フルサト・マルカホールディングス	1,900	2,955.00	5,614,500	
ヤマエグループホールディングス	1,000	1,653.00	1,653,000	
ジャパクラフトホールディングス	300	579.00	173,700	
F P G	7,100	1,217.00	8,640,700	
島根銀行	700	521.00	364,700	
じもとホールディングス	1,300	434.00	564,200	
全国保証	4,700	5,290.00	24,863,000	
めぶきフィナンシャルグループ	88,200	369.00	32,545,800	
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,600	1,055.00	1,688,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,300	3,010.00	6,923,000	
九州フィナンシャルグループ	31,800	511.00	16,249,800	
かんぽ生命保険	21,600	2,411.00	52,077,600	
ゆうちょ銀行	50,700	1,208.00	61,245,600	
あんしん保証	1,300	263.00	341,900	
富山第一銀行	4,800	654.00	3,139,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	98,100	572.00	56,113,200	
ジェイリース	500	2,380.00	1,190,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	11,200	1,129.00	12,644,800	
イントラスト	800	928.00	742,400	
日本モーゲージサービス	1,100	881.00	969,100	
C a s a	700	825.00	577,500	
アルヒ	2,200	1,119.00	2,461,800	
プレミアムグループ	3,000	1,556.00	4,668,000	
日産自動車	257,100	524.20	134,771,820	
いすゞ自動車	52,600	1,641.00	86,316,600	
トヨタ自動車	994,600	1,902.50	1,892,226,500	
日野自動車	23,200	572.00	13,270,400	
三菱自動車工業	70,500	532.00	37,506,000	
エフテック	1,400	615.00	861,000	

レシップホールディングス	1,100	468.00	514,800	
GMB	700	809.00	566,300	
ファルテック	700	590.00	413,000	
武蔵精密工業	4,400	1,815.00	7,986,000	
日産車体	3,000	883.00	2,649,000	
新明和工業	5,900	1,095.00	6,460,500	
極東開発工業	3,100	1,453.00	4,504,300	
トピー工業	1,400	1,862.00	2,606,800	
ティラド	500	2,225.00	1,112,500	
曙ブレーキ工業	11,400	147.00	1,675,800	
タチエス	2,900	1,251.00	3,627,900	
NOK	7,000	1,282.00	8,974,000	
フタバ産業	5,000	410.00	2,050,000	
KYB	1,700	3,635.00	6,179,500	
市光工業	2,500	444.00	1,110,000	
大同メタル工業	4,000	508.00	2,032,000	
プレス工業	8,100	457.00	3,701,700	
ミクニ	2,500	348.00	870,000	
太平洋工業	4,300	1,135.00	4,880,500	
河西工業	2,400	201.00	482,400	
アイシン	13,900	3,760.00	52,264,000	
マツダ	59,800	1,170.00	69,966,000	
今仙電機製作所	1,000	772.00	772,000	
本田技研工業	147,200	3,460.00	509,312,000	
スズキ	33,200	4,777.00	158,596,400	
SUBARU	57,300	2,198.00	125,945,400	
安永	800	686.00	548,800	
ヤマハ発動機	28,400	3,375.00	95,850,000	
小糸製作所	21,700	2,287.00	49,627,900	
TBK	2,100	253.00	531,300	
エクセディ	2,900	1,800.00	5,220,000	
ミツバ	3,600	507.00	1,825,200	
豊田合成	5,300	2,167.00	11,485,100	
愛三工業	3,300	869.00	2,867,700	
盟和産業	500	958.00	479,000	
日本プラスト	1,500	401.00	601,500	
ヨロズ	1,800	753.00	1,355,400	
エフ・シー・シー	3,100	1,471.00	4,560,100	
新家工業	300	2,387.00	716,100	
シマノ	7,400	21,900.00	162,060,000	
テイ・エス テック	8,200	1,732.00	14,202,400	
三十三フィナンシャルグループ	1,500	1,717.00	2,575,500	
第四北越フィナンシャルグループ	2,800	3,225.00	9,030,000	
ひろぎんホールディングス	23,600	693.00	16,354,800	
マーキュリアホールディングス	900	782.00	703,800	
おきなわフィナンシャルグループ	1,800	2,345.00	4,221,000	
ダイレクトマーケティングミックス	2,100	1,613.00	3,387,300	
ポピンズ	400	1,860.00	744,000	
LITALICO	1,400	2,589.00	3,624,600	

十六フィナンシャルグループ	2,300	3,190.00	7,337,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,500	4,330.00	6,495,000	
ネットプロテクションズホールディングス	6,400	578.00	3,699,200	
プロクレアホールディングス	2,200	2,339.00	5,145,800	
あいちフィナンシャルグループ	2,600	2,344.00	6,094,400	
ジャムコ	800	1,794.00	1,435,200	
小野建	1,700	1,506.00	2,560,200	
はるやまホールディングス	500	446.00	223,000	
南陽	400	2,022.00	808,800	
ノジマ	6,300	1,309.00	8,246,700	
佐島電機	1,000	1,633.00	1,633,000	
カッパ・クリエイト	2,900	1,429.00	4,144,100	
エコートレーディング	100	847.00	84,700	
伯東	1,100	4,840.00	5,324,000	
コンドーテック	1,500	1,060.00	1,590,000	
中山福	1,000	346.00	346,000	
ライトオン	1,500	558.00	837,000	
ナガイレーベン	2,400	1,971.00	4,730,400	
三菱食品	1,800	3,290.00	5,922,000	
良品計画	24,700	1,404.00	34,678,800	
バリミキホールディングス	2,400	277.00	664,800	
松田産業	1,500	2,270.00	3,405,000	
第一興商	3,700	4,250.00	15,725,000	
メディパルホールディングス	19,800	1,750.00	34,650,000	
アドヴァングループ	2,000	905.00	1,810,000	
S P K	800	1,519.00	1,215,200	
萩原電気ホールディングス	700	2,666.00	1,866,200	
アルビス	600	2,402.00	1,441,200	
アズワン	2,800	5,710.00	15,988,000	
スズデン	700	2,663.00	1,864,100	
尾家産業	300	1,019.00	305,700	
シモジマ	1,200	1,023.00	1,227,600	
ドウシシャ	2,000	1,769.00	3,538,000	
小津産業	400	1,703.00	681,200	
コナカ	2,300	357.00	821,100	
高速	900	1,922.00	1,729,800	
ハウス オブ ローゼ	300	1,649.00	494,700	
G-7ホールディングス	2,300	1,436.00	3,302,800	
たけびし	700	1,610.00	1,127,000	
イオン北海道	2,800	891.00	2,494,800	
コジマ	3,600	559.00	2,012,400	
ヒマラヤ	700	945.00	661,500	
コーナン商事	2,600	3,360.00	8,736,000	
ネットワンシステムズ	6,700	3,285.00	22,009,500	
エコス	700	1,854.00	1,297,800	
ワタミ	2,500	900.00	2,250,000	
マルシェ	700	387.00	270,900	
リックス	300	2,511.00	753,300	
システムソフト	6,200	88.00	545,600	

パン・パシフィック・インターナショナルホ	38,600	2,584.00	99,742,400	
丸文	1,700	1,323.00	2,249,100	
西松屋チェーン	4,200	1,565.00	6,573,000	
ゼンショーホールディングス	10,500	3,810.00	40,005,000	
ハピネット	1,700	1,858.00	3,158,600	
幸楽苑ホールディングス	1,300	1,051.00	1,366,300	
ハークスレイ	800	688.00	550,400	
橋本総業ホールディングス	800	1,118.00	894,400	
日本ライフライン	5,600	914.00	5,118,400	
サイゼリヤ	3,100	3,055.00	9,470,500	
タカショー	1,900	686.00	1,303,400	
V Tホールディングス	7,100	503.00	3,571,300	
アルゴグラフィックス	1,600	3,825.00	6,120,000	
魚力	600	2,156.00	1,293,600	
I D O M	5,700	870.00	4,959,000	
日本エム・デイ・エム	1,200	1,038.00	1,245,600	
ポプラ	700	138.00	96,600	
フジ・コーポレーション	1,100	1,251.00	1,376,100	
ユナイテッドアローズ	2,200	1,741.00	3,830,200	
進和	1,200	2,126.00	2,551,200	
エスケイジャパン	900	564.00	507,600	
ダイトロン	800	2,457.00	1,965,600	
ハイデイ日高	2,800	2,057.00	5,759,600	
シークス	2,900	1,504.00	4,361,600	
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i	2,200	201.00	442,200	
コロワイド	8,900	1,875.00	16,687,500	
ピーシーデポコーポレーション	2,300	298.00	685,400	
田中商事	800	595.00	476,000	
オーハシテクニカ	1,100	1,545.00	1,699,500	
壱番屋	1,500	4,690.00	7,035,000	
白銅	700	2,588.00	1,811,600	
トップカルチャー	1,700	197.00	334,900	
P L A N T	700	666.00	466,200	
スギホールディングス	3,800	5,730.00	21,774,000	
ダイコー通産	300	1,095.00	328,500	
薬王堂ホールディングス	1,000	2,422.00	2,422,000	
島津製作所	22,000	3,855.00	84,810,000	
J M S	1,700	516.00	877,200	
クボテック	1,100	225.00	247,500	
長野計器	1,500	1,207.00	1,810,500	
ブイ・テクノロジー	900	2,519.00	2,267,100	
スター精密	3,500	1,639.00	5,736,500	
東京計器	1,300	1,297.00	1,686,100	
愛知時計電機	800	1,451.00	1,160,800	
インターアクション	1,000	1,485.00	1,485,000	
オーバル	1,900	468.00	889,200	
東京精密	4,000	4,785.00	19,140,000	
マニー	7,900	1,862.00	14,709,800	
ニコン	28,100	1,294.00	36,361,400	

トプコン	9,600	1,698.00	16,300,800	
オリンパス	113,200	2,295.00	259,794,000	
理研計器	1,100	4,955.00	5,450,500	
S C R E E Nホールディングス	3,100	10,330.00	32,023,000	
キヤノン電子	1,900	1,738.00	3,302,200	
タムロン	1,300	3,165.00	4,114,500	
HOYA	38,700	13,410.00	518,967,000	
シード	600	564.00	338,400	
ノーリツ鋼機	1,700	2,130.00	3,621,000	
A&Dホロンホールディングス	2,600	1,257.00	3,268,200	
朝日インテック	20,200	2,356.00	47,591,200	
キヤノン	99,300	2,960.50	293,977,650	
リコー	45,300	1,066.00	48,289,800	
シチズン時計	19,900	835.00	16,616,500	
リズム	600	1,532.00	919,200	
大研医器	1,000	472.00	472,000	
メニコン	6,200	2,951.00	18,296,200	
シンシア	400	503.00	201,200	
KYORITSU	2,600	127.00	330,200	
中本パックス	400	1,638.00	655,200	
スノーピーク	3,100	2,187.00	6,779,700	
パラマウントベッドホールディングス	4,100	2,404.00	9,856,400	
トランザクション	1,200	1,509.00	1,810,800	
粧美堂	400	377.00	150,800	
ニホンフラッシュ	1,700	936.00	1,591,200	
前田工織	1,500	3,350.00	5,025,000	
永大産業	2,200	219.00	481,800	
アートネイチャー	1,800	749.00	1,348,200	
バンダイナムコホールディングス	16,500	8,575.00	141,487,500	
アイフィスジャパン	900	599.00	539,100	
SHOEI	1,900	5,150.00	9,785,000	
フランスベッドホールディングス	2,100	998.00	2,095,800	
マーベラス	3,200	720.00	2,304,000	
パイロットコーポレーション	2,800	4,420.00	12,376,000	
萩原工業	1,300	1,215.00	1,579,500	
エイベックス	3,100	1,613.00	5,000,300	
フジシールインターナショナル	3,600	1,616.00	5,817,600	
タカラトミー	8,300	1,301.00	10,798,300	
広済堂ホールディングス	1,000	2,362.00	2,362,000	
エステールホールディングス	400	630.00	252,000	
レック	2,600	933.00	2,425,800	
タカノ	900	675.00	607,500	
三光合成	2,300	546.00	1,255,800	
プロネクス	1,600	988.00	1,580,800	
ホクシン	3,100	148.00	458,800	
ウッドワン	600	913.00	547,800	
大建工業	1,200	2,127.00	2,552,400	
きもと	3,100	200.00	620,000	
凸版印刷	23,600	2,402.00	56,687,200	

大日本印刷	21,500	3,640.00	78,260,000	
共同印刷	600	2,941.00	1,764,600	
N I S S H A	3,400	1,841.00	6,259,400	
光村印刷	300	1,223.00	366,900	
藤森工業	1,500	3,075.00	4,612,500	
ヴィア・ホールディングス	2,400	97.00	232,800	
TAKARA & COMPANY	1,300	2,175.00	2,827,500	
前澤化成工業	1,300	1,380.00	1,794,000	
未来工業	700	1,503.00	1,052,100	
アシックス	16,700	3,270.00	54,609,000	
ツツミ	300	1,987.00	596,100	
ウェーブロックホールディングス	300	612.00	183,600	
J S P	1,200	1,590.00	1,908,000	
ニチハ	2,200	2,648.00	5,825,600	
ローランド	1,300	3,895.00	5,063,500	
エフピコ	3,400	3,605.00	12,257,000	
小松ウオール工業	600	1,922.00	1,153,200	
ヤマハ	11,400	4,955.00	56,487,000	
河合楽器製作所	600	2,667.00	1,600,200	
クリナップ	1,900	639.00	1,214,100	
ビジョン	11,500	2,200.00	25,300,000	
天馬	1,500	2,307.00	3,460,500	
兼松サステック	200	2,247.00	449,400	
キングジム	1,700	886.00	1,506,200	
象印マホービン	5,300	1,635.00	8,665,500	
リンテック	3,700	2,196.00	8,125,200	
信越ポリマー	3,300	1,349.00	4,451,700	
東リ	4,900	270.00	1,323,000	
イトーキ	3,800	745.00	2,831,000	
任天堂	114,300	5,464.00	624,535,200	
三菱鉛筆	2,600	1,480.00	3,848,000	
松風	800	2,087.00	1,669,600	
タカラスタンダード	3,500	1,404.00	4,914,000	
コクヨ	8,700	1,849.00	16,086,300	
ナカバヤシ	1,700	481.00	817,700	
ニフコ	6,500	3,460.00	22,490,000	
立川ブラインド工業	900	1,256.00	1,130,400	
グローブライド	1,400	2,609.00	3,652,600	
オカムラ	5,600	1,348.00	7,548,800	
バルカー	1,500	3,240.00	4,860,000	
MUTOHホールディングス	200	1,674.00	334,800	
伊藤忠商事	118,100	4,108.00	485,154,800	
丸紅	151,200	1,758.50	265,885,200	
スクロール	3,200	785.00	2,512,000	
高島	200	2,955.00	591,000	
ヨンドシーホールディングス	1,600	1,795.00	2,872,000	
三陽商会	500	1,419.00	709,500	
長瀬産業	9,000	2,044.00	18,396,000	
ナイガイ	1,200	258.00	309,600	

蝶理	1,000	2,509.00	2,509,000	
豊田通商	16,800	5,580.00	93,744,000	
オンワードホールディングス	12,100	337.00	4,077,700	
三共生興	2,600	553.00	1,437,800	
兼松	7,400	1,591.00	11,773,400	
美津濃	1,800	3,030.00	5,454,000	
ツカモトコーポレーション	200	1,409.00	281,800	
ルックホールディングス	400	2,162.00	864,800	
三井物産	140,200	3,908.00	547,901,600	
日本紙パルプ商事	1,000	5,150.00	5,150,000	
東京エレクトロン	12,800	45,480.00	582,144,000	
カメイ	2,000	1,376.00	2,752,000	
東都水産	100	5,820.00	582,000	
OUGホールディングス	200	2,484.00	496,800	
スターゼン	1,500	2,148.00	3,222,000	
セイコーグループ	2,800	2,926.00	8,192,800	
山善	5,400	1,044.00	5,637,600	
椿本興業	300	4,090.00	1,227,000	
住友商事	118,600	2,361.50	280,073,900	
BIPROGY	6,700	2,921.00	19,570,700	
内田洋行	900	4,700.00	4,230,000	
三菱商事	119,800	4,675.00	560,065,000	
第一実業	700	5,200.00	3,640,000	
キャノンマーケティングジャパン	4,400	3,090.00	13,596,000	
西華産業	700	1,720.00	1,204,000	
佐藤商事	1,300	1,367.00	1,777,100	
菱洋エレクトロ	1,700	2,436.00	4,141,200	
東京産業	1,800	773.00	1,391,400	
ユアサ商事	1,700	3,635.00	6,179,500	
神鋼商事	500	5,820.00	2,910,000	
トルク	400	215.00	86,000	
阪和興業	3,500	3,970.00	13,895,000	
正栄食品工業	1,300	4,165.00	5,414,500	
カナデン	1,700	1,103.00	1,875,100	
菱電商事	1,600	1,866.00	2,985,600	
ニプロ	15,000	1,086.00	16,290,000	
岩谷産業	4,300	5,660.00	24,338,000	
ナイス	400	1,368.00	547,200	
ニチモウ	200	3,330.00	666,000	
極東貿易	1,200	1,446.00	1,735,200	
アステナホールディングス	2,800	426.00	1,192,800	
兼松エレクトロニクス	1,100	6,180.00	6,798,000	
三愛オブリ	5,000	1,402.00	7,010,000	
稲畑産業	3,800	2,610.00	9,918,000	
G S Iクレオス	1,000	1,562.00	1,562,000	
明和産業	1,900	702.00	1,333,800	
クワザワホールディングス	300	466.00	139,800	
キムラタン	14,500	21.00	304,500	
ゴールドウイン	3,200	11,350.00	36,320,000	

ユニ・チャーム	37,800	5,059.00	191,230,200	
デサント	3,100	3,925.00	12,167,500	
キング	900	510.00	459,000	
ワキタ	3,400	1,167.00	3,967,800	
ヤマトインターナショナル	900	250.00	225,000	
東邦ホールディングス	4,700	2,151.00	10,109,700	
サンゲツ	4,900	2,383.00	11,676,700	
ミツウロコグループホールディングス	2,400	1,350.00	3,240,000	
シナネンホールディングス	600	3,515.00	2,109,000	
伊藤忠エネクス	4,600	1,102.00	5,069,200	
サンリオ	5,400	4,080.00	22,032,000	
サンワテクノス	900	1,929.00	1,736,100	
リョーサン	2,100	3,075.00	6,457,500	
新光商事	2,500	1,288.00	3,220,000	
トーヨー	900	1,765.00	1,588,500	
三信電気	700	2,550.00	1,785,000	
東陽テクニカ	2,000	1,299.00	2,598,000	
モスフードサービス	2,800	3,080.00	8,624,000	
加賀電子	1,600	4,670.00	7,472,000	
三益半導体工業	1,400	2,513.00	3,518,200	
都築電気	900	1,354.00	1,218,600	
ソーダニッカ	1,100	767.00	843,700	
立花エレクトック	1,500	1,873.00	2,809,500	
木曽路	2,800	2,191.00	6,134,800	
S R Sホールディングス	2,900	914.00	2,650,600	
千趣会	3,700	396.00	1,465,200	
タカキュー	3,300	81.00	267,300	
リテールパートナーズ	2,800	1,307.00	3,659,600	
ケーヨー	3,100	896.00	2,777,600	
上新電機	1,700	1,991.00	3,384,700	
日本瓦斯	10,400	1,879.00	19,541,600	
ロイヤルホールディングス	3,600	2,560.00	9,216,000	
東天紅	300	747.00	224,100	
いなげや	1,800	1,339.00	2,410,200	
チヨダ	1,900	792.00	1,504,800	
ライフコーポレーション	1,700	2,796.00	4,753,200	
リンガーハット	2,500	2,251.00	5,627,500	
MrMaxHD	2,600	684.00	1,778,400	
テンアライド	1,400	275.00	385,000	
AOKIホールディングス	4,000	785.00	3,140,000	
オークワ	3,200	921.00	2,947,200	
コメリ	3,000	2,650.00	7,950,000	
青山商事	4,200	951.00	3,994,200	
しまむら	2,200	12,930.00	28,446,000	
はせがわ	500	338.00	169,000	
高島屋	14,400	1,904.00	27,417,600	
松屋	3,500	1,138.00	3,983,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	9,300	1,359.00	12,638,700	
近鉄百貨店	700	2,454.00	1,717,800	

丸井グループ	14,100	2,066.00	29,130,600	
クレディセゾン	11,200	1,824.00	20,428,800	
アクシアル リテイリング	1,300	3,545.00	4,608,500	
井筒屋	500	349.00	174,500	
イオン	64,900	2,613.50	169,616,150	
イズミ	2,900	2,995.00	8,685,500	
フォーバル	700	1,011.00	707,700	
平和堂	3,300	2,177.00	7,184,100	
フジ	3,100	1,827.00	5,663,700	
ヤオコー	2,200	6,840.00	15,048,000	
ゼビオホールディングス	2,800	979.00	2,741,200	
ケーズホールディングス	15,400	1,182.00	18,202,800	
PALTAC	3,000	4,860.00	14,580,000	
三谷産業	4,200	319.00	1,339,800	
Olympicグループ	1,000	535.00	535,000	
日産東京販売ホールディングス	2,900	349.00	1,012,100	
SBI新生銀行	5,200	2,436.00	12,667,200	
あおぞら銀行	11,200	2,651.00	29,691,200	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,132,600	998.30	1,130,674,580	
りそなホールディングス	227,600	753.90	171,587,640	
三井住友トラスト・ホールディングス	32,400	4,961.00	160,736,400	
三井住友フィナンシャルグループ	130,300	6,000.00	781,800,000	
千葉銀行	49,600	990.00	49,104,000	
群馬銀行	35,100	507.00	17,795,700	
武蔵野銀行	2,300	2,497.00	5,743,100	
千葉興業銀行	3,500	513.00	1,795,500	
筑波銀行	8,000	239.00	1,912,000	
七十七銀行	5,800	2,413.00	13,995,400	
秋田銀行	1,300	1,940.00	2,522,000	
山形銀行	2,100	1,277.00	2,681,700	
岩手銀行	1,300	2,437.00	3,168,100	
東邦銀行	13,700	248.00	3,397,600	
東北銀行	900	1,032.00	928,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	14,200	3,095.00	43,949,000	
スルガ銀行	15,500	423.00	6,556,500	
八十二銀行	36,400	604.00	21,985,600	
山梨中央銀行	1,700	1,353.00	2,300,100	
大垣共立銀行	3,300	1,998.00	6,593,400	
福井銀行	1,700	1,694.00	2,879,800	
清水銀行	800	1,546.00	1,236,800	
富山銀行	300	1,805.00	541,500	
滋賀銀行	2,900	2,908.00	8,433,200	
南都銀行	2,700	2,673.00	7,217,100	
百五銀行	16,500	417.00	6,880,500	
京都銀行	5,600	6,430.00	36,008,000	
紀陽銀行	6,300	1,621.00	10,212,300	
ほくほくフィナンシャルグループ	11,600	1,056.00	12,249,600	
山陰合同銀行	11,200	843.00	9,441,600	
鳥取銀行	400	1,277.00	510,800	

百十四銀行	1,700	1,997.00	3,394,900	
四国銀行	3,000	952.00	2,856,000	
阿波銀行	2,600	2,236.00	5,813,600	
大分銀行	1,200	2,260.00	2,712,000	
宮崎銀行	1,200	2,783.00	3,339,600	
佐賀銀行	1,100	1,846.00	2,030,600	
琉球銀行	4,000	1,099.00	4,396,000	
セブン銀行	64,800	269.00	17,431,200	
みずほフィナンシャルグループ	258,000	2,145.00	553,410,000	
高知銀行	700	739.00	517,300	
山口フィナンシャルグループ	20,000	922.00	18,440,000	
芙蓉総合リース	1,600	9,090.00	14,544,000	
みずほリース	2,700	3,585.00	9,679,500	
東京センチュリー	3,300	4,630.00	15,279,000	
SBIホールディングス	25,800	2,960.00	76,368,000	
日本証券金融	7,100	1,033.00	7,334,300	
アイフル	29,300	369.00	10,811,700	
日本アジア投資	2,300	235.00	540,500	
長野銀行	600	1,524.00	914,400	
名古屋銀行	1,200	3,620.00	4,344,000	
北洋銀行	26,700	299.00	7,983,300	
大光銀行	700	1,256.00	879,200	
愛媛銀行	2,300	959.00	2,205,700	
トマト銀行	700	1,099.00	769,300	
京葉銀行	8,700	651.00	5,663,700	
栃木銀行	7,900	331.00	2,614,900	
北日本銀行	600	2,143.00	1,285,800	
東和銀行	3,500	608.00	2,128,000	
福島銀行	1,300	245.00	318,500	
大東銀行	900	726.00	653,400	
リコーリース	1,700	3,955.00	6,723,500	
イオンフィナンシャルサービス	10,400	1,332.00	13,852,800	
アコム	31,500	327.00	10,300,500	
ジャックス	1,900	4,290.00	8,151,000	
オリエントコーポレーション	4,900	1,166.00	5,713,400	
オリックス	119,300	2,426.50	289,481,450	
三菱HCキャピタル	69,400	695.00	48,233,000	
ジャフコグループ	6,000	2,121.00	12,726,000	
九州リースサービス	800	913.00	730,400	
トモニホールディングス	14,300	390.00	5,577,000	
大和証券グループ本社	127,400	644.00	82,045,600	
野村ホールディングス	328,400	565.80	185,808,720	
岡三証券グループ	16,100	447.00	7,196,700	
丸三証券	6,200	440.00	2,728,000	
東洋証券	6,500	326.00	2,119,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19,400	389.00	7,546,600	
光世証券	900	374.00	336,600	
水戸証券	5,300	303.00	1,605,900	
いちよし証券	3,100	651.00	2,018,100	

松井証券	10,300	805.00	8,291,500	
SOMPOホールディングス	30,600	5,796.00	177,357,600	
日本取引所グループ	50,100	1,966.50	98,521,650	
マネックスグループ	19,700	529.00	10,421,300	
極東証券	2,600	626.00	1,627,600	
岩井コスモホールディングス	2,000	1,383.00	2,766,000	
アイザワ証券グループ	2,400	710.00	1,704,000	
フィデアホールディングス	1,900	1,477.00	2,806,300	
池田泉州ホールディングス	23,500	255.00	5,992,500	
アニコムホールディングス	6,400	567.00	3,628,800	
MS&ADインシュアランスグループホール	36,300	4,457.00	161,789,100	
マネーパートナーズグループ	2,000	258.00	516,000	
スパークス・グループ	1,900	1,716.00	3,260,400	
小林洋行	1,300	235.00	305,500	
第一生命ホールディングス	90,800	2,964.00	269,131,200	
東京海上ホールディングス	179,600	2,866.50	514,823,400	
アドバンテッジリスクマネジメント	1,400	471.00	659,400	
イー・ギャランティ	2,800	2,275.00	6,370,000	
アサックス	600	619.00	371,400	
NECキャピタルソリューション	800	2,580.00	2,064,000	
T&Dホールディングス	47,800	2,165.00	103,487,000	
アドバンスクリエイト	1,200	1,187.00	1,424,400	
三井不動産	77,500	2,485.50	192,626,250	
三菱地所	107,600	1,638.00	176,248,800	
平和不動産	2,900	3,595.00	10,425,500	
東京建物	16,900	1,593.00	26,921,700	
京阪神ビルディング	2,200	1,219.00	2,681,800	
住友不動産	32,200	3,100.00	99,820,000	
太平洋興発	700	1,036.00	725,200	
テーオーシー	3,500	629.00	2,201,500	
東京楽天地	300	4,460.00	1,338,000	
レオパレス21	19,800	325.00	6,435,000	
スターツコーポレーション	2,600	2,562.00	6,661,200	
フジ住宅	2,400	676.00	1,622,400	
空港施設	2,000	518.00	1,036,000	
明和地所	700	921.00	644,700	
ゴールドクレスト	1,600	1,658.00	2,652,800	
リログループ	10,300	2,168.00	22,330,400	
エスリード	800	2,097.00	1,677,600	
日神グループホールディングス	3,300	451.00	1,488,300	
日本エスコン	3,900	828.00	3,229,200	
MIRARTHホールディングス	8,700	361.00	3,140,700	
AVANTIA	900	798.00	718,200	
イオンモール	9,400	1,810.00	17,014,000	
毎日コムネット	400	720.00	288,000	
ファースト住建	700	1,083.00	758,100	
ランド	110,100	10.00	1,101,000	
カチタス	4,800	2,694.00	12,931,200	
東祥	1,300	1,189.00	1,545,700	

トーセイ	2,900	1,442.00	4,181,800	
穴吹興産	400	2,180.00	872,000	
サンフロンティア不動産	2,900	1,221.00	3,540,900	
FJネクストホールディングス	2,000	985.00	1,970,000	
インテリックス	600	573.00	343,800	
ランドビジネス	1,700	226.00	384,200	
サンネクスタグループ	600	973.00	583,800	
グランディハウス	1,400	580.00	812,000	
東武鉄道	19,900	3,005.00	59,799,500	
相鉄ホールディングス	6,000	2,293.00	13,758,000	
東急	50,700	1,631.00	82,691,700	
京浜急行電鉄	20,500	1,272.00	26,076,000	
小田急電鉄	27,400	1,639.00	44,908,600	
京王電鉄	9,600	4,700.00	45,120,000	
京成電鉄	11,700	3,870.00	45,279,000	
富士急行	2,200	4,185.00	9,207,000	
東日本旅客鉄道	30,700	6,905.00	211,983,500	
西日本旅客鉄道	23,100	5,280.00	121,968,000	
東海旅客鉄道	13,900	15,300.00	212,670,000	
西武ホールディングス	21,800	1,412.00	30,781,600	
鴻池運輸	3,200	1,473.00	4,713,600	
西日本鉄道	4,800	2,408.00	11,558,400	
ハマキョウレックス	1,500	3,150.00	4,725,000	
サカイ引越センター	900	4,400.00	3,960,000	
近鉄グループホールディングス	18,100	4,115.00	74,481,500	
阪急阪神ホールディングス	24,100	3,840.00	92,544,000	
南海電気鉄道	8,600	2,753.00	23,675,800	
京阪ホールディングス	7,400	3,400.00	25,160,000	
神戸電鉄	500	3,175.00	1,587,500	
名古屋鉄道	19,900	2,077.00	41,332,300	
山陽電気鉄道	1,500	2,188.00	3,282,000	
アルプス物流	1,400	1,283.00	1,796,200	
トランコム	500	6,930.00	3,465,000	
ヤマトホールディングス	23,100	2,331.00	53,846,100	
山九	4,600	4,840.00	22,264,000	
日新	1,500	2,030.00	3,045,000	
丸運	700	220.00	154,000	
丸全昭和運輸	1,200	3,030.00	3,636,000	
センコーグループホールディングス	9,500	976.00	9,272,000	
トナミホールディングス	400	3,840.00	1,536,000	
ニッコンホールディングス	5,900	2,470.00	14,573,000	
日本石油輸送	200	2,337.00	467,400	
福山通運	1,400	3,360.00	4,704,000	
セイノーホールディングス	11,400	1,384.00	15,777,600	
エスライン	500	817.00	408,500	
神奈川中央交通	500	3,270.00	1,635,000	
AZ-COM丸和ホールディングス	4,300	1,842.00	7,920,600	
C&Fロジホールディングス	1,900	1,205.00	2,289,500	
日本郵船	48,300	3,329.00	160,790,700	

商船三井	31,800	3,420.00	108,756,000	
川崎汽船	15,400	3,250.00	50,050,000	
NSユニテッド海運	1,000	4,165.00	4,165,000	
明治海運	1,400	652.00	912,800	
飯野海運	6,500	1,002.00	6,513,000	
共栄タンカー	600	958.00	574,800	
九州旅客鉄道	12,800	2,949.00	37,747,200	
SGホールディングス	34,600	2,095.00	72,487,000	
NIPPON EXPRESSホールディング	6,700	7,660.00	51,322,000	
日本航空	44,400	2,601.00	115,484,400	
ANAホールディングス	49,200	2,813.00	138,399,600	
ビーウィズ	300	1,537.00	461,100	
パスコ	200	1,412.00	282,400	
TREホールディングス	4,000	1,482.00	5,928,000	
人・夢・技術グループ	800	1,527.00	1,221,600	
西本Wismettacホールディングス	500	3,625.00	1,812,500	
シルバーライフ	500	1,830.00	915,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,849.00	369,800	
Genky DrugStores	900	4,245.00	3,820,500	
コア商事ホールディングス	1,300	637.00	828,100	
KPPグループホールディングス	4,100	787.00	3,226,700	
ナルミヤ・インターナショナル	600	933.00	559,800	
ブックオフグループホールディングス	1,200	1,274.00	1,528,800	
ギフトホールディングス	400	4,285.00	1,714,000	
三菱倉庫	3,900	3,115.00	12,148,500	
三井倉庫ホールディングス	1,700	4,030.00	6,851,000	
住友倉庫	4,900	2,107.00	10,324,300	
澁澤倉庫	800	2,166.00	1,732,800	
ヤマタネ	900	1,665.00	1,498,500	
東陽倉庫	3,100	273.00	846,300	
乾汽船	2,400	2,038.00	4,891,200	
日本トランスシティ	4,100	567.00	2,324,700	
ケイヒン	300	1,530.00	459,000	
中央倉庫	1,100	986.00	1,084,600	
川西倉庫	300	1,004.00	301,200	
安田倉庫	1,500	945.00	1,417,500	
ファイブホールディングス	400	1,174.00	469,600	
大栄環境	3,500	1,751.00	6,128,500	
東洋埠頭	500	1,366.00	683,000	
上組	8,600	2,695.00	23,177,000	
サンリツ	700	752.00	526,400	
キムラユニティー	1,000	1,004.00	1,004,000	
キューソー流通システム	1,000	954.00	954,000	
東海運	1,000	288.00	288,000	
エーアイティー	1,200	1,578.00	1,893,600	
内外トランスライン	600	2,165.00	1,299,000	
ショーエイコーポレーション	700	569.00	398,300	
日本コンセプト	600	1,347.00	808,200	
TBSホールディングス	9,400	1,629.00	15,312,600	

日本テレビホールディングス	16,300	1,080.00	17,604,000	
朝日放送グループホールディングス	1,900	660.00	1,254,000	
テレビ朝日ホールディングス	4,500	1,402.00	6,309,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	16,500	487.00	8,035,500	
テレビ東京ホールディングス	1,400	2,128.00	2,979,200	
日本BS放送	500	910.00	455,000	
ビジョン	2,300	1,599.00	3,677,700	
スマートバリュー	1,000	434.00	434,000	
USEN-NEXT HOLDINGS	1,600	2,615.00	4,184,000	
ワイヤレスゲート	1,100	265.00	291,500	
日本通信	17,300	240.00	4,152,000	
クロップス	300	1,135.00	340,500	
日本電信電話	232,800	3,972.00	924,681,600	
KDDI	140,400	4,039.00	567,075,600	
ソフトバンク	291,800	1,532.50	447,183,500	
光通信	2,100	20,230.00	42,483,000	
エムティーアイ	1,800	510.00	918,000	
GMOインターネットグループ	6,800	2,573.00	17,496,400	
ファイバーゲート	1,000	889.00	889,000	
アйдママーケティングコミュニケーション	1,400	287.00	401,800	
KADOKAWA	9,600	2,733.00	26,236,800	
学研ホールディングス	2,900	863.00	2,502,700	
ゼンリン	3,400	852.00	2,896,800	
昭文社ホールディングス	1,500	296.00	444,000	
インプレスホールディングス	900	201.00	180,900	
東京電力ホールディングス	163,100	480.00	78,288,000	
中部電力	66,700	1,450.00	96,715,000	
関西電力	69,900	1,323.00	92,477,700	
中国電力	28,700	704.00	20,204,800	
北陸電力	17,200	571.00	9,821,200	
東北電力	44,100	683.00	30,120,300	
四国電力	15,300	752.00	11,505,600	
九州電力	41,600	754.00	31,366,400	
北海道電力	17,300	485.00	8,390,500	
沖縄電力	4,500	1,070.00	4,815,000	
電源開発	13,600	2,154.00	29,294,400	
エフオン	1,200	592.00	710,400	
イーレックス	3,200	2,032.00	6,502,400	
レノバ	4,900	2,251.00	11,029,900	
東京瓦斯	38,300	2,681.00	102,682,300	
大阪瓦斯	36,600	2,147.00	78,580,200	
東邦瓦斯	7,200	2,510.00	18,072,000	
北海道瓦斯	1,000	1,808.00	1,808,000	
広島ガス	3,800	346.00	1,314,800	
西部ガスホールディングス	1,600	1,773.00	2,836,800	
静岡ガス	4,100	1,122.00	4,600,200	
メタウォーター	2,200	1,645.00	3,619,000	
アイネット	1,000	1,280.00	1,280,000	
松竹	1,000	11,050.00	11,050,000	

東宝	11,300	4,730.00	53,449,000	
エイチ・アイ・エス	4,900	2,091.00	10,245,900	
東映	500	17,110.00	8,555,000	
ラックランド	600	2,898.00	1,738,800	
エヌ・ティ・ティ・データ	57,000	1,883.00	107,331,000	
共立メンテナンス	3,200	5,270.00	16,864,000	
イチネンホールディングス	2,100	1,272.00	2,671,200	
建設技術研究所	900	3,480.00	3,132,000	
スペース	1,400	890.00	1,246,000	
アインホールディングス	2,600	5,600.00	14,560,000	
燦ホールディングス	900	2,080.00	1,872,000	
ピー・シー・エー	1,000	1,239.00	1,239,000	
スバル興業	100	9,180.00	918,000	
東京テアトル	700	1,130.00	791,000	
タナベコンサルティンググループ	700	879.00	615,300	
ビジネスブレイン太田昭和	600	2,095.00	1,257,000	
ナガワ	500	7,600.00	3,800,000	
東京都競馬	1,500	3,725.00	5,587,500	
常磐興産	700	1,243.00	870,100	
カナモト	3,500	2,226.00	7,791,000	
D T S	3,900	3,095.00	12,070,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9,100	6,240.00	56,784,000	
シーイーシー	2,200	1,506.00	3,313,200	
カプコン	18,000	4,490.00	80,820,000	
西尾レントオール	1,800	3,110.00	5,598,000	
アイ・エス・ビー	900	1,202.00	1,081,800	
アゴーラ ホスピタリティー グループ	9,000	25.00	225,000	
日本空港ビルデング	6,300	6,500.00	40,950,000	
トランス・コスモス	2,400	3,385.00	8,124,000	
乃村工藝社	8,000	898.00	7,184,000	
ジャステック	1,200	1,238.00	1,485,600	
S C S K	14,800	1,952.00	28,889,600	
藤田観光	900	3,315.00	2,983,500	
KNT-CTホールディングス	1,200	1,713.00	2,055,600	
日本管財	2,000	2,551.00	5,102,000	
トーカイ	1,700	1,904.00	3,236,800	
白洋舎	100	1,576.00	157,600	
セコム	19,000	7,875.00	149,625,000	
N S W	800	2,104.00	1,683,200	
セントラル警備保障	1,000	2,490.00	2,490,000	
アイネス	1,300	1,331.00	1,730,300	
丹青社	4,000	712.00	2,848,000	
メイテック	7,500	2,431.00	18,232,500	
T K C	3,200	3,645.00	11,664,000	
富士ソフト	2,000	7,710.00	15,420,000	
応用地質	1,800	1,998.00	3,596,400	
船井総研ホールディングス	3,900	2,782.00	10,849,800	
N S D	6,600	2,292.00	15,127,200	
進学会ホールディングス	1,400	300.00	420,000	

丸紅建材リース	200	1,939.00	387,800	
オオバ	1,300	716.00	930,800	
コナミグループ	7,800	6,260.00	48,828,000	
いであ	500	1,526.00	763,000	
学究社	600	2,011.00	1,206,600	
ベネッセホールディングス	7,000	1,976.00	13,832,000	
イオンディライト	2,000	3,020.00	6,040,000	
ナック	900	979.00	881,100	
福井コンピュータホールディングス	1,300	2,820.00	3,666,000	
ダイセキ	3,800	4,025.00	15,295,000	
ステップ	700	1,776.00	1,243,200	
日鉄物産	1,300	9,260.00	12,038,000	
泉州電業	1,000	3,655.00	3,655,000	
元気寿司	600	3,045.00	1,827,000	
トラスコ中山	4,000	2,202.00	8,808,000	
ヤマダホールディングス	78,400	479.00	37,553,600	
オートバックスセブン	6,600	1,448.00	9,556,800	
モリト	1,500	985.00	1,477,500	
アークランズ	2,800	1,455.00	4,074,000	
ニトリホールディングス	7,700	16,085.00	123,854,500	
グルメ杵屋	1,600	1,011.00	1,617,600	
愛眼	1,300	165.00	214,500	
ケーユーホールディングス	1,100	1,455.00	1,600,500	
吉野家ホールディングス	7,600	2,371.00	18,019,600	
加藤産業	2,400	3,635.00	8,724,000	
北恵	700	699.00	489,300	
イノテック	1,200	1,331.00	1,597,200	
イエローハット	3,500	1,778.00	6,223,000	
松屋フーズホールディングス	900	4,000.00	3,600,000	
JBCホールディングス	1,400	1,892.00	2,648,800	
JKホールディングス	1,600	1,062.00	1,699,200	
サガミホールディングス	3,100	1,273.00	3,946,300	
日伝	1,200	1,903.00	2,283,600	
関西フードマーケット	1,900	1,357.00	2,578,300	
ミロク情報サービス	1,800	1,809.00	3,256,200	
北沢産業	1,900	267.00	507,300	
杉本商事	800	1,916.00	1,532,800	
因幡電機産業	5,000	2,804.00	14,020,000	
王将フードサービス	1,300	6,070.00	7,891,000	
ミニストップ	1,500	1,412.00	2,118,000	
アークス	3,600	2,218.00	7,984,800	
バローホールディングス	3,800	1,930.00	7,334,000	
東テック	700	4,155.00	2,908,500	
ミスミグループ本社	28,900	3,115.00	90,023,500	
アルテック	1,000	272.00	272,000	
ベルク	900	5,530.00	4,977,000	
大庄	1,100	1,038.00	1,141,800	
タキヒヨー	300	963.00	288,900	
ファーストリテイリング	2,900	82,670.00	239,743,000	

ソフトバンクグループ	105,000	5,729.00	601,545,000	
蔵王産業	400	1,995.00	798,000	
スズケン	5,900	3,485.00	20,561,500	
サンドラッグ	7,200	3,710.00	26,712,000	
サックスバー ホールディングス	1,900	774.00	1,470,600	
ジェコス	1,400	879.00	1,230,600	
ヤマザワ	400	1,458.00	583,200	
やまや	400	2,613.00	1,045,200	
グローセル	2,200	414.00	910,800	
ベルーナ	4,500	685.00	3,082,500	
合 計	21,299,500		52,071,981,740	

② 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	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		2,062,791	1,029,969
コール・ローン		432,597,182	140,858,383
国債証券		147,653,807,100	140,386,338,900
地方債証券		11,144,083,947	9,935,478,787
特殊債券		13,784,162,928	12,329,223,538
社債券		7,426,485,500	7,624,656,700
未収利息		405,851,717	390,721,831
前払費用		6,750,206	4,727,609
流動資産合計		180,855,801,371	170,813,035,717
資産合計		180,855,801,371	170,813,035,717
負債の部			
流動負債			
未払金		100,000,000	—
未払解約金		80,291,183	25,235,916
未払利息		1,168	376
その他未払費用		740	646
流動負債合計		180,293,091	25,236,938
負債合計		180,293,091	25,236,938
純資産の部			
元本等			
元本	1	142,408,879,533	139,970,293,356
剰余金			
剰余金又は欠損金(△)		38,266,628,747	30,817,505,423
元本等合計		180,675,508,280	170,787,798,779
純資産合計		180,675,508,280	170,787,798,779
負債純資産合計		180,855,801,371	170,813,035,717

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
1 期首元本額	125,544,496,076円	142,408,879,533円
期中追加設定元本額	28,194,208,595円	12,527,561,921円
期中一部解約元本額	11,329,825,138円	14,966,148,098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）	1,146,597,358円	1,164,208,743円
日本債券インデックス・ファンド（年金1）＜適格機関投資家限定＞	4,145,561,580円	3,880,671,890円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	7,433,390円	20,756,181円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	263,966,341円	158,848,419円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	490,392円	501,257円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	11,910,967円	10,060,868円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	32,015,457円	16,002,289円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	12,634,152,650円	11,663,119,305円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	7,178,062円	6,059,994円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	4,869,450,738円	4,160,935,398円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	2,068,538,926円	1,907,390,852円

バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	12,884,484円	12,917,978円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	1,387,394,179円	1,125,244,883円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	6,818,271,354円	6,305,197,688円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	1,595,439,627円	1,347,912,026円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	5,531,075,725円	4,883,052,281円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	147,547,330円	139,027,117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>	86,760,881円	84,694,304円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	74,286,355円	60,740,056円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	42,156,723円	40,658,164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>	18,130,385,917円	21,845,079,042円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	60,836,011円	46,549,248円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	3,667,881,617円	3,297,609,591円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	17,564,426円	15,010,274円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	12,541,551円	12,663,406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>	461,330,787円	259,120,757円
日本債券インデックス・ファンド<適格機関投資家限定>	856,700,066円	714,552,790円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	2,518,868,674円	2,367,985,908円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	9,583,442,330円	8,589,297,655円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	14,884,709円	14,162,034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>	319,947,884円	321,228,379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>	384,138,329円	1,100,556,491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>	213,778,261円	214,965,344円
ステート・ストリート日本債券インデックス・オープン	4,736,282,762円	3,243,408,716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>	56,331,731,561円	57,331,301,564円
世界バランス40VA<適格機関投	27,942,699円	19,787,946円

資家限定> 世界バランス60VA<適格機関投資家限定> グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定> グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定> グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定> 計	102,209,601円 1,409,812円 3,955,098,488円 90,264,950円 38,526,579円 142,408,879,533円	16,872,994円 1,392,721円 3,462,057,948円 77,575,032円 31,115,823円 139,970,293,356円
2 受益権の総数	142,408,879,533口	139,970,293,356口

(金融商品に関する注記)

I 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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(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 該当する事項はありません。	(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	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△2,951,774,800	△7,643,983,300
地方債証券	△160,742,382	△396,177,964
特殊債券	△165,358,206	△435,275,253
社債券	△88,374,700	△408,500,800
合計	△3,366,250,088	△8,883,937,317

(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)

	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2687円 (12,687円)	1,2202円 (12,202円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

① 株式

該当する事項はありません。

② 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
国債証券	第100回利付国債(20年)	200,000,000	219,814,000	
	第101回利付国債(20年)	100,000,000	110,911,000	
	第102回利付国債(20年)	200,000,000	222,542,000	
	第103回利付国債(20年)	200,000,000	221,490,000	
	第104回利付国債(20年)	150,000,000	164,541,000	
	第105回利付国債(20年)	100,000,000	110,026,000	
	第106回利付国債(20年)	200,000,000	221,150,000	
	第107回利付国債(20年)	100,000,000	110,309,000	
	第108回利付国債(20年)	100,000,000	109,163,000	
	第109回利付国債(20年)	200,000,000	218,762,000	
	第10回利付国債(40年)	150,000,000	126,012,000	
	第110回利付国債(20年)	200,000,000	221,144,000	
	第111回利付国債(20年)	200,000,000	222,968,000	
	第112回利付国債(20年)	200,000,000	221,730,000	
	第113回利付国債(20年)	200,000,000	222,290,000	
	第114回利付国債(20年)	300,000,000	334,338,000	
	第115回利付国債(20年)	500,000,000	560,555,000	
	第116回利付国債(20年)	500,000,000	562,300,000	
	第118回利付国債(20年)	300,000,000	333,570,000	
	第11回利付国債(40年)	90,000,000	72,841,500	
	第122回利付国債(20年)	500,000,000	549,060,000	
	第123回利付国債(20年)	300,000,000	336,534,000	
	第126回利付国債(20年)	300,000,000	334,791,000	
	第127回利付国債(20年)	400,000,000	443,284,000	
	第128回利付国債(20年)	500,000,000	555,285,000	
	第12回利付国債(30年)	300,000,000	341,700,000	
	第12回利付国債(40年)	800,000,000	578,216,000	
	第130回利付国債(20年)	400,000,000	441,680,000	
	第132回利付国債(20年)	400,000,000	439,092,000	
	第133回利付国債(20年)	300,000,000	331,848,000	
	第135回利付国債(20年)	400,000,000	439,564,000	
	第136回利付国債(20年)	450,000,000	490,621,500	
	第137回利付国債(20年)	400,000,000	440,220,000	
	第139回利付国債(20年)	300,000,000	327,507,000	
第139回利付国債(5年)	100,000,000	100,209,000		
第13回利付国債(30年)	300,000,000	338,739,000		
第13回利付国債(40年)	740,000,000	533,207,000		

第140回利付国債(20年)	300,000,000	330,189,000	
第140回利付国債(5年)	1,300,000,000	1,303,185,000	
第141回利付国債(20年)	300,000,000	329,859,000	
第141回利付国債(5年)	1,600,000,000	1,604,288,000	
第142回利付国債(20年)	300,000,000	332,634,000	
第142回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,002,920,000	
第143回利付国債(20年)	400,000,000	435,720,000	
第143回利付国債(5年)	400,000,000	401,204,000	
第144回利付国債(20年)	500,000,000	539,925,000	
第144回利付国債(5年)	1,100,000,000	1,103,454,000	
第145回利付国債(20年)	450,000,000	494,523,000	
第145回利付国債(5年)	1,800,000,000	1,805,796,000	
第146回利付国債(20年)	520,000,000	571,209,600	
第146回利付国債(5年)	2,150,000,000	2,156,686,500	
第147回利付国債(20年)	560,000,000	609,190,400	
第147回利付国債(5年)	1,600,000,000	1,600,000,000	
第148回利付国債(20年)	500,000,000	538,340,000	
第148回利付国債(5年)	1,500,000,000	1,498,995,000	
第149回利付国債(20年)	630,000,000	677,552,400	
第149回利付国債(5年)	1,500,000,000	1,497,315,000	
第14回利付国債(30年)	200,000,000	234,340,000	
第14回利付国債(40年)	810,000,000	624,218,400	
第150回利付国債(20年)	470,000,000	499,877,900	
第150回利付国債(5年)	1,600,000,000	1,595,104,000	
第151回利付国債(20年)	550,000,000	571,604,000	
第151回利付国債(5年)	1,000,000,000	995,330,000	
第152回利付国債(20年)	750,000,000	778,312,500	
第152回利付国債(5年)	200,000,000	199,836,000	
第153回利付国債(20年)	750,000,000	785,895,000	
第153回利付国債(5年)	1,500,000,000	1,490,640,000	
第154回利付国債(20年)	840,000,000	868,963,200	
第154回利付国債(5年)	1,600,000,000	1,594,176,000	
第155回利付国債(20年)	800,000,000	806,880,000	
第155回利付国債(5年)	600,000,000	602,868,000	
第156回利付国債(20年)	620,000,000	578,323,600	
第157回利付国債(20年)	400,000,000	361,520,000	
第158回利付国債(20年)	570,000,000	534,648,600	
第159回利付国債(20年)	500,000,000	473,975,000	
第15回利付国債(30年)	200,000,000	236,660,000	
第15回利付国債(40年)	400,000,000	335,440,000	
第160回利付国債(20年)	750,000,000	718,252,500	
第161回利付国債(20年)	550,000,000	517,885,500	
第162回利付国債(20年)	900,000,000	843,993,000	
第163回利付国債(20年)	700,000,000	654,129,000	
第164回利付国債(20年)	400,000,000	366,832,000	
第165回利付国債(20年)	450,000,000	411,084,000	
第166回利付国債(20年)	710,000,000	666,462,800	
第167回利付国債(20年)	500,000,000	453,445,000	
第168回利付国債(20年)	400,000,000	355,440,000	

第169回利付国債(20年)	370,000,000	322,118,300	
第16回利付国債(30年)	500,000,000	592,265,000	
第170回利付国債(20年)	420,000,000	363,955,200	
第171回利付国債(20年)	400,000,000	345,008,000	
第172回利付国債(20年)	500,000,000	437,120,000	
第173回利付国債(20年)	1,100,000,000	957,297,000	
第174回利付国債(20年)	900,000,000	780,192,000	
第175回利付国債(20年)	480,000,000	421,977,600	
第176回利付国債(20年)	600,000,000	525,516,000	
第177回利付国債(20年)	820,000,000	702,969,600	
第178回利付国債(20年)	750,000,000	652,882,500	
第179回利付国債(20年)	1,170,000,000	1,015,361,100	
第17回利付国債(30年)	200,000,000	234,828,000	
第180回利付国債(20年)	820,000,000	751,021,600	
第181回利付国債(20年)	480,000,000	446,889,600	
第182回利付国債(20年)	300,000,000	288,831,000	
第183回利付国債(20年)	200,000,000	202,514,000	
第18回利付国債(30年)	200,000,000	232,646,000	
第19回利付国債(30年)	200,000,000	232,874,000	
第1回利付国債(30年)	300,000,000	347,037,000	
第1回利付国債(40年)	160,000,000	191,470,400	
第20回利付国債(30年)	100,000,000	118,884,000	
第21回利付国債(30年)	200,000,000	233,136,000	
第22回利付国債(30年)	200,000,000	238,128,000	
第23回利付国債(30年)	100,000,000	119,038,000	
第24回利付国債(30年)	320,000,000	381,254,400	
第25回利付国債(30年)	100,000,000	116,642,000	
第26回メキシコ合衆国円貨債券(2018)	100,000,000	99,539,000	
第26回利付国債(30年)	150,000,000	177,000,000	
第27回利付国債(30年)	320,000,000	382,041,600	
第28回利付国債(30年)	300,000,000	358,242,000	
第29回利付国債(30年)	200,000,000	236,148,000	
第2回メキシコ合衆国円貨債券(2022)(SDG債)	100,000,000	98,780,000	
第2回利付国債(30年)	380,000,000	432,170,200	
第2回利付国債(40年)	500,000,000	577,505,000	
第30回利付国債(30年)	350,000,000	408,201,500	
第31回利付国債(30年)	400,000,000	460,724,000	
第32回利付国債(30年)	500,000,000	582,890,000	
第334回利付国債(10年)	700,000,000	706,363,000	
第335回利付国債(10年)	800,000,000	807,200,000	
第336回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,010,240,000	
第337回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,006,580,000	
第338回利付国債(10年)	650,000,000	655,999,500	
第339回利付国債(10年)	900,000,000	909,108,000	
第33回利付国債(30年)	400,000,000	447,424,000	
第340回利付国債(10年)	1,480,000,000	1,496,220,800	
第341回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,311,388,000	
第342回利付国債(10年)	800,000,000	802,328,000	
第343回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,202,988,000	

第344回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,201,920,000	
第345回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,000,570,000	
第346回利付国債(10年)	800,000,000	799,344,000	
第347回利付国債(10年)	750,000,000	748,387,500	
第348回利付国債(10年)	900,000,000	896,724,000	
第349回利付国債(10年)	1,260,000,000	1,253,964,600	
第34回利付国債(30年)	550,000,000	632,153,500	
第350回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,787,814,000	
第351回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,486,995,000	
第352回利付国債(10年)	1,260,000,000	1,246,858,200	
第353回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,283,997,000	
第354回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,084,281,000	
第355回利付国債(10年)	1,230,000,000	1,209,840,300	
第356回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,128,966,500	
第357回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,371,622,000	
第358回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,271,855,000	
第359回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,267,721,000	
第35回利付国債(30年)	520,000,000	580,985,600	
第360回利付国債(10年)	1,700,000,000	1,652,145,000	
第361回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,065,251,000	
第362回利付国債(10年)	1,700,000,000	1,642,115,000	
第363回利付国債(10年)	1,530,000,000	1,475,180,100	
第364回利付国債(10年)	1,700,000,000	1,636,658,000	
第365回利付国債(10年)	1,700,000,000	1,635,587,000	
第366回利付国債(10年)	1,600,000,000	1,553,600,000	
第367回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,183,200,000	
第368回利付国債(10年)	780,000,000	778,167,000	
第369回利付国債(10年)	300,000,000	300,000,000	
第36回利付国債(30年)	480,000,000	536,683,200	
第37回利付国債(30年)	330,000,000	363,165,000	
第38回利付国債(30年)	800,000,000	865,744,000	
第39回利付国債(30年)	330,000,000	362,706,300	
第3回利付国債(30年)	300,000,000	339,873,000	
第3回利付国債(40年)	250,000,000	289,265,000	
第40回利付国債(30年)	350,000,000	378,409,500	
第41回利付国債(30年)	300,000,000	318,882,000	
第42回利付国債(30年)	130,000,000	138,030,100	
第435回利付国債(2年)	700,000,000	700,770,000	
第437回利付国債(2年)	800,000,000	800,968,000	
第438回利付国債(2年)	600,000,000	600,732,000	
第439回利付国債(2年)	1,550,000,000	1,551,891,000	
第43回利付国債(30年)	340,000,000	360,899,800	
第441回利付国債(2年)	600,000,000	600,720,000	
第442回利付国債(2年)	1,200,000,000	1,201,416,000	
第444回利付国債(2年)	600,000,000	600,726,000	
第44回利付国債(30年)	350,000,000	371,087,500	
第45回利付国債(30年)	420,000,000	429,172,800	
第46回利付国債(30年)	350,000,000	357,406,000	
第47回利付国債(30年)	500,000,000	519,660,000	

第48回利付国債(30年)	500,000,000	500,000,000	
第49回利付国債(30年)	420,000,000	419,634,600	
第4回利付国債(40年)	250,000,000	289,720,000	
第50回利付国債(30年)	350,000,000	308,266,000	
第51回利付国債(30年)	250,000,000	194,957,500	
第52回利付国債(30年)	400,000,000	326,628,000	
第53回利付国債(30年)	400,000,000	333,584,000	
第54回利付国債(30年)	410,000,000	357,339,600	
第55回利付国債(30年)	390,000,000	338,925,600	
第56回利付国債(30年)	650,000,000	563,231,500	
第57回利付国債(30年)	340,000,000	293,753,200	
第58回利付国債(30年)	480,000,000	413,875,200	
第59回利付国債(30年)	400,000,000	335,720,000	
第5回利付国債(30年)	100,000,000	113,410,000	
第5回利付国債(40年)	130,000,000	145,665,000	
第60回利付国債(30年)	340,000,000	298,972,200	
第61回利付国債(30年)	120,000,000	100,078,800	
第62回利付国債(30年)	250,000,000	197,225,000	
第63回利付国債(30年)	250,000,000	191,065,000	
第64回利付国債(30年)	310,000,000	236,223,100	
第65回利付国債(30年)	310,000,000	235,748,800	
第66回利付国債(30年)	290,000,000	219,692,400	
第67回利付国債(30年)	700,000,000	558,936,000	
第68回利付国債(20年)	500,000,000	512,335,000	
第68回利付国債(30年)	600,000,000	478,326,000	
第69回利付国債(20年)	200,000,000	204,718,000	
第69回利付国債(30年)	200,000,000	163,764,000	
第6回利付国債(30年)	180,000,000	208,305,000	
第6回利付国債(40年)	150,000,000	164,307,000	
第70回利付国債(20年)	600,000,000	619,788,000	
第70回利付国債(30年)	360,000,000	294,098,400	
第71回利付国債(30年)	680,000,000	554,757,600	
第72回利付国債(20年)	600,000,000	620,568,000	
第72回利付国債(30年)	580,000,000	474,370,400	
第73回利付国債(30年)	720,000,000	588,096,000	
第74回利付国債(20年)	300,000,000	311,853,000	
第74回利付国債(30年)	520,000,000	460,371,600	
第75回利付国債(30年)	400,000,000	382,148,000	
第76回利付国債(20年)	200,000,000	208,074,000	
第76回利付国債(30年)	260,000,000	254,410,000	
第77回利付国債(20年)	300,000,000	312,735,000	
第77回利付国債(30年)	90,000,000	92,043,900	
第78回利付国債(20年)	250,000,000	261,260,000	
第7回利付国債(30年)	300,000,000	346,167,000	
第7回利付国債(40年)	160,000,000	167,670,400	
第80回利付国債(20年)	100,000,000	104,970,000	
第81回利付国債(20年)	200,000,000	210,446,000	
第83回利付国債(20年)	300,000,000	317,901,000	
第85回利付国債(20年)	200,000,000	212,876,000	

	第 8 8 回利付国債 (2 0 年)	400,000,000	430,240,000	
	第 8 9 回利付国債 (2 0 年)	400,000,000	428,912,000	
	第 8 回利付国債 (3 0 年)	300,000,000	332,700,000	
	第 8 回利付国債 (4 0 年)	50,000,000	48,653,500	
	第 9 0 回利付国債 (2 0 年)	300,000,000	322,977,000	
	第 9 1 回利付国債 (2 0 年)	300,000,000	324,051,000	
	第 9 2 回利付国債 (2 0 年)	340,000,000	366,135,800	
	第 9 3 回利付国債 (2 0 年)	300,000,000	322,929,000	
	第 9 4 回利付国債 (2 0 年)	300,000,000	324,147,000	
	第 9 5 回利付国債 (2 0 年)	150,000,000	163,896,000	
	第 9 6 回利付国債 (2 0 年)	100,000,000	108,404,000	
	第 9 7 回利付国債 (2 0 年)	150,000,000	163,794,000	
	第 9 8 回利付国債 (2 0 年)	100,000,000	108,742,000	
	第 9 9 回利付国債 (2 0 年)	200,000,000	218,220,000	
	第 9 回利付国債 (3 0 年)	100,000,000	107,076,000	
	第 9 回利付国債 (4 0 年)	1,730,000,000	1,234,268,500	
	国債証券 小計	141,750,000,000	140,386,338,900	
地方債証券	第 1 0 回静岡県公募公債 (2 0 年)	100,000,000	110,195,000	
	第 1 0 回千葉県公募公債 (2 0 年)	100,000,000	108,511,000	
	第 1 1 9 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,008,000	
	第 1 1 回埼玉県公募公債 (3 0 年)	100,000,000	75,121,000	
	第 1 1 回静岡県公募公債 (2 0 年)	150,000,000	162,793,500	
	第 1 1 回川崎市公募公債 (3 0 年)	100,000,000	83,810,000	
	第 1 2 0 回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	100,000,000	100,492,000	
	第 1 2 9 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,582,000	
	第 1 2 回埼玉県公募公債 (3 0 年)	100,000,000	75,002,000	
	第 1 2 回川崎市公募公債 (3 0 年)	100,000,000	75,002,000	
	第 1 2 回東京都公募公債 (2 0 年)	100,000,000	109,091,000	
	第 1 3 0 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,687,000	
	第 1 3 5 回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	100,609,000	
	第 1 3 6 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,823,000	
	第 1 3 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,799,000	
	第 1 3 回千葉県公募公債 (2 0 年)	100,000,000	108,668,000	
	第 1 3 回大阪市公募公債 (2 0 年)	50,000,000	55,145,000	
	第 1 3 回東京都公募公債 (2 0 年)	100,000,000	108,705,000	
	第 1 4 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,106,000	
	第 1 4 回横浜市公募公債 (2 0 年)	100,000,000	109,757,000	
	第 1 4 回神奈川県公募公債 (2 0 年)	100,000,000	109,516,000	
	第 1 4 回川崎市公募公債 (2 0 年)	100,000,000	108,697,000	
	第 1 5 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,826,000	
	第 1 5 回千葉県公募公債 (2 0 年・定時償還)	95,000,000	91,393,800	
	第 1 6 0 回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	86,087,000	
	第 1 8 1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,984,000	
	第 1 8 4 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,752,000	
	第 1 8 8 回共同発行市場公募地方債	30,000,000	29,686,500	
	第 1 8 回神奈川県公募公債 (2 0 年)	50,000,000	54,494,000	
	第 2 0 6 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,605,000	
	第 2 0 9 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,105,000	
	第 2 1 1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	95,880,000	

第24回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	94,538,000	
第24回千葉県公募公債	100,000,000	90,846,000	
第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	108,344,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	104,561,000	
第29回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	84,841,000	
第2回横浜市公募公債(30年)	100,000,000	116,572,000	
第2回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	110,842,000	
第2回兵庫県公募公債(30年)	100,000,000	115,321,000	
第2回名古屋市公募公債(15年)	100,000,000	102,306,000	
第30回2号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	100,816,000	
第36回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	92,180,000	
第374回大阪府公募公債(10年)	34,000,000	34,134,980	
第387回大阪府公募公債(10年)	44,040,000	44,354,445	
第392回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,570,000	
第3回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	118,775,000	
第3回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	107,709,000	
第3回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	104,651,000	
第469回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	95,038,000	
第479回大阪府公募公債(10年)	104,000,000	99,476,000	
第4回横浜市公募公債(30年)	100,000,000	117,653,000	
第4回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	110,232,000	
第4回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	101,960,000	
第5回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	111,185,000	
第6回京都市公募公債(20年)	200,000,000	218,814,000	
第6回札幌市公募公債(20年)	100,000,000	110,607,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,997,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	104,989,000	
第739回東京都公募公債	100,000,000	100,437,000	
第746回東京都公募公債	100,000,000	100,985,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	100,732,000	
第759回東京都公募公債	100,000,000	99,644,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	99,615,000	
第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,324,000	
第800回東京都公募公債	200,000,000	193,554,000	
平成24年度第12回愛知県公募公債(30年)	10,000,000	11,150,100	
平成24年度第14回愛知県公募公債(15年)	100,000,000	104,685,000	
平成24年度第8回福岡市公募公債	100,000,000	100,058,000	
平成25年度第10回京都府公募公債(15年)	100,000,000	103,855,000	
平成25年度第1回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	100,690,000	
平成26年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	104,679,000	
平成26年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	100,829,000	
平成26年度第9回静岡県公募公債	20,000,000	20,170,000	
平成27年度第12回愛知県公募公債(15年)	100,000,000	100,538,000	
平成27年度第13回北海道公募公債	100,000,000	100,974,000	
平成27年度第1回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	100,805,000	
平成27年度第2回京都府公募公債(15年)	100,000,000	100,853,000	
平成27年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,011,000	
平成27年度第9回北海道公募公債	100,000,000	101,008,000	
平成28年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,805,000	

平成28年度第5回広島市公募公債	100,000,000	100,019,000	
平成28年度第6回福岡県公募公債	100,000,000	99,866,000	
平成29年度第15回北海道公募公債	100,000,000	99,309,000	
平成29年度第1回秋田県公募公債	145,900,000	144,659,850	
平成29年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	99,678,000	
平成29年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	99,250,000	
平成29年度第3回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	99,828,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,635,000	
平成29年度第5回広島県公募公債	100,000,000	99,563,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,715,000	
平成30年度第18回北海道公募公債	20,000,000	19,585,800	
平成30年度第1回熊本市公募公債	100,000,000	98,924,000	
平成30年度第2回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	96,469,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	82,777,000	
平成30年度第6回広島市公募公債	145,000,000	142,088,400	
令和2年度第3回長崎県公募公債(10年)	12,400,000	11,961,412	
令和2年度第9回静岡県公募公債	100,000,000	95,962,000	
令和3年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	84,239,000	
令和3年度第4回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	85,548,000	
令和3年度第6回福岡県公募公債	100,000,000	95,154,000	
令和元年度第8回京都府公募公債(30年)	100,000,000	71,601,000	
地方債証券 小計	9,910,340,000	9,935,478,787	
特殊債券			
F116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,799,000	
F149回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,844,000	
F181回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,116,000	
F190回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,205,000	
F308回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,671,000	
F438回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,870,000	
F538回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,660,000	
い第855号商工債	100,000,000	99,338,000	
い第856号商工債	100,000,000	99,323,000	
第101回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,300,000	56,488,042	
第106回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,531,000	
第106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,218,000	60,918,888	
第108回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,639,000	
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	110,408,000	
第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	137,952,000	132,621,534	
第112回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,686,000	
第114回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,929,000	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,629,000	69,369,821	
第118回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	91,063,000	
第119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,281,000	70,153,047	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	104,176,000	
第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,681,000	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,532,000	71,953,192	
第125回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,654,000	
第12回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,630,000	
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,611,000	73,679,863	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,637,000	74,753,561	

第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,628,000	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,962,000	75,770,355	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,468,000	76,660,395	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,921,000	76,309,504	
第139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,465,000	76,574,063	
第13回公営企業債券（20年）	10,000,000	10,476,200	
第145回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	94,794,000	
第146回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,663,000	
第149回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,702,000	
第157回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,673,000	
第168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）	100,000,000	99,701,000	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,038,000	87,469,233	
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,189,000	88,196,865	
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	109,390,000	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,385,000	88,877,635	
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	108,886,000	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,702,000	89,233,906	
第174回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,763,000	89,739,613	
第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,687,000	90,004,149	
第177回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,012,000	90,927,204	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,779,000	91,396,152	
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	100,045,000	
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	100,097,000	
第18回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	100,054,000	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,262,000	
第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,482,000	
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	1,004,620	
第203回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,678,000	
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	100,518,000	
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	100,590,000	
第20回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	108,205,000	
第215回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,336,000	
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	2,016,020	
第21回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	100,868,000	
第22回公営企業債券（20年）	100,000,000	108,436,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,424,000	
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	100,849,000	
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	13,106,990	
第237回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,107,000	
第23回国際協力銀行債券	100,000,000	105,462,000	
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	130,520,400	
第252回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,935,000	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,970,000	34,645,205	
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	100,704,000	
第26回日本高速道路保有・債務返済機構債券	10,000,000	11,775,500	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,549,000	19,436,384	
第28回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	103,419,000	
第28回道路債券	200,000,000	235,652,000	

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	200,264,000	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,217,000	21,245,034	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,236,000	21,452,182	
第30回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,687,000	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,887,000	20,893,679	
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	99,512,000	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,334,000	21,315,725	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,498,000	20,331,929	
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	92,099,000	
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	92,224,000	
第342回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	13,000,000	12,879,100	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,272,000	11,438,262	
第352回信金中金債（5年）	100,000,000	99,988,000	
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	91,869,000	
第362回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	85,151,000	
第364回信金中金債（5年）	100,000,000	99,749,000	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,219,000	20,052,335	
第377回信金中金債（5年）	100,000,000	99,509,000	
第378回信金中金債（5年）	100,000,000	99,465,000	
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,435,000	
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	88,269,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,109,000	
第38回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,526,000	9,544,004	
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,513,000	22,342,971	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,706,000	21,412,902	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,802,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	39,773,000	39,425,383	
第3回都市再生債券	100,000,000	103,722,000	
第404回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	72,265,000	
第41号商工債（10年）	100,000,000	95,765,000	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,904,000	25,737,536	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,032,000	51,044,273	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,538,000	20,385,363	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	33,000,000	33,014,850	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,205,000	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,898,000	
第4回公営企業債券（30年）	100,000,000	119,821,000	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	162,000,000	160,488,540	
第55回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	98,046,000	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,856,000	27,778,503	
第5回国際協力機構債券	100,000,000	108,747,000	
第60回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,830,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,955,000	28,866,333	
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,849,000	
第63回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人	100,000,000	99,960,000	
第64回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人	100,000,000	98,974,000	

第65回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,778,000	
第66回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,835,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,461,000	35,234,304	
第68回政府保証地方公共団体金融機構債券	14,000,000	14,080,220	
第68回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	89,461,000	
第68回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,752,000	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,066,000	38,176,126	
第6回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	99,553,000	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,623,000	33,560,585	
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,992,000	31,633,534	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,958,000	
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	99,570,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,548,000	33,211,002	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	104,197,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	104,860,000	
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,221,000	36,940,711	
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	118,132,000	
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	99,641,000	
第89回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,415,000	
第8回公営企業債券(30年)	10,000,000	11,566,700	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	9,993,000	10,015,883	
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	110,404,000	
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	98,450,000	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,967,000	54,789,456	
第96回都市再生債券	100,000,000	100,825,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,651,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,579,000	
第9回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,437,000	
第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,682,000	10,792,772	
特殊債券 小計	12,193,069,000	12,329,223,538	
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	186,112,000	
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	99,970,000	
第10回九州旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	82,368,000	
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	103,630,000	
第11回東急株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	96,813,000	
第122回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同)	100,000,000	79,352,000	
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	89,380,000	
第130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	97,922,000	

第134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	100,000,000	97,720,000	
第13回東京地下鉄株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	107,834,000	
第14回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（2017）	100,000,000	97,295,000	
第14回ソフトバンク株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約	100,000,000	98,561,000	
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	100,074,000	
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	99,641,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,312,000	
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	99,240,000	
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	88,817,000	
第18回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債（2018	100,000,000	99,117,000	
第20回NTTファイナンス株式会社無担保社債（社債間限定同順	100,000,000	99,734,000	
第21回キリン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	99,135,000	
第21回株式会社オリエンタルランド無担保社債（社債間限定同順	100,000,000	99,849,000	
第21回三井住友信託銀行株式会社無担保社債（社債間限定同順位	100,000,000	98,724,000	
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	99,762,000	
第23回ルノー円貨社債（2021）	100,000,000	99,966,000	
第23回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債（社債	200,000,000	183,920,000	
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	107,332,000	
第26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	99,390,000	
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	94,505,000	
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	98,730,000	
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	107,675,000	
第298回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	84,441,000	
第30回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債（201	100,000,000	97,470,000	
第30回大和ハウス工業株式会社無担保社債（特定社債間限定同順	100,000,000	99,790,000	
第31回株式会社光通信無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	82,226,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保	100,000,000	97,317,000	

付)			
第323回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	90,021,000	
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	87,173,000	
第32回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定）	100,000,000	102,245,000	
第350回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	87,364,000	
第35回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	98,226,000	
第36回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債（202）	100,000,000	94,923,000	
第3回NNT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	97,331,000	
第422回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	95,043,000	
第426回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	94,487,000	
第432回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,568,000	
第44回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債（相模鉄道株式）	100,000,000	98,924,000	
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	109,588,000	
第45回東邦瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	94,193,000	
第465回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	97,334,000	
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	102,842,000	
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	111,410,000	
第489回九州電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	190,554,000	
第49回株式会社IHI無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	98,974,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債（社債間限定）	100,000,000	98,211,000	
第4回東京地下鉄株式会社社債（一般担保付）	10,000,000	10,672,700	
第506回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,990,000	
第510回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,120,000	
第517回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	89,090,000	
第521回東北電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	190,944,000	
第524回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	97,755,000	
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約付）	100,000,000	79,760,000	
第534回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	83,916,000	
第540回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	98,369,000	
第545回中部電力株式会社社債（一般担保付）（グリーンボンド）	100,000,000	92,723,000	
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	86,613,000	
第59回日本電気株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,104,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	97,135,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債（担保提供制限等財	100,000,000	110,144,000	

務上特約			
第67回三菱UFJリース株式会社無担保社債（社債間限定同順位）	100,000,000	97,419,000	
第67回東京瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	76,444,000	
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	99,024,000	
第72回株式会社ホンダファイナンス無担保社債（社債間限定同順）	100,000,000	99,665,000	
第73回株式会社ホンダファイナンス無担保社債（社債間限定同順）	100,000,000	98,886,000	
第8回楽天株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	96,442,000	
第96回トヨタファイナンス株式会社無担保社債（社債間限定同等）	200,000,000	198,906,000	
社債券 小計	7,910,000,000	7,624,656,700	
合 計	171,763,409,000	170,275,697,925	

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	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		4,969,966,480	4,748,045,867
金銭信託		8,261,676	8,390,656
コール・ローン		1,978,482,245	3,901,696,407
株式		185,167,372,213	197,187,704,503
投資証券		4,298,547,977	4,608,256,742
派生商品評価勘定		12,622,312	457,879,306
未収入金		41,041,575	21,956,109
未収配当金		191,050,228	232,055,540
差入委託証拠金		1,728,779,788	1,257,017,904
流動資産合計		198,396,124,494	212,423,003,034
資産合計		198,396,124,494	212,423,003,034
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		496,985,663	10,932,262
未払解約金		159,043,000	198,094,000
未払利息		5,342	10,436
その他未払費用		1,022	1,689
流動負債合計		656,035,027	209,038,387
負債合計		656,035,027	209,038,387
純資産の部			
元本等			
元本	1	47,184,065,744	45,434,848,844
剰余金			
剰余金又は欠損金(△)		150,556,023,723	166,779,115,803
元本等合計		197,740,089,467	212,213,964,647
純資産合計		197,740,089,467	212,213,964,647
負債純資産合計		198,396,124,494	212,423,003,034

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
<p>当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。</p>	<p>同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
1 期首元本額	49,551,945,295円	47,184,065,744円
期中追加設定元本額	5,521,606,426円	5,183,763,132円
期中一部解約元本額	7,889,485,977円	6,932,980,032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	5,315,474,460円	5,144,133,854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	6,330,330,821円	6,286,284,543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	76,275,626円	81,163,684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)	60,143,809円	53,544,059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)	2,519,322,111円	73,047,510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)	26,407,556円	24,203,309円
バランスファンドVA30A<適格機関投資家限定>	442,691円	1,133,923円
バランスファンドVA30B<適格機関投資家限定>	33,036,075円	19,217,219円
バランスファンドVA40A<適格機関投資家限定>	49,318円	44,957円
バランスファンドVA40B<適格機関投資家限定>	2,344,219円	1,863,710円
バランスファンドVA50A<適格機関投資家限定>	4,738,262円	2,221,353円
バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	3,736,418,535円	3,168,663,038円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	917,334円	720,976円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	353,728,849円	273,504,384円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	356,336,772円	299,920,621円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	30,378,834円	28,280,249円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	100,653,224円	74,746,045円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	1,330,879,336円	1,142,808,320円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	199,866,073円	155,096,945円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	695,802,297円	555,875,883円

バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	29,233,539円	25,048,283円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	21,780,444円	16,841,652円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	24,915,442円	22,751,598円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	12,031,668円	8,287,055円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	138,919,975円	113,172,139円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	392,345円	310,551円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	745,981円	693,530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>	339,221,706円	178,075,657円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	120,992,558円	105,834,281円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	20,325,527円	17,803,847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>	18,650,429円	18,153,238円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド(ステイブル)<適格機関投資家限定>	12,601,924円	11,926,274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	319,209,613円	317,795,282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)	2,880,952,979円	2,648,273,659円
全世界株式インデックス・ファンド	1,331,079,869円	1,976,640,969円
世界バランス40VA<適格機関投資家限定>	9,938,569円	6,566,440円
世界バランス60VA<適格機関投資家限定>	101,883,747円	15,282,464円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	502,546円	462,508円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	869,697,340円	705,426,207円
グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	32,663,503円	24,812,496円
グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	15,348,108円	11,431,915円
ワールドエクイティ・ファンドVL<適格機関投資家限定>	19,709,431,730円	21,822,784,217円
計	47,184,065,744円	45,434,848,844円
2 受益権の総数	47,184,065,744口	45,434,848,844口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

<p>1 金融商品に対する取組方針</p>	<p>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。</p>
<p>2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク</p>	<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>
<p>3 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<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>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
<p>1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額</p>	<p>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。</p>	<p>同左</p>
<p>2 金融商品の時価の算定方法</p>	<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</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</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>売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p>	<p>売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>
	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	同左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	△11,184,183,878	7,565,823,047
投資証券	△319,926,555	168,591,981
合計	△11,504,110,433	7,734,415,028

(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	(2022年2月21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	6,458,191,465	—	6,022,145,457	△436,046,008
	S&P 60	365,306,541	—	366,846,440	1,539,899
	SPI 200	269,229,821	—	265,965,480	△3,264,341
	FTSE100INDEX	341,950,183	—	350,475,214	8,525,031
	FSMI INDEX	326,381,294	—	312,378,760	△14,002,534
	EURO STOXX 50	991,411,651	—	959,733,133	△31,678,518
合 計	8,752,470,955	—	8,277,544,484	△474,926,471	

(単位：円)

区 分	種 類	(2023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	7,321,630,697	—	7,556,510,132	234,879,435
	S&P 60	433,536,909	—	443,689,632	10,152,723
	SPI 200	361,668,148	—	369,384,629	7,716,481
	FTSE100INDEX	449,605,329	—	476,212,950	26,607,621
	FSMI INDEX	350,516,404	—	356,784,962	6,268,558
	EURO STOXX 50	1,123,842,764	—	1,216,330,632	92,487,868
合 計	10,040,800,251	—	10,418,912,937	378,112,686	

(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	(2022年2月21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	1,545,014,055	—	1,539,170,976	△5,843,079
	カナダ・ドル	95,586,435	—	94,799,460	△786,975
	オーストラリア・ド ル	55,485,313	—	55,414,092	△71,221
	イギリス・ポンド	65,630,371	—	65,734,326	103,955
	ユーロ	234,835,417	—	232,095,980	△2,739,437
	売建				
	アメリカ・ドル	74,781,855	—	74,772,880	8,975
	カナダ・ドル	5,436,960	—	5,417,112	19,848
	オーストラリア・ド ル	42,048,405	—	42,180,876	△132,471
	イギリス・ポンド	7,815,880	—	7,825,515	△9,635
	ユーロ	9,140,530	—	9,127,370	13,160
	合 計	2,135,775,221	—	2,126,538,587	△9,436,880

(単位：円)

区 分	種 類	(2023年2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	3,421,595,060	—	3,487,174,600	65,579,540
	カナダ・ドル	148,299,818	—	150,122,086	1,822,268
	オーストラリア・ド ル	89,317,102	—	90,313,272	996,170
	イギリス・ポンド	190,356,840	—	193,523,160	3,166,320
	ユーロ	332,828,496	—	335,424,024	2,595,528
	売建				
	アメリカ・ドル	421,661,860	—	426,622,867	△4,961,007
	カナダ・ドル	8,950,410	—	8,947,674	2,736
	オーストラリア・ド ル	16,472,852	—	16,588,152	△115,300
	香港・ドル	8,553,000	—	8,569,300	△16,300
	ユーロ	52,854,335	—	53,089,932	△235,597
	合 計	4,690,889,773	—	4,770,375,067	68,834,358

(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。
 - ① 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。
 - ② 為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
 - (2) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
 - (3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
 3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
 4. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
1口当たり純資産額	4.1908円	4.6707円
(1万口当たり純資産額)	(41,908円)	(46,707円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

① 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	APA CORPORATION	9,800	38.09	373,282.00	
	BAKER HUGHES COMPANY	30,349	30.59	928,375.91	
	CHENIERE ENERGY INC	6,711	144.87	972,222.57	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	3,100	80.09	248,279.00	
	CHEVRON CORPORATION	55,795	162.85	9,086,215.75	
	CONOCOPHILLIPS	38,188	104.12	3,976,134.56	
	COTERRA ENERGY INC	24,300	23.40	568,620.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	18,700	53.33	997,271.00	
	DIAMONDBACK ENERGY	5,000	134.68	673,400.00	
	EOG RESOURCES INC	17,606	118.42	2,084,902.52	
	EQT CORP	10,200	31.25	318,750.00	
	EXXON MOBIL CORPORATION	124,951	111.28	13,904,547.28	
	HALLIBURTON CO	27,014	36.50	986,011.00	
	HESS CORP	8,400	135.52	1,138,368.00	
	HF SINCLAIR CORP	4,900	52.30	256,270.00	
	KINDER MORGAN INC	60,372	17.73	1,070,395.56	
	MARATHON OIL CORP	20,300	25.86	524,958.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	14,930	122.50	1,828,925.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM	27,724	60.73	1,683,678.52	
	ONEOK INC NEW	13,200	67.26	887,832.00	
	OVINTIV INC	7,600	43.54	330,904.00	
	PHILLIPS 66	14,383	99.54	1,431,683.82	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	6,824	208.96	1,425,943.04	
	SCHLUMBERGER LTD	42,362	53.34	2,259,589.08	
	TARGA RESOURCES CORP	6,500	73.94	480,610.00	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	200	1,794.75	358,950.00	
	VALERO ENERGY CORP	11,803	129.61	1,529,786.83	
	WILLIAMS COS	36,541	31.26	1,142,271.66	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	6,647	279.71	1,859,232.37	
	ALBEMARLE CORP	3,500	258.01	903,035.00	
	ALCOA CORP	5,500	46.89	257,895.00	
	AMCOR PLC	21,100	11.42	240,962.00	
	AVERY DENNISON CORP	2,457	182.50	448,402.50	
	BALL CORPORATION	9,504	57.54	546,860.16	
	CELANESE CORPORATION	3,272	118.90	389,040.80	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,200	82.35	510,570.00	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	15,700	19.82	311,174.00	
	CORTEVA INC	21,568	61.81	1,333,118.08	
	CROWN HOLDINGS INC	3,700	86.78	321,086.00	
	DOW INC	21,835	58.13	1,269,268.55	
DUPONT DE NEMOURS INC	14,969	75.08	1,123,872.52		
EASTMAN CHEMICAL CO	3,855	87.05	335,577.75		
ECOLAB INC	7,626	162.41	1,238,538.66		
FMC CORP	3,700	128.20	474,340.00		

FREEPORT MCMORAN INC	43,066	41.74	1,797,574.84	
INT'L FLAVORS FRAGRANCES	7,539	96.50	727,513.50	
INT'L PAPER CO	10,790	38.27	412,933.30	
LINDE PLC	13,073	321.52	4,203,230.96	
LYONDELLBASELL INDU CL A	7,745	97.32	753,743.40	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,900	371.68	706,192.00	
MOSAIC CO/THE	10,401	49.85	518,489.85	
NEWMONT CORPORATION	21,947	45.42	996,832.74	
NUCOR CORP	7,871	168.07	1,322,878.97	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,800	141.01	394,828.00	
PPG INDUSTRIES	6,947	129.91	902,484.77	
RPM INTERNATIONAL INC	3,900	88.07	343,473.00	
SEALED AIR CORP	4,603	50.26	231,346.78	
SHERWIN-WILLIAMS CO	7,389	227.98	1,684,544.22	
STEEL DYNAMICS INC	5,700	124.97	712,329.00	
VULCAN MATERIALS CO	3,956	185.65	734,431.40	
WESTLAKE CORP	1,100	122.51	134,761.00	
WESTROCK COMPANY	8,125	32.55	264,468.75	
3M CO	16,482	112.99	1,862,301.18	
AERCAP HOLDINGS NV	4,100	61.38	251,658.00	
ALLEGION PLC W/I	2,600	118.60	308,360.00	
AMETEK INC	7,000	146.49	1,025,430.00	
BOEING CO	16,770	211.66	3,549,538.20	
CARLISLE COS INC	1,500	266.19	399,285.00	
CARRIER GLOBAL CORP	25,156	45.22	1,137,554.32	
CATERPILLAR	15,871	247.79	3,932,675.09	
CUMMINS ENGINE CO	4,212	257.47	1,084,463.64	
DEERE & CO	8,695	433.31	3,767,630.45	
DOVER CORP	4,214	155.36	654,687.04	
EATON CORP PLC	11,861	175.24	2,078,521.64	
EMERSON ELECTRIC CO	17,549	85.44	1,499,386.56	
FASTENAL CO	17,000	53.44	908,480.00	
FORTIVE CORPORATION	10,034	69.36	695,958.24	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	4,000	64.35	257,400.00	
GENERAC HOLDINGS INC	1,900	126.77	240,863.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	6,960	235.26	1,637,409.60	
GENERAL ELECTRIC CO	32,900	83.04	2,732,016.00	
GRAINGER (WW)	1,367	677.35	925,937.45	
HEICO CORP	1,400	176.90	247,660.00	
HEICO CORP-CLASS A	2,300	139.50	320,850.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	20,217	201.42	4,072,108.14	
HOWMET AEROSPACE INC	11,329	43.02	487,373.58	
HUBBELL INC	1,600	252.06	403,296.00	
HUNTINGTON INGALLS IND	1,200	224.54	269,448.00	
IDEX CORP	2,200	231.00	508,200.00	
ILLINOIS TOOL WORKS	9,318	240.34	2,239,488.12	
INGERSOLL-RAND INC	12,427	57.58	715,546.66	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,700	51.52	242,144.00	

JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	20,624	64.71	1,334,579.04	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	5,670	214.02	1,213,493.40	
LENNOX INTERNATIONAL	1,000	269.37	269,370.00	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	7,198	475.63	3,423,584.74	
MASCO CORP	7,090	55.03	390,162.70	
NORDSON CORP	1,600	246.22	393,952.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,440	470.63	2,089,597.20	
OTIS WORLDWIDE CORP	12,678	84.76	1,074,587.28	
OWENS CORNING	3,100	99.93	309,783.00	
PACCAR INC	15,459	75.69	1,170,091.71	
PARKER HANNIFIN CORP	3,828	355.48	1,360,777.44	
PENTAIR PLC	4,834	56.83	274,716.22	
PLUG POWER INC	14,800	15.58	230,584.00	
QUANTA SERVICES INC	4,300	154.90	666,070.00	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	44,263	101.51	4,493,137.13	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,522	297.72	1,048,569.84	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,900	52.17	255,633.00	
SMITH (A. O.) CORP	3,900	67.24	262,236.00	
SNAP-ON	1,604	252.28	404,657.12	
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,460	89.18	397,742.80	
TEXTRON	6,352	74.81	475,193.12	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	7,031	184.18	1,294,969.58	
TRANSDIGM GROUP INC	1,500	743.97	1,115,955.00	
UNITED RENTALS INC	2,096	461.25	966,780.00	
WABTEC CORPORATION	5,206	105.49	549,180.94	
XYLEM INC	5,454	107.29	585,159.66	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	4,000	96.92	387,680.00	
CINTAS CORP	2,699	444.10	1,198,625.90	
CLARIVATE PLC	8,900	10.71	95,319.00	
COPART INC	12,600	68.40	861,840.00	
COSTAR GROUP	11,700	77.56	907,452.00	
EQUIFAX INC	3,603	211.72	762,827.16	
JACOBS SOLUTIONS INC	3,900	121.89	475,371.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	4,100	101.24	415,084.00	
REPUBLIC SERVICES INC	6,502	131.96	858,003.92	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	3,240	82.42	267,040.80	
ROLLINS	6,925	36.30	251,377.50	
TRANSUNION	5,600	69.28	387,968.00	
VERISK ANALYTICS INC	4,700	177.13	832,511.00	
WASTE CONNECTIONS INC	7,763	136.11	1,056,621.93	
WASTE MANAGEMENT (NEW)	12,320	154.92	1,908,614.40	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,800	101.17	384,446.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	7,216	77.61	560,033.76	
CSX CORP	64,215	31.21	2,004,150.15	
DELTA AIR LINES INC	4,900	38.36	187,964.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,084	111.40	566,357.60	
FEDEX CORP	7,440	210.30	1,564,632.00	

GRAB HOLDINGS LTD - CL A	38,900	3.48	135,372.00	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,457	188.35	462,775.95	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	4,500	60.12	270,540.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	7,069	228.15	1,612,792.35	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,850	354.84	1,011,294.00	
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,310	35.36	152,401.60	
UBER TECHNOLOGIES INC	44,500	34.77	1,547,265.00	
U-HAUL HOLDING CO	2,700	57.37	154,899.00	
UNION PACIFIC CORP	18,666	201.59	3,762,878.94	
UNITED PARCEL SERVICE -CL B	21,897	183.21	4,011,749.37	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	2,500	22.16	55,400.00	
APTIV PLC	8,012	119.64	958,555.68	
BORGWARNER INC	7,400	50.43	373,182.00	
FORD MOTOR COMPANY	118,425	12.89	1,526,498.25	
GENERAL MOTORS CO	41,499	43.17	1,791,511.83	
LEAR CORP	1,750	143.74	251,545.00	
LUCID GROUP INC	12,300	10.93	134,439.00	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	9,300	20.22	188,046.00	
TESLA INC	79,900	208.31	16,643,969.00	
DR HORTON INC	9,966	94.38	940,591.08	
GARMIN LTD	4,500	97.01	436,545.00	
HASBRO INC	4,000	59.36	237,440.00	
LENNAR CORP-CL A	7,812	99.09	774,091.08	
LULULEMON ATHLETICA INC	3,500	320.36	1,121,260.00	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,600	113.93	182,288.00	
NEWELL BRANDS INC	11,744	14.90	174,985.60	
NIKE B	37,904	124.84	4,731,935.36	
NVR INC	90	5,098.14	458,832.60	
PULTE GROUP INC	7,263	54.30	394,380.90	
VF CORP	9,898	26.99	267,147.02	
WHIRLPOOL CORP	1,774	145.00	257,230.00	
AIRBNB INC-CLASS A	11,200	131.60	1,473,920.00	
ARAMARK	7,300	38.30	279,590.00	
BOOKING HOLDINGS INC	1,143	2,462.01	2,814,077.43	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	6,500	52.80	343,200.00	
CARNIVAL CORP	29,066	11.29	328,155.14	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	801	1,617.67	1,295,753.67	
DARDEN RESTAURANTS	3,819	146.09	557,917.71	
DOMINO'S PIZZA INC	1,100	357.36	393,096.00	
EXPEDIA GROUP INC	4,527	108.96	493,261.92	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	8,217	146.34	1,202,475.78	
LAS VEGAS SANDS CORP	10,300	56.02	577,006.00	
MARRIOTT INT'L A	8,244	172.52	1,422,254.88	
MCDONALD'S CORP	22,028	269.99	5,947,339.72	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	9,400	43.56	409,464.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	6,700	73.03	489,301.00	
STARBUCKS CORP	34,452	107.10	3,689,809.20	

VAIL RESORTS	1,200	243.34	292,008.00	
WYNN RESORTS LTD	3,000	109.01	327,030.00	
YUM! BRANDS INC	8,658	132.04	1,143,202.32	
ACTIVISION BLIZZARD INC	23,500	77.57	1,822,895.00	
ALPHABET INC-CL A	179,740	94.35	16,958,469.00	
ALPHABET INC-CL C	166,320	94.59	15,732,208.80	
CHARTER COMMUNICATION-A	3,325	395.62	1,315,436.50	
COMCAST CORP-CL A	132,012	39.12	5,164,309.44	
DISCOVERY INC-W/T	68,653	15.43	1,059,315.79	
DISH NETWORK CORP-A	7,873	14.15	111,402.95	
DISNEY (WALT) CO NEW	54,664	105.22	5,751,746.08	
ELECTRONIC ARTS	8,324	112.00	932,288.00	
FOX CORP	4,338	34.22	148,446.36	
FOX CORPORATION-CLASS A	9,769	37.03	361,746.07	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	11,539	37.36	431,097.04	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	3,800	92.42	351,196.00	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	5,900	70.01	413,059.00	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	2,473	33.86	83,735.78	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	4,862	33.84	164,530.08	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	5,000	76.39	381,950.00	
MATCH GROUP INC	8,594	43.63	374,956.22	
META PLATFORMS INC-A	68,252	172.88	11,799,405.76	
NETFLIX INC	13,307	347.96	4,630,303.72	
NEWS CORP - CLASS A	12,156	19.00	230,964.00	
OMNICOM GROUP	6,188	93.72	579,939.36	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	17,915	23.69	424,406.35	
PINTEREST INC- CLASS A	16,700	24.43	407,981.00	
ROBLOX CORP -CLASS A	10,500	40.88	429,240.00	
ROKU INC	3,500	71.56	250,460.00	
SEA LTD-ADR	10,600	65.01	689,106.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	23,364	4.60	107,474.40	
SNAP INC - A	32,300	10.36	334,628.00	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	4,900	112.51	551,299.00	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	13,000	60.30	783,900.00	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	7,800	25.71	200,538.00	
ADOVANCE AUTO PARTS	1,750	149.99	262,482.50	
AMAZON COM INC	274,960	97.20	26,726,112.00	
AUTOZONE INC	581	2,605.62	1,513,865.22	
BATH & BODY WORKS INC	6,800	42.89	291,652.00	
BEST BUY COMPANY INC	6,086	86.94	529,116.84	
BURLINGTON STORES INC	2,000	227.94	455,880.00	
CARMAX INC	4,950	72.95	361,102.50	
CHEWY INC - CLASS A	2,600	44.61	115,986.00	
DOLLAR GENERAL CORP	6,809	227.82	1,551,226.38	
DOLLAR TREE INC	6,703	148.04	992,312.12	
DOORDASH INC - A	7,000	61.81	432,670.00	
EBAY INC	16,622	48.24	801,845.28	
ETSY INC	3,700	129.68	479,816.00	
GENUINE PARTS CO	4,300	180.14	774,602.00	

HOME DEPOT	30,739	317.95	9,773,465.05	
LKQ CORP	7,965	58.84	468,660.60	
LOWE'S COMPANIES	18,606	212.75	3,958,426.50	
MERCADOLIBRE	1,400	1,100.87	1,541,218.00	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,928	873.01	1,683,163.28	
POOL CORP	1,200	376.58	451,896.00	
ROSS STORES INC	10,612	115.69	1,227,702.28	
TARGET CORP	13,805	173.22	2,391,302.10	
TJX COMPANIES INC	34,822	79.83	2,779,840.26	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,344	239.00	799,216.00	
ULTA BEAUTY INC	1,516	530.00	803,480.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	13,287	507.48	6,742,886.76	
KROGER CO	20,692	44.00	910,448.00	
SYSCO CORP	15,003	78.71	1,180,886.13	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	21,729	36.76	798,758.04	
WALMART INC	45,316	146.44	6,636,075.04	
ALTRIA GROUP INC	53,932	48.07	2,592,511.24	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND	16,684	81.59	1,361,247.56	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,380	65.65	615,797.00	
BUNGE LIMITED	4,575	97.57	446,382.75	
CAMPBELL SOUP CO (US)	6,310	52.35	330,328.50	
COCA-COLA CO	123,207	60.12	7,407,204.84	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	1,500	56.23	84,345.00	
CONAGRA BRANDS INC	14,527	36.41	528,928.07	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,816	226.80	1,092,268.80	
DARLING INGREDIENTS INC	4,800	66.55	319,440.00	
GENERAL MILLS	17,861	76.77	1,371,188.97	
HORMEL FOODS CORP	9,000	45.74	411,660.00	
JM SMUCKER CO	3,288	149.94	493,002.72	
KELLOGG CO	7,687	68.38	525,637.06	
KEURIG DR PEPPER INC	23,500	35.67	838,245.00	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	4,300	100.48	432,064.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,598	75.75	575,548.50	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	5,700	52.02	296,514.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	41,161	66.85	2,751,612.85	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,740	104.18	1,223,073.20	
PEPSICO INC	41,336	176.28	7,286,710.08	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	46,451	101.82	4,729,640.82	
THE HERSHEY COMPANY	4,400	240.69	1,059,036.00	
THE KRAFT HEINZ CO/THE	22,055	40.00	882,200.00	
TYSON FOODS INC-CL A	8,626	61.37	529,377.62	
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,200	83.78	603,216.00	
CLOROX CO	3,683	153.63	565,819.29	
COLGATE-PALMOLIVE CO	23,662	74.52	1,763,292.24	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	6,913	252.88	1,748,159.44	
KIMBERLY-CLARK CORP	10,157	127.23	1,292,275.11	

PROCTER & GAMBLE CO	71,439	140.01	10,002,174.39	
ABBOTT LABORATORIES	52,377	106.74	5,590,720.98	
ALIGN TECHNOLOGY	2,200	316.71	696,762.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,742	161.49	765,785.58	
BAXTER INTERNATIONAL	14,843	41.00	608,563.00	
BECTON DICKINSON	8,509	244.52	2,080,620.68	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	42,948	46.54	1,998,799.92	
CARDINAL HEALTH INC	8,271	78.78	651,589.38	
CENTENE CORP	17,222	73.36	1,263,405.92	
CIGNA CORP	9,128	301.06	2,748,075.68	
CVS HEALTH CORPORATION	39,321	88.58	3,483,054.18	
DAVITA INC	1,700	83.93	142,681.00	
DENTSPLY SIRONA INC	6,800	35.84	243,712.00	
DEXCOM INC	11,800	114.76	1,354,168.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	18,500	78.51	1,452,435.00	
ELEVANCE HEALTH INC	7,155	495.04	3,542,011.20	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	10,966	73.17	802,382.22	
HCA HEALTHCARE INC	6,933	262.84	1,822,269.72	
HENRY SCHEIN INC	4,100	83.14	340,874.00	
HOLOGIC INC	7,516	82.73	621,798.68	
HUMANA	3,749	510.14	1,912,514.86	
IDEXX LABORATORIES	2,500	496.46	1,241,150.00	
INSULET CORP	2,100	296.00	621,600.00	
INTUITIVE SURGICAL INC COM NEW	10,714	238.91	2,559,681.74	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,744	256.26	703,177.44	
MASIMO CORP	1,500	164.75	247,125.00	
MCKESSON CORP	4,358	366.86	1,598,775.88	
MEDTRONIC PLC	39,805	84.80	3,375,464.00	
MOLINA HEALTHCARE INC	1,700	296.07	503,319.00	
NOVOCURE LTD	2,700	84.74	228,798.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,546	148.22	525,588.12	
RESMED INC	4,333	216.14	936,534.62	
STERIS PLC	3,000	189.66	568,980.00	
STRYKER CORP	10,167	263.16	2,675,547.72	
TELEFLEX	1,400	247.47	346,458.00	
THE COOPER COS INC	1,431	345.12	493,866.72	
UNITED HEALTH GROUP INC	28,091	499.08	14,019,656.28	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,020	150.75	304,515.00	
VEEVA SYSTEMS A	4,200	170.49	716,058.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	6,331	125.97	797,516.07	
ABBVIE INC	53,057	151.31	8,028,054.67	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,020	148.26	1,337,305.20	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,600	222.79	802,044.00	
AMGEN INC	16,014	240.53	3,851,847.42	
AVANTOR INC	20,200	24.54	495,708.00	
BIOGEN INC	4,301	278.38	1,197,312.38	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5,421	108.31	587,148.51	
BIO-RAD LABORATORIES-A	700	483.23	338,261.00	

BIO-TECHNE CORP	4,800	75.96	364,608.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	63,976	71.11	4,549,333.36	
CATALENT INC	5,200	71.37	371,124.00	
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,500	249.76	374,640.00	
DANAHER CORP	20,769	256.29	5,322,887.01	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	12,456	13.13	163,547.28	
EXACT SCIENCES CORP	5,000	63.48	317,400.00	
GILEAD SCIENCES INC	37,610	84.76	3,187,823.60	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	6,600	109.93	725,538.00	
ILLUMINA INC	4,700	211.83	995,601.00	
INCYTE CORP	5,608	79.00	443,032.00	
IQVIA HOLDINGS INC	5,632	219.73	1,237,519.36	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,901	147.73	280,834.73	
JOHNSON & JOHNSON	78,825	160.39	12,642,741.75	
LILLY (ELI) & CO	24,209	328.40	7,950,235.60	
MERCK & CO	75,960	109.52	8,319,139.20	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	707	1,513.93	1,070,348.51	
MODERNA INC	10,100	166.60	1,682,660.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,900	103.54	300,266.00	
PERKINELMER INC	3,800	133.44	507,072.00	
PFIZER	168,288	43.21	7,271,724.48	
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,177	748.74	2,378,746.98	
REPLIGEN CORP	1,600	190.00	304,000.00	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	10,400	37.84	393,536.00	
SEAGEN INC/WA	4,200	162.53	682,626.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	10,200	10.06	102,612.00	
THERMO ELECTRON CORP	11,771	559.70	6,588,228.70	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,710	293.66	2,264,118.60	
VIATRIS INC	36,671	11.69	428,683.99	
WATERS CORPORATION	1,827	328.73	600,589.71	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,200	313.72	690,184.00	
ZOETIS INC	13,995	172.03	2,407,559.85	
BANK OF AMERICA CORP	216,787	35.35	7,663,420.45	
CITIGROUP INC	57,851	51.42	2,974,698.42	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	14,600	43.18	630,428.00	
FIFTH THIRD BANCORP	20,220	36.95	747,129.00	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	400	761.50	304,600.00	
FIRST HORIZON CORP	16,100	24.84	399,924.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5,506	128.89	709,668.34	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	42,415	15.40	653,191.00	
JPMORGAN CHASE & CO	87,890	142.24	12,501,473.60	
KEYCORP	27,891	19.15	534,112.65	
M & T BANK CORP	5,391	159.92	862,128.72	
PNC BANK CORP	12,387	158.59	1,964,454.33	
REGIONS FINANCIAL CORP	27,645	23.86	659,609.70	
SIGNATURE BANK	1,800	124.31	223,758.00	
SVB FINANCIAL GROUP	1,700	292.79	497,743.00	
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	39,338	48.49	1,907,499.62	
US BANCORP	42,335	48.60	2,057,481.00	

WEBSTER FINANCIAL CORP	5,500	54.97	302,335.00	
WELLS FARGO COMPANY	113,697	47.49	5,399,470.53	
ALLY FINANCIAL INC.	9,975	31.05	309,723.75	
AMERICAN EXPRESS	19,115	177.30	3,389,089.50	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,296	351.48	1,158,478.08	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	12,066	71.44	861,995.04	
ARES MANAGEMENT CORP - A	4,600	83.11	382,306.00	
BANK NEW YORK MELLO CORP	23,057	51.50	1,187,435.50	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	39,034	308.24	12,031,840.16	
BLACKROCK INC	4,490	716.16	3,215,558.40	
BLACKSTONE INC	20,900	93.52	1,954,568.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	11,699	111.17	1,300,577.83	
CARLYLE GROUP INC/THE	5,800	35.04	203,232.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,200	129.09	413,088.00	
CME GROUP INC	10,689	188.64	2,016,372.96	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	3,600	65.20	234,720.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	8,232	111.18	915,233.76	
EQUITABLE HOLDINGS INC	11,200	32.75	366,800.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,100	431.23	474,353.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	9,205	31.33	288,392.65	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	1,800	47.31	85,158.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	10,284	368.50	3,789,654.00	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	16,625	107.11	1,780,703.75	
INVESCO LTD	10,380	18.71	194,209.80	
KKR & CO INC	16,700	57.18	954,906.00	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	2,400	249.99	599,976.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,100	355.17	390,687.00	
MOODY'S CORPORATION	4,949	301.45	1,491,876.05	
MORGAN STANLEY	38,599	99.51	3,840,986.49	
MSCI INC	2,370	544.83	1,291,247.10	
NASDAQ INC	10,320	58.56	604,339.20	
NORTHERN TRUST CORP	6,005	96.71	580,743.55	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,872	112.17	658,662.24	
S&P GLOBAL INC	10,242	360.83	3,695,620.86	
SCHWAB (CHARLES) CORP	43,635	80.32	3,504,763.20	
SEI INVESTMENTS CO COM	3,600	61.40	221,040.00	
STATE STREET CORP	10,831	92.00	996,452.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	14,415	35.77	515,624.55	
T ROWE PRICE GROUP INC	6,893	118.73	818,405.89	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	3,200	72.57	232,224.00	
AFLAC	18,010	69.37	1,249,353.70	
ALLSTATE CORP	8,228	135.05	1,111,191.40	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,100	133.80	280,980.00	
AMERICAN INT'L GROUP	22,817	60.82	1,387,729.94	
AON PLC	6,334	310.27	1,965,250.18	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	11,350	67.81	769,643.50	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6,200	188.60	1,169,320.00	
ASSURANT INC	1,600	132.41	211,856.00	

BROWN & BROWN INC	7,200	57.67	415,224.00	
CHUBB LTD	12,484	210.61	2,629,255.24	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,637	127.03	589,038.11	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	800	241.69	193,352.00	
EVEREST RE GROUP LTD	1,200	386.75	464,100.00	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	7,902	42.95	339,390.90	
GLOBE LIFE INC	2,850	122.93	350,350.50	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	10,009	78.45	785,206.05	
LINCOLN NATIONAL CORP	4,915	33.82	166,225.30	
LOEWS CORP	6,305	61.51	387,820.55	
MARKEL CORP	405	1,326.57	537,260.85	
MARSH & MCLENNAN COS	14,875	166.44	2,475,795.00	
METLIFE INC	20,371	72.54	1,477,712.34	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7,686	91.03	699,656.58	
PROGRESSIVE CORP	17,489	141.52	2,475,043.28	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	11,135	101.53	1,130,536.55	
TRAVELERS COS INC/THE ST. PAUL TRAVELERS	7,234	185.75	1,343,715.50	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,328	240.89	801,681.92	
WR BERKLEY CORP	6,222	67.14	417,745.08	
CBRE GROUP INC-A	9,884	88.76	877,303.84	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	34,700	4.70	163,090.00	
ZILLOW GROUP INC-C	4,800	45.89	220,272.00	
ACCENTURE PLC-CL A	18,997	277.05	5,263,118.85	
ADOBE INC	14,028	356.85	5,005,891.80	
AFFIRM HOLDINGS INC	5,100	12.98	66,198.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES	4,772	77.30	368,875.60	
ANSYS INC	2,600	270.76	703,976.00	
ASPEN TECHNOLOGY INC	900	213.95	192,555.00	
AUTODESK INC	6,537	219.98	1,438,009.26	
AUTOMATIC DATA PROCESS	12,463	228.69	2,850,225.78	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	5,300	40.89	216,717.00	
BILL.COM HOLDINGS INC	2,800	93.30	261,240.00	
BLACK KNIGHT INC	4,600	63.94	294,124.00	
BLOCK INC-A	13,400	75.02	1,005,268.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	3,500	143.86	503,510.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	8,200	194.44	1,594,408.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	4,200	74.96	314,832.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	3,003	124.96	375,254.88	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	7,500	64.45	483,375.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	15,555	65.48	1,018,541.40	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	6,100	114.25	696,925.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,200	146.13	175,356.00	
DATADOG INC - CLASS A	7,200	79.99	575,928.00	
DOCUSIGN INC	5,900	64.47	380,373.00	
DROPBOX INC-CLASS A	8,400	21.22	178,248.00	
DYNATRACE INC	5,600	42.71	239,176.00	

EPAM SYSTEMS INC	1,700	338.21	574,957.00	
FAIR ISAAC CORP	800	682.19	545,752.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	18,096	69.50	1,257,672.00	
FISERV INC	18,402	115.37	2,123,038.74	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,181	213.58	465,817.98	
FORTINET INC	20,500	60.64	1,243,120.00	
GARTNER INC	2,400	346.02	830,448.00	
GEN DIGITAL INC	17,500	21.04	368,200.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	8,478	116.31	986,076.18	
GODADDY INC-CLASS A	4,700	77.81	365,707.00	
HUBSPOT INC	1,400	404.65	566,510.00	
IBM CORP	27,061	135.02	3,653,776.22	
INTUIT CORP	8,026	404.38	3,245,553.88	
JACK HENRY & ASSOCIATES, INC.	2,200	169.00	371,800.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	25,914	361.13	9,358,322.82	
MICROSOFT CORP	212,432	258.06	54,820,201.92	
MONGODB INC	2,000	213.13	426,260.00	
OKTA INC	4,500	74.01	333,045.00	
ORACLE CORP	47,959	87.28	4,185,861.52	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	47,900	9.20	440,680.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,820	169.28	1,493,049.60	
PAYCHEX INC	9,651	114.75	1,107,452.25	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,500	303.89	455,835.00	
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,200	209.31	251,172.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	32,822	74.66	2,450,490.52	
PTC INC	3,300	130.29	429,957.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,200	427.68	1,368,576.00	
SALESFORCE INC	30,027	165.17	4,959,559.59	
SERVICENOW INC	6,084	439.01	2,670,936.84	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	6,600	154.08	1,016,928.00	
SPLUNK INC	4,800	105.00	504,000.00	
SS&C TECHNOLOGIES HLDGS	6,800	61.74	419,832.00	
SYNOPSYS INC	4,615	354.45	1,635,786.75	
TOAST INC-CLASS A	7,400	19.48	144,152.00	
TWILIO INC - A	5,000	70.67	353,350.00	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,200	343.60	412,320.00	
UNITY SOFTWARE INC	7,400	39.67	293,558.00	
VERISIGN INC	2,999	204.71	613,925.29	
VISA INC-CLASS A SHARES	48,995	223.56	10,953,322.20	
VMWARE INC	6,323	116.15	734,416.45	
WESTERN UNION CO	11,416	13.83	157,883.28	
WIX.COM LTD	1,800	85.40	153,720.00	
WORKDAY INC CLASS A	6,072	185.80	1,128,177.60	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	6,800	76.11	517,548.00	
ZSCALER INC	2,500	132.35	330,875.00	
AMPHENOL CORP-CL A	17,700	81.03	1,434,231.00	
APPLE INC	481,968	152.55	73,524,218.40	

ARISTA NETWORKS	7,200	138.23	995,256.00	
ARROW ELECTRONICS INC	2,100	123.28	258,888.00	
CDW CORP/DE	4,000	213.93	855,720.00	
CISCO SYSTEMS	124,182	50.77	6,304,720.14	
COGNEX CORP	5,200	48.14	250,328.00	
CORNING	23,728	35.58	844,242.24	
DELL TECHNOLOGIES INC-C	7,977	42.48	338,862.96	
F5 INC	1,900	146.88	279,072.00	
HEWLETT-PACKARD CO	31,203	30.16	941,082.48	
HP ENTERPRISE CO	39,076	16.36	639,283.36	
JUNIPER NETWORKS INC	10,008	31.56	315,852.48	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	5,400	185.78	1,003,212.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,943	269.42	1,331,743.06	
NETAPP INC	6,548	67.41	441,400.68	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	6,178	70.26	434,066.28	
TE CONNECTIVITY LTD	9,662	131.85	1,273,934.70	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,400	438.95	614,530.00	
TRIMBLE INC	7,443	55.20	410,853.60	
WESTERN DIGITAL CORP	9,492	41.58	394,677.36	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,600	322.58	516,128.00	
AT & T INC	213,683	19.44	4,153,997.52	
LIBERTY GLOBAL PLC A	4,699	20.94	98,397.06	
LIBERTY GLOBAL PLC SERIES C	9,480	21.43	203,156.40	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	26,589	3.93	104,494.77	
T MOBILE US INC	18,790	149.35	2,806,286.50	
VERIZON COMMUNICATIONS	125,884	40.22	5,063,054.48	
AES CORPORATION	20,062	26.23	526,226.26	
ALLIANT ENERGY CORP	7,590	53.97	409,632.30	
AMEREN CORPORATION	7,577	87.26	661,169.02	
AMERICAN ELECTRIC POWER	15,285	92.41	1,412,486.85	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,500	149.61	822,855.00	
ATMOS ENERGY CORP	4,058	117.11	475,232.38	
CENTERPOINT ENERGY INC	18,256	29.21	533,257.76	
CMS ENERGY CORP	8,700	61.97	539,139.00	
CONSOLIDATED EDISON	10,559	93.25	984,626.75	
CONSTELLATION ENERGY	9,636	84.55	814,723.80	
DOMINION ENERGY INC	24,960	58.70	1,465,152.00	
DTE ENERGY	5,866	115.30	676,349.80	
DUKE ENERGY CORP	23,065	99.49	2,294,736.85	
EDISON INTERNATIONAL	11,416	67.59	771,607.44	
ENTERGY CORP	6,120	109.43	669,711.60	
ESSENTIAL UTILITIES INC	7,400	46.15	341,510.00	
EVERGY INC	6,700	62.10	416,070.00	
EVERSOURCE ENERGY	10,371	80.27	832,480.17	
EXELON CORP	29,709	43.05	1,278,972.45	
FIRSTENERGY CORP	16,316	41.03	669,445.48	
NEXTERA ENERGY INC	58,960	76.07	4,485,087.20	
NISOURCE INC	11,900	27.14	322,966.00	
NRG ENERGY INC	7,300	34.22	249,806.00	

P G & E CORP	45,200	15.57	703,764.00	
PPL CORPORATION	22,166	28.81	638,602.46	
PUBLIC SV ENTERPRISE CO	14,802	62.23	921,128.46	
SEMPRA ENERGY	9,341	158.49	1,480,455.09	
SOUTHERN CO	32,639	66.63	2,174,736.57	
UGI CORP	6,500	39.15	254,475.00	
VISTRA CORP	11,600	22.96	266,336.00	
WEC ENERGY GROUP INC	9,286	92.87	862,390.82	
XCEL ENERGY INC	16,444	68.01	1,118,356.44	
ADVANCED MICRO DEVICES	48,542	78.50	3,810,547.00	
ANALOG DEVICES	15,466	192.71	2,980,452.86	
APPLIED MATERIALS	25,841	115.44	2,983,085.04	
BROADCOM INC	12,146	595.59	7,234,036.14	
ENPHASE ENERGY INC	4,100	204.99	840,459.00	
ENTEGRIS INC	4,500	85.48	384,660.00	
FIRST SOLAR INC	2,900	164.28	476,412.00	
INTEL CORP	123,128	27.61	3,399,564.08	
KLA CORPORATION	4,248	387.92	1,647,884.16	
LAM RESEARCH CORP	4,100	495.66	2,032,206.00	
MARVELL TECHNOLOGY INC	25,600	44.14	1,129,984.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	16,420	83.27	1,367,293.40	
MICRON TECHNOLOGY	33,230	59.01	1,960,902.30	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,300	502.09	652,717.00	
NVIDIA CORP	74,600	213.88	15,955,448.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	7,791	188.46	1,468,291.86	
ON SEMICONDUCTOR CORP	13,000	81.86	1,064,180.00	
QORVO INC	3,325	103.08	342,741.00	
QUALCOMM	33,718	127.72	4,306,462.96	
SKYWORKS SOLUTIONS INC.	4,851	115.83	561,915.58	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	1,700	305.04	518,568.00	
TERADYNE INC	4,800	105.25	505,200.00	
TEXAS INSTRUMENTS	27,386	175.32	4,801,313.52	
WOLFSPEED INC	3,700	77.63	287,231.00	
アメリカ・ドル小計	10,155,901		1,056,097,923.91 (141,992,365,870)	
カナダ・ドル				
ARC RESOURCES LTD	20,600	14.73	303,438.00	
CAMECO CORP	12,922	38.78	501,115.16	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	33,590	75.05	2,520,929.50	
CENOVUS ENERGY INC	42,048	24.51	1,030,596.48	
ENBRIDGE INC	60,671	52.38	3,177,946.98	
IMPERIAL OIL LTD	6,985	67.57	471,976.45	
KEYERA CORP	6,842	31.09	212,717.78	
PARKLAND CORPORATION	4,600	30.20	138,920.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	16,549	45.76	757,282.24	
SUNCOR ENERGY INC	40,930	44.59	1,825,068.70	
TC ENERGY CORP	30,307	56.84	1,722,649.88	
TOURMALINE OIL CORP	9,400	58.96	554,224.00	
AGNICO EAGLE MINES LTD	13,731	62.31	855,578.61	
BARRICK GOLD CORP	52,580	22.57	1,186,730.60	

CCL INDUSTRIES INC	4,700	61.63	289,661.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	17,628	26.57	468,375.96	
FRANCO NEV CORP	5,662	178.50	1,010,667.00	
IVANHOE MINES LTD-CL A	17,900	12.51	223,929.00	
KINROSS GOLD CORP	36,963	5.20	192,207.60	
LUNDIN MINING CORP	20,600	8.82	181,692.00	
NEWMONT CORPORATION	1,688	61.27	103,423.76	
NUTRIEN LTD	16,353	100.70	1,646,747.10	
PAN AMERICAN SILVER CORP	6,800	21.83	148,444.00	
TECK RESOURCES LTD	14,308	59.40	849,895.20	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,800	104.99	188,982.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	13,647	56.97	777,469.59	
CAE Inc.	9,550	31.44	300,252.00	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	2,500	112.50	281,250.00	
WSP GLOBAL INC	3,700	172.39	637,843.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	5,500	41.77	229,735.00	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,500	84.36	295,260.00	
THOMSON REUTERS CORPORATION	5,062	166.03	840,443.86	
AIR CANADA	4,800	21.20	101,760.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	17,625	157.22	2,771,002.50	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	20,665	104.58	2,161,145.70	
TFI INTERNATIONAL INC	2,500	169.63	424,075.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,538	76.28	651,278.64	
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,100	120.00	132,000.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,015	40.18	241,682.70	
RESTAURANT BRANDS INTERN	8,533	90.99	776,417.67	
QUEBECOR INC -CL B	4,800	32.62	156,576.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	14,256	39.25	559,548.00	
CANADIAN TIRE CORP.	1,731	174.64	302,301.84	
DOLLARAMA INC	8,285	79.92	662,137.20	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	25,000	65.59	1,639,750.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	5,266	36.85	194,052.10	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,072	118.89	603,010.08	
METRO INC	7,118	71.90	511,784.20	
WESTON (GEORGE)	2,290	169.61	388,406.90	
SAPUTO INC	7,407	36.70	271,836.90	
BANK OF MONTREAL	19,994	135.18	2,702,788.92	
BANK OF NOVA SCOTIA	36,022	72.95	2,627,804.90	
CANADIAN IMPERIAL BANK	27,128	62.52	1,696,042.56	
NATIONAL BANK OF CANADA	9,946	101.50	1,009,519.00	
ROYAL BANK OF CANADA	41,742	138.79	5,793,372.18	
TRONTO-DOMINION BANK	54,548	92.87	5,065,872.76	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	10,536	47.28	498,142.08	
BROOKFIELD CORP	42,145	48.26	2,033,917.70	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	11,800	19.54	230,572.00	
IGM FINANCIAL INC	2,833	42.81	121,280.73	
ONEX CORPORATION	2,309	67.46	155,765.14	
TMX GROUP LTD	1,600	135.56	216,896.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	657	932.70	612,783.90	

GREAT-WEST LIFE CO INC	8,646	36.52	315,751.92	
IA FINANCIAL CORP INC	3,293	89.34	294,196.62	
INTACT FINANCIAL CORP	5,200	202.70	1,054,040.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	57,420	27.07	1,554,359.40	
POWER CORP OF CANADA	16,833	36.10	607,671.30	
SUN LIFE FINANCIAL INC	17,291	68.91	1,191,522.81	
FIRSTSERVICE CORP	1,100	191.28	210,408.00	
CGI INC	6,584	125.80	828,267.20	
CONSTELLATION SOFTWARE	555	2,419.84	1,343,011.20	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	2,500	101.29	253,225.00	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	1,500	44.20	66,300.00	
OPEN TEXT CORP	8,084	47.43	383,424.12	
SHOPIFY INC - CLASS A	35,600	58.70	2,089,720.00	
BCE INC	2,115	61.78	130,664.70	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	10,704	66.17	708,283.68	
TELUS CORP	14,064	27.79	390,838.56	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	20,000	10.55	211,000.00	
ALTAGAS LTD	8,313	24.16	200,842.08	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	4,050	40.47	163,903.50	
CANADIAN UTILITIES LTD A	3,800	36.49	138,662.00	
EMERA	7,800	54.77	427,206.00	
FORTIS INC	14,230	55.74	793,180.20	
HYDRO ONE	9,800	36.13	354,074.00	
NORLAND POWER INC	7,100	33.47	237,637.00	
カナダ・ドル小計	1,218,459		73,187,165.04 (7,293,100,995)	
オーストラリア・ドル				
AMPOL LIMITED	7,072	31.77	224,677.44	
SANTOS	94,054	6.85	644,269.90	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	6,459	29.15	188,279.85	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	45,923	34.51	1,584,802.73	
AMCOR PLC-CDI	24,450	16.59	405,625.50	
BHP GROUP LIMITED	91,696	48.00	4,401,408.00	
BLUESCOPE STEEL LTD	15,345	19.82	304,137.90	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	50,005	22.26	1,113,111.30	
IGO LTD	20,435	13.54	276,689.90	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	13,343	32.47	433,247.21	
MINERAL RESOURCES LTD	5,201	85.07	442,449.07	
NEWCREST MINING	26,186	23.57	617,204.02	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	33,945	11.39	386,633.55	
ORICA	13,454	16.06	216,071.24	
PILBARA MINERALS LTD	76,069	4.44	337,746.36	
RIO TINTO LTD	10,972	124.26	1,363,380.72	
SOUTH32 LTD	136,871	4.53	620,025.63	
REECE LTD	6,565	16.98	111,473.70	
BRAMBLES LTD	43,897	12.13	532,470.61	
AURIZON HOLDINGS LTD	57,849	3.42	197,843.58	
QANTAS AIRWAYS LTD	26,005	6.60	171,633.00	
TRANSURBAN GROUP	90,772	14.07	1,277,162.04	
ARISTOCRAT LEISURE LIMITED	18,086	35.50	642,053.00	

	IDP EDUCATION LTD	6,244	30.72	191,815.68	
	LOTTERY CORP LTD/THE	69,014	4.82	332,647.48	
	REA GROUP LTD	1,584	126.43	200,265.12	
	SEEK LTD	10,386	24.78	257,365.08	
	WESFARMERS LIMITED	34,006	51.09	1,737,366.54	
	COLES GROUP LTD	40,130	18.24	731,971.20	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	39,995	6.78	271,166.10	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	35,818	36.69	1,314,162.42	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	21,448	13.72	294,266.56	
	COCHLEAR LIMITED	1,988	224.99	447,280.12	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,357	66.76	357,633.32	
	SONIC HEALTHCARE LIMITED	13,655	33.45	456,759.75	
	CSL LIMITED	14,443	298.40	4,309,791.20	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	89,649	24.67	2,211,640.83	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	51,018	100.97	5,151,287.46	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	97,962	29.85	2,924,165.70	
	WESTPAC BANKING	104,977	22.78	2,391,376.06	
	AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	5,672	67.97	385,525.84	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	11,009	189.00	2,080,701.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	73,535	4.83	355,174.05	
	MEDIBANK PRIVATE LTD.	81,879	3.12	255,462.48	
	QBE INSURANCE GROUP	44,700	14.39	643,233.00	
	SUNCORP GROUP LTD	37,797	12.78	483,045.66	
	LENLEASE GROUP	20,422	7.76	158,474.72	
	BLOCK INC - CDI	2,469	112.62	278,058.78	
	COMPUTERSHARE LIMITED	16,232	23.88	387,620.16	
	WISETECH GLOBAL LTD	4,331	56.54	244,874.74	
	XERO LTD	3,801	77.76	295,565.76	
	TELSTRA GROUP LTD	125,976	4.21	530,358.96	
	APA GROUP	35,277	10.86	383,108.22	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	54,587	7.00	382,109.00	
	オーストラリア・ドル小計	2,070,015		46,936,669.24 (4,333,662,670)	
イギリス・ポンド	BP PLC	564,169	5.60	3,158,782.23	
	SHELL PLC	217,812	25.41	5,534,602.92	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	10,621	19.57	207,852.97	
	ANGLO AMERICAN PLC	38,100	32.10	1,222,819.50	
	ANTOFAGASTA PLC	12,248	17.32	212,074.12	
	BHP GROUP LTD	60,196	27.68	1,666,225.28	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	4,092	69.94	286,194.48	
	GLENCORE PLC	293,044	5.10	1,493,645.26	
	JOHNSON MATTHEY PLC	5,926	22.20	131,557.20	
	MONDI PLC	14,192	14.95	212,099.44	
	RIO TINTO PLC REG	33,715	61.03	2,057,626.45	
	ASHTREAD GROUP PLC	13,125	56.30	738,937.50	
	BAE SYSTEMS PLC	93,002	8.94	831,251.87	
	BUNZL PLC	10,109	30.66	309,941.94	
	DCC (GB)	2,866	46.07	132,036.62	

FERGUSON PLC	6,283	123.20	774,065.60	
MELROSE INDUSTRIES PLC	137,016	1.44	196,823.48	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	253,553	1.12	285,145.70	
SMITHS GROUP PLC	11,268	17.75	200,007.00	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,202	120.45	265,230.90	
EXPERIAN PLC	27,251	29.89	814,532.39	
INTERTEK GROUP PLC	4,716	44.90	211,748.40	
RELX PLC	48,945	24.92	1,219,709.40	
RENTOKIL INITIAL PLC	74,714	5.11	382,087.39	
BARRATT DEVELOPMENTS	31,827	4.63	147,454.49	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,330	41.89	139,493.70	
BURBERRY GROUP PLC	11,936	25.57	305,203.52	
PERSIMMON PLC	9,537	14.36	136,951.32	
TAYLOR WIMPEY PLC	108,410	1.20	130,308.82	
COMPASS GROUP PLC	52,796	19.25	1,016,059.02	
ENTAIN PLC	17,175	13.97	240,020.62	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	5,440	55.94	304,313.60	
PEARSON	20,269	9.17	185,907.26	
WHITBREAD PLC	6,304	31.10	196,054.40	
AUTO TRADER GROUP PLC	29,463	6.00	176,836.92	
INFORMA PLC	44,736	6.73	300,894.33	
WPP PLC	34,252	10.10	345,773.94	
JD SPORTS FASHION PLC	78,700	1.81	142,289.60	
KINGFISHER PLC	61,012	2.82	171,870.80	
NEXT PLC	3,960	68.90	272,844.00	
OCADO GROUP PLC	17,313	6.29	108,898.77	
SAINSBURY (J) PLC	50,437	2.64	133,355.42	
TESCO PLC	229,684	2.51	576,277.15	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	10,625	19.32	205,328.12	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	64,561	31.62	2,041,418.82	
COCA COLA HBC AG CDI	6,210	21.10	131,031.00	
DIAGEO	68,674	35.61	2,445,137.77	
IMPERIAL BRANDS PLC	27,144	20.37	552,923.28	
HALEON PLC	150,777	3.36	506,233.77	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	21,456	57.76	1,239,298.56	
UNILEVER PLC	40,016	42.36	1,694,877.68	
SMITH&NEOHEW PLC	26,907	11.55	310,775.85	
ASTRAZENECA PLC	46,459	114.86	5,336,280.74	
GSK PLC	122,079	14.84	1,811,896.51	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,103	17.70	90,348.61	
BARCLAYS PLC	495,596	1.74	859,859.06	
HSBC HOLDINGS PLC	600,842	6.21	3,731,829.66	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,044,941	0.51	1,041,079.46	
NATWEST GROUP PLC	159,350	2.85	453,510.10	
STANDARD CHARTERED PLC	76,867	7.65	588,186.28	
3I GROUP PLC	29,219	16.45	480,652.55	
ABRDN PLC	64,987	2.16	140,371.92	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,488	8.54	89,525.56	

	LONDON STOCK EXCAHNGE GROUP	9,868	76.14	751,349.52	
	M&G PLC	81,141	2.01	163,417.97	
	SCHRODERS PLC	22,611	4.99	112,851.50	
	ST JAMES' S PLACE PLC	16,327	12.50	204,087.50	
	ADMIRAL GROUP PLC	5,321	22.44	119,403.24	
	AVIVA PLC	84,925	4.48	380,124.30	
	LEGAL & GENERAL GROUP	175,951	2.60	457,472.60	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	22,489	6.34	142,490.30	
	PRUDENTIAL PLC	81,234	13.07	1,061,322.21	
	SAGE GROUP PLC/THE	30,397	7.61	231,442.75	
	HALMA PLC	11,365	22.39	254,462.35	
	BT GROUP PLC	208,628	1.42	296,251.76	
	VODAFONE GROUP PLC	797,290	1.02	816,265.50	
	NATIONAL GRID PLC	109,742	10.70	1,174,239.40	
	SEVERN TRENT PLC	7,480	28.07	209,963.60	
	SSE PLC	32,790	17.56	575,628.45	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	19,909	10.50	209,144.04	
	イギリス・ポンド小計	8,545,515		58,486,288.01 (9,451,969,004)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	7,136	15.87	113,248.32	
	EMS CHEMIE HOLDING AG RE	212	715.50	151,686.00	
	GIVAUDAN-REG	273	2,850.00	778,050.00	
	HOLCIM LTD	16,688	56.84	948,545.92	
	SIG GROUP AG	9,107	22.20	202,175.40	
	SIKA AG-BEARER	4,379	276.90	1,212,545.10	
	ABB LTD	47,128	31.56	1,487,359.68	
	GEBERIT AG-REG	1,092	517.20	564,782.40	
	SCHINDLER HLDG AG	704	191.40	134,745.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,275	199.35	254,171.25	
	VAT GROUP AG	818	285.40	233,457.20	
	ADECCO GROUP AG-REG	4,626	34.93	161,586.18	
	SGS S. A.	191	2,201.00	420,391.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,630	245.50	400,165.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON REG	15,652	144.00	2,253,888.00	
	THE SWATCH GROUP	1,897	60.75	115,242.75	
	THE SWATCH GROUP AG-B	904	330.40	298,681.60	
	BARRY CALLEBAUT AG REG	107	1,944.00	208,008.00	
	LINDT SPRUENGLI PTG CERT CHF10	32	10,340.00	330,880.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	3	104,200.00	312,600.00	
	NESTLE SA-REG	82,455	109.28	9,010,682.40	
	ALCON INC	14,781	67.66	1,000,082.46	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,582	237.90	376,357.80	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	3,347	129.70	434,105.90	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	925	86.95	80,428.75	
	LOMZA AG-REG	2,233	554.40	1,237,975.20	
	NOVARTIS AG-REG SHS	64,865	80.29	5,208,010.85	
	ROCHE HOLDING AG GENUSS	21,065	279.20	5,881,348.00	
	ROCHE HOLDING AG-BR	798	295.60	235,888.80	

	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	903	83.05	74,994.15	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	99,429	2.73	271,441.17	
	JULIUS BAER GROUP LTD	6,704	61.46	412,027.84	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	670	920.80	616,936.00	
	UBS GROUP AG	100,398	20.29	2,037,075.42	
	BALOISE HOLDING AG REG	1,366	152.50	208,315.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	956	554.40	530,006.40	
	SWISS RE LTD	9,016	96.14	866,798.24	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,511	440.50	1,987,095.50	
	SWISS PRIME SITE REG	2,361	82.25	194,192.25	
	TEMENOS GROUP AG-REG	1,889	68.78	129,925.42	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	5,383	53.34	287,129.22	
	SWISSCOM	782	574.00	448,868.00	
	BKW AG	633	134.40	85,075.20	
	スイス・フラン小計	540,906		42,196,969.37 (6,128,687,830)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED	79,123	47.80	3,782,079.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	40,500	100.80	4,082,400.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	56,000	15.60	873,600.00	
	MTR CORP	45,246	40.10	1,814,364.60	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	40,000	16.78	671,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	65,000	52.20	3,393,000.00	
	SANDS CHINA LTD	76,944	28.15	2,165,973.60	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	53,700	23.30	1,251,210.00	
	WH GROUP LIMITED	249,500	4.68	1,167,660.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	111,989	26.25	2,939,711.25	
	HANG SENG BANK	22,500	123.30	2,774,250.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	36,141	330.80	11,955,442.80	
	AIA GROUP LTD	358,884	83.65	30,020,646.60	
	CK ASSET HOLDINGS LIMITED	58,633	49.90	2,925,786.70	
	ESR GROUP LTD	57,800	14.50	838,100.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	65,000	15.90	1,033,500.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	43,308	27.05	1,171,481.40	
	NEW WORLD DEVELOPMENT COMPANY LIMITED	45,293	21.85	989,652.05	
	SINO LAND	104,997	10.24	1,075,169.28	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	43,108	110.90	4,780,677.20	
	SWIRE PACIFIC A	14,500	66.05	957,725.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	35,677	20.90	745,649.30	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	49,125	43.00	2,112,375.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	112,000	10.40	1,164,800.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	20,000	42.50	850,000.00	
	CLP HOLDINGS	49,317	56.20	2,771,615.40	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS AND HK ELECTRIC	77,161	5.15	397,379.15	
	HONGKONG CHINA GAS	335,197	7.46	2,500,569.62	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	43,000	42.45	1,825,350.00	

香港・ドル小計		2,389,643		93,031,368.35 (1,594,557,654)	
シンガポール・ドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	3,000	28.89	86,670.00	
	KEPPEL CORP LTD	43,400	7.27	315,518.00	
	SINGAPORE TECH ENGR.	47,700	3.63	173,151.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	41,000	5.84	239,440.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	190,500	1.02	194,310.00	
	WILMAR INTERL LTD SGDO.5	59,800	3.97	237,406.00	
	DBS GROUP HOLDING	54,301	35.02	1,901,621.02	
	OVERSEA-CHINESE BANKING	100,024	13.13	1,313,315.12	
	UNITED OVERSEAS BANK	34,843	30.98	1,079,436.14	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	26,600	8.97	238,602.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	77,575	3.87	300,215.25	
	CITY DEVELOPMENTS	11,900	7.82	93,058.00	
	UOL GROUP LIMITED	13,000	6.77	88,010.00	
	VENTURE CORP LTD	8,400	18.49	155,316.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	247,874	2.45	607,291.30		
シンガポール・ドル小計		959,917		7,023,359.83 (706,198,831)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	34,695	8.62	299,070.90	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	16,809	26.60	447,119.40	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	54,085	5.34	288,813.90	
	MERCURY NZ LTD	23,232	6.48	150,427.20	
	MERIDIAN ENERGY LTD	39,492	5.48	216,218.70	
ニュージーランド・ドル小計		168,313		1,401,650.10 (117,374,178)	
スウェーデン・クローナ	BOLIDEN AB	8,018	445.05	3,568,410.90	
	HOLMEN AB-B SHARES	2,776	425.40	1,180,910.40	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	18,203	147.60	2,686,762.80	
	ALFA LAVAL AB	8,757	351.50	3,078,085.50	
	ASSA ABLOY AB-B	29,589	255.70	7,565,907.30	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	80,538	125.28	10,089,800.64	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	47,432	110.42	5,237,441.44	
	EPIROC AB-A	19,757	203.50	4,020,549.50	
	EPIROC AB-B	12,143	174.90	2,123,810.70	
	HUSQVARNA AB-B SHS	12,545	92.00	1,154,140.00	
	INDUTRADE AB	8,119	233.00	1,891,727.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	4,596	230.20	1,057,999.20	
	LIFCO AB-B SHS	7,001	214.30	1,500,314.30	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	45,455	122.75	5,579,601.25	
	SANDVIK AB	32,068	218.40	7,003,651.20	
	SKANSKA AB-B	10,601	194.95	2,066,664.95	
	SKF AB-B SHARES	11,143	200.00	2,228,600.00	
	VOLVO AB-A SHS	6,004	218.60	1,312,474.40	
	VOLVO AB-B SHS	45,423	209.35	9,509,305.05	
	SECURITAS B	15,183	92.52	1,404,731.16	
VOLVO CAR AB-B	17,636	50.83	896,437.88		
ELECTROLUX AB-SER B	6,943	127.68	886,482.24		
EVOLUTION AB	5,496	1,317.00	7,238,232.00		

	EMBRACER GROUP AB	19,953	55.18	1,101,006.54	
	HENNES & MAURITZ B	21,368	130.50	2,788,524.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	18,283	280.00	5,119,240.00	
	GETINGE AB-B SHS	6,907	234.10	1,616,928.70	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	4,958	236.90	1,174,550.20	
	NORDEA BANK ABP	101,566	128.26	13,026,855.16	
	SKAND. ENSKILDA BANKEN A	47,937	127.90	6,131,142.30	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	42,868	107.85	4,623,313.80	
	SWEDBANK AB	27,501	208.60	5,736,708.60	
	EQT AB	8,629	248.00	2,139,992.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	3,703	288.00	1,066,464.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,402	287.30	1,264,694.60	
	INVESTOR AB-A SHS	15,095	208.10	3,141,269.50	
	INVESTOR AB-B SHS	54,628	203.70	11,127,723.60	
	KINNEVIK AB - B	7,577	160.75	1,218,002.75	
	LUNDBERGFÖRETAGEN B	2,461	493.30	1,214,011.30	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	18,870	53.33	1,006,337.10	
	SAGAX AB-B	5,717	258.40	1,477,272.80	
	”ERICSSON (LM) TEL, SEK1 SER B”	86,147	60.31	5,195,525.57	
	HEXAGON AB-B SHS	57,446	119.10	6,841,818.60	
	TELE2 AB-B SHS	15,684	93.64	1,468,649.76	
	TELIA COMPANY AB	77,865	26.72	2,080,552.80	
	スウェーデン・クローナ小計	1,104,991		163,842,623.49 (2,103,739,286)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	9,402	277.20	2,606,234.40	
	EQUINOR ASA	28,906	318.05	9,193,553.30	
	NORSK HYDRO	41,153	77.36	3,183,596.08	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,989	464.20	2,315,893.80	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	2,618	430.60	1,127,310.80	
	ADEVINTA ASA	7,366	84.95	625,741.70	
	MOWI ASA	12,380	177.05	2,191,879.00	
	ORKLA ASA	23,588	70.64	1,666,256.32	
	SALMAR ASA	1,738	436.80	759,158.40	
	DNB BANK ASA	27,407	197.85	5,422,474.95	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6,150	181.70	1,117,455.00	
	TELENOR ASA	20,453	117.20	2,397,091.60	
	ノルウェー・クローネ小計	186,150		32,606,645.35 (425,190,654)	
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,072	496.00	1,523,712.00	
	NOVOZYMES A/S B SHARES	6,030	347.30	2,094,219.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	285	1,774.50	505,732.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	30,395	205.00	6,230,975.00	
	A P MOLLER MAERSK A/S	160	15,590.00	2,494,400.00	
	A. P. MOLLER-MAERSK A DKK1000	95	15,420.00	1,464,900.00	
	DSV A/S	5,675	1,290.50	7,323,587.50	
	PANDORA A/S	2,765	660.60	1,826,559.00	
	CARLSBERG B	3,046	979.00	2,982,034.00	
	COLOPLAST B	3,609	813.40	2,935,560.60	

	DEMANT A/S	2,833	217.60	616,460.80	
	GENMAB A/S	1,973	2,756.00	5,437,588.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	49,636	986.00	48,941,096.00	
	DANSKE BANK A/S	20,212	152.75	3,087,383.00	
	TRYG A/S	11,018	155.80	1,716,604.40	
	ORSTED A/S	5,578	630.30	3,515,813.40	
	デンマーク・クローネ小計	146,382		92,696,625.20 (1,787,190,934)	
イスラエル・シ ェケル	ICL GROUP LIMITED	20,623	26.36	543,622.28	
	ELBIT SYSTEMS LTD	786	584.90	459,731.40	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	22,893	35.70	817,280.10	
	BANK HAPOALIM BM	38,036	31.17	1,185,582.12	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	45,974	30.11	1,384,277.14	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	35,010	18.31	641,033.10	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,624	116.00	536,384.00	
	AZRIELI GROUP	1,403	212.00	297,436.00	
	NICE LTD	1,853	775.00	1,436,075.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	61,768	5.42	334,782.56	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	3,233	144.60	467,491.80	
	イスラエル・シェケル小計	236,203		8,103,695.50 (307,484,190)	
ユーロ	ENI SPA	74,672	14.30	1,067,809.60	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	14,913	11.65	173,811.01	
	NESTE OYJ	12,471	45.01	561,319.71	
	OMV AG	4,297	45.71	196,415.87	
	REPSOL SA	41,371	15.01	621,185.56	
	TENARIS SA	14,277	16.51	235,784.65	
	TOTAL SE	74,605	58.66	4,376,329.30	
	AIR LIQUIDE	15,691	149.42	2,344,549.22	
	AKZO NOBEL	5,453	69.86	380,946.58	
	ARKEMA	1,729	93.84	162,249.36	
	BASF SE	27,539	52.24	1,438,637.36	
	COVESTRO	5,886	42.04	247,447.44	
	CRH	23,073	43.86	1,011,981.78	
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,222	20.01	124,502.22	
	HEIDELBERGCEMENT AG	4,323	64.42	278,487.66	
	KONINKLIJKE DSM N.V	5,164	123.40	637,237.60	
	LINDE PLC	1,841	300.85	553,864.85	
	NLG) ARCELORMITTAL	15,685	28.26	443,258.10	
	OCI NV	3,093	30.14	93,223.02	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	7,198	36.29	261,215.42	
	SOLVAY	2,156	109.40	235,866.40	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	16,501	13.45	221,938.45	
	SYMRISE AG	3,907	96.06	375,306.42	
	UMICORE	6,243	32.40	202,273.20	
	UPM-KYMMENE	15,727	34.06	535,661.62	
	VOESTALPINE AG	3,551	34.32	121,870.32	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	6,951	27.48	191,013.48	
	AIRBUS SE	17,723	125.66	2,227,072.18	

ALSTOM	9,588	27.32	261,944.16	
BOUYGUES SA	6,885	31.77	218,736.45	
BRENTAG SE	4,630	72.92	337,619.60	
CIE DE SAINT-GOBAIN	14,991	54.52	817,309.32	
CNH INDUSTRIAL NV	30,716	15.57	478,094.54	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	13,571	31.42	426,468.67	
DASSAULT AVIATION SA	766	164.00	125,624.00	
EIFFAGE EUR4 (POST SUBDIV ISIO	2,587	103.25	267,107.75	
FERROVIAL SA	14,408	26.49	381,667.92	
GEA GROUP AG NPV	4,733	41.09	194,478.97	
IMCD NV	1,726	151.65	261,747.90	
KINGSPAN GROUP PLC	4,524	63.42	286,912.08	
KNORR-BREMSE AG	2,182	63.60	138,775.20	
KONE OYJ	10,009	48.49	485,336.41	
LEGRAND PROMESSES EUR4	7,891	89.52	706,402.32	
MTU AERO ENGINES AG	1,600	234.00	374,400.00	
PRYSMIAN SPA EURO.10	7,952	37.70	299,790.40	
RATIONAL AG	151	618.00	93,318.00	
RHEINMETALL AG	1,302	249.60	324,979.20	
SAFRAN SA	10,248	136.86	1,402,541.28	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	16,267	156.26	2,541,881.42	
SIEMENS AG	22,938	145.44	3,336,102.72	
SIEMENS ENERGY AG	12,340	19.20	236,928.00	
THALES SA	3,200	129.70	415,040.00	
VINCI SA	16,125	109.54	1,766,332.50	
WARTSILA OYJ	13,590	9.31	126,550.08	
BUREAU VERITAS	8,577	26.26	225,232.02	
RANDSTAD NV	3,659	59.24	216,759.16	
RELX PLC	8,324	28.01	233,155.24	
TELEPERFORMANCE	1,786	255.50	456,323.00	
WOLTERS KLUWER CVA	7,901	103.50	817,753.50	
ADP	906	135.40	122,672.40	
AENA SME SA	2,249	140.40	315,759.60	
DEUTSCHE POST AG-REG	29,721	40.60	1,206,672.60	
GETLINK SE	13,683	16.45	225,153.76	
LUFTHANSA	18,612	9.73	181,094.76	
BAYER MOTOREN WERKEUR1	9,784	99.75	975,954.00	
BAYER MOTOREN WERKNON-VTG PRF EUR1	1,799	91.65	164,878.35	
CONTINENTAL	3,284	69.62	228,632.08	
DR ING HC F PORSCHE AG	3,391	114.10	386,913.10	
FERRARI NV	3,721	249.00	926,529.00	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	24,058	74.64	1,795,689.12	
MICHELIN (CGDE)	20,012	30.34	607,064.02	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE (PREF)	4,638	55.60	257,872.80	
RENAULT SA	5,976	42.21	252,246.96	
STELLANTIS NV	41,895	15.95	668,225.25	

STELLANTIS NV	24,091	15.95	384,251.45	
VALEO SA	6,088	21.08	128,335.04	
VOLKSWAGEN STAMM	878	166.80	146,450.40	
VOLKSWAGEN VORZUG	5,486	131.22	719,872.92	
ADIDAS AG	5,113	143.52	733,817.76	
HERMES INTERNATIONAL	950	1,747.00	1,659,650.00	
KERING	2,245	590.00	1,324,550.00	
LVMH	8,299	818.40	6,791,901.60	
MONCLER SPA	5,995	57.66	345,671.70	
PUMA SE	3,065	61.32	187,945.80	
SEB	804	99.80	80,239.20	
ACCOR SA	5,051	30.05	151,782.55	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,150	37.55	118,282.50	
PADDY POWER BETFAIR PLC	4,917	154.55	759,922.35	
SODEXO	2,760	86.68	239,236.80	
BOLLORE SE	26,053	5.17	134,694.01	
PUBLICIS GROUPE	6,977	75.58	527,321.66	
SCOUT24 SE	2,374	51.86	123,115.64	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,988	20.43	61,044.84	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	21,566	22.52	485,666.32	
VIVENDI SE	22,234	9.88	219,671.92	
DELIVERY HERO SE	4,892	40.38	197,538.96	
D' IETEREN GROUP	733	187.80	137,657.40	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	32,208	28.80	927,590.40	
JUST EAT TAKEAWAY	5,663	21.53	121,924.39	
PROSUS NV	24,870	73.00	1,815,510.00	
ZALANDO SE	6,284	39.78	249,977.52	
CARREFOUR	18,222	18.15	330,729.30	
HELLOFRESH SE	4,629	21.87	101,236.23	
JERONIMO MARTINS	8,284	20.30	168,165.20	
KESKO OYJ-B SHS	8,375	20.31	170,096.25	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	30,897	29.73	918,722.29	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	26,044	55.01	1,432,680.44	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	4,700	52.40	246,280.00	
DANONE	19,539	52.09	1,017,786.51	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	15,854	10.49	166,308.46	
HEINEKEN HOLDING EUR1.6	3,007	78.30	235,448.10	
HEINEKEN NV	7,653	95.66	732,085.98	
JDE PEET'S BV	2,655	27.70	73,543.50	
KERRY GROUP A	4,780	93.04	444,731.20	
PERNOD RICARD	6,200	194.95	1,208,690.00	
REMY COINTREAU	683	167.70	114,539.10	
BEIERSDORF	3,016	113.20	341,411.20	
HENKEL AG & CO KGAA (PREF)	5,380	67.24	361,751.20	
HENKEL KGAA	3,245	64.10	208,004.50	
L' OREAL	7,242	384.60	2,785,273.20	

UNILEVER PLC	36,302	47.66	1,729,971.81	
AMPLIFON SPA	3,732	27.40	102,256.80	
BIOMERIEUX	1,223	95.78	117,138.94	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,212	133.50	161,802.00	
DIASORIN ITALIA SPA	813	116.30	94,551.90	
ESSILORLUXOTTICA	8,658	174.60	1,511,686.80	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO KGAA	6,332	37.47	237,260.04	
FRESENIUS SE & CO KGaA	12,707	28.99	368,375.93	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	26,590	15.85	421,345.14	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	8,300	50.32	417,656.00	
ARGENX SE	1,640	345.80	567,112.00	
BAYER AG	29,457	59.12	1,741,497.84	
EUROFINS SCIENTIFIC	3,948	67.92	268,148.16	
GRIFOLS SA	9,432	14.28	134,688.96	
IPSEN	1,163	107.70	125,255.10	
MERCK KGAA	3,815	183.45	699,861.75	
ORION OYJ	3,271	45.35	148,339.85	
QIAGEN N. V.	6,910	44.73	309,084.30	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,263	41.10	134,109.30	
SANOFI	34,203	89.10	3,047,487.30	
SARTORIUS AG-VORZUG	728	427.10	310,928.80	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	827	330.60	273,406.20	
UCB SA	3,817	77.90	297,344.30	
ABN AMRO BANK NV-CVA	12,519	16.53	207,001.66	
AIB GROUP PLC	32,064	3.93	126,011.52	
BANCA INTESA SPA	500,921	2.56	1,284,611.90	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT	181,921	6.98	1,269,080.89	
BANCO SANTANDER SA	513,654	3.52	1,810,116.69	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	32,092	9.78	313,731.39	
BNP PARIBAS	33,309	65.43	2,179,407.87	
CAIXABANK	130,463	4.11	536,333.39	
COMMERZBANK AG	31,163	11.38	354,634.94	
CREDIT AGRICOLE SA	36,061	11.75	423,716.75	
ERSTE GROUP BANK AG	10,073	36.37	366,355.01	
FINECOBANK SPA	17,792	16.72	297,482.24	
ING GROUP N. V.	112,956	13.21	1,492,374.67	
KBC BANCASSURANCE HOLDING NV	7,510	71.82	539,368.20	
MEDIOBANCA	18,507	10.25	189,789.28	
SOCIETE GENERALE-A	23,916	27.86	666,299.76	
UNICREDIT SPA	57,602	19.56	1,126,579.91	
AMUNDI SA	1,867	62.95	117,527.65	
DEUTSCHE BANK AG-REG	60,984	11.88	724,489.92	
DEUTSCHE BOERSE AG	5,697	171.45	976,750.65	
EURAZEO	1,267	64.90	82,228.30	
EURONEXT NV	2,584	77.16	199,381.44	
EXOR NV	3,383	76.18	257,716.94	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	3,038	79.70	242,128.60	
SOFINA	490	234.40	114,856.00	

WENDEL	782	101.20	79,138.40	
AEGON NV	55,887	5.17	288,935.79	
AGEAS	4,846	43.54	210,994.84	
ALLIANZ	12,247	216.95	2,656,986.65	
ASSICURAZIONI GENERALI	32,624	18.32	597,671.68	
AXA SA	56,043	28.32	1,587,417.97	
HANNOVER RUECK SE	1,886	181.95	343,157.70	
MUENCHENER RUECK AG-REG	4,201	329.90	1,385,909.90	
NN GROUP NV	9,035	40.61	366,911.35	
POSTE ITALIANE	16,160	10.23	165,236.00	
SAMPO INSURANCE CO A	14,839	45.45	674,432.55	
AROUNDTOWN SA	32,616	2.51	81,996.62	
LEG IMMOBILIEN SE	2,254	70.54	158,997.16	
VONOVIA SE	21,038	25.46	535,627.48	
ADYEN NV	650	1,466.80	953,420.00	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	13,308	57.02	758,822.16	
BECHTLE AG	2,430	40.48	98,366.40	
CAPGEMINI SA	4,884	186.00	908,424.00	
DASSAULT SYSTEMES SE	19,703	37.44	737,778.83	
EDENRED	7,473	52.04	388,894.92	
NEMETSCHEK SE	1,844	50.66	93,417.04	
NEXI SPA	17,698	7.85	138,929.30	
SAP SE	31,310	109.48	3,427,818.80	
WORLDLINE SA	6,974	41.11	286,701.14	
NOKIA OYJ	159,839	4.46	712,482.34	
CELLNEX TELECOM SA	16,353	37.98	621,086.94	
DEUTSCHE TELEKOM	97,183	20.76	2,017,519.08	
ELISA CORP-A SHARES	4,146	53.10	220,152.60	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	9,879	10.47	103,482.52	
KPN (KON. PTT NEDERLAND	96,873	3.25	314,837.25	
ORANGE S. A.	58,889	10.71	630,936.74	
TELECOM ITALIA SPA	255,922	0.31	80,231.54	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	27,651	2.83	78,279.98	
TELEFONICA S. A.	161,628	3.82	616,772.44	
UNITED INTERNET	2,824	20.80	58,739.20	
ACCIONA SA	730	186.80	136,364.00	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	1,974	38.00	75,012.00	
E. ON SE	66,247	10.16	673,400.75	
EDP ELERGIAS DE PORTUGAL	83,896	4.71	394,730.68	
EDP RENOVAVEIS SA	8,749	19.89	174,017.61	
ELIA GROUP SA/NV	950	129.50	123,025.00	
ENAGAS	7,199	16.85	121,339.14	
ENDESA SA	9,460	19.05	180,165.70	
ENEL SPA	243,868	5.35	1,305,425.40	
ENGIE	53,915	13.50	727,852.50	
FORTUM OYJ	12,949	14.43	186,854.07	
IBERDROLA SA	184,241	10.90	2,008,226.90	
NATURGY ENERGY GROUP SA	4,294	26.76	114,907.44	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	12,113	16.31	197,623.59	

RWE AG	18,978	39.52	750,010.56	
SNAM SPA	61,706	4.77	294,461.03	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	41,249	7.39	304,912.60	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	20,155	28.45	573,409.75	
VERBUND AG	2,100	80.85	169,785.00	
ASM INTERNATIONAL NV	1,377	323.05	444,839.85	
ASML HOLDING NV	12,188	610.30	7,438,336.40	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	39,156	35.24	1,379,661.66	
STMICROELECTRONICS NV	20,493	45.90	940,731.16	
ユーロ小計	5,507,379		145,935,918.67 (20,946,182,407)	
合計	33,229,774		197,187,704,503 (197,187,704,503)	

- (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。

② 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE	4,500.00	727,110.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	9,400.00	312,550.00	
		AMERICAN TOWER CORP	13,992.00	2,941,957.92	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	14,050.00	303,339.50	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,115.00	737,696.05	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,550.00	320,502.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,006.00	360,870.30	
		CROWN CASTLE INC	12,966.00	1,824,056.88	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,600.00	952,536.00	
		EQUINIX INC	2,727.00	1,954,604.52	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5,300.00	380,964.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	10,743.00	707,748.84	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,937.00	458,739.71	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	4,000.00	635,960.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	7,600.00	400,368.00	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	11,300.00	236,848.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	15,900.00	415,467.00	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	21,048.00	356,553.12	
		INVITATION HOMES INC	18,300.00	597,129.00	
		IRON MOUNTAIN INC	8,757.00	460,618.20	
		KIMCO REALTY CORP	18,900.00	399,735.00	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	17,300.00	224,208.00	
		MID AMERICA APARTMENT COMM	3,437.00	578,584.58	
PROLOGIS INC	27,628.00	3,462,340.96			
PUBLIC STORAGE	4,730.00	1,414,317.30			
REALTY INCOME CORP	18,538.00	1,225,732.56			

	REGENCY CENTERS CORP	4,700.00	302,351.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	3,200.00	899,968.00	
	SIMON PTY (SIMON DEBART	9,680.00	1,197,028.80	
	SUN COMMUNITIES INC	3,700.00	584,785.00	
	UDR INC	9,700.00	434,075.00	
	VENTAS INC COM	11,600.00	585,336.00	
	VICI PROPERTIES INC	28,400.00	962,476.00	
	WELLTOWER INC	13,891.00	1,075,163.40	
	WEYERHAEUSER CO	22,060.00	710,332.00	
	WP CAREY INC	5,800.00	486,794.00	
	アメリカ・ドル小計	386,055.00	29,628,846.64 (3,983,598,431)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,800.00	140,000.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,000.00	111,550.00	
	カナダ・ドル小計	7,800.00	251,550.00 (25,066,958)	
オーストラ リア・ドル	DEXUS/AU	31,342.00	272,048.56	
	GOODMAN GROUP	50,608.00	1,006,087.04	
	GPT GROUP	55,573.00	258,414.45	
	MIRVAC GROUP	122,258.00	272,635.34	
	SCENTRE GROUP	155,373.00	456,796.62	
	STOCKLAND	71,820.00	278,661.60	
	VINCINITY CENTERS	117,781.00	246,162.29	
	オーストラリア・ドル小計	604,755.00	2,790,805.90 (257,675,109)	
イギリス・ ポンド	BRITISH LAND CO	26,659.00	119,352.34	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	21,473.00	150,654.56	
	SEGRO PLC	35,390.00	306,548.18	
	イギリス・ポンド小計	83,522.00	576,555.08 (93,177,066)	
香港・ドル	LINK REIT	62,187.00	3,299,020.35	
	香港・ドル小計	62,187.00	3,299,020.35 (56,545,209)	
シンガポー ル・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	101,885.00	283,240.30	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	154,021.00	298,800.74	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	88,867.00	148,407.89	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	71,600.00	123,152.00	
	シンガポール・ドル小計	416,373.00	853,600.93 (85,829,574)	
ユーロ	COVIVIO	1,463.00	91,803.25	
	GECINA SA	1,365.00	150,286.50	
	KLEPIERRE	6,452.00	154,009.24	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,517.00	212,954.35	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	4,412.00	132,007.04	
	ユーロ小計	17,209.00	741,060.38 (106,364,396)	

投資証券合計		4,608,256,742 (4,608,256,742)	
合計		4,608,256,742 (4,608,256,742)	

- (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 601銘柄	97.3%	—	72.4%
	投資証券 36銘柄	—	2.7%	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	99.7%	—	3.6%
	投資証券 2銘柄	—	0.3%	
オーストラリア・ドル	株式 54銘柄	94.4%	—	2.3%
	投資証券 7銘柄	—	5.6%	
イギリス・ポンド	株式 80銘柄	99.0%	—	4.7%
	投資証券 3銘柄	—	1.0%	
スイス・フラン	株式 43銘柄	100.0%	—	3.0%
香港・ドル	株式 29銘柄	96.6%	—	0.8%
	投資証券 1銘柄	—	3.4%	
シンガポール・ドル	株式 15銘柄	89.2%	—	0.4%
	投資証券 4銘柄	—	10.8%	
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	100.0%	—	0.1%
スウェーデン・クローナ	株式 45銘柄	100.0%	—	1.0%
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	100.0%	—	0.2%
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	100.0%	—	0.9%
イスラエル・シェケル	株式 11銘柄	100.0%	—	0.2%
ユーロ	株式 226銘柄	99.5%	—	10.4%
	投資証券 5銘柄	—	0.5%	

(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	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		404,762,831	331,423,291
金銭信託		434,636	58,881
コール・ローン		104,085,365	27,379,779
国債証券		112,815,109,040	98,967,020,992
派生商品評価勘定		150,640	—
未収利息		745,402,426	693,324,926
前払費用		18,948,737	43,024,725
流動資産合計		114,088,893,675	100,062,232,594
資産合計		114,088,893,675	100,062,232,594
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		581,280	98,765
未払金		605,654,872	—
未払解約金		224,535,783	55,948,622
未払利息		281	73
その他未払費用		87	18
流動負債合計		830,772,303	56,047,478
負債合計		830,772,303	56,047,478
純資産の部			
元本等			
元本	1	44,829,220,968	39,505,032,684
剰余金			
剰余金又は欠損金(△)		68,428,900,404	60,501,152,432
元本等合計		113,258,121,372	100,006,185,116
純資産合計		113,258,121,372	100,006,185,116
負債純資産合計		114,088,893,675	100,062,232,594

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
1 期首元本額	56,125,021,105円	44,829,220,968円
期中追加設定元本額	7,492,685,110円	6,861,120,999円
期中一部解約元本額	18,788,485,247円	12,185,309,283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	6,525,734,988円	6,573,053,611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	27,752,805円	27,914,213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）	864,844,189円	858,207,630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＞	2,727,903,184円	3,522,109,524円
外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	945,432,342円	731,180,349円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	1,477,413円	3,965,865円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	131,144,952円	77,880,401円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	81,946円	79,545円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	5,901,645円	4,841,917円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	4,039,197円	1,950,052円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	6,334,376,233円	5,649,737,183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＞	78,290,488円	73,245,212円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	1,522,649円	1,234,781円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	2,140,003,570円	1,770,620,355円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	1,128,658,937円	999,215,937円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	25,724,700円	25,180,532円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	696,774,062円	547,267,577円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	3,408,874,554円	3,057,943,620円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	796,702,791円	657,500,727円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	2,375,871,421円	2,036,207,903円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	74,144,512円	66,481,698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＞	159,210,423円	—円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	93,357,417円	74,087,159円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	56,178,677円	53,201,916円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	40,736,429円	30,342,970円
バランスファンドVA25B＜適格機関	560,225,202円	483,144,559円

投資家限定>		
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	2,022,530円	1,653,331円
投資家限定>		
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	1,874,506円	1,825,877円
投資家限定>		
外国債券インデックス・ファンドVA3<適格機関投資家限定>	916,323,583円	505,687,107円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	838,619,218円	762,368,435円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	1,464,119,127円	1,261,385,716円
投資家限定>		
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>	600,045,110円	410,575,814円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	29,466,570円	27,738,807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>	193,067,286円	188,469,837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>	565,394,934円	—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>	278,379,509円	214,783,410円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド(ステイブル)<適格機関投資家限定>	127,780,936円	126,400,166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	103,024,464円	200,353,653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)	5,435,093,427円	5,805,670,470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>	3,896,322,199円	1,746,137,311円
世界バランス40VA<適格機関投資家限定>	19,489,997円	13,481,149円
世界バランス60VA<適格機関投資家限定>	85,830,664円	13,639,600円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	984,013円	949,115円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	990,434,150円	834,530,442円
グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	63,125,976円	52,778,605円
グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	12,858,043円	10,008,603円
計	44,829,220,968円	39,505,032,684円
2 受益権の総数	44,829,220,968口	39,505,032,684口

(金融商品に関する注記)

I 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	<p>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。</p>
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>

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	<p>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</p> <p>ん。</p>	<p>同左</p>
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品</p> <p>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券</p> <p>売買目的有価証券</p> <p>「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</p> <p>「注記表（デリバティブ取引等関</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品</p> <p>同左</p> <p>(2)有価証券</p> <p>売買目的有価証券</p> <p>同左</p> <p>(3)デリバティブ取引</p> <p>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>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>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	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△6,563,134,191	△13,481,187,186
合計	△6,563,134,191	△13,481,187,186

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

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

(単位：円)

区 分	種 類	(2022年2月21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	333,795,800	—	333,662,110	△133,690
	イギリス・ポンド	46,983,000	—	46,965,510	△17,490
	ユーロ	287,108,800	—	286,803,440	△305,360
	売建				
アメリカ・ドル	103,428,000	—	103,552,740	△124,740	
ユーロ	104,440,000	—	104,289,360	150,640	
合 計		875,755,600	—	875,273,160	△430,640

(単位：円)

区 分	種 類	(2023年2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	46,949,635	—	47,048,400	△98,765
	合 計	46,949,635	—	47,048,400	△98,765

(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。
- ① 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。
 - ② 為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
- (2) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
- (3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
 3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
 4. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(2022年2月21日現在)	(2023年2月20日現在)
1口当たり純資産額	2,5264円	2,5315円
(1万口当たり純資産額)	(25,264円)	(25,315円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

① 株式

該当する事項はありません。

② 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリ カ・ドル	US TREASURY N/B 0.25% 25/08/31	4,000,000.00	3,605,625.00	
		US TREASURY N/B 0.38% 27/07/31	3,500,000.00	2,976,230.46	
		US TREASURY N/B 0.38% 27/09/30	3,200,000.00	2,707,624.99	
		US TREASURY N/B 0.5% 25/03/31	7,500,000.00	6,896,484.37	
		US TREASURY N/B 0.5% 27/06/30	2,000,000.00	1,714,843.76	
		US TREASURY N/B 0.5% 27/10/31	2,000,000.00	1,697,890.62	
		US TREASURY N/B 0.63% 27/11/30	6,500,000.00	5,539,472.64	
		US TREASURY N/B 0.63% 27/12/31	2,950,000.00	2,507,845.71	
		US TREASURY N/B 0.63% 30/05/15	2,800,000.00	2,231,140.63	
		US TREASURY N/B 0.63% 30/08/15	4,000,000.00	3,169,687.52	
		US TREASURY N/B 0.75% 26/03/31	3,200,000.00	2,876,249.98	

US TREASURY N/B 0.88% 26/06/30	4,000,000.00	3,581,562.48
US TREASURY N/B 0.88% 26/09/30	2,200,000.00	1,955,250.00
US TREASURY N/B 0.88% 30/11/15	4,000,000.00	3,219,687.52
US TREASURY N/B 1.13% 27/02/28	2,100,000.00	1,868,835.94
US TREASURY N/B 1.13% 31/02/15	4,200,000.00	3,441,046.89
US TREASURY N/B 1.13% 40/05/15	1,000,000.00	640,742.19
US TREASURY N/B 1.13% 40/08/15	2,500,000.00	1,591,894.52
US TREASURY N/B 1.25% 26/11/30	3,000,000.00	2,693,437.50
US TREASURY N/B 1.25% 28/03/31	1,400,000.00	1,220,898.43
US TREASURY N/B 1.25% 28/05/31	4,200,000.00	3,649,242.19
US TREASURY N/B 1.25% 28/06/30	4,000,000.00	3,468,906.24
US TREASURY N/B 1.25% 28/09/30	600,000.00	517,242.18
US TREASURY N/B 1.25% 31/08/15	4,100,000.00	3,346,464.85
US TREASURY N/B 1.25% 50/05/15	1,500,000.00	834,316.41
US TREASURY N/B 1.38% 26/08/31	3,500,000.00	3,176,386.71
US TREASURY N/B 1.38% 28/10/31	2,500,000.00	2,166,503.90
US TREASURY N/B 1.38% 28/12/31	4,000,000.00	3,458,750.00
US TREASURY N/B 1.38% 31/11/15	4,000,000.00	3,277,656.24
US TREASURY N/B 1.38% 40/11/15	3,000,000.00	1,992,421.86
US TREASURY N/B 1.38% 50/08/15	2,700,000.00	1,551,339.83
US TREASURY N/B 1.5% 26/08/15	3,500,000.00	3,193,066.41
US TREASURY N/B 1.5% 27/01/31	4,800,000.00	4,336,687.48
US TREASURY N/B 1.5% 28/11/30	4,900,000.00	4,270,273.46
US TREASURY N/B 1.5% 30/02/15	1,500,000.00	1,284,082.03
US TREASURY N/B 1.63% 26/02/15	3,000,000.00	2,775,703.14
US TREASURY N/B 1.63% 26/05/15	4,000,000.00	3,682,500.00
US TREASURY N/B 1.63% 26/09/30	4,000,000.00	3,657,656.24
US TREASURY N/B 1.63% 29/08/15	6,000,000.00	5,223,750.00
US TREASURY N/B 1.63% 31/05/15	4,400,000.00	3,724,187.50
US TREASURY N/B 1.63% 50/11/15	800,000.00	491,406.24
US TREASURY N/B 1.75% 29/01/31	4,100,000.00	3,615,207.02
US TREASURY N/B 1.75% 29/11/15	3,000,000.00	2,629,687.50
US TREASURY N/B 1.88% 24/08/31	3,800,000.00	3,632,562.50
US TREASURY N/B 1.88% 32/02/15	4,000,000.00	3,410,156.24
US TREASURY N/B 1.88% 41/02/15	1,400,000.00	1,011,937.50
US TREASURY N/B 1.88% 51/02/15	4,850,000.00	3,173,529.30
US TREASURY N/B 1.88% 51/11/15	2,500,000.00	1,627,734.37
US TREASURY N/B 2.0% 24/04/30	6,500,000.00	6,275,039.03
US TREASURY N/B 2.0% 24/05/31	6,000,000.00	5,779,921.86
US TREASURY N/B 2.0% 24/06/30	4,000,000.00	3,844,687.52
US TREASURY N/B 2.0% 25/02/15	5,000,000.00	4,753,906.25
US TREASURY N/B 2.0% 25/08/15	4,500,000.00	4,244,414.04
US TREASURY N/B 2.0% 26/11/15	4,550,000.00	4,205,906.25
US TREASURY N/B 2.0% 41/11/15	3,000,000.00	2,188,710.93
US TREASURY N/B 2.0% 50/02/15	2,200,000.00	1,494,109.36
US TREASURY N/B 2.0% 51/08/15	1,600,000.00	1,076,500.00
US TREASURY N/B 2.13% 24/02/29	6,500,000.00	6,311,347.64
US TREASURY N/B 2.13% 24/03/31	6,200,000.00	6,007,460.92
US TREASURY N/B 2.13% 24/07/31	3,000,000.00	2,884,570.32
US TREASURY N/B 2.13% 24/09/30	5,300,000.00	5,082,203.12
US TREASURY N/B 2.13% 25/05/15	5,200,000.00	4,936,343.77
US TREASURY N/B 2.25% 24/01/31	3,300,000.00	3,214,792.97
US TREASURY N/B 2.25% 24/11/15	7,700,000.00	7,383,878.88
US TREASURY N/B 2.25% 24/12/31	2,500,000.00	2,392,382.80
US TREASURY N/B 2.25% 25/11/15	4,000,000.00	3,782,343.76
US TREASURY N/B 2.25% 26/03/31	2,300,000.00	2,165,863.28
US TREASURY N/B 2.25% 27/02/15	3,500,000.00	3,256,914.08
US TREASURY N/B 2.25% 27/08/15	2,000,000.00	1,850,000.00
US TREASURY N/B 2.25% 27/11/15	2,800,000.00	2,582,125.00
US TREASURY N/B 2.25% 41/05/15	2,050,000.00	1,573,535.14
US TREASURY N/B 2.25% 46/08/15	1,200,000.00	872,765.62

US TREASURY N/B 2.25% 49/08/15	1,000,000.00	721,093.75	
US TREASURY N/B 2.25% 52/02/15	2,100,000.00	1,499,613.27	
US TREASURY N/B 2.38% 24/08/15	8,300,000.00	8,001,718.75	
US TREASURY N/B 2.38% 27/05/15	4,200,000.00	3,913,710.94	
US TREASURY N/B 2.38% 29/05/15	2,500,000.00	2,277,734.37	
US TREASURY N/B 2.38% 49/11/15	2,500,000.00	1,851,953.12	
US TREASURY N/B 2.38% 51/05/15	4,000,000.00	2,943,750.00	
US TREASURY N/B 2.5% 24/05/15	6,000,000.00	5,821,640.64	
US TREASURY N/B 2.5% 25/01/31	2,500,000.00	2,401,562.50	
US TREASURY N/B 2.5% 26/02/28	3,000,000.00	2,847,421.86	
US TREASURY N/B 2.5% 45/02/15	1,000,000.00	771,132.81	
US TREASURY N/B 2.5% 46/05/15	1,000,000.00	765,976.56	
US TREASURY N/B 2.63% 25/03/31	5,000,000.00	4,807,226.55	
US TREASURY N/B 2.63% 25/12/31	3,000,000.00	2,865,351.56	
US TREASURY N/B 2.63% 26/01/31	2,300,000.00	2,194,164.07	
US TREASURY N/B 2.63% 27/05/31	1,800,000.00	1,694,179.69	
US TREASURY N/B 2.63% 29/02/15	5,000,000.00	4,633,398.45	
US TREASURY N/B 2.75% 24/02/15	4,000,000.00	3,910,781.24	
US TREASURY N/B 2.75% 25/02/28	3,900,000.00	3,762,281.25	
US TREASURY N/B 2.75% 25/06/30	2,900,000.00	2,788,191.39	
US TREASURY N/B 2.75% 28/02/15	2,300,000.00	2,166,132.82	
US TREASURY N/B 2.75% 32/08/15	4,800,000.00	4,389,000.00	
US TREASURY N/B 2.75% 42/08/15	1,200,000.00	987,609.37	
US TREASURY N/B 2.75% 42/11/15	1,000,000.00	820,781.25	
US TREASURY N/B 2.75% 47/08/15	500,000.00	400,058.59	
US TREASURY N/B 2.75% 47/11/15	1,000,000.00	800,585.94	
US TREASURY N/B 2.88% 25/07/31	4,600,000.00	4,434,328.14	
US TREASURY N/B 2.88% 25/11/30	2,300,000.00	2,211,773.42	
US TREASURY N/B 2.88% 28/05/15	3,400,000.00	3,213,664.05	
US TREASURY N/B 2.88% 28/08/15	4,000,000.00	3,773,437.52	
US TREASURY N/B 2.88% 32/05/15	4,900,000.00	4,535,179.71	
US TREASURY N/B 2.88% 43/05/15	1,750,000.00	1,462,275.38	
US TREASURY N/B 2.88% 45/08/15	1,100,000.00	905,695.31	
US TREASURY N/B 2.88% 46/11/15	800,000.00	656,875.00	
US TREASURY N/B 2.88% 49/05/15	2,000,000.00	1,645,546.88	
US TREASURY N/B 2.88% 52/05/15	2,500,000.00	2,051,562.50	
US TREASURY N/B 3.0% 25/09/30	2,500,000.00	2,412,304.70	
US TREASURY N/B 3.0% 42/05/15	1,200,000.00	1,031,484.37	
US TREASURY N/B 3.0% 45/05/15	1,100,000.00	926,664.06	
US TREASURY N/B 3.0% 45/11/15	1,000,000.00	841,562.50	
US TREASURY N/B 3.0% 47/02/15	900,000.00	755,050.77	
US TREASURY N/B 3.0% 47/05/15	1,000,000.00	838,632.81	
US TREASURY N/B 3.0% 48/02/15	550,000.00	461,462.89	
US TREASURY N/B 3.0% 48/08/15	1,500,000.00	1,259,531.25	
US TREASURY N/B 3.0% 49/02/15	1,700,000.00	1,432,117.19	
US TREASURY N/B 3.0% 52/08/15	1,800,000.00	1,516,218.75	
US TREASURY N/B 3.13% 27/08/31	3,200,000.00	3,073,375.00	
US TREASURY N/B 3.13% 28/11/15	3,200,000.00	3,053,124.99	
US TREASURY N/B 3.13% 41/11/15	950,000.00	838,115.23	
US TREASURY N/B 3.13% 42/02/15	1,400,000.00	1,230,796.86	
US TREASURY N/B 3.13% 43/02/15	700,000.00	609,847.65	
US TREASURY N/B 3.13% 44/08/15	1,000,000.00	863,398.44	
US TREASURY N/B 3.13% 48/05/15	1,700,000.00	1,460,339.84	
US TREASURY N/B 3.25% 29/06/30	2,800,000.00	2,682,750.00	
US TREASURY N/B 3.38% 42/08/15	3,300,000.00	3,001,968.75	
US TREASURY N/B 3.38% 48/11/15	2,050,000.00	1,846,681.63	
US TREASURY N/B 3.5% 39/02/15	600,000.00	571,992.18	
US TREASURY N/B 3.63% 43/08/15	1,100,000.00	1,034,000.00	
US TREASURY N/B 3.63% 44/02/15	1,300,000.00	1,218,089.84	
US TREASURY N/B 3.75% 41/08/15	800,000.00	775,218.75	
US TREASURY N/B 3.75% 43/11/15	1,050,000.00	1,004,062.50	

	US TREASURY N/B 3.88% 26/01/15	1,000,000.00	987,500.00	
	US TREASURY N/B 3.88% 40/08/15	900,000.00	892,371.09	
	US TREASURY N/B 4.0% 42/11/15	300,000.00	298,593.75	
	US TREASURY N/B 4.0% 52/11/15	2,350,000.00	2,398,101.54	
	US TREASURY N/B 4.13% 32/11/15	700,000.00	715,640.62	
	US TREASURY N/B 4.25% 39/05/15	500,000.00	521,035.15	
	US TREASURY N/B 4.25% 40/11/15	1,000,000.00	1,039,257.81	
	US TREASURY N/B 4.38% 38/02/15	400,000.00	423,656.24	
	US TREASURY N/B 4.38% 39/11/15	750,000.00	793,242.18	
	US TREASURY N/B 4.38% 40/05/15	500,000.00	527,343.75	
	US TREASURY N/B 4.5% 36/02/15	500,000.00	538,730.47	
	US TREASURY N/B 4.5% 38/05/15	300,000.00	321,843.75	
	US TREASURY N/B 4.75% 41/02/15	1,800,000.00	1,990,757.80	
	US TREASURY N/B 5.0% 37/05/15	200,000.00	225,835.93	
	US TREASURY N/B 5.38% 31/02/15	500,000.00	550,234.37	
	US TREASURY N/B 6.0% 26/02/15	2,000,000.00	2,092,890.62	
	US TREASURY N/B 6.13% 27/11/15	300,000.00	326,074.21	
	US TREASURY N/B 6.25% 30/05/15	900,000.00	1,030,464.84	
	アメリカ・ドル小計	413,050,000.00	368,815,284.75 (49,587,215,035)	
カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.0% 27/06/01	1,050,000.00	951,041.70	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 30/06/01	1,780,000.00	1,546,907.22	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 24/09/01	2,290,000.00	2,197,575.60	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 26/06/01	1,100,000.00	1,029,374.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 31/06/01	2,000,000.00	1,741,808.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 53/12/01	720,000.00	509,924.88	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 28/06/01	550,000.00	515,653.60	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 32/06/01	1,900,000.00	1,705,115.10	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 51/12/01	1,520,000.00	1,158,896.64	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 24/03/01	800,000.00	782,066.40	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 25/06/01	2,500,000.00	2,412,135.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.5% 24/06/01	2,400,000.00	2,344,111.20	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 48/12/01	650,000.00	588,885.70	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 64/12/01	430,000.00	380,125.16	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 45/12/01	600,000.00	616,128.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 37/06/01	450,000.00	533,907.45	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 29/06/01	750,000.00	853,432.50		
CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/06/01	700,000.00	846,083.70		
	カナダ・ドル小計	22,190,000.00	20,713,172.35 (2,064,067,625)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.0% 30/12/21	1,700,000.00	1,384,660.52	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.0% 31/11/21	910,000.00	721,861.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 32/05/21	2,400,000.00	1,925,423.41	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 51/06/21	900,000.00	539,080.38	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 28/05/21	700,000.00	655,597.39	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.5% 30/05/21	1,900,000.00	1,754,330.76	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 24/04/21	400,000.00	395,961.49	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 27/11/21	650,000.00	626,929.14	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 28/11/21	900,000.00	859,978.62	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 35/06/21	400,000.00	353,278.59	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 41/05/21	500,000.00	409,230.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 47/03/21	570,000.00	465,160.99	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25%	1,100,000.00	1,094,579.50	

	25/04/21			
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 29/04/21	450,000.00	440,262.36	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 39/06/21	350,000.00	313,796.72	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 37/04/21	350,000.00	339,192.39	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 26/04/21	1,450,000.00	1,482,551.15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 33/04/21	1,600,000.00	1,691,143.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 27/04/21	1,500,000.00	1,569,459.81	
	オーストラリア・ドル小計	18,730,000.00	17,022,479.12 (1,571,685,496)	
イギリス・ポンド	UK GILT BOND 0.25% 31/07/31	1,150,000.00	875,101.70	
	UK GILT BOND 0.38% 30/10/22	1,000,000.00	791,608.20	
	UK GILT BOND 0.88% 29/10/22	1,400,000.00	1,186,618.16	
	UK GILT BOND 1.0% 24/04/22	150,000.00	145,280.40	
	UK GILT BOND 1.13% 39/01/31	650,000.00	433,927.00	
	UK GILT BOND 1.25% 27/07/22	1,300,000.00	1,184,214.20	
	UK GILT BOND 1.5% 26/07/22	1,150,000.00	1,078,816.38	
	UK GILT BOND 1.63% 28/10/22	600,000.00	544,506.60	
	UK GILT BOND 1.63% 71/10/22	870,000.00	469,478.10	
	UK GILT BOND 1.75% 37/09/07	1,300,000.00	991,364.40	
	UK GILT BOND 1.75% 49/01/22	900,000.00	577,035.00	
	UK GILT BOND 1.75% 57/07/22	1,030,000.00	621,553.50	
	UK GILT BOND 2.0% 25/09/07	800,000.00	772,246.96	
	UK GILT BOND 2.5% 65/07/22	970,000.00	711,349.11	
	UK GILT BOND 2.75% 24/09/07	1,100,000.00	1,083,562.92	
	UK GILT BOND 3.25% 44/01/22	300,000.00	267,718.20	
	UK GILT BOND 3.5% 45/01/22	1,000,000.00	924,180.80	
	UK GILT BOND 3.5% 68/07/22	650,000.00	613,008.50	
	UK GILT BOND 3.75% 52/07/22	850,000.00	819,074.87	
	UK GILT BOND 4.0% 60/01/22	870,000.00	900,001.08	
	UK GILT BOND 4.25% 27/12/07	1,050,000.00	1,087,002.00	
	UK GILT BOND 4.25% 32/06/07	1,300,000.00	1,373,333.00	
	UK GILT BOND 4.25% 36/03/07	850,000.00	887,748.50	
	UK GILT BOND 4.25% 39/09/07	430,000.00	444,764.82	
	UK GILT BOND 4.25% 40/12/07	1,280,000.00	1,323,776.00	
	UK GILT BOND 4.25% 46/12/07	900,000.00	929,790.00	
	UK GILT BOND 4.25% 49/12/07	650,000.00	676,286.00	
	UK GILT BOND 4.25% 55/12/07	850,000.00	902,038.70	
	UK GILT BOND 4.5% 34/09/07	1,000,000.00	1,074,838.40	
	UK GILT BOND 4.5% 42/12/07	1,220,000.00	1,306,010.48	
	UK GILT BOND 4.75% 30/12/07	800,000.00	869,392.96	
	UK GILT BOND 4.75% 38/12/07	600,000.00	657,756.00	
UK GILT BOND 5.0% 25/03/07	1,720,000.00	1,769,304.14		
UK GILT BOND 6.0% 28/12/07	1,050,000.00	1,185,970.80		
	イギリス・ポンド小計	31,740,000.00	29,478,657.88 (4,764,045,900)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 1.88% 50/03/01	300,000.00	246,243.63	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 1.88% 51/10/01	190,000.00	158,476.15	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.0% 24/02/01	60,000.00	59,191.41	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.38% 25/06/01	1,280,000.00	1,255,523.23	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.38% 39/07/01	240,000.00	213,941.36	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 42/04/01	350,000.00	334,752.25	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 46/03/01	200,000.00	192,526.66	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.88% 30/09/01	800,000.00	780,551.54	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.0% 72/08/01	10,000.00	10,682.09	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.38% 33/09/01	350,000.00	354,150.47	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.5% 27/03/01	840,000.00	850,247.89	

	シンガポール・ドル小計	4,620,000.00	4,456,286.68 (448,079,626)
マレーシ ア・リン ギット	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.48% 24/06/14	1,900,000.00	1,906,308.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 27/05/31	1,000,000.00	993,150.44
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.76% 40/05/22	200,000.00	187,231.88
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.9% 26/11/30	2,500,000.00	2,530,005.80
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.96% 25/09/15	5,000,000.00	5,053,502.80
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.07% 50/06/15	2,750,000.00	2,595,900.36
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 30/04/15	900,000.00	940,398.53
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.74% 46/03/15	1,550,000.00	1,632,441.27
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.92% 48/07/06	450,000.00	482,103.15
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.94% 43/09/30	1,500,000.00	1,614,644.64
	マレーシア・リングgit小計	17,750,000.00	17,935,686.87 (544,760,616)
ニュージ ーラン ド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	850,000.00	817,570.10
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	800,000.00	649,474.15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	800,000.00	659,620.58
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	290,000.00	188,856.07
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	170,000.00	123,669.74
	ニュージーランド・ドル小計	2,910,000.00	2,439,190.64 (204,257,823)
スウェー デン・ク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/05/12	4,200,000.00	3,851,925.00
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 0.75% 29/11/12	3,000,000.00	2,695,982.43
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 1.0% 26/11/12	3,000,000.00	2,833,212.75
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 2.5% 25/05/12	2,850,000.00	2,828,389.78
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.5% 39/03/30	2,800,000.00	3,207,249.77
	スウェーデン・クローナ小計	15,850,000.00	15,416,759.73 (197,951,195)
ノルウェ ー・クロ ーネ	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.38% 30/08/19	2,200,000.00	1,931,979.28
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 26/02/19	3,200,000.00	3,037,942.40
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 27/02/17	3,500,000.00	3,308,270.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 29/09/06	3,200,000.00	2,924,800.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 2.13% 32/05/18	1,300,000.00	1,185,128.10
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 24/03/14	2,400,000.00	2,388,200.01
	ノルウェー・クローネ小計	15,800,000.00	14,776,319.79 (192,683,209)
デンマー ク・クロ ーネ	DANISH GOVERNMENT BOND 0.25% 52/11/15	2,530,000.00	1,369,333.15
	DANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 27/11/15	4,000,000.00	3,622,036.00
	DANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/11/15	3,900,000.00	3,393,648.96
	DANISH GOVERNMENT BOND 1.75% 25/11/15	3,500,000.00	3,401,365.45
	DANISH GOVERNMENT BOND 4.5% 39/11/15	4,100,000.00	5,119,281.32
	デンマーク・クローネ小計	18,030,000.00	16,905,664.88 (325,941,219)
メキシ コ・ペソ	MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 24/12/05	18,000,000.00	17,852,641.92
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 36/11/20	7,200,000.00	7,785,792.00
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.5% 27/06/03	22,000,000.00	20,521,600.00
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 31/05/29	13,000,000.00	12,069,980.00
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 34/11/23	7,500,000.00	6,843,525.00
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 42/11/13	8,500,000.00	7,436,565.00
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 23/12/07	15,000,000.00	14,610,357.75
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 47/11/07	9,100,000.00	8,169,616.00
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 53/07/31	2,500,000.00	2,243,733.60
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 29/05/31	12,000,000.00	11,676,720.00
	メキシコ・ペソ小計	123,800,000.00	117,762,781.27 (861,788,032)
イスラエ ル・シェ ケル	ISRAEL FIXED BOND	800,000.00	786,960.00
	ISRAEL FIXED BOND	1,800,000.00	1,721,430.00
	ISRAEL FIXED BOND	1,800,000.00	1,710,810.00
	ISRAEL FIXED BOND	1,700,000.00	1,595,450.00
	ISRAEL FIXED BOND	680,000.00	573,614.00

	ISRAEL FIXED BOND	890,000.00	1,104,178.50	
	ISRAEL FIXED BOND	1,180,000.00	1,219,589.00	
	イスラエル・シェケル小計	8,850,000.00	8,712,031.50 (330,566,710)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 1.25% 30/10/25	2,900,000.00	2,017,849.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 1.75% 32/04/25	1,000,000.00	684,200.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5% 24/04/25	3,000,000.00	2,879,850.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5% 26/07/25	3,000,000.00	2,641,521.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25% 25/07/25	2,900,000.00	2,699,987.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 29/04/25	3,400,000.00	3,300,210.00	
	ポーランド・ズロチ小計	16,200,000.00	14,223,617.00 (428,954,418)	
中国・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	24,000,000.00	23,919,211.44	
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,800,000.00	11,747,737.56	
	CHINA GOVERNMENT BOND	13,000,000.00	12,901,858.19	
	CHINA GOVERNMENT BOND	39,100,000.00	39,211,536.66	
	CHINA GOVERNMENT BOND	21,000,000.00	20,776,872.06	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,000,000.00	11,905,854.84	
	CHINA GOVERNMENT BOND	40,000,000.00	40,312,000.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,700,000.00	20,965,548.29	
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,800,000.00	20,821,985.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,200,000.00	6,789,677.96	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,700,000.00	8,006,028.56	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,100,000.00	7,173,046.42	
	中国・人民元小計	223,400,000.00	224,531,357.58 (4,392,462,041)	
ユーロ	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.0% 30/02/20	950,000.00	776,010.35	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.0% 31/02/20	550,000.00	435,569.75	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.0% 40/10/20	250,000.00	144,117.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.5% 29/02/20	500,000.00	434,947.50	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 26/10/20	800,000.00	742,936.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 28/02/20	750,000.00	678,090.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 51/03/20	390,000.00	225,259.71	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.85% 20/06/30	130,000.00	53,095.64	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.2% 25/10/20	750,000.00	719,665.50	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.5% 47/02/20	405,000.00	297,932.17	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.5% 86/11/02	150,000.00	90,407.85	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.65% 24/10/21	550,000.00	538,720.60	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.1% 17/09/20	210,000.00	153,271.23	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.4% 34/05/23	300,000.00	280,927.20	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.15% 44/06/20	290,000.00	292,603.91	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.8% 62/01/26	220,000.00	255,883.98	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.15% 37/03/15	800,000.00	891,548.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.85% 26/03/15	450,000.00	477,694.46	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 6.25% 27/07/15	700,000.00	797,226.50	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.1% 30/06/22	400,000.00	328,225.60	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.35% 32/06/22	200,000.00	157,011.60	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.4% 40/06/22	280,000.00	173,470.36	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.65% 71/06/22	280,000.00	114,866.92	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 25/06/22	1,200,000.00	1,144,892.40	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 27/06/22	300,000.00	276,017.40	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 28/06/22	550,000.00	497,021.80	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.9% 29/06/22	750,000.00	668,007.75	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.0% 31/06/22	900,000.00	773,413.65	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.25% 33/04/22	450,000.00	380,482.30	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.45% 37/06/22	300,000.00	239,140.50	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.6% 47/06/22	550,000.00	392,579.55	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.7% 50/06/22	450,000.00	320,031.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.9% 38/06/22	300,000.00	251,046.90		
BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.15% 66/06/22	200,000.00	152,006.00		
BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.25% 57/06/22	470,000.00	370,937.16		

BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.6% 24/06/22	620,000.00	616,380.44	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.0% 34/06/22	450,000.00	443,472.30	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.75% 45/06/22	440,000.00	467,800.96	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 32/03/28	1,250,000.00	1,347,027.50	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 41/03/28	640,000.00	720,531.20	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/28	1,000,000.00	1,050,401.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.0% 35/03/28	900,000.00	1,062,683.10	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.5% 28/03/28	850,000.00	958,627.45	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.0% 24/09/15	470,000.00	449,900.92	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.0% 30/09/15	200,000.00	160,890.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.13% 31/09/15	230,000.00	181,723.46	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.13% 36/04/15	280,000.00	191,049.34	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.13% 52/04/15	215,000.00	99,787.73	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.25% 40/09/15	150,000.00	92,419.50	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 26/04/15	480,000.00	448,628.16	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 27/09/15	120,000.00	108,325.24	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 28/09/15	150,000.00	131,836.95	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/09/15	220,000.00	189,165.68	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.75% 31/04/15	180,000.00	151,815.38	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.13% 34/04/15	300,000.00	245,524.80	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.38% 47/04/15	230,000.00	168,683.80	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.63% 42/07/04	235,000.00	220,833.02	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.75% 28/07/04	200,000.00	199,340.64	
FINNISH GOVERNMENT BOND 4.0% 25/07/04	450,000.00	463,491.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 24/03/25	900,000.00	871,492.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 29/11/25	1,400,000.00	1,163,281.93	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 30/11/25	1,800,000.00	1,452,669.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 31/11/25	1,600,000.00	1,251,340.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 32/05/25	2,100,000.00	1,614,091.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.25% 26/11/25	2,400,000.00	2,183,973.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 25/05/25	3,500,000.00	3,317,720.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 26/05/25	2,800,000.00	2,599,749.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/05/25	2,200,000.00	1,915,465.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 40/05/25	1,100,000.00	710,528.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 72/05/25	150,000.00	57,490.86	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/05/25	2,500,000.00	2,253,787.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/11/25	2,300,000.00	2,053,449.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 53/05/25	380,000.00	202,567.93	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 25/11/25	1,750,000.00	1,665,687.62	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 27/05/25	1,250,000.00	1,161,580.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.25% 34/05/25	1,500,000.00	1,249,101.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.25% 36/05/25	1,800,000.00	1,438,837.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.5% 31/05/25	2,200,000.00	1,994,282.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.5% 50/05/25	1,700,000.00	1,183,735.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 24/11/25	2,800,000.00	2,742,642.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 39/06/25	1,200,000.00	992,212.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 66/05/25	850,000.00	583,429.15	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.0% 48/05/25	1,200,000.00	953,474.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.25% 24/05/25	2,400,000.00	2,377,428.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.5% 30/05/25	2,100,000.00	2,063,533.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.75% 27/10/25	2,600,000.00	2,596,528.35	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.25% 45/05/25	1,500,000.00	1,510,578.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.5% 26/04/25	2,100,000.00	2,142,489.30	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 38/10/25	900,000.00	990,292.83	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 55/04/25	1,200,000.00	1,382,193.48	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 60/04/25	1,150,000.00	1,349,497.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.5% 41/04/25	1,400,000.00	1,644,648.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.75% 35/04/25	1,200,000.00	1,400,451.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.5% 29/04/25	1,700,000.00	1,957,369.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/10/25	1,600,000.00	1,982,195.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 6.0% 25/10/25	1,650,000.00	1,781,265.75	

GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 25/10/10	400,000.00	373,739.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 26/08/15	2,200,000.00	2,013,182.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 29/08/15	1,550,000.00	1,326,889.90	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 30/02/15	1,000,000.00	846,303.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 30/08/15	900,000.00	754,889.40	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 31/02/15	900,000.00	744,630.45	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 31/08/15	1,200,000.00	981,141.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 35/05/15	1,200,000.00	884,716.39	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 50/08/15	1,700,000.00	900,575.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 52/08/15	700,000.00	354,218.90	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 27/02/15	1,900,000.00	1,737,650.70	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 28/08/15	1,800,000.00	1,598,373.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 29/02/15	1,800,000.00	1,582,844.40	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 25/02/15	2,400,000.00	2,294,542.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 26/02/15	2,000,000.00	1,878,470.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 27/08/15	2,050,000.00	1,878,490.85	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.0% 24/08/15	3,150,000.00	3,064,203.45	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.0% 25/08/15	3,250,000.00	3,114,744.75	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.25% 48/08/15	1,150,000.00	905,262.75	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 24/05/15	750,000.00	737,300.45	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.7% 32/08/15	1,850,000.00	1,737,980.65	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.8% 53/08/15	250,000.00	217,434.25	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 44/07/04	1,100,000.00	1,108,478.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 46/08/15	1,150,000.00	1,167,860.65	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 42/07/04	950,000.00	1,058,383.74	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/04	1,380,000.00	1,617,546.99	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.25% 39/07/04	700,000.00	862,734.95	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/07/04	1,400,000.00	1,558,933.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 34/07/04	1,200,000.00	1,469,976.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 40/07/04	850,000.00	1,114,765.65	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.5% 31/01/04	1,100,000.00	1,339,085.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.63% 28/01/04	1,300,000.00	1,484,693.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.25% 30/01/04	850,000.00	1,053,312.77	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.5% 27/07/04	1,200,000.00	1,393,912.80	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.0% 31/10/18	100,000.00	78,073.70	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.35% 32/10/18	100,000.00	78,695.10	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.4% 35/05/15	300,000.00	219,180.60	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.55% 41/04/22	70,000.00	44,503.76	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.9% 28/05/15	520,000.00	473,597.80	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.0% 26/05/15	800,000.00	757,986.80	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.1% 29/05/15	500,000.00	451,872.50	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.3% 33/05/15	190,000.00	161,667.39	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.35% 31/03/18	500,000.00	447,110.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.5% 50/05/15	480,000.00	333,950.40	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.7% 37/05/15	240,000.00	200,251.44	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.0% 45/02/18	320,000.00	258,087.68	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.4% 30/05/15	400,000.00	389,787.20	
IRISH GOVERNMENT BOND 5.4% 25/03/13	450,000.00	472,869.49	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.35% 25/02/01	1,850,000.00	1,746,021.67	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.6% 31/08/01	1,430,000.00	1,084,629.26	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.9% 31/04/01	2,000,000.00	1,578,499.07	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 26/12/01	2,700,000.00	2,485,080.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.35% 30/04/01	1,000,000.00	844,155.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 25/06/01	2,350,000.00	2,255,130.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.6% 26/06/01	2,600,000.00	2,449,249.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.65% 30/12/01	1,000,000.00	846,495.18	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.65% 32/03/01	2,250,000.00	1,846,710.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.7% 51/09/01	720,000.00	421,607.22	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.8% 41/03/01	1,070,000.00	732,094.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.85% 24/05/15	2,250,000.00	2,210,604.75	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 25/12/01	2,000,000.00	1,924,900.00	

ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 28/02/01	2,500,000.00	2,316,505.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.05% 27/08/01	1,000,000.00	937,100.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.2% 27/06/01	1,200,000.00	1,135,680.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 36/09/01	1,200,000.00	951,970.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.45% 33/09/01	1,000,000.00	849,010.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.45% 50/09/01	800,000.00	561,652.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.7% 47/03/01	500,000.00	379,803.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.8% 28/12/01	1,300,000.00	1,239,437.62	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.8% 67/03/01	600,000.00	418,166.10	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.95% 38/09/01	900,000.00	760,005.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 29/08/01	1,500,000.00	1,433,365.30	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 46/09/01	700,000.00	587,269.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.35% 35/03/01	700,000.00	634,865.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.45% 48/03/01	800,000.00	691,520.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 30/03/01	1,100,000.00	1,077,560.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 24/09/01	1,800,000.00	1,810,168.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.85% 49/09/01	750,000.00	687,012.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/02/01	1,350,000.00	1,309,203.06	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 24/03/01	300,000.00	303,508.12	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/01	1,500,000.00	1,543,222.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/09/01	2,100,000.00	2,209,966.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 44/09/01	650,000.00	679,462.86	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 25/03/01	1,200,000.00	1,237,680.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 34/08/01	1,000,000.00	1,060,347.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 39/08/01	1,000,000.00	1,070,084.46	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 40/09/01	1,050,000.00	1,127,205.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.25% 29/11/01	1,800,000.00	1,962,640.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/02/01	800,000.00	897,885.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 6.0% 31/05/01	800,000.00	916,201.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 7.25% 26/11/01	900,000.00	1,017,513.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 30/07/15	500,000.00	411,437.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 31/07/15	900,000.00	720,568.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 38/01/15	400,000.00	264,987.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 52/01/15	600,000.00	293,087.76	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.25% 25/07/15	900,000.00	847,105.92	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.25% 29/07/15	450,000.00	387,214.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.5% 26/07/15	1,250,000.00	1,160,537.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.5% 40/01/15	470,000.00	328,502.74	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.75% 27/07/15	700,000.00	644,955.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.75% 28/07/15	800,000.00	724,009.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.0% 24/07/15	600,000.00	591,971.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.0% 54/01/15	170,000.00	148,049.13	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.5% 33/01/15	900,000.00	881,820.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.75% 47/01/15	730,000.00	742,845.81	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.75% 42/01/15	750,000.00	858,186.22	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/15	600,000.00	682,375.80	

	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 5.5% 28/01/15	700,000.00	789,446.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 0.1% 31/04/30	1,500,000.00	1,161,808.50	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 30/04/30	1,150,000.00	953,072.85	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 0.6% 29/10/31	1,000,000.00	847,044.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 0.7% 32/04/30	2,200,000.00	1,742,758.60	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.0% 42/07/30	380,000.00	236,664.38	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.0% 50/10/31	820,000.00	436,607.36	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.3% 26/10/31	1,000,000.00	940,342.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.4% 28/04/30	800,000.00	734,348.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.4% 28/07/30	1,000,000.00	914,659.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 27/10/31	1,500,000.00	1,392,942.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 29/04/30	1,000,000.00	904,620.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 71/10/31	250,000.00	119,711.25	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.5% 27/04/30	1,700,000.00	1,596,922.20	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.6% 25/04/30	1,350,000.00	1,309,196.25	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.85% 35/07/30	950,000.00	785,170.25	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.9% 52/10/31	500,000.00	328,337.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.95% 30/07/30	1,200,000.00	1,099,002.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 2.15% 25/10/31	1,550,000.00	1,515,762.05	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 2.35% 33/07/30	1,200,000.00	1,084,334.40	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 2.7% 48/10/31	720,000.00	594,431.93	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 2.75% 24/10/31	2,100,000.00	2,091,112.80	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 2.9% 46/10/31	750,000.00	652,167.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 3.45% 66/07/30	500,000.00	454,702.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 3.8% 24/04/30	1,000,000.00	1,009,060.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.2% 37/01/31	1,100,000.00	1,163,003.60	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.65% 25/07/30	1,600,000.00	1,659,140.80	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.7% 41/07/30	900,000.00	1,012,414.41	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.8% 24/01/31	600,000.00	609,771.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.9% 40/07/30	900,000.00	1,031,614.20	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15% 28/10/31	1,100,000.00	1,211,763.30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15% 44/10/31	550,000.00	662,796.20	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/07/30	900,000.00	1,075,808.70	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.9% 26/07/30	1,800,000.00	1,964,431.80	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 6.0% 29/01/31	1,100,000.00	1,268,128.40	
	ユーロ小計	246,225,000.00	230,283,299.99 (33,052,562,048)	
	国債証券合計		98,967,020,992 (98,967,020,992)	
	合 計		98,967,020,992 (98,967,020,992)	

(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。

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 151銘柄	100.0%	50.1%
カナダ・ドル	国債証券 18銘柄	100.0%	2.1%
オーストラリア・ドル	国債証券 19銘柄	100.0%	1.6%
イギリス・ポンド	国債証券 34銘柄	100.0%	4.8%
シンガポール・ドル	国債証券 11銘柄	100.0%	0.5%
マレーシア・リンギット	国債証券 10銘柄	100.0%	0.6%
ニュージーランド・ドル	国債証券 5銘柄	100.0%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%

メキシコ・ペソ	国債証券	11銘柄	100.0%	0.9%
イスラエル・シェケル	国債証券	7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券	6銘柄	100.0%	0.4%
中国・人民元	国債証券	12銘柄	100.0%	4.4%
ユーロ	国債証券	238銘柄	100.0%	33.4%

(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。

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月6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
業務執行社員

公認会計士 榎原 康太

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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2023年2月21日から2023年8月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、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2023年8月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年2月21日から2023年8月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められる

かどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

【中間財務諸表】

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) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 (2023年2月20日現在)	当中間計算期間末 (2023年8月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,572,657	35,144
コール・ローン	731,293,434	793,038,819
親投資信託受益証券	4,093,196,702	4,236,123,503
流動資産合計	4,826,062,793	5,029,197,466
資産合計	4,826,062,793	5,029,197,466
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	30,733,553	—
未払解約金	1,947	15,386,006
未払受託者報酬	1,342,033	1,342,365
未払委託者報酬	18,788,444	18,793,102
未払利息	1,956	6,379
その他未払費用	268,638	269,731
流動負債合計	51,136,571	35,797,583
負債合計	51,136,571	35,797,583
純資産の部		
元本等		
元本	3,841,694,195	3,838,256,880
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	933,232,027	1,155,143,003
（分配準備積立金）	255,741,063	252,443,412
元本等合計	4,774,926,222	4,993,399,883
純資産合計	4,774,926,222	4,993,399,883
負債純資産合計	4,826,062,793	5,029,197,466

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 2022年2月22日 至 2022年8月21日	当中間計算期間 自 2023年2月21日 至 2023年8月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	150,398,101	243,826,801
営業収益合計	150,398,101	243,826,801
営業費用		
支払利息	359,854	351,818
受託者報酬	1,340,955	1,342,365
委託者報酬	18,773,173	18,793,102
その他費用	273,927	274,414
営業費用合計	20,747,909	20,761,699
営業利益又は営業損失(△)	129,650,192	223,065,102
経常利益又は経常損失(△)	129,650,192	223,065,102
中間純利益又は中間純損失(△)	129,650,192	223,065,102
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	207,103	1,614,729
期首剰余金又は期首欠損金(△)	1,005,448,944	933,232,027
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,395,735	12,656,242
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	9,395,735	12,656,242
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,095,814	12,195,639
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	5,095,814	12,195,639
中間剰余金又は中間欠損金(△)	1,139,191,954	1,155,143,003

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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。
-------------------	--

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末 (2023年2月20日現在)	当中間計算期間末 (2023年8月20日現在)
1 期首元本額	3,830,185,356円	3,841,694,195円
期中追加設定元本額	50,649,746円	46,832,882円
期中一部解約元本額	39,140,907円	50,270,197円
2 受益権の総数	3,841,694,195口	3,838,256,880口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当する事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	前計算期間末 (2023年2月20日現在)	当中間計算期間末 (2023年8月20日現在)
1 中間貸借対照表計上額、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。	中間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。
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 該当する事項はありません。	(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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場	同左

合、当該価額が異なることもありません。

(有価証券関係に関する注記)

該当する事項はありません。

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	前計算期間末 (2023年2月20日現在)	当中間計算期間末 (2023年8月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2429円 (12,429円)	1.3010円 (13,010円)

<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、中間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	(2023年2月20日現在)	(2023年8月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		2,716,528	14,543
コール・ローン		1,263,199,054	956,785,738
株式		52,071,981,740	53,088,933,407
派生商品評価勘定		11,415,120	35,520
未収入金		166,180	—
未収配当金		94,775,972	75,787,989
前払金		—	22,477,500
差入委託証拠金		55,890,000	34,582,500
流動資産合計		53,500,144,594	54,178,617,197
資産合計		53,500,144,594	54,178,617,197
負債の部			
流動負債			
前受金		4,392,500	—
派生商品評価勘定		—	22,546,020
未払解約金		33,915,000	—
未払利息		3,378	2,566
その他未払費用		493	1,778
流動負債合計		38,311,371	22,550,364
負債合計		38,311,371	22,550,364
純資産の部			
元本等			
元本	1	14,752,340,035	13,169,712,504
剰余金			
剰余金又は欠損金(△)		38,709,493,188	40,986,354,329
元本等合計		53,461,833,223	54,156,066,833
純資産合計		53,461,833,223	54,156,066,833
負債純資産合計		53,500,144,594	54,178,617,197

(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	(2023年2月20日現在)	(2023年8月20日現在)
1 期首元本額	25,294,590,585円	14,752,340,035円
期中追加設定元本額	1,753,907,266円	771,877,701円
期中一部解約元本額	12,296,157,816円	2,354,505,232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）	68,981,331円	60,246,870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＞	710,778,676円	668,187,324円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	2,911,390円	2,620,042円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	23,988,398円	17,777,906円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	95,561円	87,650円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	2,369,752円	840,696円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	4,168,214円	3,220,530円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	4,061,655,987円	3,586,543,496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＞	293,758,056円	262,304,489円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	2,111,954円	1,967,787円

バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	529,744,420円	444,454,913円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	439,072,406円	381,991,304円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	31,673,865円	23,904,655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>	73,118,849円	71,405,159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>	76,780,705円	74,869,125円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	95,893,393円	76,798,613円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	1,452,987,603円	1,252,280,086円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	198,988,819円	154,716,576円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	954,113,869円	805,878,731円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	32,221,168円	26,971,826円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	10,627,900円	8,447,938円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	14,305,109円	12,691,126円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	5,287,440円	4,269,364円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	341,221,323円	293,775,685円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	1,210,294円	1,014,709円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	2,213,592円	1,999,019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>	41,848,936円	57,649,996円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	203,449,609円	170,462,534円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	890,829,665円	751,029,841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>	68,530,913円	60,848,258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>	430,650,499円	395,622,534円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド(ステイブル)<適格機関投資家限定>	45,838,046円	58,642,120円
ステート・ストリート日本株式インデックス・オープン	3,320,174,162円	3,174,743,019円
世界バランス40VA<適格機関投資家限定>	2,834,577円	2,368,677円

世界バランス 60VA<適格機関投資家限定>	3,825,689円	1,670,937円
グローバルバランス 40VA<適格機関投資家限定>	200,823円	117,137円
グローバルバランス 40VA 2<適格機関投資家限定>	299,633,386円	246,169,490円
グローバルバランス 40VA 3<適格機関投資家限定>	10,512,704円	7,764,170円
グローバルバランス 50VA<適格機関投資家限定>	3,730,952円	3,358,172円
計	14,752,340,035円	13,169,712,504円
2 受益権の総数	14,752,340,035口	13,169,712,504口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2023年2月20日現在)	(2023年8月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありませ ん。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(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	同左

	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)

該当する事項はありません。

(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	(2023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)	1,347,860,000	—	1,359,320,000	11,460,000
	合 計	1,347,860,000	—	1,359,320,000	11,460,000

(単位：円)

区 分	種 類	(2023年8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)	1,140,977,500	—	1,118,500,000	△22,477,500
	合 計	1,140,977,500	—	1,118,500,000	△22,477,500

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	(2023年2月20日現在)	(2023年8月20日現在)
1口当たり純資産額	3.6240円	4.1122円
(1万口当たり純資産額)	(36,240円)	(41,122円)

「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	(2023年2月20日現在)	(2023年8月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		1,029,969	478,789
コール・ローン		140,858,383	309,104,079
国債証券		140,386,338,900	115,474,268,400
地方債証券		9,935,478,787	7,901,406,818
特殊債券		12,329,223,538	9,436,604,240
社債券		7,624,656,700	6,516,765,700
未収利息		390,721,831	337,276,589
前払費用		4,727,609	9,513,313
流動資産合計		170,813,035,717	139,985,417,928
資産合計		170,813,035,717	139,985,417,928
負債の部			
流動負債			
未払解約金		25,235,916	4,716,229
未払利息		376	828
その他未払費用		646	977
流動負債合計		25,236,938	4,718,034
負債合計		25,236,938	4,718,034
純資産の部			
元本等			
元本	1	139,970,293,356	114,213,018,696
剰余金			
剰余金又は欠損金(△)		30,817,505,423	25,767,681,198
元本等合計		170,787,798,779	139,980,699,894
純資産合計		170,787,798,779	139,980,699,894
負債純資産合計		170,813,035,717	139,985,417,928

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(2023年2月20日現在)	(2023年8月20日現在)
1 期首元本額	142,408,879,533円	139,970,293,356円
期中追加設定元本額	12,527,561,921円	6,083,634,248円
期中一部解約元本額	14,966,148,098円	31,840,908,908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）	1,164,208,743円	1,208,128,068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＞	3,880,671,890円	3,925,354,550円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	20,756,181円	21,614,659円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	158,848,419円	137,416,799円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	501,257円	526,917円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	10,060,868円	4,141,402円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	16,002,289円	14,707,342円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	11,663,119,305円	11,873,147,840円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	6,059,994円	6,441,229円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	4,160,935,398円	4,024,037,604円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	1,907,390,852円	1,932,497,354円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	12,917,978円	11,764,243円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	1,125,244,883円	1,039,519,625円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	6,305,197,688円	6,339,030,192円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	1,347,912,026円	1,228,664,035円

バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	4,883,052,281円	4,757,489,256円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	139,027,117円	136,238,445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>	84,694,304円	82,375,333円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	60,740,056円	55,744,316円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	40,658,164円	42,057,442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>	21,845,079,042円	25,002,841,879円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	46,549,248円	43,676,870円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	3,297,609,591円	3,305,777,321円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	15,010,274円	14,837,989円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	12,663,406円	13,171,627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>	259,120,757円	413,725,039円
日本債券インデックス・ファンド<適格機関投資家限定>	714,552,790円	699,825,957円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	2,367,985,908円	2,314,377,622円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	8,589,297,655円	8,362,586,231円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	14,162,034円	14,841,859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>	321,228,379円	338,801,723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>	1,100,556,491円	1,088,696,285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>	214,965,344円	326,686,368円
ステート・ストリート日本債券インデックス・オープン	3,243,408,716円	2,772,963,427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>	57,331,301,564円	29,156,230,561円
世界バランス40VA<適格機関投資家限定>	19,787,946円	19,813,404円
世界バランス60VA<適格機関投資家限定>	16,872,994円	8,618,325円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	1,392,721円	991,876円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	3,462,057,948円	3,374,770,106円

グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	77,575,032円	65,566,584円
グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	31,115,823円	33,320,992円
計	139,970,293,356円	114,213,018,696円
2 受益権の総数	139,970,293,356口	114,213,018,696口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2023年2月20日現在)	(2023年8月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありませ ん。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(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 該当する事項はありません。	(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)

該当する事項はありません。

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	(2023年2月20日現在)	(2023年8月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2202円 (12,202円)	1.2256円 (12,256円)

「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	(2023年2月20日現在)	(2023年8月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		4,748,045,867	3,273,868,373
金銭信託		8,390,656	42,697
コール・ローン		3,901,696,407	2,808,992,370
株式		197,187,704,503	225,180,784,951
投資証券		4,608,256,742	4,602,727,386
派生商品評価勘定		457,879,306	49,724,787
未収入金		21,956,109	36,302,040
未収配当金		232,055,540	332,021,090
差入委託証拠金		1,257,017,904	769,175,573
流動資産合計		212,423,003,034	237,053,639,267
資産合計		212,423,003,034	237,053,639,267
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		10,932,262	69,536,094
未払解約金		198,094,000	54,110,000
未払利息		10,436	7,533
その他未払費用		1,689	4,724
流動負債合計		209,038,387	123,658,351
負債合計		209,038,387	123,658,351
純資産の部			
元本等			
元本	1	45,434,848,844	44,353,216,141
剰余金			
剰余金又は欠損金 (△)		166,779,115,803	192,576,764,775
元本等合計		212,213,964,647	236,929,980,916
純資産合計		212,213,964,647	236,929,980,916
負債純資産合計		212,423,003,034	237,053,639,267

(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	先物取引 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。 為替予約取引 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。
3 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。
4 その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 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。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(2023年2月20日現在)	(2023年8月20日現在)
1 期首元本額	47,184,065,744円	45,434,848,844円
期中追加設定元本額	5,183,763,132円	1,445,342,000円
期中一部解約元本額	6,932,980,032円	2,526,974,703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	5,144,133,854円	5,071,723,438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	6,286,284,543円	6,172,721,716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	81,163,684円	87,941,828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)	53,544,059円	47,329,431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)	73,047,510円	68,743,365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)	24,203,309円	18,127,276円
バランスファンドVA30A<適格機関投資家限定>	1,133,923円	1,025,935円
バランスファンドVA30B<適格機関投資家限定>	19,217,219円	13,993,761円
バランスファンドVA40A<適格機関投資家限定>	44,957円	41,575円
バランスファンドVA40B<適格機関投資家限定>	1,863,710円	673,645円
バランスファンドVA50A<適格機関投資家限定>	2,221,353円	1,690,543円
バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	3,168,663,038円	2,786,287,662円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	720,976円	680,467円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	273,504,384円	228,787,930円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	299,920,621円	260,401,664円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	28,280,249円	21,458,297円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	74,746,045円	60,092,699円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	1,142,808,320円	969,022,376円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	155,096,945円	120,854,374円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	555,875,883円	470,351,225円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	25,048,283円	20,959,869円

グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	16,841,652円	13,202,535円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	22,751,598円	19,858,031円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	8,287,055円	6,622,422円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	113,172,139円	97,657,402円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	310,551円	261,453円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	693,530円	644,028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>	178,075,657円	235,261,657円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	105,834,281円	88,417,987円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	17,803,847円	16,863,093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>	18,153,238円	15,945,570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>	11,926,274円	15,356,427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	317,795,282円	260,253,927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）	2,648,273,659円	2,426,075,096円
全世界株式インデックス・ファンド	1,976,640,969円	2,293,798,234円
世界バランス40VA<適格機関投資家限定>	6,566,440円	5,564,026円
世界バランス60VA<適格機関投資家限定>	15,282,464円	6,564,633円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	462,508円	269,473円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	705,426,207円	571,689,966円
グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	24,812,496円	18,019,042円
グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	11,431,915円	10,417,007円
ワールドエクイティ・ファンドVL<適格機関投資家限定>	21,822,784,217円	21,827,565,056円
計	45,434,848,844円	44,353,216,141円
2 受益権の総数	45,434,848,844口	44,353,216,141口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2023年2月20日現在)	(2023年8月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありませ ん。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(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)

該当する事項はありません。

(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	(2023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	7,321,630,697	—	7,556,510,132	234,879,435
	S&P 60	433,536,909	—	443,689,632	10,152,723
	SPI 200	361,668,148	—	369,384,629	7,716,481
	FTSE100INDEX	449,605,329	—	476,212,950	26,607,621
	FSMI INDEX	350,516,404	—	356,784,962	6,268,558
	EURO STOXX 50	1,123,842,764	—	1,216,330,632	92,487,868
合 計	10,040,800,251	—	10,418,912,937	378,112,686	

(単位：円)

区 分	種 類	(2023年8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	5,256,950,928	—	5,270,640,323	13,689,395
	S&P 60	310,658,417	—	306,567,330	△4,091,087
	SPI 200	199,559,030	—	198,993,464	△565,566
	FTSE100INDEX	338,859,448	—	326,432,962	△12,426,486
	FSMI INDEX	242,683,929	—	234,942,828	△7,741,101
	EURO STOXX 50	732,639,080	—	712,868,388	△19,770,692
合 計	7,081,350,832	—	7,050,445,295	△30,905,537	

(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	(2023年2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	3,421,595,060	—	3,487,174,600	65,579,540
	カナダ・ドル	148,299,818	—	150,122,086	1,822,268
	オーストラリア・ド ル	89,317,102	—	90,313,272	996,170
	イギリス・ポンド	190,356,840	—	193,523,160	3,166,320
	ユーロ	332,828,496	—	335,424,024	2,595,528
	売建				
	アメリカ・ドル	421,661,860	—	426,622,867	△4,961,007
	カナダ・ドル	8,950,410	—	8,947,674	2,736
	オーストラリア・ド ル	16,472,852	—	16,588,152	△115,300
	香港・ドル	8,553,000	—	8,569,300	△16,300
	ユーロ	52,854,335	—	53,089,932	△235,597
	合 計	4,690,889,773	—	4,770,375,067	68,834,358

(単位：円)

区 分	種 類	(2023年8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	2,242,599,239	—	2,252,820,625	10,221,386
	カナダ・ドル	93,426,168	—	93,266,175	△159,993
	オーストラリア・ド ル	47,763,642	—	47,514,813	△248,829
	イギリス・ポンド	111,705,762	—	112,913,318	1,207,556
	ユーロ	275,118,186	—	275,198,400	80,214
	売建				
	イギリス・ポンド	14,856,800	—	14,862,904	△6,104
合 計	2,785,469,797	—	2,796,576,235	11,094,230	

(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。
- ① 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。
 - ② 為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
- (2) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

- (3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
 3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
 4. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(2023年2月20日現在)	(2023年8月20日現在)
1口当たり純資産額	4.6707円	5.3419円
(1万口当たり純資産額)	(46,707円)	(53,419円)

「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	(2023年2月20日現在)	(2023年8月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		331,423,291	336,586,621
金銭信託		58,881	153
コール・ローン		27,379,779	10,060,308
国債証券		98,967,020,992	101,814,873,183
派生商品評価勘定		—	451,200
未収入金		—	174,205,984
未収利息		693,324,926	635,445,414
前払費用		43,024,725	37,554,760
流動資産合計		100,062,232,594	103,009,177,623
資産合計		100,062,232,594	103,009,177,623
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		98,765	107,260
未払金		—	15,386,988
未払解約金		55,948,622	62,756,746
未払利息		73	26
その他未払費用		18	217
流動負債合計		56,047,478	78,251,237
負債合計		56,047,478	78,251,237
純資産の部			
元本等			
元本	1	39,505,032,684	37,649,683,035
剰余金			
剰余金又は欠損金 (△)		60,501,152,432	65,281,243,351
元本等合計		100,006,185,116	102,930,926,386
純資産合計		100,006,185,116	102,930,926,386
負債純資産合計		100,062,232,594	103,009,177,623

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(2023年2月20日現在)	(2023年8月20日現在)
1 期首元本額	44,829,220,968円	39,505,032,684円
期中追加設定元本額	6,861,120,999円	2,072,489,336円
期中一部解約元本額	12,185,309,283円	3,927,838,985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	6,573,053,611円	6,552,669,168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	27,914,213円	30,660,055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)	858,207,630円	824,779,794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>	3,522,109,524円	3,470,377,298円
外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	731,180,349円	640,809,711円

バランスファンドVA30A<適格機関投資家限定>	3,965,865円	3,965,865円
バランスファンドVA30B<適格機関投資家限定>	77,880,401円	62,976,299円
バランスファンドVA40A<適格機関投資家限定>	79,545円	79,545円
バランスファンドVA40B<適格機関投資家限定>	4,841,917円	1,928,203円
バランスファンドVA50A<適格機関投資家限定>	1,950,052円	1,668,388円
バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	5,649,737,183円	5,518,384,563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>	73,245,212円	65,417,684円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	1,234,781円	1,255,596円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	1,770,620,355円	1,584,205,718円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	999,215,937円	955,205,315円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	25,180,532円	21,563,686円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	547,267,577円	476,542,754円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	3,057,943,620円	2,885,978,034円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	657,500,727円	557,899,056円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	2,036,207,903円	1,857,894,575円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	66,481,698円	62,393,478円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	74,087,159円	64,541,546円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	53,201,916円	52,109,705円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	30,342,970円	26,152,374円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	483,144,559円	450,445,463円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	1,653,331円	1,551,755円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	1,825,877円	1,825,877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>	505,687,107円	741,460,588円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	762,368,435円	699,428,250円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	1,261,385,716円	1,158,296,999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 >	410,575,814円	193,359,030円
4資産インデックスバランスVA50 <適格機関投資家限定>	27,738,807円	27,596,108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>	188,469,837円	185,183,944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>	214,783,410円	95,594,190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>	126,400,166円	178,458,790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	200,353,653円	260,250,117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）	5,805,670,470円	5,459,350,328円
世界国債タームスプレッド・プレミア 戦略ファンド/為替ヘッジ付き<適格機 関投資家限定>	1,746,137,311円	1,650,309,256円
世界バランス40VA<適格機関投資 家限定>	13,481,149円	12,758,153円
世界バランス60VA<適格機関投資 家限定>	13,639,600円	6,585,389円
グローバルバランス40VA<適格機 関投資家限定>	949,115円	620,932円
グローバルバランス40VA2<適格 機関投資家限定>	834,530,442円	754,919,084円
グローバルバランス40VA3<適格 機関投資家限定>	52,778,605円	42,118,533円
グローバルバランス50VA<適格機 関投資家限定>	10,008,603円	10,111,839円
計	39,505,032,684円	37,649,683,035円
2 受益権の総数	39,505,032,684口	37,649,683,035口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2023年2月20日現在)	(2023年8月20日現在)
1 貸借対照表計上 額、時価及びこれ らの差額	貸借対照表計上額は時価を計上し ているため、その差額はありませ ん。	同左
2 金融商品の時価の 算定方法	(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	(1)有価証券及びデリバティブ取引 以外の金融商品 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	<p>額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	<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> <p>同左</p>
---------------------------	---	---

(有価証券関係に関する注記)
 該当する事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)
 取引の時価等に関する事項
 通貨関連

(単位：円)

区 分	種 類	(2023年2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	46,949,635	—	47,048,400	△98,765
	合 計	46,949,635	—	47,048,400	△98,765

(単位：円)

区 分	種 類	(2023年8月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	145,965,000	—	145,629,050	335,950
	カナダ・ドル	21,500,000	—	21,515,500	△15,500
	オーストラリア・ドル	9,338,000	—	9,344,380	△6,380
	イギリス・ポンド	18,571,000	—	18,578,630	△7,630
	ユーロ	66,643,200	—	66,605,700	37,500
	合 計	262,017,200	—	261,673,260	343,940

(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。

① 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。

② 為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

4. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(2023年2月20日現在)	(2023年8月20日現在)
1口当たり純資産額	2.5315円	2.7339円
(1万口当たり純資産額)	(25,315円)	(27,339円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

(2023年8月31日現在)

I 資産総額	5,051,250,840円
II 負債総額	3,295,191円
III 純資産総額 (I - II)	5,047,955,649円
IV 発行済口数	3,839,729,255口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.3147円

<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)

(2023年8月31日現在)

I 資産総額	56,318,339,358円
II 負債総額	125,960,926円
III 純資産総額 (I - II)	56,192,378,432円
IV 発行済口数	13,107,072,910口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	4.2872円

<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)

(2023年8月31日現在)

I 資産総額	142,853,846,314円
II 負債総額	3,166,310,009円
III 純資産総額 (I - II)	139,687,536,305円
IV 発行済口数	114,141,758,537口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.2238円

<参考情報>

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)

(2023年8月31日現在)

I 資産総額	245,300,759,679円
II 負債総額	135,101,552円
III 純資産総額 (I - II)	245,165,658,127円
IV 発行済口数	44,339,814,887口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	5.5292円

<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)

(2023年8月31日現在)

I 資産総額	103,909,776,690円
II 負債総額	136,659,553円
III 純資産総額 (I - II)	103,773,117,137円
IV 発行済口数	37,350,533,132口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	2.7784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>

① 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。

② 上記①の申請のある場合には、上記①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①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。

③ 上記①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ます。）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）

① 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。

② 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。

③ 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。

④ 最近5年間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

① 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。

② 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。

2023年8月末現在、委託会社の運用する証券投資信託は、121本であり、その純資産総額は3,300,784百万円です（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。
2. 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、当事業年度（2022年4月1日から2023年3月31日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2023年6月22日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

取締役会 御中

EY 新日本 有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第26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2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査役の実務責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、監査役に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以 上

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

1. 財務諸表

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2022年3月31日現在)			当事業年度 (2023年3月31日現在)		
	金 額	構成比	%	金 額	構成比	%
(資産の部)			%			%
流動資産						
預金		4,391,110			4,944,755	
有価証券		23,294			24,319	
前払金		119,649			232,900	
前払費用		29,290			34,419	
未収入金		688,466			615,211	
未収委託者報酬		685,229			665,966	
未収収益		42,751			36,568	
流動資産計		5,979,793	75.8		6,554,141	80.5
固定資産						
有形固定資産		375			112	
建物附属設備	※1	0		0		
器具備品	※1	375		112		
無形固定資産		0			0	
ソフトウェア		0		0		
投資その他の資産		1,904,306			1,586,165	
長期差入保証金		71,694		42,548		
繰延税金資産		1,826,336		1,537,341		
その他投資		6,275		6,275		
固定資産計		1,904,682	24.2		1,586,278	19.5
資産合計		7,884,475	100.0		8,140,419	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2022年3月31日現在)			当事業年度 (2023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		172,682		211,213		
未払金		344,370		341,855		
未払手数料	177,539			180,016		
その他未払金	166,831			161,839		
未払費用		11,699		12,884		
未払法人税等		296,332		176,932		
未払消費税等		30,068		25,106		
賞与引当金		74,876		92,579		
流動負債計		930,030	11.8	860,572		10.6
固定負債						
退職給付引当金		84,840		76,260		
固定負債計		84,840	1.1	76,260		0.9
負債合計		1,014,871	12.9	936,833		11.5
(純資産の部)			%			%
株主資本		6,869,604	87.1	7,203,586		88.5
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	6,450,484			6,784,466		
純資産合計		6,869,604	87.1	7,203,586		88.5
負債・純資産合計		7,884,475	100.0	8,140,419		100.0

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

科 目	期 別	前事業年度		当事業年度	
		自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日		自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日	
		金 額	構成比	金 額	構成比
			%		%
営業収益					
委託者報酬		2,655,508		2,681,106	
投資顧問収入		3,030,659		2,805,885	
その他営業収益	※ 1	85,660		12,640	
営業収益計		5,771,828	100.0	5,499,631	100.0
営業費用					
支払手数料		711,649		753,876	
広告宣伝費		53,735		51,264	
公告費		1,140		1,140	
調査費		712,486		654,933	
調査費		407,466		337,268	
委託調査費		304,641		317,181	
図書費		378		483	
委託計算費		485,872		387,357	
営業雑経費		29,696		44,076	
通信費		3,997		6,765	
印刷費		7,276		14,575	
協会費		12,853		17,758	
諸会費		55		7	
その他		5,512		4,968	
営業費用計		1,994,579	34.6	1,892,648	34.4
一般管理費					
給料		1,568,661		1,475,040	
役員報酬		425,268		251,291	
給料・手当		787,766		816,610	
賞与		285,950		330,579	
賞与引当金繰入額		69,676		76,559	
交際費		1,607		3,676	
旅費交通費		676		10,847	
租税公課		32,240		3,770	
不動産賃借料		60,478		64,855	
退職給付費用		74,675		61,481	
固定資産減価償却費		2,571		765	
福利厚生費		130,238		139,590	
諸経費		186,753		192,029	
一般管理費計		2,057,903	35.7	1,952,057	35.5
営業利益		1,719,345	29.8	1,654,925	30.1
営業外収益					
移転価格調整金	※ 1、※ 2			131,841	
為替差益		18		1,707	
有価証券運用益		1,013		2,727	
雑収入		881		106	
営業外収益計		1,913	0.0	136,383	2.5
営業外費用					
移転価格調整金	※ 1	363,220		-	
為替差損		214		1,046	
有価証券運用損		1		-	
雑損失		329		73	
営業外費用計		363,766	6.3	1,119	0.0
経常利益		1,357,491	23.5	1,790,188	32.6
特別利益					

事業再構築費用戻入		7,084			—	
特別利益計		7,084	0.1		—	0.0
特別損失						
事務処理損失		146			4,303	
固定資産除却損		2,326			—	
特別損失計		2,472	0.0		4,303	0.1
税引前当期純利益		1,362,102	23.6		1,785,884	32.5
法人税, 住民税及び事業税		261,905	4.5		324,907	5.9
法人税等調整額		261,874	4.5		288,994	5.3
当期純利益		838,322	14.5		1,171,982	21.3

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位: 千円)

	株 主 資 本						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	株主資本 合計	
			その他利益 剰余金	繰越利益 剰余金			
		別途積立金					
当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,091,161	6,200,281	6,510,281	6,510,281
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	(479,000)	(479,000)	(479,000)	(479,000)
当期純利益	-	-	-	838,322	838,322	838,322	838,322
当期変動額合計	-	-	-	359,322	359,322	359,322	359,322
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,450,484	6,559,604	6,869,604	6,869,604

当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位: 千円)

	株 主 資 本						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	株主資本 合計	
			その他利益 剰余金	繰越利益 剰余金			
		別途積立金					
当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,450,484	6,559,604	6,869,604	6,869,604
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	(838,000)	(838,000)	(838,000)	(838,000)
当期純利益	-	-	-	1,171,982	1,171,982	1,171,982	1,171,982
当期変動額合計	-	-	-	333,982	333,982	333,982	333,982
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,784,466	6,893,586	7,203,586	7,203,586

[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	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 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

	<p>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、必要額を計上しております。</p> <p>① 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>② 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。</p>
5. 収益の計上方法	<p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託約款に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資信託約款毎に、日々の純資産総額に信託報酬率を乗じた金額で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問収入 投資顧問収入は、投資顧問契約に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資顧問契約毎に計算基礎額に投資顧問料率を乗じた金額で収益を認識しております。</p>
6. その他 財務諸表作成のための重要な事項	<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>

会計方針の変更

(時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。ただし、これによる具体的な会計方針の変更は無く、したがって、時価算定会計基準適用指針の適用にともなう当事業年度における貸借対照表、損益計算書および株主資本等変動計算書への影響は有りません。

会計上の見積りに関する注記

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

繰延税金資産 1,537,341千円

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

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

注記事項

(貸借対照表関係)

前事業年度 (2022年3月31日現在)	当事業年度 (2023年3月31日現在)
※1. 有形固定資産の減価償却累計額 器 具 備 品 30,399千円	※1. 有形固定資産の減価償却累計額 器 具 備 品 30,661千円
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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
※1. 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85,395千円は、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363,220千円は、損益計算書の営業外費用である移転価格調整金に含まれております。	※1. 移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた事務手数料調整額12,389千円は、損益計算書のその他営業収益に、移転価格調整額131,841千円は、損益計算書の営業外収益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。	※2. 関係会社に係る注記 関係会社との取引高 営業外収益 131,841千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 発行済株式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
2021年6月24日 定時株主総会	普通株式	479,000千円	77,258.06円	2021年3月31日	2021年6月25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
2022年6月27日 定時株主総会	普通株式	838,000千円	利益剰余金	135,161.29円	2022年3月31日	2022年6月28日

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式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
2022年6月27日 定時株主総会	普通株式	838,000千円	135,161.29円	2022年3月31日	2022年6月28日

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

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

2022年3月31日現在

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

2023年3月31日現在

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
有価証券	24,319	24,319	-
資産計	24,319	24,319	-

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

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

2022年3月31日現在

前項にて注記を省略しているため、記載を省略しております。

2023年3月31日現在

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券	-	24,319	-	24,319
資産計	-	24,319	-	24,319

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

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

(有価証券関係)

前事業年度 (2022年3月31日現在)		当事業年度 (2023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	23,294千円	貸借対照表計上額	24,319千円
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	1,013千円	に含まれた評価差額	1,025千円

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
退職給付債務の期首残高	450,505
勤務費用	58,354
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	△10,018
退職給付の支払額	<u>△18,668</u>
退職給付債務の期末残高	480,173

(単位：千円)

	当事業年度
	自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
退職給付債務の期首残高	480,173
勤務費用	53,150
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	△12,549
退職給付の支払額	<u>△37,376</u>
退職給付債務の期末残高	483,396

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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
年金資産の期首残高	368,935
期待運用収益	2,728
数理計算上の差異の発生額	△2,919
事業主からの拠出額	52,354
退職給付の支払額	<u>△18,668</u>
年金資産の期末残高	402,431

(単位：千円)

	当事業年度
	自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
年金資産の期首残高	402,431
期待運用収益	2,979
数理計算上の差異の発生額	△3,493
事業主からの拠出額	51,651
退職給付の支払額	<u>△37,376</u>
年金資産の期末残高	416,191

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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
積立型制度の退職給付債務	480,173
年金資産	<u>△402,431</u>
	77,742
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	<u>77,742</u>
未認識数理計算上の差異	<u>7,098</u>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	84,840

(単位：千円)

	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
積立型制度の退職給付債務	483,396
年金資産	<u>△416,191</u>
	67,205
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	<u>67,205</u>
未認識数理計算上の差異	<u>9,055</u>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	76,260

5. 退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	<u>55,694</u>
(1) 勤務費用	58,354
(2) 利息費用	-
(3) 期待運用収益	△2,728
(4) 過去勤務費用の費用処理額	0
(5) 数理計算上の差異の費用処理額	69
(6) その他	-

(単位：千円)

	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	43,071
(1)勤務費用	53,150
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益	△2,979
(4)過去勤務費用の費用処理額	0
(5)数理計算上の差異の費用処理額	△7,098
(6)その他	-

6. 年金資産に関する事項

前事業年度（2022年3月31日現在）

① 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%

② 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（2023年3月31日現在）

① 年金資産の内訳

保険資産（一般勘定）	98.2%
その他	1.8%
合計	100.0%

② 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 (2022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 (2023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 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,980千円であります。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,410千円であります。

(税効果会計関係)

前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日																																				
<p>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)</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">19,674</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">27,681</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">(注) 繰越欠損金</td> <td style="text-align: right;">1,727,082</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">その他</td> <td style="text-align: right;">51,898</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;"></td> <td style="border-top: 1px solid black;"></td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">繰延税金資産 合計</td> <td style="text-align: right;">1,826,336</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">繰延税金負債との相殺</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;"></td> <td style="border-top: 1px solid black;"></td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right;">1,826,336</td> </tr> </table>	賞与引当金繰入超過額	19,674	退職給付引当金	27,681	(注) 繰越欠損金	1,727,082	その他	51,898			繰延税金資産 合計	1,826,336	繰延税金負債との相殺	-			繰延税金資産の純額	1,826,336	<p>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)</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">22,144</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">25,052</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">(注) 繰越欠損金</td> <td style="text-align: right;">1,453,659</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">その他</td> <td style="text-align: right;">36,485</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;"></td> <td style="border-top: 1px solid black;"></td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">繰延税金資産 合計</td> <td style="text-align: right;">1,537,341</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">繰延税金負債との相殺</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;"></td> <td style="border-top: 1px solid black;"></td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right;">1,537,341</td> </tr> </table>	賞与引当金繰入超過額	22,144	退職給付引当金	25,052	(注) 繰越欠損金	1,453,659	その他	36,485			繰延税金資産 合計	1,537,341	繰延税金負債との相殺	-			繰延税金資産の純額	1,537,341
賞与引当金繰入超過額	19,674																																				
退職給付引当金	27,681																																				
(注) 繰越欠損金	1,727,082																																				
その他	51,898																																				
繰延税金資産 合計	1,826,336																																				
繰延税金負債との相殺	-																																				
繰延税金資産の純額	1,826,336																																				
賞与引当金繰入超過額	22,144																																				
退職給付引当金	25,052																																				
(注) 繰越欠損金	1,453,659																																				
その他	36,485																																				
繰延税金資産 合計	1,537,341																																				
繰延税金負債との相殺	-																																				
繰延税金資産の純額	1,537,341																																				

(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（2022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)	-	-	-	597,044	157,331	972,706	1,727,082
繰延税金資産	-	-	-	597,044	157,331	972,706	(*2) 1,727,082

(*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1,727,082千円（法定実効税率を乗じた金額）について、繰延税金資産1,727,082千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（2023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)	-	-	319,359	158,439	-	975,860	1,453,659
繰延税金資産	-	-	319,359	158,439	-	975,860	(*2) 1,453,659

(*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1,453,659千円（法定実効税率を乗じた金額）について、繰延税金資産1,453,659千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（2022年3月31日現在）	当事業年度（2023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 8.0%	交際費等永久に損金に 算入されない項目 3.1%
その他 △ 0.2%	その他 0.6%
-----	-----
税効果会計適用後の 法人税等の負担率 38.4%	税効果会計適用後の 法人税等の負担率 34.3%
=====	=====

（資産除去債務関係）

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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14,661千円であります。当事業年度において、本社オフィスの一部解約等に伴う原状回復費用の精算が行われたことから、資産除去債務の総額は、20,679千円減少しました。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

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

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

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

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は15,059千円であります。当事業年度において、原状回復費用の見直しが行われたことから、資産除去債務の総額は、397千円増加千円減少しました。

(収益認識関係)

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

- (1) 収益の分解情報
損益計算書に記載のとおりです。
- (2) 収益を理解するための基礎となる情報
重要な会計方針「5. 収益の計上方法」に記載のとおりです。
- (3) 当期及び翌期以降の収益の金額を理解するための情報
重要性が乏しいため、注記を省略しております。

当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

- (1) 収益の分解情報
損益計算書に記載のとおりです。
- (2) 収益を理解するための基礎となる情報
重要な会計方針「5. 収益の計上方法」に記載のとおりです。
- (3) 当期及び翌期以降の収益の金額を理解するための情報
重要性が乏しいため、注記を省略しております。

(セグメント情報)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

2. セグメント関連情報

1. 商品及びサービスに関する情報

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

2. 地域に関する情報

① 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。

② 有形固定資産

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

3. 主要な顧客に関する情報

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

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)
該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)
該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)
該当事項はありません。

(関連当事者情報)

I 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 2021年4月1日 至 2022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	前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日 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 マサチューセツ 州ボースト 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	351,919	前払金	598		
								投資顧問料の支 払	221,949				
								ソフトウェア の使用契約	396,782			未払金	28,457
								人件費等の支払	85,395				
事務手数料の受 取	363,220												
	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	38,999	前払金	119,051			
							兼職社員の人 件費支払等	127,476					
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・コソイテッド・キングダム	英国 ロンドン	62百万ポ ンド	投資顧問、 投資信託委 託業務	なし	なし	投資顧問サービ スの受入れ	19,193	-	-			
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポ ール	136万シ ンガポ ール	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	264 24,400	-	-			

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

当事業年度 自 2022年4月1日 至 2023年3月31日												
種 類	会社等の 名称	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	295,434	前払金	3,388	
								投資顧問料の支 払	232,843			
								ソフトウェア の使用契約	175,762	未払金		24,509
								人件費等及び 事務手数料の 支払	12,389			
							移転価格調整金 の受取	131,841				
ステート・スト リート信託銀 行株式会 社	東京都港 区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理 の事務サービ スの受入れ	投資信託計理業 務委託	39,303	前払金	229,512		
							兼職社員の人 件費支払等	127,670				
ステート・スト リート・グロ ーバル・アド ヴァイザー ズ・ユナイテ ッド・キング ダム	英国 ロンドン	62百万ポ ンド	投資顧問、 投資信託委 託業務	なし	なし	投資顧問サービ スの受入れ	投資顧問料の支 払	19,754	-	-		
ステート・スト リート・グロ ーバル・アド ヴァイザー ズ・シンガ ポール	シンガポ ール 市	136万シ ンガポ ール	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービ スの受入れ及 びE T F 商品 の紹介	紹介料の受取	250	-	-		
							投資顧問料の支 払	22,792				

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

II 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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
1株当たり純資産 1,108,000円68銭	1株当たり純資産 1,161,868円75銭
1株当たり当期純利益 135,213円36銭	1株当たり当期純利益 189,029円36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、記載しておりません。	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、記載しておりません。

(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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
当期純利益（千円）	838,322	1,171,982
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）	838,322	1,171,982
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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度

自 2022年4月 1日

至 2023年3月31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。

- ① 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。）。
- ② 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。）。
- ③ 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④⑤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。
- ④ 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。
- ⑤ 上記③④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。

追加型証券投資信託

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）

約 款

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

運用の基本方針

約款第17条の規定に基づき、委託者が定める運用の基本方針は次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

「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。

(2) 投資態度

- ① 「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。
- ② 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^{※1})]

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^{※2}）]

^{※1} 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円換算のうえ合成して指数化したものです。

※² F T S E 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円換算のうえ合成して指数化したものです。

- ③ 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。
- ④ 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、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限り、以下同じ。）を行うことができます。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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。
- ⑦ 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。

（3）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、約款20条、第21条および第22条の範囲で行います。
- 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。

3. 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。

- ① 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。
- ② 分配金額は、委託者が基準価額水準、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。
- ③ 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
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）

約 款

（信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託）

第1条 この信託は、証券投資信託であり、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を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

- ② この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。
- ③ 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条、第16条および第28条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。
- ④ 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

（信託の目的、金額および追加信託の限度額）

第2条 委託者は、金1,000億円を上限として受益者のために利殖する目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

- ② 委託者は、受託者と合意のうえ金2兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ③ 委託者は、受託者と合意のうえ、第2項の限度額を変更することができます。

（信託期間）

第3条 この信託の期間は、信託契約締結日から第46条第1項および第2項、第47条第1項、第48条第1項、第50条第2項の規定による信託終了日または信託契約解約の日までとします。

（受益権の取得申込みの勧誘の種類）

第4条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

（当初の受益者）

第5条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第6条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

（受益権の分割および再分割）

第6条 委託者は、第2条第1項に規定する信託によって生じた受益権については、これを1,000億口を上限とし、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど、第7条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

- ② 委託者は、受託者と協議のうえ、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。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第7条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

- ② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第25条に規定する借入有価証券を除きます。）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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- ③ 第27条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第8条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第9条 この信託のすべての受益権は、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ることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）およ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。）。

- ② 委託者は、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、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託者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。

- ③ 委託者は、第6条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第10条 受託者は、この信託契約締結により生じた受益権については信託設定時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

(受益権の申込単位および価額)

第11条 委託者の指定する第一種金融商品取引業者（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第6条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、第4項に規定する受益権の価額に取得申込口数を乗じて得た金額について、委託者の承諾を得て各第一種金融商品取引業者および登録金融機関が定める申込単位を

もって当該受益権の取得の申込に応ずることができるものとします。ただし、第42条第2項に規定する収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込に限り、1口の整数倍をもって取得の申込に応ずることができるものとします。なお、委託者は、1億円または1億口を超える大口の取得の申込には、制限を設けることがあります。

- ② 前項の取得申込者は委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該取得申込の代金（第4項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。
- ③ 第1項の規定にかかわらず、取得申込日が米国もしくは英国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を「金融商品取引所」といい、金融商品取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「取引所」といいます。以下同じ。）または銀行の休業日、またはフランスおよびドイツの両国の取引所または銀行の休業日の場合は、原則として受益権の取得の申込に応じないものとします。
- ④ 第1項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、手数料および当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みに係る受益権の価額は、1口につき1円に、手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑤ 前項の手数料額は、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関がそれぞれ定めるものとします。
- ⑥ 前2項の規定にかかわらず、受益者が委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関との間に結ばれた別に定める自動けいぞく投資約款にしたがった契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第36条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑦ 前各項の規定にかかわらず、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、委託者の判断により、受益権の取得申込の受け付けを中止することおよび既に受け付けた受益権の取得申込の受け付けを取り消すことができます。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第12条 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。

- ② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項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。
- ③ 委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(受益権の譲渡の対抗要件)

第13条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

(投資の対象とする資産の種類)

第14条 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。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限り、以下同じ。）
 - ハ. 金銭債権
 - ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

(運用の指図範囲等)

第15条 委託者は、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者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された「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、前号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. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
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前号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、第1号の証券または証書、第12号および第17号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、第2号から第6号までの証券ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- ② 委託者は、信託金を、前項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
- ③ 第1項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、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、前項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。
- ④ 委託者は、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。
- ⑤ 前項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。

（利害関係人等との取引等）

第16条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となつて行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第28条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、前2条に定める資産への投資等を行うことができます。

- ② 前項の取扱いは、第19条ないし第25条、第27条および第31条ないし第33条における委託者の指図による取引その他これらに類する行為を行う場合についても同様とします。
- ③ 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算

で行う場合も同様とします。

- ④ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等ならびに第19条ないし第25条、第27条および第31条ないし第33条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。
- ⑤ 前4項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

（運用の基本方針）

第17条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

（投資する株式等の範囲）

第18条 委託者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。

（信用取引の指図範囲）

- 第19条 委託者は、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るものとします。
- ② 前項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。
 - ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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。
 - ④ 第2項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。
 - ⑤ 委託者は、第1項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。

（先物取引等の運用指図）

- 第20条 委託者は、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。）。② 委託者は、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。

- ③ 委託者は、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。

(スワップ取引の運用指図)

第21条 委託者は、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。

- ② 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、原則として第3条に定める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。
- ③ 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、委託者は速やかに、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。
- ④ 前項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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 委託者は、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。

(金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図)

第22条 委託者は、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。

- ② 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、原則として第3条に定める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。
- ③ 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。
- ④ 委託者は、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。

(デリバティブ取引等にかかる投資制限)

第22条の2 委託者は、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。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第23条 委託者は、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。

- ② 委託者は、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。

(公社債の空売りの指図範囲)

第24条 委託者は、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。

- ② 前項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。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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。

(公社債の借入れ)

第25条 委託者は、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。

- ② 前項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。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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。
- ④ 第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

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。

(外国為替予約取引の指図および範囲)

第27条 委託者は、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。

- ② 前項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。
- ③ 前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者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。
- ④ 第1項および第2項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。

(信託業務の委託等)

第28条 受託者は、委託者と協議の上、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存に係る業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
 4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

（混蔵寄託）

第29条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

第30条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

（有価証券の売却等の指図）

第31条 委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券に係る信託契約の一部解約、有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第32条 委託者は、前条の規定による一部解約金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資

することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第33条 委託者は、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。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- ② 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、当該資金借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないものとします。
- ③ 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ④ 借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

(損益の帰属)

第34条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第35条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(計算期間)

第36条 この信託の計算期間は、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。ただし、第1計算期間は平成24年3月9日から平成25年2月20日までとします。

- ② 前項の規定にかかわらず、前項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、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、第3条に定める信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告等)

第37条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
- ③ 受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。
- ④ 受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者

の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

(信託事務の諸費用)

第38条 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者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。

- ② 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。
- ③ 第1項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者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。

(信託報酬等)

第39条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、以下の各号により計算された額の合計額とします。

1. 第36条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の75の率を乗じて得た額
2. 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、その品貸料のうち信託財産に属するとみなした額の100分の50以内の額
- ② 前項の信託報酬は、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に信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。
- ③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。
- ④ 第1項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の受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める品貸料の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(収益の分配)

第40条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- ② 毎計算期末において信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第41条 受託者は、収益分配金については、第42条第1項に規定する支払開始日および同条第2項に規定する交付開始前までに、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第42条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第45条第5項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗

じて得た額をいいます。以下同じ。)については第42条第4項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第42条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末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（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末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委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関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。

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関と受益権の取得申込者との間に結ばれた別に定める自動けいぞく投資約款にしたがった契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関に交付されます。この場合、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。ただし、第45条第1項により信託の一部解約が行われた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、第1項に準じて受益者に支払います。当該売付けにより増加した受益権は、第9条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 償還金は、信託終了日後1ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了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委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関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。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還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。
- ④ 一部解約金は、第45条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として5営業日目から当該受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の営業所等において行うものとし、
- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、
- ⑦ 前項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとし、また、前項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとし、

(収益分配金および償還金の時効)

第43条 受益者が、収益分配金については第42条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金について第42条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から

交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第44条 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係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、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(一部解約)

第45条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し、委託者の承諾を得て各第一種金融商品取引業者および登録金融機関が定める解約単位をもって一部解約の実行を請求することができます。なお、委託者は、1億円または1億口を超える大口の解約請求には、制限を設けることがあります。

- ② 信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ③ 前各項の規定にかかわらず、解約請求日が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の両国の取引所または銀行の休業日の場合は、原則として受益権の一部解約の実行を受け付けないものとします。
- ④ 委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第1項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引き換えに、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。
- ⑤ 前項の一部解約の価額は、解約請求日の翌営業日の基準価額から当該基準価額に0.05%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。
- ⑥ 委託者は、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、委託者の判断により、第1項による一部解約の実行の請求の受付を中止することおよび既に受け付けた第1項による一部解約の実行の請求を取り消すことができます。
- ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第5項の規定に準じて計算された価額とします。

(信託契約の解約)

第46条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、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、委託者は、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。

- ② 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、委託者は、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。
- ③ 委託者は、第1項の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます)

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、この信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- ④ 前項の書面決議において、受益者（委託者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者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該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。
- ⑤ 第3項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。
- ⑥ 第3項から前項までの規定は、委託者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又は電磁的記録により同意の意思表示をしたとき及び第2項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合には適用しません。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、第3項から前項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。

（信託契約に関する監督官庁の命令）

第47条 委託者は、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。

- ② 委託者は、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、第51条の規定にしたがいます。

（委託者の登録取消等に伴う取扱い）

第48条 委託者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、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項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者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、第51条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者との間において存続します。

（委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い）

第49条 委託者は、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。

- ② 委託者は、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。

（受託者の辞任および解任に伴う取扱い）

第50条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者が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、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第51条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

（信託約款の変更等）

第51条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、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、この信託約款は本条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。

- ② 委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあっては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあっ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、この信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者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者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該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。
- ④ 第2項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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 第2項から前項までの規定は、委託者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又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ⑦ 前各項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、当該併合に係る一又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。

（反対受益者の受益権買取請求の不適用）

第52条 この信託は、受益者が第45条に規定による一部解約の実行の請求を行ったときは、委託者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、第46条に規定する投資信託の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行なう場合において、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。

（他の受益者の氏名等の開示の請求の制限）

第53条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

（公 告）

第54条 委託者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。

（信託約款に関する疑義の取扱い）

第55条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

（運用報告書に記載すべき事項の提供）

第56条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

上記条項により信託契約を締結します。

平成 24 年 3 月 9 日
平成 24 年 4 月 1 日変更
平成 25 年 1 月 4 日変更
平成 26 年 5 月 20 日変更
平成 26 年 12 月 1 日変更
平成 27 年 4 月 1 日変更
平成 28 年 5 月 31 日変更
平成 28 年 11 月 19 日変更
平成 30 年 5 月 19 日変更

委託者 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

受託者 三井住友信託銀行株式会社

(付則)

第1条 第22条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日からの一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第2条 第22条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

親投資信託

日本株式インデックス・マザーファンド

約

款

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

運用の基本方針

約款第13条の規定に基づき、委託者が別に定める運用の基本方針は次のものとします。

1. 基本方針

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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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。

(2) 投資態度

- ①TOPIX（東証株価指数配当込み）をベンチマークとします。
- ②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。
- ③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。
- ④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。
- ⑤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。
- ⑥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。

(3) 投資制限

- ①株式への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資は行いません。
- ③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。
- ④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。
- ⑤信用取引の指図は、約款第15条の範囲で行います。
- ⑥有価証券先物取引等は、約款第16条の範囲で行います。
- ⑦スワップ取引は、約款第17条の範囲で行います。
- ⑧金利先渡取引は、約款第18条の範囲で行います。
- ⑨一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。

親投資信託
日本株式インデックス・マザーファンド
約 款

(信託の種類、委託者および受託者)

第1条 この信託は、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする証券投資信託であり、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を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

- ② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法(大正11年法律第62号) (以下「信託法」といいます。) の適用を受けます。
- ③ 第1項の受託者は、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

(信託の目的、金額および追加信託の限度額)

第2条 委託者は、金50億円を上限として受益者のために利殖する目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

- ② 委託者は、受託者と合意のうえ金2兆円を限度として信託金を追加することができるものとし、追加信託が行われたときは、受託者は、その引き受けを証する書面を委託者に交付します。
- ③ 委託者は、受託者と合意のうえ、第2項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第3条 この信託の期間は、信託契約締結日から、第40条第1項、第2項、第41条第1項、第42条第1項、第44条第2項の規定による信託終了日または信託契約解約の日までとします。

(受益証券の取得申込みの勧誘の種類)

第4条 この信託にかかる受益証券の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第2号イに掲げる場合に該当する勧誘のうち、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第9項第1号に掲げる適格機関投資家私募により行われます。

(受益者)

第5条 この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を投資対象とするステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の証券投資信託 (以下「ベビーファンド」といいます。) の受託者である信託業務を営む銀行とします。

(受益権の分割および再分割)

第6条 委託者は、第2条第1項に規定する信託によって生じた受益権については、これを50億口を上限として、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど、第7条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と協議の上、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第7条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該基準価額に0.05%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として加算した価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第22条に規定する借入有価証券を除きます。）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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第8条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益証券の発行および種類)

第9条 委託者は、第6条第1項の規定により分割された受益権を表示する受益証券を発行します。この場合の受益証券は、記名式とします。

② 委託者が発行する受益証券は、1口の整数倍の口数を表示した受益証券とします。

③ 受益者は、当該受益証券を他に譲渡することはできません。

(受益証券の発行についての受託者の認証)

第10条 委託者は、前条第1項の規定により受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

② 前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行います。

(投資の対象とする資産の種類)

第11条 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。）

イ. 有価証券

- ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第16条、第17条および第18条に定めるものに限り。）
 - ハ. 金銭債権
 - ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
- イ. 為替手形

（運用の指図範囲等）

第12条 委託者は、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ます。）

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

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

② 委託者は、信託金を、前項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

③ 第1項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、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、前項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。

④ 委託者は、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。

⑤ 委託者は、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。

（運用の基本方針）

第13条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

（投資する株式等の範囲）

第14条 委託者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、国内の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を「金融商品取引所」といい、金融商品取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「取引所」もしくは「証券取引所」といいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、または国内の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。

(信用取引の指図範囲)

第15条 委託者は、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るものとします。

- ② 前項の信用取引の指図にあたっては、当該売り付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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。
- ④ 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の信用取引による株券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の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。当該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の100分の5を上回ることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に相当する当該売り付けに係る建玉を決済するための指図をするものとします。
- ⑤ 委託者は、第1項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。

(先物取引等の運用指図)

第16条 委託者は、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。）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。）。

- ② 委託者は、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を行うことの指図をすることができます。

(スワップ取引の運用指図)

第17条 委託者は、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。）を行うことの指図をすることができます。

- ② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期間が、原則として第3条に定める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。
- ③ 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、委託者は速やかに、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。
- ④ 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。
- ⑤ 委託者は、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。

(金利先渡取引の運用指図)

第18条 委託者は、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を回避するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第3条に定める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。
- ③ 金利先渡取引の評価は、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。
- ④ 委託者は、金利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。

(デリバティブ取引等にかかる投資制限)

第18条の2 委託者は、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。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第19条 委託者は、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。

- ② 委託者は、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。

(公社債の空売りの指図範囲)

第20条 委託者は、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。

- ② 前項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を超えないものとします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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。

(公社債の借入れ)

第21条 委託者は、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られた時は、担保の提供の指図を行うものとします。

- ② 前項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を超えないものとします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を決済するための指図をするものとします。
- ④ 第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

(保管業務の委任)

第22条 受託者は、委託者と協議の上、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

(有価証券の保管)

第23条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

(混蔵寄託)

第24条 金融機関または第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書

またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとしします。

(一括登録)

第25条 信託財産に属する国債証券のうち振替決済に係る国債証券については、日本銀行で保管することがあります。この場合、日本銀行においては日本銀行名義で一括登録することがあります。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第26条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとしします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとしします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(有価証券の売却等の指図)

第27条 委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第28条 委託者は、前条の規定による売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(損益の帰属)

第29条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第30条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合

で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(計算期間)

第31条 この信託の計算期間は、毎年3月6日から翌年3月5日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成15年5月20日から平成16年3月5日までとします。

- ② 前項の規定にかかわらず、前項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、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。但し、最終計算期間の終了日は、第3条に定める信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告)

第32条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

(信託事務の諸費用)

第33条 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者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。

- ② 第1項に定める信託事務の処理等に要する諸費用のうち、ベビーファンドに関連して生じたものについては、委託者はこれをこの信託に関連して生じたものではないとみなすことができます。

(信託報酬等)

第34条 委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を収受しません。

(利益の留保)

第35条 信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産に留保し、期中には分配を行いません。

(追加信託金および一部解約金の計理処理)

第36条 追加信託金または一部解約金は、当該金額と元本に相当する金額の差額を、追加信託にあつては追加信託差金、信託の一部解約にあつては解約差金として処理します。

(償還金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責)

第37条 受託者は、信託が終了した時は、償還金(信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。)の全額を委託者に交付します。

② 受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(償還金の支払い)

第38条 委託者は、受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引き換えに当該償還金を受益者に支払います。

(一部解約)

第39条 委託者は、受益者の請求があつた場合には、この信託契約の一部を解約します。

② 前項の一部解約の価額は、一部解約実行日の前営業日の基準価額から当該基準価額に0.05%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。

(信託契約の解約)

第40条 委託者は、信託期間中において、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、受託者と合意のうえ、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、委託者は、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。

② 委託者は、この信託の受益証券を投資対象とすることを信託約款において定めるすべての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、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。

③ 委託者は、前2項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

④ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

⑤ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。

- ⑥ 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ⑦ 第4項から前項までの規定は、第2項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合には適用しません。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第41条 委託者は、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。

- ② 委託者は、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、第45条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第42条 委託者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、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項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者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、第45条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第43条 委託者は、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。

- ② 委託者は、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。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第44条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第45条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更)

第45条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらか

じめ、変更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。

- ② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。
- ⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第46条 第40条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第40条第4項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己の有する受益証券を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

(利益相反のおそれがある場合の受益者の書面交付)

第47条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第13条第1項に定める書面を交付しません。

(運用報告書)

第48条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条に定める運用報告書を交付しません。

(公 告)

第49条 委託者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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第50条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成 15 年 5 月 20 日
平成 17 年 6 月 8 日変更
平成 17 年 7 月 1 日変更
平成 18 年 5 月 1 日変更
平成 19 年 9 月 30 日変更
平成 19 年 10 月 1 日変更
平成 19 年 11 月 30 日変更
平成 20 年 5 月 16 日変更
平成 20 年 7 月 1 日変更
平成 20 年 6 月 30 日変更
平成 24 年 4 月 1 日変更
平成 25 年 1 月 4 日変更
平成 26 年 12 月 1 日変更
平成 28 年 4 月 28 日変更
平成 28 年 5 月 31 日変更

委託者 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

受託者 三井住友信託銀行株式会社

(付則)

第 1 条 第 18 条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日からの一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

親投資信託

日本債券インデックス・マザーファンド

約

款

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

運用の基本方針

約款第13条の規定に基づき、委託者が別に定める運用の基本方針は次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ① NOMURA-BPI 総合をベンチマークとします。
- ② 債券組入比率は原則として高位を維持します。
- ③ 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- ④ 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- ⑤ 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ⑥ 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。
- ⑦ 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。

(3) 投資制限

- ① 公社債の投資割合には制限を設けません。
- ② 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ます。）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。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 外貨建資産への投資は行いません。
- ⑥ 有価証券先物取引等は、約款第15条の範囲で行います。
- ⑦ スワップ取引は、約款第16条の範囲で行います。
- ⑧ 金利先渡取引は、約款第17条の範囲で行います。
- ⑨ 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。

親投資信託
日本債券インデックス・マザーファンド
約 款

(信託の種類、委託者および受託者)

第1条 この信託は、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする証券投資信託であり、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を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

- ② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法(大正11年法律第62号)(以下「信託法」といいます。)の適用を受けます。
- ③ 第1項の受託者は、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

(信託の目的、金額および追加信託の限度額)

第2条 委託者は、金50億円を上限として受益者のために利殖する目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

- ② 委託者は、受託者と合意のうえ金2兆円を限度として信託金を追加することができるものとし、追加信託が行われたときは、受託者は、その引き受けを証する書面を委託者に交付します。
- ③ 委託者は、受託者と合意のうえ、第2項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第3条 この信託の期間は、信託契約締結日から、第39条第1項、第2項、第40条第1項、第41条第1項、第43条第2項の規定による信託終了日または信託契約解約の日までとします。

(受益証券の取得申込みの勧誘の種類)

第4条 この信託にかかる受益証券の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第2号イに掲げる場合に該当する勧誘のうち、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第9項第1号に掲げる適格機関投資家私募により行われます。

(受益者)

第5条 この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を投資対象とするステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の証券投資信託(以下「ベビーファンド」といいます。)の受託者である信託業務を営む銀行とします。

(受益権の分割および再分割)

第6条 委託者は、第2条第1項に規定する信託によって生じた受益権については、これを50億円を上限とし、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど、第7条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

- ② 委託者は、受託者と協議の上、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第7条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該基準価額に0.05%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として加算した価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

- ② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および第20条に規定する借入有価証券を除きます。)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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

（信託日時異なる受益権の内容）

第8条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

（受益証券の発行および種類）

第9条 委託者は、第6条第1項の規定により分割された受益権を表示する記名式の受益証券を発行します。

- ② 委託者が発行する受益証券は、1口の整数倍の口数を表示した受益証券とします。
- ③ 受益者は、当該受益証券を他に譲渡することはできません。

（受益証券の発行についての受託者の認証）

第10条 委託者は、前条第1項の規定により受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

- ② 前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行います。

（投資の対象とする資産の種類）

第11条 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。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。）
 - ハ. 金銭債権
 - ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

（運用の指図範囲等）

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

- ② 委託者は、信託金を、前項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
- ③ 第1項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、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、前項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。
- ④ 委託者は、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。
- ⑤ 委託者は、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。
- ⑥ 委託者は、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。

（運用の基本方針）

第13条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

（投資する株式の範囲）

第14条 委託者が投資することを指図する株式は、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ます。）の行使により取得可能なものに限り、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を「金融商品取引所」といい、金融商品取引所のうち、有価証券の売買また

は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「取引所」もしくは「証券取引所」といいます。以下同じ。)に上場されている株式の発行会社の発行するもの、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については、この限りではありません。

(先物取引等の運用指図)

第15条 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。)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。)

- ② 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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を行うことの指図をすることができます。

(スワップ取引の運用指図)

第16条 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

- ② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期間が、原則として第3条に定める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。
- ③ 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、委託者は速やかに、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。
- ④ 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。
- ⑤ 委託者は、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。

(金利先渡取引の運用指図)

第17条 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第3条に定める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。
- ③ 金利先渡取引の評価は、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。
- ④ 委託者は、金利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。

(デリバティブ取引等にかかる投資制限)

第17条の2 委託者は、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人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。

（有価証券の貸付の指図および範囲）

第18条 委託者は、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。

② 委託者は、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。

（公社債の空売りの指図範囲）

第19条 委託者は、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。

② 前項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を超えないものとします。

③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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。

（公社債の借入れ）

第20条 委託者は、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られた時は、担保の提供の指図を行うものとします。

② 前項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を超えないものとします。

③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を決済するための指図をするものとします。

④ 第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

（保管業務の委任）

第21条 受託者は、委託者と協議の上、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

（有価証券の保管）

第22条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

（混蔵寄託）

第23条 金融機関または第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

(一括登録)

第24条 信託財産に属する国債証券のうち振替決済に係る国債証券については、日本銀行で保管することがあります。この場合、日本銀行においては日本銀行名義で一括登録することがあります。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第25条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産(金銭を除きます。)については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(有価証券の売却等の指図)

第26条 委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第27条 委託者は、前条の規定による売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(損益の帰属)

第28条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第29条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(計算期間)

第30条 この信託の計算期間は、毎年3月6日から翌年3月5日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成15年5月20日から平成16年3月5日までとします。

- ② 前項の規定にかかわらず、前項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、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。但し、最終計算期間の終了日は、第3条に定める信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告)

第31条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これ

を委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

(信託事務の諸費用)

第32条 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者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。

- ② 第1項に定める信託事務の処理等に要する諸費用のうち、ベビーファンドに関連して生じたものについては、委託者はこれをこの信託に関連して生じたものではないとみなすことができます。

(信託報酬等)

第33条 委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を収受しません。

(利益の留保)

第34条 信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産に留保し、期中には分配を行いません。

(追加信託金および一部解約金の計理処理)

第35条 追加信託金または一部解約金は、当該金額と元本に相当する金額の差額を、追加信託にあつては追加信託差金、信託の一部解約にあつては解約差金として処理します。

(償還金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責)

第36条 受託者は、信託が終了した時は、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）の全額を委託者に交付します。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(償還金の支払い)

第37条 委託者は、受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引き換えに当該償還金を受益者に支払います。

(一部解約)

第38条 委託者は、受益者の請求があつた場合には、この信託契約の一部を解約します。

- ② 前項の一部解約の価額は、一部解約実行日の前営業日の基準価額から当該基準価額に0.05%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。

(信託契約の解約)

第39条 委託者は、信託期間中において、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、受託者と合意のうえ、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、委託者は、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。

- ② 委託者は、この信託の受益証券を投資対象とすることを信託約款において定めるすべての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、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。
- ③ 委託者は、前2項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

- ④ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ⑤ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
- ⑥ 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ⑦ 第4項から前項までの規定は、第2項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合には適用しません。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第40条 委託者は、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。

- ② 委託者は、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、第44条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第41条 委託者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、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項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者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、第44条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第42条 委託者は、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。

- ② 委託者は、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。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第43条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第44条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更)

第44条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更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。

- ② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

- ⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第45条 第39条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第39条第4項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己の有する受益証券を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

(利益相反のおそれがある場合の受益者の書面交付)

第46条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第13条第1項に定める書面を交付しません。

(運用報告書)

第47条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条に定める運用報告書を交付しません。

(公 告)

第48条 委託者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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第49条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成 15 年 5 月 20 日
平成 17 年 6 月 8 日変更
平成 17 年 7 月 1 日変更
平成 17 年 10 月 1 日変更
平成 18 年 5 月 1 日変更
平成 19 年 9 月 30 日変更
平成 19 年 10 月 1 日変更
平成 19 年 11 月 30 日変更
平成 20 年 5 月 16 日変更
平成 20 年 7 月 1 日変更
平成 21 年 6 月 30 日変更
平成 24 年 4 月 1 日変更
平成 25 年 1 月 4 日変更
平成 26 年 12 月 1 日変更
平成 28 年 4 月 28 日変更
平成 28 年 5 月 31 日変更
令和 5 年 11 月 21 日変更

委託者 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

受託者 三井住友信託銀行株式会社

(付則)

第1条 第17条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日からの一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

親投資信託
外国株式インデックス・オープン
・マザーファンド
約 款

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

<親投資信託 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

約款第13条の規定に基づき、委託者が別に定める運用の基本方針は次のものとします。

基本方針

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。

運用方法

(1) 投資対象

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。

(2) 投資態度

- ①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。
- ②株式の組入率は、原則として高位を維持します。
- ③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。
- ④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。
- ⑤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。

運用制限

- (1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。
- (2) 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。
- (3) 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- (4) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- (5) 有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行います。
- (6) スワップ取引は、約款第18条の範囲で行います。
- (7) 金利先物取引及び為替先渡取引は、約款第19条の範囲で行います。
- (8) 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。

親投資信託

外国株式インデックス・オープン・マザーファンド 約款

【信託の種類、委託者および受託者】

第1条 この信託は、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする証券投資信託であり、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を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

- ② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。
- ③ 第1項の受託者は、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

【信託の目的、金額および追加信託の限度額】

第2条 委託者は、金100万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

- ② 委託者は、受託者と合意のうえ金2兆円を限度として信託金を追加できるものとし、追加信託を行ったときは、受託者は、その引き受けを証する書面を委託者に交付します。
- ③ 前項の規定にかかわらず、委託者は、この信託の受益権を他の証券投資信託の投資信託財産に属する有価証券（投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第25条第1項第1号イからハマまでに掲げる有価証券に限りません。）をもって投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第7条第3項第1号に従って取得させることができます。
- ④ 委託者は、受託者と合意のうえ、第2項の限度額を変更することができます。

【信託期間】

第3条 この信託の期間は、信託契約締結日から第41条第1項及び第2項、第44条第1項、第45条第1項または第47条第2項の規定による信託終了日または信託契約解約日までとします。

【受益証券の取得申込の勧誘の種類】

第4条 この信託にかかる受益証券の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第2号イに掲げる場合に該当する勧誘のうち、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第9項第1号で定める適格機関投資家私募により行われます。

【受益者】

第5条 この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を投資対象とするステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の証券投資信託（以下「ベビー・ファンド」といいます。）の受託者である信託業務を営む銀行とします。

【受益権の分割および再分割】

第6条 委託者は、第2条第1項による受益権については100万口に、第2条第2項及び第2条

第3項に定める追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第7条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

【追加信託金の計算方法】

第7条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産の資産総額（受入担保金代用有価証券および第22条に定める借入有価証券を除きます。）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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

③ なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

④ 第24条に規定する予約為替の評価は原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

【追加日時の異なる受益権の内容】

第8条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

【受益証券の発行および種類】

第9条 委託者は、第6条第1項の規定により分割された受益権を表示する記名式受益証券を発行します。

② 委託者が発行する受益証券は、1口の整数倍の口数を表示した受益証券とします。

③ 受益者は当該受益証券を他に譲渡することはできません。

【受益証券の発行についての受託者の認証】

第10条 委託者は、受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

② 前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行います。

【投資の対象とする資産の種類】

第11条 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。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第17条、第18条および第19条に定めるものに限りません。）
 - ハ. 金銭債権

- ニ. 約束手形
- 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

【運用の指図範囲等】

第12条 委託者は、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. 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、前各号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、第1号の証券または証書および第8号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、第2号から第5号までの証券および第8号の証券または証書のうち第2号から第5号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、第9号または第10号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- ② 委託者は、信託金を、前項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
- ③ 第 1 項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、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、前項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。
- ④ 委託者は、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。

【運用の基本方針】

第 13 条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

【投資する株式等の範囲】

第 14 条 委託者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（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場を「金融商品取引所」といい、金融商品取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号もしくは同項第 5 号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「取引所」もしくは「証券取引所」といいます。以下同じ。）に上場または日本証券業協会に登録されている株式の発行会社の発行するもの、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。

【同一銘柄の株式への投資制限】

第 15 条 委託者は、取得時において信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額が、取得時において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。

【信用取引の指図範囲】

第 16 条 委託者は、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なうことの指図をすることができるものとします。

- ② 前項の信用取引の指図は、当該売り付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けにかか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、委託者は速やかに、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。

【先物取引等の運用指図】

第 17 条 委託者は、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、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な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。）。

- ② 委託者は、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、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、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- ③ 委託者は、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、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、わが国の取引所における金利にかか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なうことの指図をすることができます。

【スワップ取引の運用指図】

第 18 条 委託者は、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（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

- ② 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、原則として第 3 条に定める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。
- ③ 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。
- ④ 委託者は、スワップ取引を行な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なうものとします。

【金利先渡し取引および為替先渡し取引の運用指図】

第 19 条 委託者は、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、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行なうことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡し取引および為替先渡し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第 3 条に定める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。
- ③ 金利先渡し取引および為替先渡し取引の評価は、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。
- ④ 委託者は、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行な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なうものとします。

【デリバティブ取引等にかかる投資制限】

第 19 条の 2 委託者は、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。

【有価証券の貸付の指図および範囲】

第 20 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の 50%を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の 50%を超えないものとします。
- ② 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
 - ③ 委託者は、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なうものとします。

【公社債の空売りの指図範囲】

第 21 条 委託者は、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（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。

- ② 前項の売り付けの指図は、当該売り付けにかか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。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けにかか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、委託者は速やかに、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。

【公社債の借入れ】

第 22 条 委託者は、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なうにあたり担保の提供が必要と認められた時は、担保の提供の指図を行なうものとします。

- ② 前項の指図は、当該借入れにかか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。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかか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、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ④ 第 1 項の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

【特別の場合の外貨建有価証券への投資制限】

第 23 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。

【外国為替予約取引の指図および範囲】

第 24 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ② 前項の予約取引の指図は、信託財産にかか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為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ③ 前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者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。

【保管業務の委任】

第 25 条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

【有価証券の保管】

第 26 条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機構等に預託し保管させることができます。

【混蔵寄託】

第 27 条 金融機関または第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第 28 条第 1 項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄

託できるものとしします。

【一括登録】

第 28 条 信託財産に属する国債証券のうち振替決済にかかる国債証券については、日本銀行で保管することがあります。この場合、日本銀行においては日本銀行名義で一括登録することがあります。

【信託財産の登記等および記載等の留保等】

第 29 条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとしします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとしします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

【有価証券の売却等の指図】

第 30 条 委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

【再投資の指図】

第 31 条 委託者は、前条の規定による売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

【損益の帰属】

第 32 条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

【受託者による資金の立替え】

第 33 条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は、資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前 2 項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

【信託の計算期間】

第 34 条 この信託の計算期間は、毎年 12 月 1 日から翌年 11 月 30 日までとすることを原則とし

ます。ただし、第1計算期間は平成14年1月11日から平成14年11月30日までとします。

- ② 前項にかかわらず、前項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、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、第3条に定める信託期間の終了日とします。

【信託財産に関する報告】

第35条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

【信託事務の諸費用】

第36条 信託財産に関する租税、信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）等の信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担として、信託財産中から支弁します。ただし、当該諸経費の金額をあらかじめ合理的に見積もったうえで、実際の金額にかかわらず固定率又は固定金額にて信託財産中から支弁することもできるものとします。

- ② 第1項に定める信託事務の処理等に要する諸費用のうち、ベビー・ファンドに関連して生じたものについては、委託者はこれをこの信託に関連して生じたものではないとみなすことができます。

【信託報酬等の額】

第37条 委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を受領しません。

【利益の留保】

第38条 信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産に留保し、期中には分配を行いません。

【追加信託金および一部解約金の計理処理】

第39条 追加信託金または信託の一部解約金は、当該金額と元本に相当する金額との差額を、追加信託にあつては追加信託差金、信託の一部解約にあつては解約差金として処理します。

【一部解約】

第40条 委託者は、受益者の請求があつた場合には、信託の一部を解約します。

- ② 前項の一部解約の価額は、一部解約実行日の前営業日の基準価額から、当該基準価額に0.30%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額に、当該解約にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

【信託契約の解約】

第41条 委託者は、信託期間中において、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、受託者と合意のうえ、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、委託者は、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。

- ② 委託者は、この信託の受益証券を投資対象とすることを信託約款において定める全ての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、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。
- ③ 委託者は、前2項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ④ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ⑤ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
- ⑥ 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- ⑦ 第4項から前項までの規定は、第2項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合には適用しません。

【償還金の委託者への交付と支払に関する受託者の免責】

第42条 受託者は、信託が終了したときは、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。）の全額を委託者に交付します。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払につき、その責に任じません。

【償還金に関する支払時期】

第43条 委託者は、受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引換えに、当該償還金を受益者に支払います。

【信託契約に関する監督官庁の命令】

第44条 委託者は、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。

- ② 委託者は、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、第48条の規定にしたがいます。

【委託者の登録取消等に伴う取扱い】

第45条 委託者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、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項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者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、第48条第4項に規定する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

【委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い】

第46条 委託者は、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。

- ② 委託者は、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。

【受託者の辞任および解任に伴う取扱い】

第47条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第48条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

【信託約款の変更】

第48条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更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。

- ② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。
- ⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

【反対者の買取り請求】

第49条 第41条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第41条第4項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己の有する受益証券を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

【利益相反のおそれがある場合の受益者への書面交付】

第 50 条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 13 条第 1 項に定める書面を交付しません

【運用報告書】

第 51 条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 14 条に定める運用報告書を交付しません。

【公告】

第 52 条 委託者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。

【信託約款に関する疑義の取扱い】

第 53 条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成 14 年 1 月 11 日

平成 14 年 3 月 25 日 変更

平成 15 年 9 月 19 日変更

平成 18 年 5 月 1 日変更

平成 19 年 9 月 30 日変更

平成 19 年 10 月 1 日変更

平成 19 年 11 月 30 日変更

平成 20 年 5 月 16 日変更

平成 20 年 7 月 1 日変更

平成 21 年 6 月 30 日変更

平成 24 年 4 月 1 日変更

平成 25 年 1 月 4 日変更

平成 26 年 12 月 1 日変更

平成 28 年 4 月 28 日変更

平成 28 年 5 月 31 日変更

平成 29 年 8 月 22 日変更

平成 30 年 3 月 1 日変更

令和 5 年 2 月 28 日変更

委託者 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

受託者 三井住友信託銀行株式会社

(付則)

第1条 第19条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日からの一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第2条 第19条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

親投資信託

外国債券インデックス・マザー・ファンド

約

款

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

運用の基本方針

約款第13条の規定に基づき、委託者が別に定める運用の基本方針は次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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。

(2) 投資態度

- ① 公社債への投資は原則として高位を維持します。
- ② 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。
- ③ 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）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。その際の投資比率は、原則として信託財産の純資産総額の100%以内とします。また、投資比率がこの上限を超過した場合には、速やかに調整するものとします。なお、ここでいう投資比率は、現物資産の時価総額と有価証券先物等の買建玉の時価総額の合計額から売建玉の時価総額を差引いた額の、純資産総額に対する比率をいいます。
- ④ 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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。

(3) 運用制限

- ① 公社債の投資割合には制限を設けません。
- ② 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。
- ③ 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ④ 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。
- ⑤ 有価証券先物取引等は、約款15条の範囲で行います。

- ⑥ スワップ取引は、約款16条の範囲で行います。
- ⑦ 金利先渡取引及び為替先渡取引は、約款17条の範囲で行います。
- ⑧ 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。

親投資信託
外国債券インデックス・マザー・ファンド
約 款

(信託の種類、委託者および受託者)

第1条 この信託は、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする証券投資信託であり、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を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

- ② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。
- ③ 第1項の受託者は、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

(信託の目的、金額および追加信託の限度額)

第2条 委託者は、金15億530万円を受益者のために利殖する目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

- ② 委託者は、受託者と合意のうえ金2兆円を限度として信託金を追加することができるものとし、追加信託が行なわれたときは、受託者は、その引き受けを証する書面を委託者に交付します。
- ③ 委託者は、受託者と合意のうえ、第2項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第3条 この信託の期間は、信託契約締結日から第39条第1項および第2項、第42条第1項、第43条第1項、第45条第2項の規定による信託終了日または信託契約解約の日までとします。

(受益証券の取得申込みの勧誘の種類)

第4条 この信託にかかる受益証券の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第2号イに掲げる場合に該当する勧誘のうち、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第9項第1号で定める適格機関投資家私募により行われます。

(受益者)

第5条 この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を投資対象とするステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の証券投資信託（以下「ベビー・ファンド」といいます。）の受託者である信託業務を営む銀行とします。

(受益権の分割および再分割)

第6条 委託者は、第2条第1項に規定する信託によって生じた受益権については、これを20億口を上限とし、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど、第7条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

- ② 委託者は、受託者と協議の上、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

(追加信託金の計算方法)

第7条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該基準価額に0.05%の率を乗じて得た額を追加信託時の信託財産留保額として加算した価額に、当該追加信託にかかる受益権口数を乗じた額とします。

- ② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保代用有価証券および第20条に規定する借入有価証券を除きます）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

(以下「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

- ③ 信託財産に属する外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。)、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- ④ 第22条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

(追加日時の異なる受益権の内容)

第8条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益証券の発行および種類)

第9条 委託者は、第6条第1項の規定により分割された受益権を表示する記名式受益証券を発行します。

- ② 委託者が発行する受益証券は、1口の整数倍の口数を表示した受益証券とします。
- ③ 受益者は当該受益証券を他に譲渡することはできません。

(受益証券の発行についての受託者の認証)

第10条 委託者は、前条の規定により、受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

- ② 前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行います。

(投資の対象とする資産の種類)

第11条 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。)
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限りません。)
 - ハ. 金銭債権
 - ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

(運用の指図範囲等)

第12条 委託者は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

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

定めるものをいいます。)

9. 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号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前号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、第1号の証券または証書、第12号および第17号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、第2号から第6号までの証券ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。
- ② 委託者は、信託金を、前項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
 - ③ 第1項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、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、前項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。
 - ④ 委託者は、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。
 - ⑤ 委託者は、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。

（運用の基本方針）

第13条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

（投資する株式等の範囲）

第14条 委託者が投資することを指図する株式は、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、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を「金融商品取引所」といい、金融商品取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「取引所」もしくは「証券取引所」といいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび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（上場予定で目論見書等において上場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割当による取得する株式については、この限りではありません。

（先物取引等の運用指図）

第15条 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。）。

- ② 委託者は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引並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。
- ③ 委託者は、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。

（スワップ取引の運用指図）

第16条 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった通貨、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。

- ② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期間が、原則として第3条に定める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。
- ③ スワップ取引の指図にあたっては、当該取引信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下同じ。）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、委託者は速やかに、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。
- ④ 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。
- ⑤ 委託者は、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。

（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）

第17条 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡し取引および為替先渡し取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第3条に定める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。
- ③ 金利先渡し取引および為替先渡し取引の評価は、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。
- ④ 委託者は、金利先渡し取引および為替先渡し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。

(デリバティブ取引等にかかる投資制限)

第17条の2 委託者は、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人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。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第18条委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

- 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- ② 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部解約を指図するものとします。
- ③ 委託者は、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。

(公社債の空売りの指図範囲)

第19条 委託者は、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。

- ② 前項の売り付けの指図は、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。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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。

(公社債の借入れ)

第20条 委託者は、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られた時は、担保の提供の指図を行うものとします。

- ② 前項の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を決済するための指図をするものとします。
- ④ 第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第21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。

(外国為替予約取引の指図および範囲)

第22条 委託者は、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。

- ② 前項の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ③ 前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者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しますものとします。

(保管業務の委任)

第23条 受託者は、委託者と協議の上、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

(有価証券の保管)

第24条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

(混蔵寄託)

第25条 金融機関または第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

(一括登録)

第26条 信託財産に属する国債証券のうち振替決済に係る国債証券については、日本銀行で保管することがあります。この場合、日本銀行においては日本銀行名義で一括登録することがあります。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第27条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をしますものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(有価証券の売却等の指図)

第28条 委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第29条 委託者は、前条の規定による売却代金、有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(損益の帰属)

第30条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第31条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(計算期間)

第32条 この信託の計算期間は、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。ただし、第1計算期間は平成13年3月14日から平成14年2月20日までとします。

- ② 前項の規定にかかわらず、前項の原則により計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(信託財産に関する報告)

第33条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

(信託事務の諸費用)

第34条 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者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。

- ② 第1項に定める信託事務の処理等に要する諸費用のうち、ベビー・ファンドに関連して生じたものについては、委託者はこれをこの信託に関連して生じたものではないとみなすことができます。

(信託報酬)

第35条 委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を受領しません。

(利益の留保)

第36条 信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産に留保し、期中には分配を行いません。

(追加信託金および一部解約金の計理処理)

第37条 追加信託金または信託の一部解約金は、当該金額と元本に相当する金額との差額を、追加信託にあっては追加信託差金、信託の一部解約にあっては解約差金として処理します。

(一部解約)

第38条 委託者は、受益者の請求があった場合には、信託の一部を解約します。

- ② 前項の一部解約の価額は、一部解約実行日の前営業日の基準価額から、当該基準価額に0.05%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額に、当該解約にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

(信託契約の解約)

- 第39条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために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、受託者と合意のうえ、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、委託者は、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。
- ② 委託者は、この信託の受益証券を投資対象とすることを信託約款において定めるすべての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、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。
- ③ 委託者は、前2項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ④ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ⑤ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
- ⑥ 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ⑦ 第4項から前項までの規定は、第2項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合には適用しません。

(償還金の委託者への交付と支払に関する受託者の免責)

- 第40条 受託者は、信託が終了したときは、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。）の全額を委託者に交付します。
- ② 受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払につき、その責に任じません。

(償還金に関する支払時期)

- 第41条 委託者は、受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引換えに、当該償還金を受益者に支払います。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

- 第42条 委託者は、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。
- ② 委託者は、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、第46条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

- 第43条 委託者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、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ② 前項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者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、第46条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第44条 委託者は、投資信託委託業者の事業の全部または一部を譲渡することがあります。また、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡されることがあります。

② 委託者は、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。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第45条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第46条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更)

第46条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更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。

② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第47条 第39条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第39条第4項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己の有する受益証券を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

(利益相反のおそれがある場合の受益者への書面交付)

第48条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第13条第1項に定める書面を交付しません。

(運用報告書)

第49条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条に定める運用報告書を交付しません。

(公 告)

第50条 委託者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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第51条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成 13 年 3 月 14 日
平成 13 年 10 月 2 日 変更
平成 14 年 3 月 25 日 変更
平成 14 年 4 月 1 日 変更
平成 15 年 9 月 19 日 変更
平成 16 年 4 月 5 日 変更
平成 17 年 7 月 1 日 変更
平成 17 年 10 月 1 日 変更
平成 18 年 5 月 1 日 変更
平成 19 年 9 月 30 日 変更
平成 19 年 10 月 1 日 変更
平成 19 年 11 月 30 日 変更
平成 20 年 5 月 16 日 変更
平成 20 年 7 月 1 日 変更
平成 21 年 6 月 30 日 変更
平成 24 年 4 月 1 日 変更
平成 25 年 1 月 4 日 変更
平成 26 年 5 月 20 日 変更
平成 26 年 12 月 1 日 変更
平成 28 年 4 月 28 日 変更
平成 28 年 5 月 31 日 変更
平成 30 年 5 月 19 日 変更
令和 5 年 11 月 21 日 変更

委託者 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

受託者 三井住友信託銀行株式会社

(付則)

第1条 第17条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日からの一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第2条 第17条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日にお

ける当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。