【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年10月12日提出
【計算期間】	第3期(自 2020年7月11日至 2021年7月12日)
【ファンド名】	コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田　賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長　民野　誠
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

＜信託金限度額＞

上限　1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信、その他資産（バンクローン、デリバティブ、為替予約取引等））資産配分変更型）） 資産複合 （　　） 資産配分 固定型 資産配分 変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル （日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり （部分ヘッジ） なし	日経225 ＴＯＰＩＸ その他 （　　）	ブル・ベア型 条件付運用型 ロング・ショート型/絶対収益追求型 その他 （　　）

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

す。

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

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

(1)単位型投信…当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。

(2)追加型投信…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

［投資対象地域による区分］

(1)国内…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2)海外…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)内外…目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

(1)株式…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2)債券…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)不動産投信(リート)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)その他資産…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。

(5)資産複合…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［独立した区分］

(1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。

(2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。

(3)ETF…投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

［補足分類］

(1)インデックス型…目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

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

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

(1)株式

①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

③社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

②資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

［決算頻度による属性区分］

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

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

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

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

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

いう。

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

(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

(5)アジア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(6)オセアニア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

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

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

(10)エマージング…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

(1)ファミリーファンド…目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。

(2)ファンド・オブ・ファンズ…「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]

(1)為替ヘッジあり…目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

(2)為替ヘッジなし…目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

(1)日経225

(2)TOPIX

(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]

(1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。

(2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。

(3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

(4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

＜ファンドの特色＞

1. 長期分散投資により、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指します。

●投資対象ファンドを通じて、国内外の株式・債券といった様々な資産に分散投資し、これらをうまく組み合わせることで中長期的に安定した収益の獲得を目指します。

●今後も先進国の安定成長と新興国の高い経済成長が見込まれることから、投資対象の多様化により、世界経済の成長果実をじっくりと享受することを目指します。

2. 短期的な下振れリスクの抑制を目指します。

●保有資産の価値を守り、収益を安定させるために、市場の下落局面でも損失の抑制や収益の獲得を目指します。

●市場の下振れリスクに伴う保有資産の価値の減少を抑制するために、投資対象ファンドを通じてヘッジファンド※1等に投資し、オルタナティブ運用※2を行います。

※1 実質的に金利、為替、株式、債券、商品等に対して裁定取引やデリバティブ取引等の様々な手法を活用してリスクを回避しながら利益を追求するファンドを指します。

※2 株式や債券等の伝統的資産とは異なる資産への投資を言います。具体的な投資対象は、リート、バンクローン、コモディティ、ヘッジファンド等があり、一般に株式や債券等との価格連動性（相関性）が低く、分散投資効果があるとされています。なお、オルタナティブ運用では、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指した運用を行うこともあります。

3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

●各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の値動きの関係（相関関係）、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。また、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合の定期的な見直しを行うほか、市場環境等の変化に応じた機動的な調整を行います。

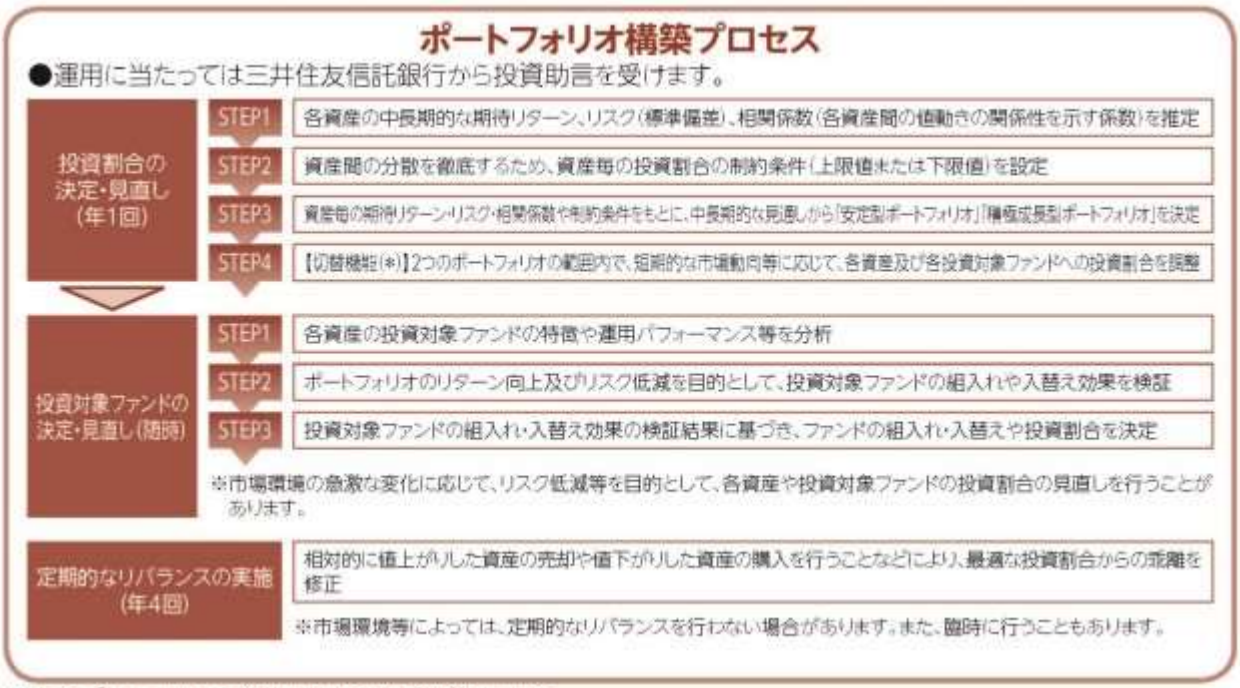
●投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、投資対象とする資産及びファンドを限定していません。また、それらへの投資割合も予め定めているものでもありません。
従って、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資割合を変更する運用を行います。

●「株式」、「リート」、「コモディティ」を実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、90%未満とします。

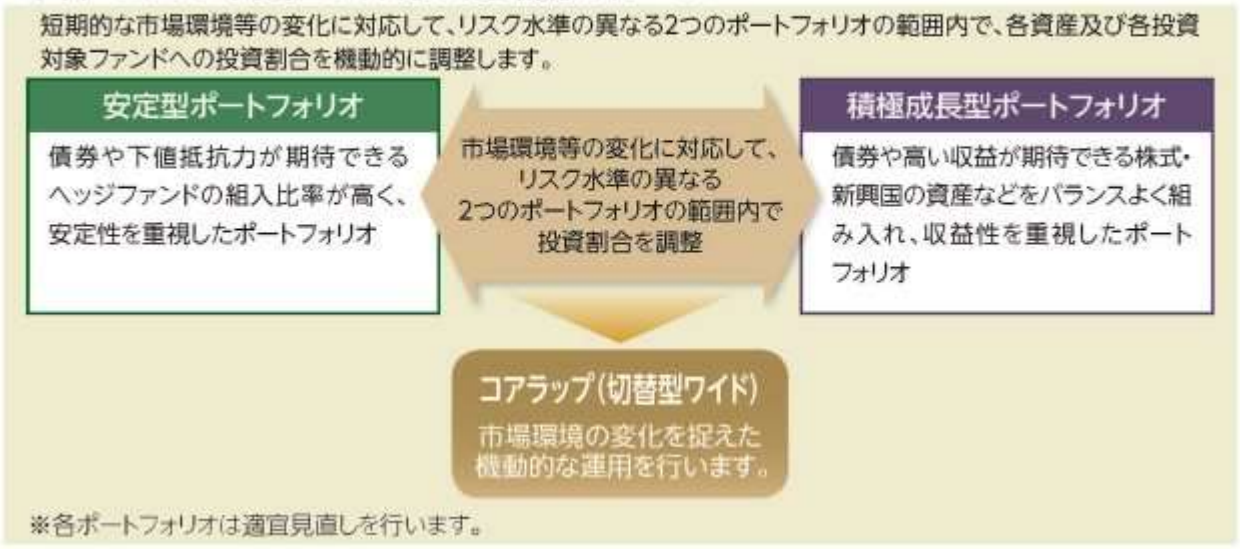
※当該投資割合には、ヘッジファンドに投資する投資対象ファンドが含まれていないため、ヘッジファンドへの投資割合が高くなる可能性があります。ヘッジファンドには特有のリスクがありますので、後掲「3　投資リスク　(1)ファンドのリスク　⑩ヘッジファンドの運用手法に係るリスク」を十分にお読みください。

●市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

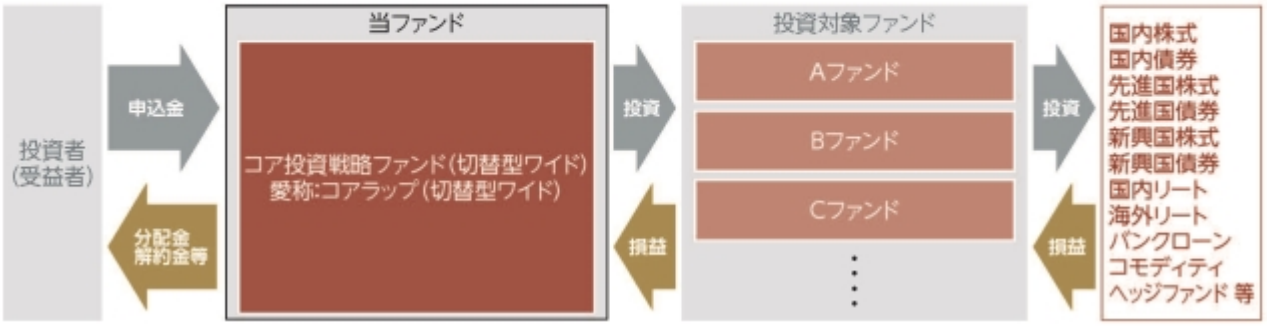
<(*)「コアラップ（切替型ワイド）」の切替機能のイメージ>



※各ポートフォリオは適宜見直しを行います。

ファンドのしくみ

ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



※投資対象ファンドの概要につきましては、後掲「２　投資方針（２）投資対象　(参考)投資対象ファンドの概要」をご参照ください。

？ ファンド・オブ・ファンズ方式とは

投資者の皆様からお預かりした資金を、直接株式や債券といった資産に投資するのではなく、株式や債券等に投資している複数の投資信託に投資して運用を行う仕組みです。

分配方針

●年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。
ただし、分配を行わないことがあります。
●分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
●株式への直接投資は行いません。
●外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
●デリバティブの直接利用は行いません。

〈ご参考情報〉

バンクローン

銀行などの金融機関が、事業拡大などのために資金調達を希望する企業などに対して行う融資(ローン)を指します。一般的に、バンクローンは投資適格未満の格付を有する企業への変動金利のローンです。

コモディティ

金や原油、穀物などの「商品」のことです。商品への投資に際しては、商品インデックスに連動する仕組み債券に投資するファンドなどがあります。

ヘッジファンド

ヘッジとは元々"回避する"という意味で、投資対象資産の価格変動に伴うリスクを回避する投資行動のことをいいます。裁定取引やデリバティブ取引(先物取引、オプション取引等)等を活用して実質的に金利・債券・株式・リート・コモディティ等に投資を行います。市場環境に関わらず収益(絶対収益)を追求するファンド※などがあります。
※特定の市場の動向に関わらず収益を追求することを目標として運用を行うファンドのことで、絶対に収益が得られるという意味ではありません。

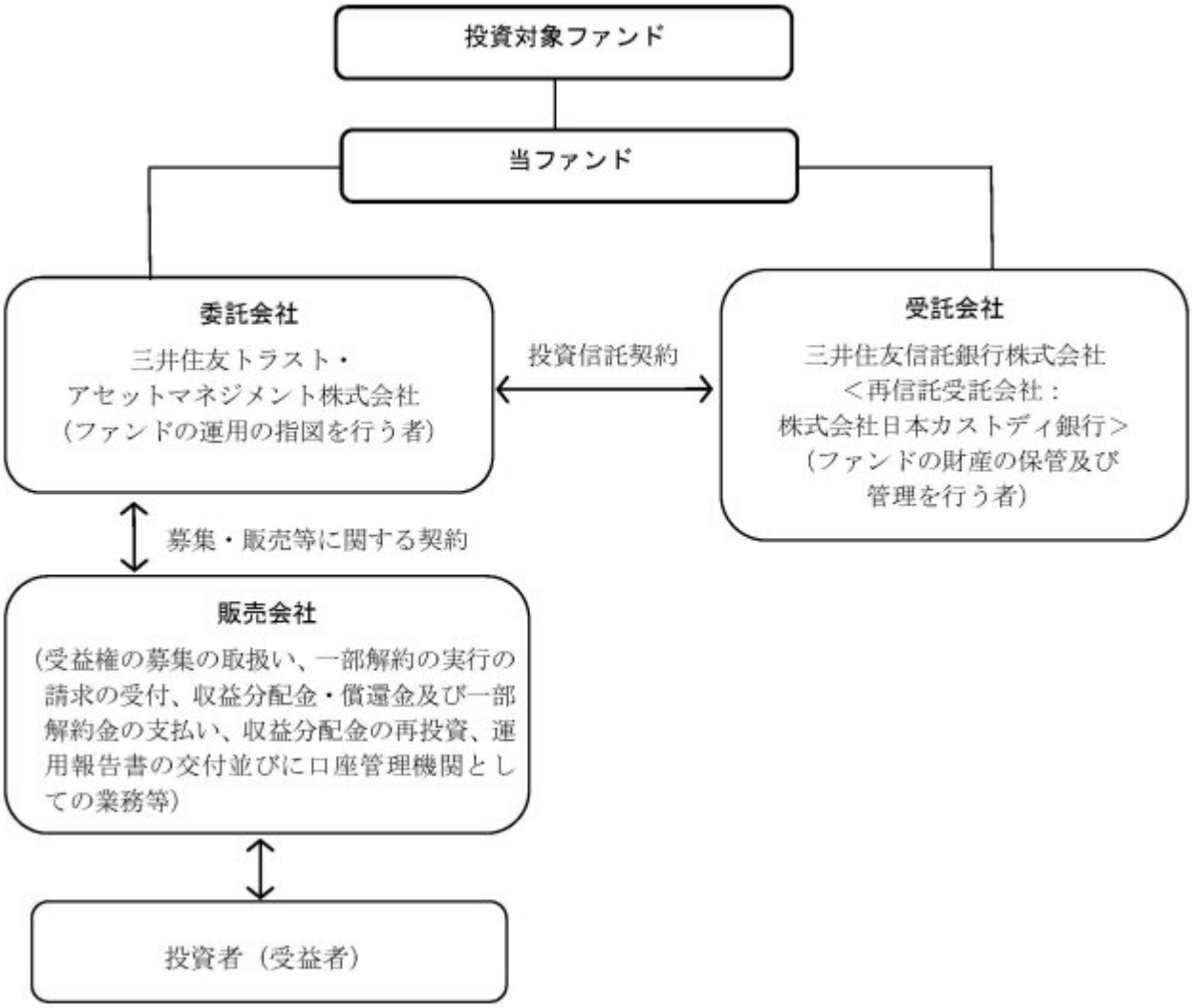
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（２）【ファンドの沿革】

2018年10月26日　　当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

（3）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2021年 7月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

1986年11月1日：	住信キャピタルマネジメント株式会社設立
1987年2月20日：	投資顧問業の登録
1987年9月9日：	投資一任契約に係る業務の認可
1990年10月1日：	住信投資顧問株式会社に商号変更
1999年2月15日：	住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
1999年3月25日：	証券投資信託委託業の認可
2007年9月30日：	金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）
2012年4月1日：	中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更
2018年10月1日：	三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

ハ．大株主の状況

株　主　名	住　　所	持株数	持株比率

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

①基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。なお、投資対象とするファンドは、当該ファンドの投資対象資産及び投資手法等を考慮して選定しております。

②投資対象

別に定める投資信託証券（以下「投資対象ファンド」という場合があります。）を主要投資対象とします。このほか、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資する場合があります。

③投資態度

イ．主として、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、国内不動産投資信託証券（以下「国内リート」といいます。）、海外不動産投資信託証券（以下「海外リート」といいます。）、貸付債権（以下「バンクローン」といいます。）、コモディティ[*1]、ヘッジファンド[*2]及びその他の様々な資産を実質的な投資対象とする投資対象ファンドに分散投資します。

＊1：コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的にコモディティリンク債券やコモディティ関連デリバティブ等を活用するファンドを指します。

＊2：ヘッジファンドを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的に金利、債券、株式、リート、為替、コモディティ等に対する裁定取引やデリバティブ取引等を積極的に活用するファンド、又は各種ヘッジファンド指数に概ね連動する投資成果を目標とするファンドを指します。

ロ．各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の相関係数、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じても機動的に調整を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。

※投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

ハ．国内株式、先進国株式、新興国株式、国内リート、海外リート、コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、90%未満とします。なお、市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。

ニ．投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されたり、新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。

ホ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

ヘ．当ファンドでは原則として為替ヘッジを行いません。ただし、外貨建資産について為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れる場合があります。

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

（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。

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

1. 有価証券
2. 金銭債権
3. 約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

②有価証券の指図範囲

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

1.コマーシャル・ペーパー及び短期社債等
2.外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前号の証券の性質を有するもの
3.国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（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の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）
4.外国法人が発行する譲渡性預金証書
5.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。）

なお、第3号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

③金融商品の指図範囲

イ．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（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

ロ．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は、委託会社は、信託金を上記イ．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当ファンドが、当ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性のある投資対象ファンドの概要は、下記「（参考）投資対象ファンドの概要」に記載されている通りです。

（参考）投資対象ファンドの概要

・全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。
・投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

以下の内容は、2021年 7月30日（（★）のファンドに関しては2021年 9月24日、（★★）のファンドに関しては2021年 9月30日）現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。
なお、投資対象ファンドの運用会社より確認した情報をもとにしており、記載している定義は、当該ファンドに限定されます。

1.国内株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（※）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場されている株式
投資態度	①原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。 ③投資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、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④ただし、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投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 ⑤投資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、国内外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を行うことができます。

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新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。 ⑤同一銘柄の転換社債、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。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ⑧前各号の規定にかかわらず、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投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引およ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、投資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。
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。

①同指数の指数値及び同指数の商標は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利・ノウハウ及び同指数の商標に関する全ての権利は東証が有しています。

②東証は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止又は同指数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東証は、同指数の指数値及び同指数の商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指

数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

④東証は、同指数の指数値及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、東証は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

⑤当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

⑥東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。

⑦東証は、当社又は当ファンドの購入者のニーズを、同指数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以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

・2022年4月4日に東京証券取引所（以下「東証」といいます。）は、「市場第一部・市場第二部・マザーズ・JASDAQ（スタンダード・グロース）」の4つの市場区分を「プライム市場・スタンダード市場・グロース市場」の3つの市場区分に見直すこととしております。これに伴い東証の市場区分に関する記載内容を変更する予定です。詳細は日本取引所グループのホームページをご確認ください。

2.国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	**日興アセットマネジメント株式会社**
運用の基本方針	**この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数）（※））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。**
主要投資対象	**アクティブバリュー マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。**
投資態度	**主として、マザーファンド受益証券に投資を行ない、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。** **マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。** **株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。** **ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、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できない場合があります。**

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。）への実質投資割合には、制限を設けません。 ②投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行ないません。 ④一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取引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。 ⑤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の定めるところに従い、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ないものとします。
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：10月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	①分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 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、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。 ③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.517%（税抜　0.47%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年9月28日
信託期間	2018年9月28日から2028年10月25日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

・2022年4月4日に東京証券取引所（以下「東証」といいます。）は、「市場第一部・市場第二部・マザーズ・JASDAQ（スタンダード・グロース）」の4つの市場区分を「プライム市場・スタンダード市場・グロース市場」の3つの市場区分に見直すこととしております。これに伴い東証の市場区分に関する記載内容を変更する予定です。詳細は日本取引所グループのホームページをご確認ください。

3.国内債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合（※）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債

投資態度	①NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。 ⑤投資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、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。
主な投資制限	①同一銘柄の転換社債、並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（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は、行いません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤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、投資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。
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限

受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

4.日本債券ツイン戦略マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債
投資態度	①わが国の公社債に投資しつつ、国債先物取引及び国債に係る選択権付債券売買取引を行うことでNOMURA-BPI総合（※）を上回る投資成果を目指します。 ②ポートフォリオは、クレジット戦略に基づいて事業債を中心とした銘柄選択を行い、金利戦略に基づいてデュレーション等を調整しながら構築します。なお、金利戦略においては、国債先物取引や国債に係る選択権付債券売買取引を活用します。 ③公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。 ④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）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、投資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。
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
決算日	年1回：2月21日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月18日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

5.FOFs用世界物価連動債ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

主要投資対象	日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）に投資する「世界物価連動債マザーファンド　為替ヘッジあり」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界のインフレ連動国債等に直接投資することもあります。
投資態度	①マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）に投資し、ブルームバーグ世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）（※）に連動する投資成果を目指します。 ②インフレ連動国債（物価連動国債）への実質投資割合は、原則として高位を維持します。 ③実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。 ④運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）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、投資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。
ベンチマーク	ブルームバーグ世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）
決算日	年1回：1月17日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額については、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。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜　0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年3月31日
信託期間	原則として2017年3月31日から2027年1月18日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「ブルームバーグ世界インフレ連動国債インデックス」とは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社が開発、算出、公表を行うインデックスであり、世界の物価連動国債市場のパフォーマンスを表します。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。

Bloomberg(R) およびブルームバーグ世界インフレ連動国債インデックスは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー、および同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limitedをはじめとする関連会社のサービスマークであり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。

6.マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	マニュライフ・インベストメント・マネジメント株式会社
運用の基本方針	主としてわが国の公社債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主としてマニュライフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）受益証券に投資します。なお、コマーシャル・ペーパーなど短期金融商品等に直接投資する場合があります。
投資態度	①マザーファンド受益証券を主たる投資対象とします。 ②NOMURA-BPI総合（※）を参考指数として、ユーロ円債を含む円建て公社債のうち、主として投資適格債券に実質的に投資することによって、中長期的に同指標を上回る運用を目指します。 ③マザーファンドの受益証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 ④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等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行われないことがあります。

主な投資制限	①債券への実質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有価証券先物取引等の直接利用は行いません。 ④投資信託証券（マザーファンド受益証券を除く）への投資は行いません。 ⑤一般社団法人投資信託協会の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10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の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。 ⑥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。 ⑦同一銘柄の株式、転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑧信用取引、空売り、有価証券の借入れは行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：3月5日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託者が基準価額の水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。 ③留保益（収益分配に充てず信託財産内に留保した利益）については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。
信託報酬	毎年3月および9月の最終営業日における日本相互証券株式会社の発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下の通りとし、当該最終営業日の翌月の21日以降で、前日が営業日である最初の営業日から適用するものとします。 新発10年固定利付国債の利回り　　信託報酬 0.5%未満の場合・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.264%（税抜　0.24%） 0.5%以上１%未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率0.297%（税抜　0.27%） １%以上の場合　・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.33%（税抜　0.3%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。
同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確

性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

7.明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）（★★）

運用会社	明治安田アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主として、邦貨建ての国債、政府保証債、地方債、利付金融債、社債等に実質的に投資し、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	明治安田日本債券アクティブ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」ということがあります）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、邦貨建ての国債、政府保証債、地方債、利付金融債、社債等へ分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目指します。 ②NOMURA-BPI総合（※）をベンチマークとしてこれを中長期的に上回る投資成果を目指します。 ③信用リスクの低減を図るため、原則として取得時に信用ある格付会社によるBBB格相当以上の格付を有する公社債およびそれと同等の信用度を有すると判断した公社債に投資します。 ④債券市場は、長期的には経済のファンダメンタルズによって変動するという考えを基本としファンダメンタルズ分析を重視したアクティブ運用を行います。 ⑤マクロ経済分析をベースとした金利の方向性予測等に基づき、市況動向やリスク分散等を勘案して、デュレーションの調整、イールドカーブポジショニングのコントロールを行います。 ⑥公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。 ⑦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。

主な投資制限	①株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③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。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑦外貨建資産への投資は行いません。 ⑧デリバティブ取引等は、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行うことができます。 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うこととします。
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
決算日	年1回：5月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、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、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 ③収益分配金にあてず信託財産内に留保した利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。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.264%以内（税抜　0.24%以内）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年9月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「NOMURA-BPI総合」は、日本国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村證券株式会社の知的財産です。野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し一切責任はありません。

8.外国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）（※）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

主要投資対象	**原則として、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式**
投資態度	**①原則としてMSCIコクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。** **②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。** **③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。** **④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。** **⑤有価証券等の価格変動リスク及び為替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、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。** **⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。** **⑦投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。** **⑧投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。**

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割合には制限を設けません。 ③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑤同一銘柄の転換社債、並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（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資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。
ベンチマーク	MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

9.グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント株式会社
運用の基本方針	投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行うことを基本とします。

主要投資対象	グローバル・フランチャイズ・マザーファンドⅢ（以下、「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目指します。 ②有力な無形資産（特許、著作権、ブランド等）を有し、中長期的に株主価値の高い成長をもたらすことが期待される企業を厳選して投資を行います。 ③実質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資金状況、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合もあります。
主な投資制限	①株式の実質投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産の実質投資割合には制限を設けません。 ③新株引受権証券並びに新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ④同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑤同一銘柄の新株引受権証券並びに新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑦デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。 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及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ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うこととします。 ⑨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の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年１回：4月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額は、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合には委託者の判断で分配を行わないことがあります。 ③収益の分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.814%（税抜0.74%） マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬は、委託者との間で別に定める取決めに基づく金額を、委託者から支払うものとします。
信託財産留保額	該当事項はありません。

設定日	2020年3月25日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

10.ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）（★）

運用会社	フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主に「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券に投資することにより、信託財産の長期的な成長を目指します。
主要投資対象	「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券を主要投資対象とします。
投資態度	①「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目指します。 ②MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、円換算ベース）（※）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。ただし、この目標の達成を約束するものではありません。 ③「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ④資金動向や市場動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主として、日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券に投資を行います。 ②MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。ただし、この目標の達成を約束するものではありません。 ③マクロ分析に基づくトップダウンの投資判断と、ボトムアップの個別銘柄分析に基づく銘柄選択を合わせて、本源的価値に比べて割安と判断される銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築します。 ④原則として対円での為替ヘッジを行いません。ただし、見通しに基づいて米ドルを基準として相対的な魅力度を判断して、外国為替の予約取引等を通じて個別株式選択の結果とは異なる通貨配分とする場合があります。 ⑤資金動向や市場動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ⑥運用の指図に関する権限を投資顧問会社であるブランディワイン・グローバル・インベストメント・マネジメント・エルエルシーに委託します。

主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。 ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ④同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約券証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ⑤同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ⑥投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑧為替予約の利用及びデリバティブの使用は、ヘッジ目的に限定しません。 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及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、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。
ベンチマーク	MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)
決算日	年1回：9月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	原則、毎決算時に分配を行います。 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。 ※分配金は、決算日から起算して５営業日以内に支払われます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.671%（税抜　0.61%） このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の0.05%を上限）をファンドから支弁します。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年9月24日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を含む世界の主要先進国・新興国の株式で構成されています。MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、円換算ベース）は、MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、ドルベース）をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権は、全てMSCI Inc.に帰属します。MSCI Inc.では、かかるデータに基づく投資による損失に一切責任を負いません。

11.Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL

投資顧問会社	キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー
運用の基本方針	投資信託財産の長期的な成長を目指します。
主要投資対象	世界各国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	①主として世界各国の金融商品取引所（これに準ずるものを含みます。）に上場され、またはその他の規制ある市場で取引されている株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目標とします。 ②市場動向によっては、非上場株式及び債券等に投資を行う場合があります。 ③市況動向、資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①原則として同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②原則として同一銘柄の転換社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③原則として同一銘柄の新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④純資産総額の10%を超えての借入れは、行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年12月31日
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	年率0.525% その他の費用 ファンド管理費用：上限年率0.15% その他、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料及びデリバティブ取引に要する費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年11月7日
信託期間	無期限
関係法人	・管理会社 キャピタル・インターナショナル・マネジメント・カンパニー・エス・エイ・アール・エル ・投資顧問会社 キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー ・管理事務代行会社 J.P.モルガン・バンク・ルクセンブルク・エス・エイ ・名義書換事務受託会社 J.P.モルガン・バンク・ルクセンブルク・エス・エイ ・保管受託銀行 J.P.モルガン・バンク・ルクセンブルク・エス・エイ

12.外国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）（※）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債
投資態度	①FTSE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、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 ④有価証券等の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及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。 ⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。 ⑥投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

主な投資制限	①同一銘柄の転換社債、並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（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%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。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤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、投資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。
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）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

13.フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	フィデリティ投信株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行ないます。
主要投資対象	フィデリティ・外国債券・マザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。

投資態度	①フィデリティ・外国債券・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、世界各国の投資適格債券（除く日本円）を主要な投資対象とし、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を目的として運用を行ないます。 ②実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行ないません。 ③資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。
主な投資制限	①株式への実質的な直接投資は、原則として行ないません。ただし、転換社債の転換ならびに新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものを除きます。 ②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ④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。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ⑤一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投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：4月30日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。 ①分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、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、必ず分配を行なうものではありません。 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ないます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.451%（税抜0.41%）
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0.1%の率を乗じて得た額
設定日	2021年7月16日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社

14.新興国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）（※）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

主要投資対象	取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）
投資態度	①主として、取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。 ②株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。 ③組入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。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、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、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。 ⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式（新株引受権証券及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外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資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。
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月12日
信託期間	原則として無期限

受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「MSCI エマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

15.Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J

運用会社	Wellington Management Company LLP
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	金融商品取引所等に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。 ＊この投資信託においては、新興国に所在する企業のほか、新興国に資産を保有している企業、新興国で生産された商品・サービスによる収入の割合が高い企業、新興国に対する商品・サービスの販売による収入の割合が高い企業等にも投資します。
投資態度	①MSCIエマージング・マーケット・インデックス（※）の騰落率を上回る投資成果を追求します。 ②ポートフォリオは、カントリー・アロケーションおよび業種別アナリストの個別銘柄選択による、ファンダメンタルズ分析に基づくボトム・アップ・アプローチで構築します。 ③株式への投資割合は、原則として高位を維持します。 ④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。 ⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ②投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。 ③投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。 ④運用会社が他に運用する投資信託の保有分を合算して、いずれか一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。 ⑤流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。 ⑥受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス
決算日	毎年12月31日
収益の分配	該当事項はありません。

信託報酬	年率0.8%以内 なお、この報酬率には投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が含まれます。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年5月30日
信託期間	原則として無期限
関係法人	・管理会社（マネージメントカンパニー） Wellington Luxembourg S.a r.l. ・運用会社（インベストメントマネージャー） Wellington Management Company LLP ・預託機関（デポジタリー） State Street Bank International GMBH, Luxembourg Branch ・管理事務代行会社（アドミニストレーター） State Street Bank International GMBH, Luxembourg Branch ・名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） State Street Bank International GMBH, Luxembourg Branch

※「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

16.新興国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）（※）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	新興国の債券

投資態度	①主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。 ②組入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投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、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、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。 ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は行いません。 ②同一銘柄の転換社債、並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（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資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。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤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、投資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。
ベンチマーク	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月11日

信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド」とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

17.FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として日本を含む世界各国の債券（国債、州政府債、政府保証債、国際機関債等をいいます。以下同じ。）に投資する世界ハイインカム入替戦略マザーファンド　為替ヘッジあり（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を含む世界各国の債券に直接投資することもあります。
投資態度	①マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を含む世界各国の債券に投資します。 ②ポートフォリオの構築に当たっては、主として日本を含む世界各国の債券の中から、格付、流動性、財政健全度、為替ヘッジコスト控除後の金利水準等にかかる評価・分析を行い、投資対象国及び各銘柄への実質投資割合を決定します。 ③債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。 ④実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行うことにより為替変動リスクの低減を目指します。 ⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当または社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資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実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑤外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑦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、投資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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額については、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留保金の運用については、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。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜　0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2014年10月8日
信託期間	原則として、2014年10月8日から2024年9月17日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

18.LM・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社

運用の基本方針	当ファンドは、主に「LM・ウエスタン・グローバル債券マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に日本を除く世界の公社債に実質的に投資を行うことにより、信託財産の中長期的成長を目指します。
主要投資対象	「LM・ウエスタン・グローバル債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 主に日本を除く世界の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	①LM・ウエスタン・グローバル債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。 ②ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）（※）をベンチマークとします。 ③LM・ウエスタン・グローバル債券マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。 ④資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主に、日本を除く世界の公社債に投資します。 ②ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）をベンチマークとします。 ③原則として、取得時において1社以上の格付機関から投資適格（ＢＢＢ－／Ｂａａ３）以上の長期格付けが付与された、あるいはこれに相当する信用力をもつと運用者が判断する公社債を主要な投資対象としますが、取得時において信託財産の20%を上限としてこれを下回る信用力の公社債に投資することがあります。 ④外貨建資産の為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、通貨見通しに基づいて相対的に魅力があると判断される通貨に、為替予約取引等を通じて資産配分することがあります。 ⑤資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ⑥運用の指図に関する権限を下記投資顧問会社に委託します。 ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・エルエルシー（在米国） ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド（在英国） ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ディーティーブイエム・リミターダ（在ブラジル） ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーイー・リミテッド（在シンガポール） ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーワイ・リミテッド（在オーストラリア） ウエスタン・アセット・マネジメント株式会社

主な投資制限	①株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ②新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ③同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ④投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ⑤外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑥為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。 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及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、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。
ベンチマーク	ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）
決算日	毎年10月9日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	原則、毎決算時に分配を行います。 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。 ＊分配金は、決算日から起算して5営業日以内に支払われます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.33%（税抜　0.3%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）」は、ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックスをフランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社が独自に円換算したものです。Bloomberg(R) およびブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックスは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー、および同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limitedをはじめとする関連会社のサービスマークであり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。
なお、2021年8月24日に「ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）」から「ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）」への名称変更に係る約款変更を行います。上記概要は当該約款変更後のものです。

19.J-REITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針	**この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）（※）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。**
主要投資対象	**わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券**
投資態度	**①わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。 ③投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。**

主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数(配当込み)における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 ③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（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の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。 ④外貨建資産への投資は行いません。 ⑤投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券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。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。 ⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）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、投資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。
ベンチマーク	東証REIT指数（配当込み）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「東証REIT指数（配当込み）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。

①同指数の指数値及び同指数の商標は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利・ノウハウ及び同指数の商標に関する全ての権利は東証が有しています。

②東証は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止又は同指数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東証は、同指数の指数値及び同指数の商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
④東証は、同指数の指数値及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。また東証は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
⑤当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。
⑥東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
⑦東証は、当社又は当ファンドの購入者のニーズを、同指数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以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

20.グローバルREITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）（※）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券
投資態度	①日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。 ③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。 ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 ③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（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の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。 ④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ⑤一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）」とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's(R)およびS&P(R)は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones(R)はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追随するS&P先進国REIT指数の能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。S&P先進国REIT指数に関して、S&P Dow Jones Indicesと当社との間にあ

る唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indicesまたはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および商標名のライセンス供与です。S&P先進国REIT指数は当社または当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P先進国REIT指数の決定、構成または計算において当社または当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格または数量、あるいは当ファンドの新規設定または販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P先進国REIT指数に基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追随する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。SPDJIは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P Dow Jones Indicesは、当インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる誤り、欠落または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックスまたはそれに関連するデータの商品性、特定の目的または使用への適合性、それらを使用することによって当社、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと当社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

21.グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

運用会社	**三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社**
運用の基本方針	**この投資信託は、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価格が概ね連動する米ドル建て債券（以下「米ドル建て債券」といいます。）に投資を行い、世界の様々な商品（コモディティ）市況を捉えることを目的に、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）（※）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。**
主要投資対象	**米ドル建て債券**

投資態度	①ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。 ②米ドル建て債券への投資は高位とすることを基本とします。 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投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並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、金利に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（スワップ取引）、並びに金利先渡取引を行うことができます。 ⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④同一銘柄の転換社債、並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（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑤同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 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投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。

信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年7月1日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（総称して、「ブルームバーグ」）とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index SM）および「ブルームバーグ（Bloomberg (R)）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、当社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index SM）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シーおよびその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグおよびUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューしまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index SM）に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。

22.ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 ＜別に定める金現物に投資する上場投資信託証券＞（2021年7月30日現在） iShares Gold Trust SPDR Gold Shares
投資態度	①主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。 ②投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託者の判断により見直しを行うことがあります。 ③投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%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。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）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、投資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。
ベンチマーク	ＬＢＭＡ金価格（円ヘッジベース）（※）（2021年7月30日現在） ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年10月11日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※ＬＢＭＡ金価格の正式名称は LBMA Gold Price PMといい、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）によってロンドン時間の午後に公表される1トロイオンスあたりの金現物価格（米ドル建て）を指します。なお、ＬＢＭＡは、ロンドン貴金属市場協会（London Bullion Market Association）の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。

ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）は、ＬＢＭＡ金価格及びＬＢＭＡ金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

23.BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY

管理会社	BlueBay Funds Management Company S.A.
運用の基本方針	主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。

主要投資対象	わが国を含む世界の投資適格債券を主要投資対象とし、デリバティブ取引及び為替予約取引を主要取引対象とします。 なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。
投資態度	①主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。 ②ポートフォリオの構築は、買建（ロングポジション）だけでなく売建（ショートポジション）でも行います。また、債券投資の代替手段としてデリバティブ取引を活用することがあります。 ③債券の組入総額とデリバティブ取引の想定元本の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。 ⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①投資適格債券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以上とします。 ②投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年6月30日（休業日の場合は前営業日）
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	年率0.74% なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、管理会社・管理事務代行会社・名義書換事務受託会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2011年5月24日
関係法人	・管理会社 BlueBay Funds Management Company S.A. ・投資顧問会社 BlueBay Asset Management LLP ・副投資顧問会社 BlueBay Asset Management USA LLC ・管理事務代行会社／名義書換事務受託会社／保管受託銀行 Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.

24.FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

投資態度	①マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます）に投資し、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR － Diversified Alpha」（以下「PTRディバーシファイド・アルファ・ファンド」※といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。 ※PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドは、世界の株式、債券、為替等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルク籍投資信託証券です。 ②円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。 ③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）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、投資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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額については、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。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜　0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2016年1月20日
信託期間	原則として、2016年1月20日から2025年10月10日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

25.米国株式LSマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する米ドル建債券（以下「米ドル建債券」といいます。）を主要投資対象とします。
投資態度	①米ドル建債券への投資を通じて、主として米国の金融商品取引所等に上場している株式等の買建（ロングポジション）と売建（ショートポジション）を組み合わせたマーケット・ニュートラル戦略による運用※を行います。 ※米ドル建債券への投資額のうち、マーケット・ニュートラル戦略による運用に用いられない余剰資金は、原則として米ドル建MMFもしくはそれに類するもの又は米ドル建公社債、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券もしくは短期金融商品等により運用されます。 ②米ドル建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。 ④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

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投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%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。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）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、投資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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

26.コモディティLSアルファ・マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主としてブルームバーグ商品指数（※）の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数（以下、「フォワード指数」※１といいます。）の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券※2（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。 ※1この投資信託においてフォワード指数とは、ブルームバーグ商品指数と構成商品（エネルギー、穀物、非鉄、貴金属等に係る各種商品先物）及び構成比率を同一としながら、異なる限月の商品先物で構成された指数をいいます。 ※2運用効率の向上を目的として、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に一定数を乗じた数値とフォワード指数の騰落率に一定数を乗じた数値の差に基づいて償還価格が決定される円建の債券に投資することがあります。なお、この場合、夫々の指数騰落率に乗じる一定数は同値とします。

投資態度	①円建債券への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とフォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指します。 ②円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）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、投資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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年7月8日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（総称して、「ブルームバーグ」）とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index ^{SM}）および「ブルームバーグ（Bloomberg $^{(R)}$）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、当社による一定の目的で

の利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index[SM]）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シーおよびその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグおよびUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューしまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index[SM]）に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。

27.米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として米国株式イントラデイ・トレンド戦略[※1]に基づいて償還価格が決定される円建債券（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。 ※1）この投資信託において米国株式イントラデイ・トレンド戦略とは、米国株式市場の1日の取引時間中の値動き[※2]を捉えることを目的とする戦略をいいます。具体的には、一定のルールに従って株式市場が一定率以上上昇した場合には買い建てポジションを、一定率以上下落した場合には売り建てポジションを構築し、全てのポジションを当該取引日の終了時までに解消する戦略です。なお、株式市場の値動きによっては、同一日に買い建てポジションと売り建てポジションを同時に構築することや、買い建てポジションの合計額あるいは売り建てポジションの合計額が一時的に投資信託財産の純資産総額の2倍程度になることがあります。 ※2）当該戦略の参照対象は、S&P500のほかダウ・ジョーンズ工業株価平均（NYダウ）やナスダック総合指数等の株価指数、あるいはこれらの株価指数先物も含みます。
投資態度	①円建債券への投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指します。 ②円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）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、投資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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：3月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年10月6日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

28.ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	野村アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	日本成長株投資マザーファンド受益証券および野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、TOPIX（東証株価指数）を対象とした株価指数先物取引（以下、「株価指数先物取引」といいます。）を主要取引対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。

投資態度	各マザーファンド受益証券を主要投資対象、株価指数先物取引を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。 ①各マザーファンド受益証券に投資を行うとともに、株価指数先物取引を活用します。株価指数先物取引の活用にあたっては、実質的に投資する株式に対する株式市場全体の変動の影響を抑えることを目指し、株価指数先物取引の売建てを行います。各マザーファンド受益証券への投資割合および株価指数先物取引の売建ての枚数は、市場環境や各マザーファンドの特性等を考慮し、適宜調整を行うことを基本とします。 ②各マザーファンド受益証券の合計組入比率は、原則として信託財産の純資産総額の70%～90%程度を維持することを基本とします。ただし、株価指数先物取引を行うにあたって必要となる証拠金の額等によっては、上記の範囲とならない場合があります。 ③非株式割合（株式以外の資産への実質投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。 ④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。 ＜日本成長株投資マザーファンドの投資態度＞ ①わが国の株式の中から、個別企業の調査・分析等に基づいたボトムアップアプローチにより、企業の経営戦略や財務戦略などを通じて長期的な株主資本成長や利益成長が期待できる銘柄を選定します。 ②ポートフォリオの構築にあたっては、株主資本や利益等の成長率の高さ及びその継続性等に関する評価に基づき組入銘柄を決定し、バリュエーション評価（株価の割高・割安の度合い）等を勘案して組入比率を決定します。 ③株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。 ④非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。 ⑤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。 ＜野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンドの投資態度＞ ①株式への投資にあたっては、財務リスク・流動性等を考慮し、投資候補銘柄を選定した上で定量モデルにより最適化を行い、ポートフォリオのボラティリティを最小化することを目指します。 ②ポートフォリオの最適化にあたっては、業種配分、投資銘柄数、個別銘柄への投資比率、取引コスト等を勘案します。 ③株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。 ④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。

主な投資制限	①株式への実質投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ④デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。 ⑤新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ⑦同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ⑧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。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ⑨一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デリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行いません。 ⑩一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10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：12月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.506%（税抜　0.46%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額
設定日	2019年4月10日
信託期間	無期限
受託会社	野村信託銀行株式会社

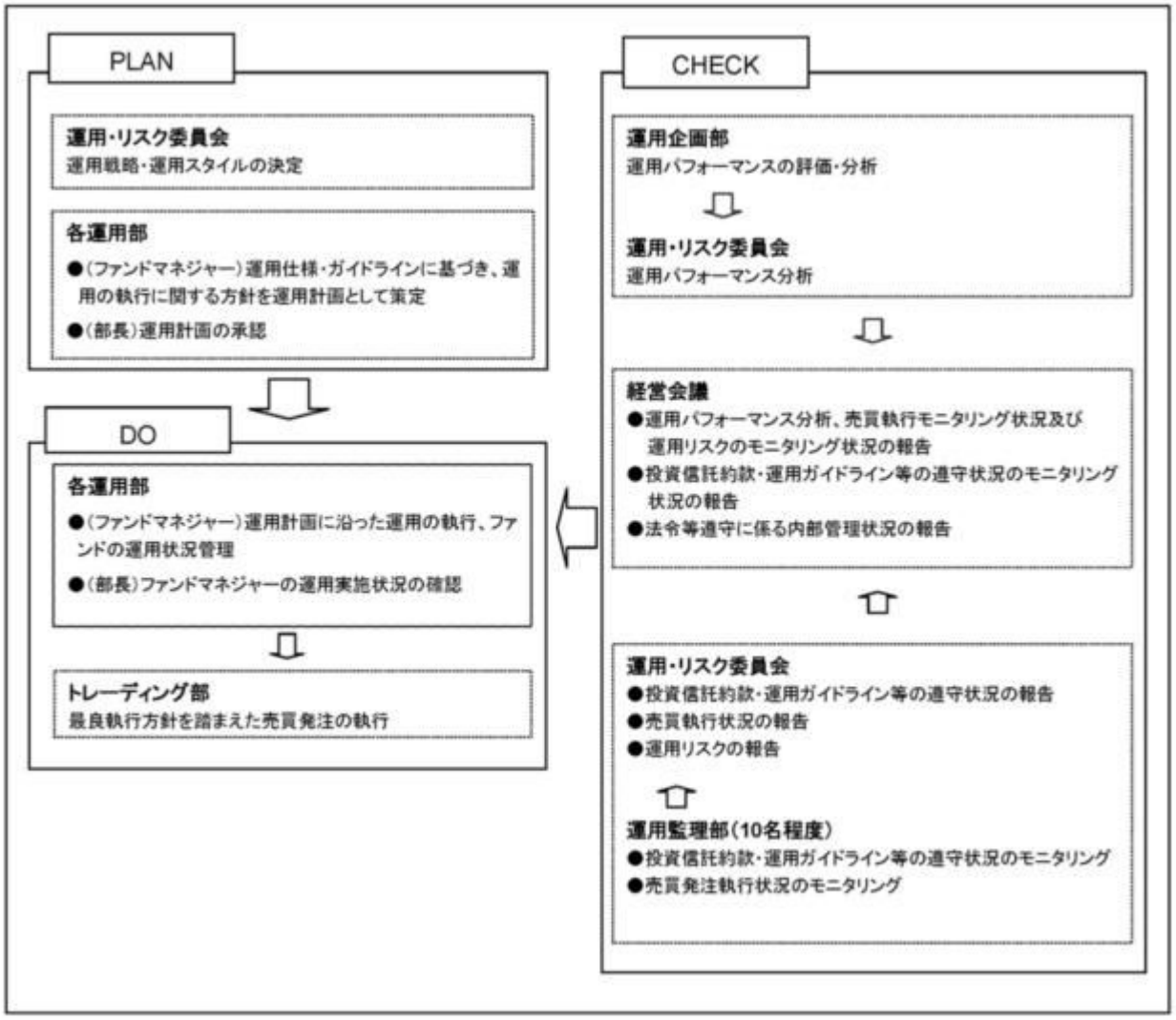
29.MA Hedge Fund Strategies Limited

運用会社	UBS O'Connor LLC
運用の基本方針	主として、公表された合併や買収案件等において、合併案件の公表買収価格と買収先企業または買収元企業の案件成立前の株価の差異を捉える等、収益を積み上げることを目指して運用を行います。
主要投資対象	主として世界各国（日本を含みます。）の企業の株式に投資を行います。なお、関連する上場デリバティブ商品等に投資を行うことがあります。

投資態度	①公表された合併・買収案件等において、買収先企業の株式を買い付け、又は買収先企業の株式を買い付けると同時に買収元企業の株式を売り建てることを基本戦略とします。なお、関連する上場デリバティブ商品等を活用することがあります。 ②ポートフォリオ構築プロセスに沿って適切な格付を付与、これに基づき確信度、リスク/リターン、ファンダメンタル要因などの分析結果に基づきポジションを決定します。 ③為替変動リスクを回避するために、原則として対円での為替ヘッジを行います。
主な投資制限	①投資法人財産を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。 ②投資法人財産の10%を超える借り入れは行いません。 ③一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。 ④流動性に欠ける資産への投資は、投資法人財産の15%以下とします。 ⑤外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ⑥一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑦投資信託証券への投資は行いません。 ⑧デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：12月31日（決算日が休日の場合は、前営業日となります。）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	運用報酬：年率0.6% 成功報酬：15% 月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月10日
関係法人	・運用会社 UBS O'Connor LLC ・保管銀行・管理事務代行会社 MUFG Alternative Fund Services (Ireland) Limited

（３）【運用体制】

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



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

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

（4）【分配方針】

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

ハ．同一銘柄の投資信託証券への投資割合

同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ニ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

ホ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

ヘ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資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たときは、担保の提供の指図を行うものとします。

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

（ハ）投資信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の借入れに係る公社債の時価総額が投資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。

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ト．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

チ．外国為替予約取引の指図

委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

リ．資金の借入れ

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

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資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投資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、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

（ハ）収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資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。

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

ヌ．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクス

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

＜その他の投資制限＞

イ．当ファンドでは直接デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引及び選択権付債券売買を含みます。）は行いませんが、投資対象とする投資信託でデリバティブ取引等を行う場合、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、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

●当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様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。

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①株価変動リスク

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

②金利変動リスク

債券、バンクローン等の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。なお、債券、バンクローン等が変動金利である場合、こうした金利変動による価格の変動は固定金利の場合と比べて小さくなる傾向があります。また、発行者・債務者等の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。加えて、物価連動債券の価格は、物価変動及び将来の物価変動に対する市場予想の変化によっても変動します。債券、バンクローン等の価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

③リートの価格変動リスク

リートの価格は、不動産市況（不動産稼働率、賃貸料、不動産価格等）、金利変動、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。また、リート及びリートの運用会社の業績、財務状況の変化等により価格が変動し、基準価額の変動要因となります。

④商品（コモディティ）の価格変動リスク

商品の価格は、需給関係や為替、金利変動等の様々な要因により大きく変動します。需給関係は、天候、作況、生産国（産出国）の政治、経済、社会情勢の変化等の影響を大きく受けます。商品価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

⑤為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。なお、投資対象ファンドにおいて、外貨建資産について、為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図る場合がありますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の

金利差相当分のコストがかかりますが、さらに需給要因等によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があることにご留意ください。

⑥信用リスク

有価証券等の発行体等が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券等の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。相対的に格付が低い発行体等の有価証券等に投資する際には、信用度に関するマーケットの考え方の変化の影響をより大きく受ける可能性があり、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなるリスクがより高いものになると想定されます。

⑦流動性リスク

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

⑧カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。また、新興国への投資は先進国に比べ、上記のリスクが高まる可能性があります。

⑨資産等の選定・配分に係るリスク

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資比率を変更します。この投資行動が、ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、損失が発生する要因となる場合があります。

また、投資対象とする資産やファンドの追加に伴い、新たな投資リスクが生じる可能性があります。

⑩ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的に現物有価証券、デリバティブや為替予約取引等の買建てや売建てによりポートフォリオを組成することがあり、買い建てている対象が下落した場合もしくは売り建てている対象が上昇した場合に損失が発生し、ファンドの基準価額が影響を受け、投資元本を割り込むことがあります。また、投資対象ファンドの純資産総額を上回る買建て、売建てを行う場合があるため、投資対象ファンドの基準価額は現物有価証券に投資する場合と比べ大きく変動することがあり、投資元本を割り込むことがあります。

ヘッジファンドのパフォーマンスは、通常、運用者の運用能力に大きく依存することになるため、市場の動向に関わらず、損失が発生する可能性があります。

⑪仕組み債券に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、特定の対象（指数やファンド等）の値動きに概ね連動する投資成果を目指す仕組み債券を活用する場合がありますが、投資対象ファンドが、特定の対象と連動することを保証するものではありません。

また、仕組み債券の価格は取引に関わる関係法人の財務状況等及びそれらに関する外部評価等、市場や経済環境の悪化や混乱、また概ね連動を目指すファンドの流動性の制約等により変動し、あるいは債券取引が一部不可能となる等、概ね連動を目指す対象と大きく乖離することがあります。加えて、通常、仕組み債券の取引に関わるブローカーは限定的であり（1社の場合もあります）、取引にあたっては高いコストがかかる場合があります。

なお、仕組み債券の発行体は少数であることが多いため、信用リスクが顕在化した場合には、投資対象ファンドは多数の発行体に分散投資を行う投資信託と比較して、大きな影響を被る可能性があ

ります。また、発行体の財務状況や信用力の他、市場や経済環境の変動等により、仕組み債券が発行されない場合には、投資対象ファンドが償還となる可能性があります。

⑫ブローカーの信用リスク

投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的にデリバティブや為替予約取引等を行う場合があります。ブローカーの債務不履行等によって、ブローカーで保管されている証拠金の一部又は相当の額が失われる可能性や契約が履行されない可能性があり、ファンドが大きな影響を被る可能性があります。

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

①同じ投資対象ファンドに投資する他のファンドによる追加設定や一部解約等があり、投資対象ファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

②分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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

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

③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。

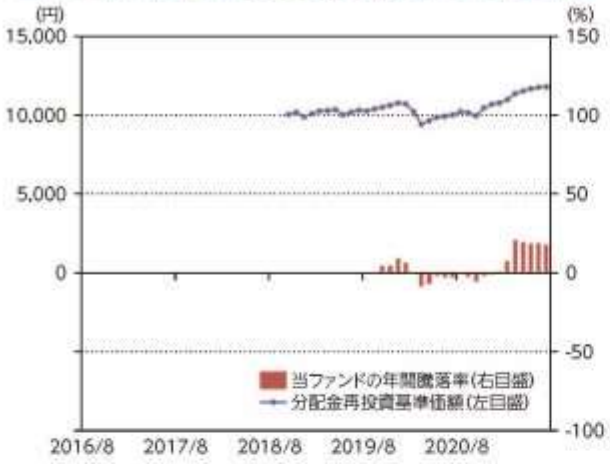
(2)リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

*当ファンドについては2019年10月～2021年7月の1年10ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2016年8月～2021年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

*当ファンドの年間騰落率は、設定後のデータのみで算出しています。従って、当該ファンドの年間騰落率と他の代表的な資産クラスの指数の年間騰落率を同じ図に表示すると、誤認につながる懸念があるため、別の図に表示しています。

各資産クラスの指数について

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

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

①取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.3%（税抜　3.0%）（※1）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

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

②「分配金再投資コース」（※2）において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

※2：収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

③上記①及び②の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞
ありません。
＜信託財産留保額＞
当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（※）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有する投資対象ファンドの解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法
①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率1.518%（税抜　1.38%）を乗じて得た額とします（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。
その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率　0.968%　　（税抜　0.88%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率　0.495%　　（税抜　0.45%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率　0.055%　　（税抜　0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。
③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

各投資対象ファンドの信託報酬（投資信託財産の純資産総額に対する年率）は下記の通りです。
当該信託報酬は、投資対象とする投資信託証券に係る信託財産の運用、基準価額の計算、運用財産の管理等の対価として、投資対象ファンドから支払われます。
なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.517%　（税抜　0.47%）
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
日本債券ツイン戦略マザーファンド	ありません。
FOFs用世界物価連動債ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	年率　0.066%　（税抜　0.06%）
マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	毎年3月および9月の最終営業日における日本相互証券株式会社の発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下の通りとし、当該最終営業日の翌月の21日以降で、前日が営業日である最初の営業日から適用するものとします。 新発10年固定利付国債の利回り　信託報酬 0.5%未満の場合・・・・・・・・・・年率　0.264%（税抜　0.24%） 0.5%以上１%未満の場合・・・・・年率　0.297%（税抜　0.27%） １%以上の場合 ・・・・・・・・・・年率　0.33%（税抜　0.3%）
明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.264%以内　（税抜　0.24%以内）
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.814%　（税抜　0.74%）
ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.671%　（税抜　0.61%）
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	年率　0.525%
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.451%　（税抜　0.41%）
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	年率　0.8%以内
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。

FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	年率　0.066%　（税抜　0.06%）
LM・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.33%　（税抜　0.3%）
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバルREITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド	ありません。
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY	年率　0.74%
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.066%　（税抜　0.06%）
米国株式LSマザーファンド	ありません。
コモディティLSアルファ・マザーファンド	ありません。
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	ありません。
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.506%　（税抜　0.46%）
MA Hedge Fund Strategies Limited	運用報酬：年率　0.6% 成功報酬：15% 月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。

当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な信託報酬率の概算値は下記の通りです。ただし、この値は目安であり、投資対象ファンドの実際の組入状況により実質的な信託報酬率は変動します。なお、投資対象ファンドによっては、別途運用実績に基づき計算される成功報酬額がかかる場合があります。

◎実質的な信託報酬率：年率1.518%～2.00946%程度（税抜　1.38%～1.8445%程度）

（投資対象とする投資信託証券：年率0.0%～0.49146%程度（税抜　0.0%～0.4645%程度））

（４）【その他の手数料等】

①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。
⑤ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用（※）は、受益者の負担とし、日々投資信託財産で負担します（投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。）。
⑥これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。
※上記における役務提供の内容は以下の通りです。
組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用は、仕組み債券の発行・管理にあたり発行者等に支払う手数料、仕組み債券の連動対象となるファンド及びファンドが組み入れるヘッジファンド等の運用者に支払う運用報酬（成功報酬を含みます。）等
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬の中から支払うものとし、その額は、ファンドの純資産総額に年率0.495%（税抜0.45%）を乗じて得たものとします。
手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示しておりません。

（ご参考）
《　仕組み債券の費用にかかる記載　》
・FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）
実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。
・円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
・円建債券の連動対象となるPTRディバーシファイド・アルファ・ファンドにおいては、運用報酬（PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドの純資産総額に対して年率1.0%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。
これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・米国株式LSマザーファンド
主要投資対象である米ドル建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。
・米ドル建債券の評価額に対して年率0.38%が発行・管理手数料等としてかかります。加えて保管費用として年率0.02%、その他管理費用等がかかります。
・マーケット・ニュートラル戦略による運用額に対する運用報酬として年率2.00%、純資産価値算出費用として年率0.03%、有価証券の売買費用、借株費用、その他管理費用等がかかります。
・米ドル建MMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。
これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。
①個人の受益者に対する課税
イ．収益分配金に対する課税
収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉

徴収が行われます。
なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

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

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合
NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。
ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。
販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税
収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。
なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

③個別元本について
イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。

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

ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。
（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について
追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
受益者が収益分配金を受け取る際、
イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元

本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、

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

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
※上記は、2021年 7月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。
※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

以下は、2021年7月30日現在の状況について記載してあります。

【コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	日本	2,704,119,519	20.93
	ルクセンブルク	293,513,202	2.27
	小計	2,997,632,721	23.20
投資証券	ルクセンブルク	178,652,183	1.38
	ケイマン	80,957,190	0.63
	小計	259,609,373	2.01
親投資信託受益証券	日本	9,410,477,888	72.84
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	252,221,203	1.95
合計(純資産総額)		12,919,941,185	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス　マザーファンド	664,326,699	3.8849	2,580,842,792	3.9067	2,595,325,114	20.09
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス　マザーファンド	1,178,861,159	1.8864	2,223,803,690	1.8361	2,164,506,974	16.75
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	818,704,679	1.1393	932,750,240	1.1562	946,586,349	7.33

日本	親投資信託受益証券	グローバルＲＥＩＴインデックスマザーファンド	408,099,388	2.2787	929,936,075	2.2848	932,425,481	7.22
日本	親投資信託受益証券	Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	400,278,336	2.2917	917,317,863	2.2759	910,993,464	7.05
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	271,449,363	3.0772	835,303,979	3.0869	837,937,038	6.49
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	573,404,997	1.2643	724,969,594	1.2783	732,983,607	5.67
日本	投資信託受益証券	ノムラＦＯＦｓ用　日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	468,130,990	0.9792	458,415,016	0.9858	461,483,529	3.57
日本	投資信託受益証券	ＦＯＦｓ用　ピクテ　マルチストラテジー　リンクファンド（適格機関投資家専用）	408,019,816	1.0767	439,314,935	1.0679	435,724,361	3.37
日本	投資信託受益証券	グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	219,239,671	1.4842	325,395,519	1.4995	328,749,886	2.54
日本	親投資信託受益証券	コモディティＬＳアルファ・マザーファンド	275,252,897	1.1304	311,145,874	1.1315	311,448,652	2.41
ルクセンブルク	投資信託受益証券	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	23,417.361	12,801	299,765,638	12,534	293,513,202	2.27
日本	親投資信託受益証券	米国株式ＬＳマザーファンド	295,448,402	0.9712	286,939,488	0.9864	291,430,303	2.26
日本	親投資信託受益証券	グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド	663,375,528	0.3817	253,210,439	0.3953	262,232,346	2.03
日本	投資信託受益証券	ＬＭ・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	178,480,244	1.2037	214,836,669	1.2053	215,122,238	1.67
日本	投資信託受益証券	マニュライフＦＯＦｓ用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	212,116,993	1.0014	212,413,956	1.0046	213,092,731	1.65
日本	親投資信託受益証券	日本債券ツイン戦略マザーファンド	206,069,694	0.9985	205,771,581	1.0007	206,213,942	1.60
ルクセンブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY	16,778.114	10,683.05	179,241,547	10,647.93	178,652,183	1.38
日本	親投資信託受益証券	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	100,000,000	0.8951	89,510,000	0.8898	88,980,000	0.69
ケイマン	投資証券	MA Hedge Fund Strategies Limited	8,028	10,250.79	82,293,355	10,084.35	80,957,190	0.63
日本	投資信託受益証券	FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド　為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	71,276,709	1.0664	76,009,482	1.0743	76,572,568	0.59
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス　マザーファンド	43,103,997	1.7618	75,940,621	1.7632	76,000,967	0.59
日本	投資信託受益証券	ＦＯＦｓ用世界物価連動債ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	23,114,900	1.1312	26,147,574	1.1589	26,787,857	0.21

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	23.20
投資証券	2.01
親投資信託受益証券	72.84
合計	98.05

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2019年 7月10日)	8,980,843,249	8,980,843,249	10,284	10,284
第2期計算期間末 (2020年 7月10日)	11,787,026,676	11,787,026,676	9,951	9,951
第3期計算期間末 (2021年 7月12日)	12,831,760,694	12,831,760,694	11,807	11,807
2020年 7月末日	11,905,699,196	—	10,015	—
8月末日	12,074,263,730	—	10,229	—
9月末日	11,970,188,039	—	10,152	—
10月末日	11,637,358,614	—	9,947	—
11月末日	12,079,556,972	—	10,462	—
12月末日	12,119,297,483	—	10,688	—
2021年 1月末日	11,891,109,805	—	10,769	—
2月末日	12,085,086,622	—	10,988	—
3月末日	12,337,450,789	—	11,368	—
4月末日	12,452,112,983	—	11,519	—
5月末日	12,619,583,008	—	11,672	—
6月末日	12,736,889,241	—	11,762	—
7月末日	12,919,941,185	—	11,786	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2018年10月26日～2019年 7月10日	0
第2期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第3期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第1期計算期間	2018年10月26日～2019年 7月10日	2.8

第2期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	△3.2
第3期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	18.7

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2018年10月26日～2019年 7月10日	9,362,328,441	629,077,416	8,733,251,025
第2期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	6,207,727,771	3,096,276,176	11,844,702,620
第3期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	1,926,137,065	2,903,204,631	10,867,635,054

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。
(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

（参考）

国内株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	459,412,921,520	99.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	3,447,755,193	0.74
合計(純資産総額)		462,860,676,713	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	3,543,300,000	0.77

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,785,800	9,127.79	16,300,424,865	9,805.00	17,509,769,000	3.78
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,104,300	10,787.43	11,912,562,545	11,375.00	12,561,412,500	2.71
日本	株式	キーエンス	電気機器	173,000	53,921.96	9,328,500,526	60,740.00	10,508,020,000	2.27
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,372,600	8,241.70	11,312,568,433	6,837.00	9,384,466,200	2.03
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	11,893,400	619.53	7,368,400,465	578.50	6,880,331,900	1.49
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,206,700	5,554.75	6,702,924,007	5,629.00	6,792,514,300	1.47
日本	株式	任天堂	その他製品	100,900	67,622.13	6,823,073,071	56,400.00	5,690,760,000	1.23
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,023,400	2,930.29	5,929,166,589	2,802.50	5,670,578,500	1.23
日本	株式	信越化学工業	化学	319,300	18,844.65	6,017,098,951	17,750.00	5,667,575,000	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,466,600	3,719.01	5,454,305,574	3,682.00	5,400,021,200	1.17
日本	株式	日立製作所	電気機器	847,600	5,748.53	4,872,459,771	6,258.00	5,304,280,800	1.15
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	344,000	14,361.24	4,940,267,065	15,405.00	5,299,320,000	1.14
日本	株式	日本電産	電気機器	424,300	12,534.65	5,318,454,769	12,240.00	5,193,432,000	1.12
日本	株式	ダイキン工業	機械	224,600	21,597.96	4,850,903,057	22,665.00	5,090,559,000	1.10
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,387,900	3,356.58	4,658,598,373	3,493.00	4,847,934,700	1.05
日本	株式	村田製作所	電気機器	517,900	8,284.71	4,290,655,048	9,040.00	4,681,816,000	1.01
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	103,300	48,629.50	5,023,427,586	44,920.00	4,640,236,000	1.00
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,387,300	3,711.73	5,149,284,592	3,332.00	4,622,483,600	1.00
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,203,200	3,948.33	4,750,636,550	3,695.00	4,445,824,000	0.96
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,214,400	3,248.61	3,945,123,685	3,232.00	3,924,940,800	0.85
日本	株式	ファナック	電気機器	154,700	26,302.92	4,069,061,858	24,380.00	3,771,586,000	0.81

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,362,500	1,671.28	3,948,402,022	1,565.50	3,698,493,750	0.80
日本	株式	三井物産	卸売業	1,385,000	2,416.04	3,346,222,677	2,499.50	3,461,807,500	0.75
日本	株式	ＳＭＣ	機械	51,600	65,517.32	3,380,694,031	64,800.00	3,343,680,000	0.72
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	679,200	4,744.67	3,222,584,653	4,868.00	3,306,345,600	0.71
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,057,100	2,985.27	3,155,733,927	3,062.00	3,236,840,200	0.70
日本	株式	第一三共	医薬品	1,385,300	2,526.75	3,500,319,076	2,159.50	2,991,555,350	0.65
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	572,600	5,178.18	2,965,026,787	5,210.00	2,983,246,000	0.64
日本	株式	富士通	電気機器	158,600	17,835.33	2,828,684,149	18,565.00	2,944,409,000	0.64
日本	株式	デンソー	輸送用機器	388,100	7,503.63	2,912,161,593	7,482.00	2,903,764,200	0.63

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.19
		建設業	2.34
		食料品	3.35
		繊維製品	0.50
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.07
		医薬品	5.02
		石油・石炭製品	0.42
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.76
		鉄鋼	0.80
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.62
		機械	5.47
		電気機器	18.33
		輸送用機器	8.03
		精密機器	2.78

		その他製品	2.29
		電気・ガス業	1.20
		陸運業	3.26
		海運業	0.36
		空運業	0.45
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	8.44
		卸売業	4.85
		小売業	4.55
		銀行業	4.89
		証券、商品先物取引業	0.75
		保険業	1.88
		その他金融業	1.11
		不動産業	1.98
		サービス業	5.63
		小計	99.26
合計			99.26

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物	買建	186	円	3,595,097,300	3,543,300,000	0.77

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

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

日本債券ツイン戦略マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）

国債証券	日本	15,764,653,000	23.26
社債券	日本	47,385,307,600	69.91
	フランス	3,211,558,000	4.74
	スペイン	200,916,000	0.30
	小計	50,797,781,600	74.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,214,177,565	1.79
合計(純資産総額)		67,776,612,165	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
債券先物取引	買建	日本	2,132,200,000	3.15

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
債券オプション	買建	日本	22,058,000	0.03
	売建	日本	20,973,000	△0.03

(注1)評価にあたっては、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額で評価しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	社債券	第１回東京海上日動火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	2,000,000,000	100.74	2,014,820,000	102.20	2,044,000,000	0.960	2079/12/24	3.02
日本	国債証券	第７０回利付国債（３０年）	1,650,000,000	101.00	1,666,549,500	101.87	1,680,937,500	0.700	2051/3/20	2.48
日本	国債証券	第１７５回利付国債（２０年）	1,450,000,000	100.96	1,463,943,500	102.35	1,484,089,500	0.500	2040/12/20	2.19
日本	社債券	第４回楽天利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,200,000,000	102.62	1,231,523,000	102.91	1,234,920,000	1.810	2055/11/4	1.82

日本	社債券	第５回三井住友海上火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,200,000,000	101.74	1,220,954,000	102.60	1,231,248,000	1.020	2081/2/7	1.82
日本	国債証券	第１７３回利付国債（２０年）	1,050,000,000	98.84	1,037,881,500	100.79	1,058,358,000	0.400	2040/6/20	1.56
日本	社債券	第１回アサヒグループＨＤ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,000,000,000	100.68	1,006,830,000	101.92	1,019,200,000	0.970	2080/10/15	1.50
日本	社債券	第６回みずほＦＧ任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	1,000,000,000	101.36	1,013,610,000	101.02	1,010,220,000	1.130	9999/99/99	1.49
日本	社債券	第１回ＭＳ＆ＡＤインシュアランス利払繰延・期限前償還（劣後特	1,000,000,000	100.49	1,004,940,000	100.29	1,002,990,000	1.030	2076/12/25	1.48
フランス	社債券	ＢＮＰパリバ　０．５５７％　２０２７／０５／２０	1,000,000,000	100.00	1,000,000,000	100.21	1,002,140,000	0.557	2027/5/20	1.48
日本	社債券	第１回明治安田生命第１回劣後ローン流動化利払繰延・期限前（劣	1,000,000,000	100.00	1,000,000,000	100.20	1,002,020,000	0.000	2051/8/2	1.48
フランス	社債券	第２３回ルノー円貨社債	1,000,000,000	100.00	1,000,000,000	100.08	1,000,870,000	1.030	2023/7/6	1.48
日本	社債券	第３回ＥＮＥＯＳホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後）	800,000,000	100.00	800,000,000	103.21	825,728,000	1.310	2081/6/15	1.22
日本	社債券	第３回野村ホールディングス任意償還・無担保永久社債（劣後特約	800,000,000	100.00	800,000,000	101.25	810,016,000	1.300	9999/99/99	1.20
日本	国債証券	第１６９回利付国債（２０年）	800,000,000	96.64	773,144,000	99.66	797,288,000	0.300	2039/6/20	1.18
日本	社債券	第３回ソフトバンクグループ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	790,000,000	100.79	796,261,000	100.19	791,532,600	3.000	2041/9/30	1.17
日本	社債券	第１１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	700,000,000	101.57	711,046,000	102.07	714,546,000	0.790	2028/1/25	1.05
日本	社債券	第４１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	700,000,000	101.48	710,416,000	101.55	710,857,000	0.640	2026/10/8	1.05
日本	社債券	第１回積水ハウス利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	100.62	704,361,000	100.47	703,304,000	0.810	2077/8/18	1.04
日本	社債券	第２０回みずほフィナンシャルグループ期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	99.56	696,934,000	100.14	701,008,000	0.390	2029/10/30	1.03
日本	社債券	第５回Ａ号太陽生命利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	100.21	701,533,000	100.02	700,168,000	0.640	2027/12/22	1.03
日本	社債券	第７回イオン利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	600,000,000	102.32	613,974,000	103.32	619,974,000	1.740	2050/12/2	0.91
日本	社債券	第１回日本生命第５回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣	600,000,000	101.07	606,423,000	102.64	615,840,000	1.050	2050/9/23	0.91
日本	社債券	第２回ＥＮＥＯＳホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後）	600,000,000	100.00	600,000,000	101.85	611,142,000	0.970	2081/6/15	0.90
日本	社債券	第４８回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債	600,000,000	102.25	613,524,000	101.68	610,128,000	2.130	2022/12/9	0.90
日本	社債券	第８回みずほＦＧ任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	600,000,000	101.00	606,000,000	100.78	604,722,000	0.980	9999/99/99	0.89

日本	社債券	第２回住友化学利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	600,000,000	100.12	600,750,000	100.74	604,476,000	0.840	2079/12/13	0.89
日本	社債券	第９回ソフトバンク株式会社無担保社債	600,000,000	99.47	596,868,000	100.55	603,330,000	0.480	2027/12/3	0.89
日本	国債証券	第２回利付国債（４０年）	410,000,000	138.93	569,625,300	141.44	579,908,100	2.200	2049/3/20	0.86
日本	国債証券	第４１回利付国債（３０年）	450,000,000	123.94	557,748,000	126.70	570,181,500	1.700	2043/12/20	0.84

(注1）国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(注3）償還期限は、償還期限の定めがない場合「9999/99/99」と記載しております。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	23.26
社債券	74.95
合計	98.21

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	14	円	2,133,464,620	2,132,200,000	3.15

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

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

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
債券オプション	店頭	第７０回利付国債（３０年）コール　オプション	売建	5,000,000	円	2,900,000	5,495,000	△0.01
	店頭	第１７６回利付国債（２０年）コール　オプション	買建	4,000,000	円	4,000	3,160,000	0.00
	店頭	第１７６回利付国債（２０年）コール　オプション	買建	15,000,000	円	6,750,000	10,710,000	0.02
	店頭	第１７７回利付国債（２０年）コール　オプション	買建	7,000,000	円	7,000	4,452,000	0.01
	店頭	第３６３回利付国債（１０年）コール　オプション	買建	14,000,000	円	2,100,000	2,506,000	0.00
	店頭	第７０回利付国債（３０年）プット　オプション	買建	5,000,000	円	3,635,000	1,230,000	0.00
	店頭	第１７６回利付国債（２０年）プット　オプション	売建	4,000,000	円	404,000	1,168,000	△0.00

	店頭	第１７６回利付国債（２０年）プット　オプション	売建	15,000,000	円	8,220,000	6,120,000	△0.01
	店頭	第１７７回利付国債（２０年）プット　オプション	売建	7,000,000	円	630,000	4,508,000	△0.01
	店頭	第３６３回利付国債（１０年）プット　オプション	売建	14,000,000	円	2,590,000	3,682,000	△0.01

(注1)評価にあたっては、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額で評価しております。

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

外国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	355,563,101,163	65.99
	イギリス	22,607,822,987	4.20
	カナダ	18,496,000,336	3.43
	スイス	17,665,266,660	3.28
	フランス	17,114,297,056	3.18
	ドイツ	15,080,524,735	2.80
	オーストラリア	10,279,020,899	1.91
	オランダ	10,184,161,739	1.89
	アイルランド	9,682,306,636	1.80
	スウェーデン	5,929,756,632	1.10
	デンマーク	4,316,132,381	0.80
	スペイン	3,950,846,492	0.73
	香港	3,691,797,746	0.69
	イタリア	3,076,822,471	0.57
	フィンランド	2,197,718,451	0.41
	ジャージー	1,713,828,768	0.32
	シンガポール	1,509,154,194	0.28
	ベルギー	1,401,987,027	0.26
	バミューダ	1,222,773,158	0.23
	ノルウェー	1,042,169,023	0.19
	イスラエル	1,017,532,708	0.19
	ケイマン	927,673,671	0.17
	ルクセンブルク	554,146,474	0.10
	ニュージーランド	539,785,083	0.10
	キュラソー	398,085,958	0.07
	オーストリア	313,122,780	0.06
	ポルトガル	241,208,304	0.04
	パナマ	175,349,242	0.03
	リベリア	168,805,697	0.03

	マン島	138,286,173	0.03
	パプアニューギニア	58,542,246	0.01
	小計	511,258,026,890	94.88
投資信託受益証券	オーストラリア	228,825,401	0.04
	香港	80,384,013	0.01
	小計	309,209,414	0.06
投資証券	アメリカ	10,033,423,942	1.86
	オーストラリア	701,470,366	0.13
	イギリス	329,628,798	0.06
	フランス	274,934,151	0.05
	シンガポール	231,662,920	0.04
	香港	180,175,875	0.03
	カナダ	78,608,037	0.01
	小計	11,829,904,089	2.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	15,428,238,919	2.86
合計(純資産総額)		538,825,379,312	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	11,520,694,370	2.14
	買建	カナダ	895,683,398	0.17
	買建	ドイツ	2,018,822,445	0.37
	買建	イギリス	599,460,792	0.11
	買建	オーストラリア	474,227,728	0.09

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	437,946,550	0.08

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,450,831	13,643.54	19,794,483,694	15,946.12	23,135,130,449	4.29
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	619,180	27,337.46	16,926,810,464	31,368.88	19,422,986,214	3.60
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	36,986	352,893.93	13,052,135,054	394,155.24	14,578,225,736	2.71
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	207,790	35,992.64	7,478,912,265	39,232.45	8,152,112,198	1.51
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	25,977	258,051.50	6,703,403,984	297,325.56	7,723,626,319	1.43
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	25,465	264,041.70	6,723,822,002	298,996.38	7,613,942,992	1.41
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	66,189	68,455.33	4,530,990,354	74,163.05	4,908,778,216	0.91
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	213,732	17,786.10	3,801,459,377	21,527.92	4,601,206,210	0.85
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	263,503	17,982.63	4,738,478,956	16,751.97	4,414,194,351	0.82
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	226,967	18,531.18	4,205,966,899	18,851.98	4,278,779,206	0.79
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	146,419	24,887.07	3,643,940,928	27,144.76	3,974,508,732	0.74
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	81,910	45,101.12	3,694,232,805	45,118.63	3,695,667,737	0.69
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	118,353	31,690.78	3,750,699,548	30,630.92	3,625,261,559	0.67
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	248,795	13,428.85	3,341,031,234	13,740.64	3,418,603,773	0.63
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	92,922	34,917.45	3,244,599,837	35,850.31	3,331,282,571	0.62
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	76,521	39,479.90	3,021,041,750	42,570.80	3,257,560,715	0.60
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	212,538	14,764.72	3,138,065,441	15,271.66	3,245,809,178	0.60
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	156,656	19,560.38	3,064,252,221	19,527.54	3,059,106,541	0.57
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	36,125	71,859.75	2,595,933,577	83,621.69	3,020,833,804	0.56
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	95,999	28,469.58	2,733,052,152	31,004.28	2,976,380,193	0.55
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	670,589	4,641.28	3,112,392,051	4,235.07	2,839,993,502	0.53
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	41,289	55,246.46	2,281,071,261	68,069.93	2,810,539,464	0.52

スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	60,854	38,140.25	2,320,987,382	42,007.46	2,556,321,971	0.47
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	394,334	6,278.15	2,475,690,605	6,362.46	2,508,935,840	0.47
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	365,193	6,390.93	2,333,923,374	6,452.24	2,356,314,964	0.44
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	484,175	4,240.54	2,053,167,183	4,685.07	2,268,397,205	0.42
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	355,696	6,053.70	2,153,277,622	6,246.40	2,221,821,095	0.41
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	82,450	26,002.83	2,143,933,363	26,719.93	2,203,059,020	0.41
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	364,089	5,792.02	2,108,811,134	6,029.61	2,195,316,241	0.41
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	356,926	6,185.09	2,207,619,469	6,129.25	2,187,688,757	0.41

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	3.00
		素材	4.30
		資本財	6.28
		商業・専門サービス	1.22
		運輸	1.91
		自動車・自動車部品	1.87
		耐久消費財・アパレル	2.02
		消費者サービス	1.79
		メディア・娯楽	7.32
		小売	5.53
		食品・生活必需品小売り	1.32
		食品・飲料・タバコ	3.75
		家庭用品・パーソナル用品	1.68
		ヘルスケア機器・サービス	5.06
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.44
		銀行	5.70
		各種金融	4.59
		保険	2.87
		不動産	0.47

		ソフトウェア・サービス	12.08
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.78
		電気通信サービス	1.61
		公益事業	2.81
		半導体・半導体製造装置	4.49
		小計	94.88
投資信託受益証券	—	—	0.06
投資証券	—	—	2.20
合計			97.14

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	477	アメリカドル	101,816,341.5	11,147,871,230	105,221,430	11,520,694,370	2.14
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	42	カナダドル	10,080,679	885,486,843	10,196,760	895,683,398	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	46	スイスフラン	5,493,792	663,924,763	5,547,600	670,427,460	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	252	ユーロ	10,312,629	1,341,776,159	10,363,500	1,348,394,985	0.25
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	32	オーストラリアドル	5,819,474	470,562,668	5,864,800	474,227,728	0.09
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	56	イギリスポンド	3,941,460	602,097,430	3,924,200	599,460,792	0.11

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	4,000,000.00	438,457,500	437,946,550	0.08

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

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

外国債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	135,764,022,446	44.70
	フランス	30,352,011,059	9.99
	イタリア	28,652,890,818	9.43
	ドイツ	22,672,878,224	7.46
	イギリス	19,731,005,963	6.50
	スペイン	17,775,376,123	5.85
	ベルギー	7,122,778,518	2.35
	オーストラリア	6,107,070,808	2.01
	オランダ	5,902,987,498	1.94
	カナダ	5,878,668,915	1.94
	オーストリア	4,488,584,742	1.48
	アイルランド	2,483,088,862	0.82
	メキシコ	2,142,034,680	0.71
	フィンランド	1,881,677,324	0.62
	ポーランド	1,840,574,348	0.61
	デンマーク	1,499,814,432	0.49
	マレーシア	1,398,471,153	0.46
	イスラエル	1,366,694,469	0.45
	シンガポール	1,304,342,857	0.43
	スウェーデン	881,476,007	0.29
	ノルウェー	740,704,477	0.24
	小計	299,987,153,723	98.77
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	3,739,326,653	1.23
合計(純資産総額)		303,726,480,376	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
債券先物取引	買建	アメリカ	638,125,678	0.21
	買建	ドイツ	792,702,981	0.26

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	1,276,495,381	0.42
	売建	—	4,977,844,980	△1.64

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	15,950,000	10,096.17	1,610,340,008	10,388.71	1,657,000,711	0.625	2030/8/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	10,509.32	1,581,654,046	10,821.54	1,628,642,800	1.125	2031/2/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,137.23	1,429,350,043	10,421.22	1,469,392,589	0.625	2030/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	10,950.71	1,423,592,401	10,934.88	1,421,535,190	0.250	2024/3/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/40	13,000,000	9,534.18	1,239,443,908	10,125.25	1,316,283,655	1.375	2040/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	11,812.94	1,269,891,536	11,898.48	1,279,086,986	2.375	2027/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.5% 02/28/26	11,500,000	10,829.24	1,245,363,211	10,866.88	1,249,691,488	0.500	2026/2/28	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	11,977.17	1,196,520,235	12,168.78	1,215,661,824	2.625	2029/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	10,946.86	1,204,154,771	10,984.92	1,208,341,905	0.750	2026/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	11,590.54	1,184,553,491	11,646.57	1,190,279,564	2.000	2026/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	10,303.18	1,148,804,585	10,600.00	1,181,900,070	0.875	2030/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,642.29	1,181,692,848	11,600.80	1,177,481,976	2.250	2024/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	11,243.46	1,124,346,821	11,209.46	1,120,946,642	2.000	2022/10/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	10,974.23	1,113,884,756	10,968.03	1,113,255,291	0.250	2023/4/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	11,137.61	1,113,761,361	11,111.95	1,111,195,189	1.500	2022/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	12,165.36	1,085,150,599	12,326.17	1,099,495,158	2.875	2028/8/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,720,000	22,454.25	1,059,840,775	23,260.28	1,097,885,459	4.500	2041/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	10,890.96	1,089,096,482	10,923.33	1,092,333,828	0.250	2024/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	10,920.34	1,092,034,439	10,908.79	1,090,879,670	0.125	2024/1/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	10,796.31	1,079,631,280	10,811.70	1,081,170,983	0.250	2025/7/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	10,576.04	1,057,604,969	10,722.74	1,072,274,921	0.625	2027/12/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	9,470,000	11,128.85	1,053,902,885	11,309.11	1,070,973,617	1.625	2031/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/51	9,900,000	10,014.05	991,391,750	10,816.41	1,070,825,033	1.875	2051/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/15/22	9,500,000	11,148.51	1,059,109,391	11,123.71	1,056,752,784	1.500	2022/9/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	11,737.24	1,050,483,203	11,803.53	1,056,416,408	2.250	2027/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	12,365.52	1,038,704,257	12,540.02	1,053,362,231	3.125	2028/11/15	0.35
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000	15,934.83	1,016,642,276	16,229.53	1,035,444,082	2.500	2030/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.375% 01/31/25	9,000,000	11,312.54	1,018,128,697	11,292.43	1,016,319,543	1.375	2025/1/31	0.33

アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	11,726.55	1,002,620,036	11,829.62	1,011,432,909	2.250	2027/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	9,500,000	10,496.49	997,167,349	10,622.66	1,009,153,502	0.375	2027/7/31	0.33

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	98.77
合計	98.77

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	17	アメリカドル	2,114,610.1	231,528,659	2,113,445.27	231,401,122	0.08
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	13	アメリカドル	1,748,833.33	191,479,761	1,744,843.75	191,042,942	0.06
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	12	アメリカドル	1,986,002.35	217,447,398	1,969,875	215,681,614	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	8	ユーロ	898,126.8	116,855,278	898,800	116,942,868	0.04
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	11	ユーロ	1,484,623.1	193,164,311	1,488,520	193,671,337	0.06
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	21	ユーロ	3,691,174.1	480,258,662	3,705,240	482,088,776	0.16

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	5,260,000.00	577,622,591	575,830,610	0.19
	カナダドル	買建	721,749.00	62,459,990	63,386,545	0.02
	ユーロ	買建	4,040,000.00	523,741,775	525,711,060	0.17
	イギリスポンド	買建	730,000.00	110,609,764	111,498,813	0.04
	スウェーデンクローナ	買建	1,835.00	23,435	23,488	0.00

	シンガポールドル	買建	140.42	11,358	11,355	0.00
	イスラエルシェケル	買建	990.60	33,507	33,510	0.00
	アメリカドル	売建	20,750,290.38	2,276,910,688	2,271,868,367	△0.75
	カナダドル	売建	1,122,443.72	98,341,784	98,591,078	△0.03
	メキシコペソ	売建	6,658,443.33	36,644,742	36,666,715	△0.01
	ユーロ	売建	15,650,130.82	2,033,455,927	2,036,299,556	△0.67
	イギリスポンド	売建	2,148,278.78	327,780,079	328,159,895	△0.11
	スウェーデンクローナ	売建	2,114,550.00	27,000,266	27,066,240	△0.01
	ポーランドズロチ	売建	1,001,140.25	28,271,900	28,496,756	△0.01
	オーストラリアドル	売建	1,184,595.00	95,798,197	95,786,351	△0.03
	シンガポールドル	売建	166,042.27	13,431,308	13,427,406	△0.00
	マレーシアリンギット	売建	841,671.80	21,831,872	21,742,402	△0.01
	イスラエルシェケル	売建	583,546.60	19,699,249	19,740,214	△0.01

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

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

新興国債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	中国	7,570,027,430	10.19
	インドネシア	7,220,165,991	9.72
	メキシコ	6,769,286,571	9.11
	タイ	6,404,231,028	8.62
	ポーランド	6,338,617,109	8.53
	ブラジル	6,214,740,375	8.36
	マレーシア	5,565,934,272	7.49
	ロシア	5,548,577,271	7.47
	南アフリカ	5,539,081,968	7.46
	コロンビア	3,400,091,679	4.58
	チェコ	3,093,840,736	4.16
	ハンガリー	2,919,786,794	3.93
	ペルー	1,598,041,847	2.15
	チリ	1,548,047,031	2.08
	トルコ	1,370,011,359	1.84
	ウルグアイ	96,319,402	0.13
	ドミニカ共和国	95,986,006	0.13
	フィリピン	84,562,793	0.11
	小計	71,377,349,662	96.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	2,921,070,803	3.93

合計(純資産総額)	74,298,420,465	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	72,300,000,000	3.67	2,656,375,980	3.38	2,445,832,651	9.850	2027/6/28	3.29
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	92,100,000	1,802.76	1,660,346,756	1,776.54	1,636,195,774	0.000	2024/1/1	2.20
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	123,900,000	884.52	1,095,923,026	854.74	1,059,026,751	10.500	2026/12/21	1.43
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	51,200,000	1,864.42	954,584,884	1,855.71	950,126,820	0.000	2023/7/1	1.28
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	39,550,000	2,351.15	929,881,439	2,216.55	876,647,855	10.000	2023/1/1	1.18
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	27,250,000	2,837.71	773,277,756	2,716.26	740,182,779	3.885	2029/8/15	1.00
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000	3,115.85	750,920,196	3,044.85	733,809,137	2.500	2026/7/25	0.99
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000	2,438.84	775,553,771	2,248.97	715,175,000	10.000	2025/1/1	0.96
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	31,400,000	2,449.16	769,037,987	2,259.51	709,486,790	10.000	2027/1/1	0.95
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	116,900,000	653.06	763,433,151	606.68	709,220,073	8.500	2029/5/31	0.95
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000	2,758.80	717,288,603	2,725.00	708,500,382	3.955	2025/9/15	0.95
タイ	国債証券	THAIGB 3.3% 06/17/38	178,700,000	406.84	727,030,297	389.48	696,000,992	3.300	2038/6/17	0.94
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	95,200,000	716.26	681,880,143	713.08	678,854,074	8.000	2030/1/31	0.91
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	21,550,000	3,202.35	690,108,140	3,132.92	675,144,536	2.750	2029/10/25	0.91
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000	613.76	666,855,417	573.95	623,605,756	7.500	2027/6/3	0.84
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	116,300,000	563.80	655,704,580	535.82	623,166,896	5.750	2026/3/5	0.84
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	100,250,000	655.98	657,622,045	613.81	615,348,894	10.000	2024/12/5	0.83
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	97,100,000	610.00	592,312,578	629.51	611,262,210	8.750	2048/2/28	0.82
マレーシア	国債証券	MGS 3.48% 03/15/23	22,850,000	2,685.61	613,663,982	2,650.96	605,745,699	3.480	2023/3/15	0.82
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	21,600,000,000	2.95	638,088,985	2.77	600,312,384	7.250	2034/10/18	0.81
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000	3,001.18	597,236,051	2,943.51	585,759,784	2.500	2023/1/25	0.79
中国	国債証券	CGB 2.94% 10/17/24	34,000,000	1,694.24	576,044,799	1,712.22	582,156,023	2.940	2024/10/17	0.78
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	103,700,000	569.26	590,332,049	556.27	576,852,296	6.500	2022/6/9	0.78
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	97,950,000	605.07	592,670,985	576.83	565,009,623	8.000	2023/12/7	0.76
インドネシア	国債証券	INDOGB 6.5% 06/15/25	70,100,000,000	0.79	559,078,518	0.80	562,855,612	6.500	2025/6/15	0.76
ポーランド	国債証券	POLGB 2.25% 10/25/24	17,950,000	3,048.46	547,199,146	2,992.44	537,144,325	2.250	2024/10/25	0.72

メキシコ	国債証券	MBONO 6.75% 03/09/23	92,600,000	575.90	533,287,405	560.76	519,264,862	6.750	2023/3/9	0.70
中国	国債証券	CGB 2.85% 06/04/27	30,500,000	1,652.91	504,140,233	1,695.18	517,030,251	2.850	2027/6/4	0.70
中国	国債証券	CGB 3.19% 04/11/24	29,400,000	1,708.57	502,321,961	1,723.13	506,601,241	3.190	2024/4/11	0.68
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	86,400,000	608.65	525,876,204	579.24	500,470,485	8.000	2024/9/5	0.67

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	96.07
合計	96.07

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	日本	105,248,148,000	96.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	3,981,592,900	3.65
合計(純資産総額)		109,229,740,900	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	買建	日本	3,944,646,000	3.61

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	10,151	578,842.86	5,875,833,871	708,000	7,186,908,000	6.58
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	8,957	555,498.16	4,975,597,019	687,000	6,153,459,000	5.63
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	29,008	156,119.11	4,528,703,142	196,500	5,700,072,000	5.22
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	14,190	331,039.03	4,697,443,835	366,000	5,193,540,000	4.75
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	45,191	85,589.79	3,867,888,199	114,500	5,174,369,500	4.74
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	28,964	137,733.58	3,989,315,411	174,100	5,042,632,400	4.62
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	12,779	246,816.89	3,154,073,037	326,000	4,165,954,000	3.81
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	17,846	161,051.56	2,874,126,139	209,000	3,729,814,000	3.41
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	8,955	307,805.18	2,756,395,386	373,500	3,344,692,500	3.06
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	20,163	128,478.5	2,590,511,995	161,100	3,248,259,300	2.97
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	12,715	177,337.27	2,254,843,388	211,900	2,694,308,500	2.47
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	26,344	75,571.56	1,990,857,176	96,600	2,544,830,400	2.33
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	5,886	320,378.56	1,885,748,204	428,000	2,519,208,000	2.31
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	2,771	638,288.35	1,768,697,017	807,000	2,236,197,000	2.05
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	4,488	405,898.08	1,821,670,583	497,500	2,232,780,000	2.04
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	10,965	162,949.83	1,786,744,885	201,000	2,203,965,000	2.02
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,093	586,638.18	1,814,471,890	671,000	2,075,403,000	1.90
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,329	500,529.84	1,666,263,837	614,000	2,044,006,000	1.87
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	5,852	291,672.05	1,706,864,836	332,500	1,945,790,000	1.78
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	27,439	57,829.87	1,586,793,802	66,700	1,830,181,300	1.68
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	39,422	38,459.52	1,516,151,197	43,050	1,697,117,100	1.55
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	10,532	133,003.12	1,400,788,859	161,100	1,696,705,200	1.55
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,140	388,895.83	1,221,132,906	508,000	1,595,120,000	1.46
日本	投資証券	イオンリート投資法人	9,690	126,586.01	1,226,618,436	159,500	1,545,555,000	1.41
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	7,874	147,160.08	1,158,738,469	193,800	1,525,981,200	1.40
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	1,894	634,033.36	1,200,859,183	790,000	1,496,260,000	1.37
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,117	176,207.32	1,077,860,176	237,300	1,451,564,100	1.33
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,033	302,663.13	1,220,640,403	350,500	1,413,566,500	1.29
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	11,715	100,631.26	1,178,895,210	120,400	1,410,486,000	1.29
日本	投資証券	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	8,090	122,443.53	990,568,157	159,100	1,287,119,000	1.18

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	96.35
合計	96.35

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証ＲＥＩＴ指数先物	買建	1,836	円	3,807,313,200	3,944,646,000	3.61

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

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

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	アメリカ	68,689,501,526	72.33
	オーストラリア	6,003,808,490	6.32
	イギリス	5,076,119,765	5.34
	シンガポール	3,359,367,740	3.54
	フランス	2,062,385,572	2.17
	カナダ	1,780,991,178	1.88
	香港	1,366,141,601	1.44
	ベルギー	1,284,660,725	1.35
	スペイン	394,791,265	0.42
	ニュージーランド	391,985,333	0.41
	ドイツ	263,988,116	0.28
	ガーンジー	240,793,803	0.25
	オランダ	181,185,094	0.19
	韓国	161,635,280	0.17
	アイルランド	114,602,840	0.12
	イスラエル	61,936,924	0.07
	イタリア	18,069,273	0.02
	小計	91,451,964,525	96.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	3,520,816,148	3.71

合計(純資産総額)	94,972,780,673	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	19,707,678	0.02
	売建	—	3,131,524,090	△3.30

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	398,739	10,965.42	4,372,342,001	14,002.67	5,583,413,065	5.88
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	48,266	81,371.87	3,927,494,827	86,100.74	4,155,738,616	4.38
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	81,967	24,467.73	2,005,546,449	34,140.07	2,798,359,683	2.95
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	151,595	15,142.46	2,295,522,284	16,477.15	2,497,853,569	2.63
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	176,855	8,763.57	1,549,882,870	13,786.98	2,438,296,489	2.57
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	224,691	7,340.20	1,649,279,035	9,605.55	2,158,282,365	2.27
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	75,099	18,165.48	1,364,209,825	25,173.94	1,890,537,780	1.99
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	185,046	6,544.21	1,210,981,234	9,248.62	1,711,420,192	1.80
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	904,193	1,615.58	1,460,798,659	1,819.35	1,645,043,535	1.73
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	73,754	17,269.85	1,273,721,085	21,870.62	1,613,046,261	1.70
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	200,847	6,759.91	1,357,708,166	7,688.38	1,544,189,624	1.63
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	71,850	11,798.64	847,732,456	19,022.79	1,366,787,648	1.44
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	305,031	3,053.67	931,465,875	4,449.67	1,357,288,388	1.43
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	201,564	5,161.35	1,040,344,085	6,529.98	1,316,209,614	1.39
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	61,496	13,878.95	853,500,057	21,132.66	1,299,574,361	1.37
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	60,066	15,039.54	903,365,394	21,419.52	1,286,585,411	1.35
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	34,915	27,992.21	977,348,131	36,197.39	1,263,832,012	1.33
香港	投資証券	LINK REIT	1,116,400	891.89	995,713,811	1,056.75	1,179,755,700	1.24
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	289,412	3,193.82	924,330,789	4,066.45	1,176,881,916	1.24
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	643,447	1,388.58	893,483,040	1,825.48	1,174,600,916	1.24
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	201,331	4,247.11	855,076,333	5,574.13	1,122,246,355	1.18
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	76,195	9,791.69	746,077,873	12,964.71	987,846,147	1.04
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	288,170	2,617.90	754,401,943	3,393.09	977,788,215	1.03

アメリカ	投資証券	UDR INC	159,237	4,215.36	671,242,076	6,086.54	969,203,819	1.02
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	52,356	10,926.00	572,042,028	16,286.63	852,703,193	0.90
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	95,394	7,339.11	700,107,508	8,809.56	840,379,682	0.88
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	90,869	6,438.01	585,015,713	9,119.42	828,672,767	0.87
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	154,632	2,978.12	460,513,889	4,756.24	735,467,770	0.77
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	314,946	2,117.53	666,909,682	2,280.67	718,290,004	0.76
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	74,571	5,670.19	422,832,022	9,488.92	707,598,425	0.75

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	96.29
合計	96.29

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	買建	180,000.00	19,751,400	19,707,678	0.02
	アメリカドル	売建	21,950,000.00	2,403,086,000	2,403,219,895	△2.53
	カナダドル	売建	700,000.00	61,479,600	61,484,640	△0.06
	ユーロ	売建	1,150,000.00	149,609,250	149,630,985	△0.16
	イギリスポンド	売建	1,050,000.00	160,383,300	160,392,540	△0.17
	オーストラリアドル	売建	2,570,000.00	207,812,770	207,810,200	△0.22
	香港ドル	売建	3,400,000.00	47,892,400	47,901,580	△0.05
	シンガポールドル	売建	1,250,000.00	101,085,000	101,084,250	△0.11

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

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

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）

社債券	アイルランド	8,709,250,662	41.97
	ルクセンブルク	8,703,984,193	41.95
	イギリス	2,073,009,206	9.99
	アメリカ	463,635,405	2.23
	ジャージー	440,149,800	2.12
	小計	20,390,029,266	98.27
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	359,722,860	1.73
合計(純資産総額)		20,749,752,126	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 008 10/22/21	59,000,000	13,740.99	8,107,187,050	14,761.44	8,709,250,662	0.000	2021/10/22	41.97
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 023 03/31/22	21,000,000	11,902.65	2,499,558,159	12,738.06	2,674,993,986	0.000	2022/3/31	12.89
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 024 05/31/22	19,000,000	11,192.64	2,126,602,372	11,476.74	2,180,580,942	0.000	2022/5/31	10.51
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 022 01/31/22	15,000,000	12,290.25	1,843,537,875	13,182.59	1,977,389,400	0.000	2022/1/31	9.53
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 021 11/30/21	13,000,000	13,473.92	1,751,610,071	14,392.46	1,871,019,865	0.000	2021/11/30	9.02
イギリス	社債券	BAR USD COM 038 08/31/21	7,000,000	13,949.13	976,439,483	15,000.78	1,050,055,085	0.000	2021/8/31	5.06
イギリス	社債券	CS USD COM 018 06/30/22	9,000,000	10,981.84	988,366,230	11,366.15	1,022,954,121	0.000	2022/6/30	4.93
アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000	2,874.11	431,116,875	3,090.90	463,635,405	0.000	2036/6/12	2.23
ジャージー	社債券	ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000	1,035.77	414,310,160	1,100.37	440,149,800	0.000	9999/99/99	2.12

(注1）国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2）投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。
(注3）償還期限は、償還期限の定めがない場合「9999/99/99」と記載しております。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
社債券	98.27
合計	98.27

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	アメリカ	36,219,808,447	98.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	642,877,342	1.74
合計(純資産総額)		36,862,685,789	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	―	34,857,658,643	△94.56

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	9,497,695	3,769.76	35,804,070,600	3,813.53	36,219,808,447	98.26

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	98.26
合計	98.26

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	売建	318,380,722.00	35,067,639,740	34,857,658,643	△94.56

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

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

米国株式ＬＳマザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
社債券	アイルランド	18,164,328,152	97.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	524,574,379	2.81
合計(純資産総額)		18,688,902,531	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	―	18,387,499,200	△98.39

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 004 10/18/22	154,000,000	11,606.29	17,873,687,166	11,795.01	18,164,328,152	0.000	2022/10/18	97.19

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
社債券	97.19
合計	97.19

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	168,000,000.00	18,440,402,400	18,387,499,200	△98.39

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
社債券	アイルランド	20,382,824,000	99.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	206,271,202	1.00
合計(純資産総額)		20,589,095,202	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	ＳＴＡＲ　ＨＥＬＩＯＳ　０％　０７／１３／２２	17,930,000,000	112.18	20,113,874,000	113.68	20,382,824,000	0.000	2022/7/13	99.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
社債券	99.00
合計	99.00

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
社債券	アイルランド	18,867,492,000	99.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	156,126,682	0.82
合計(純資産総額)		19,023,618,682	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	ＳＴＡＲ　ＨＥＬＩＯＳ　０％　１０／１８／２１	21,240,000,000	91.02	19,332,949,000	88.83	18,867,492,000	0.000	2021/10/18	99.18

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
社債券	99.18
合計	99.18

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

≪参考情報≫

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2018年10月26日
作成基準日：2021年７月30日

基準価額・純資産の推移

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	11,786円
純資産総額	129.20億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2019年７月	0円
2020年７月	0円
2021年７月	0円
－	－
－	－
設定来分配金合計額	0円

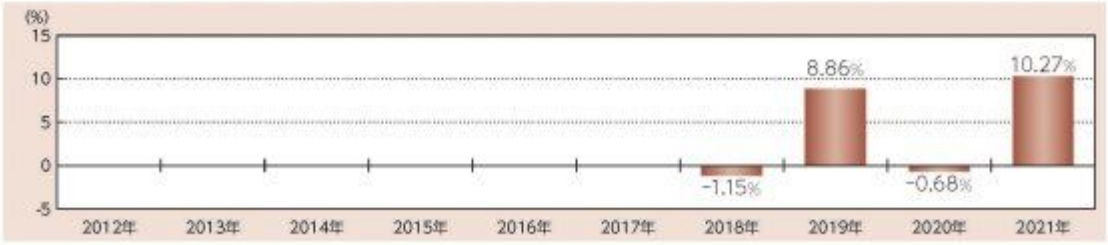
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	20.1%
国内株式インデックス マザーファンド	16.8%
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	7.3%
グローバルREIT インデックス マザーファンド	7.2%
J-REIT インデックス マザーファンド	7.1%
外国債券インデックス マザーファンド	6.5%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	5.7%
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	3.6%
FOFs 用ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	3.4%
グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)	2.5%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移（暦年ベース）



※2018年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2021年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

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

＜申込コース＞

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

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

＜申込みの受付＞

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

＜申込単位＞

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

＜申込価額＞

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

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

＜申込手数料＞

前記　第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (1)申込手数料をご覧ください。

＜申込代金の支払い＞

販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞

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

ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行休業日
ロンドンの銀行休業日

＜申込受付の中止等＞

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等（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及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のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

＜その他＞

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファン

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

＜スイッチング＞

当ファンドはコア投資戦略ファンドを構成する各ファンドの間において、スイッチング（※）の取扱いを行う場合があります。上記受付不可日の場合は、スイッチングの取扱いは行いません。
販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

※スイッチングとは、当ファンドの解約請求日に当該ファンドの解約に係る手取金をもって別のファンドの取得申込みを行うことをいいます。

＜問い合わせ先＞

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

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

＜一部解約の受付＞

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

＜一部解約単位＞

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜解約価額＞

一部解約の実行の請求受付日の翌々営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。
解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（https://www.smtam.jp/）でご覧いただけます。

＜一部解約代金の支払い＞

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、7営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

＜受付不可日＞

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行休業日
ロンドンの銀行休業日

＜一部解約受付の中止等＞

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記＜解約価額＞の規定に準じて計算された価額とします。

＜一部解約の制限＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

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

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

①内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

②外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）の評価方法

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

③外国投資信託証券の評価方法

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

④マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

⑤マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

・国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

・外国上場株式、外国上場投資信託受益証券（海外REITを含みます。）、外国上場投資証券（海外REITを含みます。）（上場には店頭登録を含みます。）

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

・公社債等（仕組債を含みます。）

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

a.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c.価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

・市場デリバティブ取引

金融商品取引所が発表する計算日の清算値段又は帳入値段で評価します。

・店頭デリバティブ取引

計算日における次のa.又はb.のいずれかの価額で評価します。

a.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

b.価格情報会社の提供する価額

⑥外貨建資産等の円換算

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

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2018年10月26日設定）

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとします。

ただし、第1計算期間は2018年10月26日から2019年7月10日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合

・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合

・やむを得ない事情が発生した場合

②委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらか

じめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知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。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

④上記①から③までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき
・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知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。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファン

ドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

①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投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

①信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

②上記①ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

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。

４【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

①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。

②収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③上記②の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

④上記②に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(2)償還金に対する請求権

①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。

②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

④受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2020年7月11日から2021年7月12日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 （2020年 7月10日現在）	第3期 （2021年 7月12日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	459,556,923	296,642,623
投資信託受益証券	4,043,559,879	2,985,986,389
投資証券	323,629,869	251,534,902
親投資信託受益証券	7,054,121,459	9,429,691,996
流動資産合計	11,880,868,130	12,963,855,910
資産合計	11,880,868,130	12,963,855,910
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,700,527	37,508,465
未払受託者報酬	3,109,759	3,414,678
未払委託者報酬	82,719,422	90,830,210
未払利息	246	452
その他未払費用	311,500	341,411
流動負債合計	93,841,454	132,095,216
負債合計	93,841,454	132,095,216
純資産の部		
元本等		
元本	11,844,702,620	10,867,635,054
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△57,675,944	1,964,125,640
（分配準備積立金）	72,311,332	1,543,253,919
元本等合計	11,787,026,676	12,831,760,694
純資産合計	11,787,026,676	12,831,760,694
負債純資産合計	11,880,868,130	12,963,855,910

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自　2019年 7月11日 至　2020年 7月10日	第3期 自　2020年 7月11日 至　2021年 7月12日
営業収益		
受取配当金	9,195,037	-
受取利息	1,539	873
有価証券売買等損益	△218,081,594	2,272,271,541
営業収益合計	△208,885,018	2,272,272,414
営業費用		
支払利息	209,014	95,243
受託者報酬	6,010,099	6,749,570
委託者報酬	159,868,379	179,538,203
その他費用	601,681	674,838
営業費用合計	166,689,173	187,057,854
営業利益又は営業損失（△）	△375,574,191	2,085,214,560
経常利益又は経常損失（△）	△375,574,191	2,085,214,560
当期純利益又は当期純損失（△）	△375,574,191	2,085,214,560
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（△）	58,985,089	262,347,122
期首剰余金又は期首欠損金（△）	247,592,224	△57,675,944
剰余金増加額又は欠損金減少額	225,243,135	198,934,146
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	1,307,695
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	225,243,135	197,626,451
剰余金減少額又は欠損金増加額	95,952,023	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	95,952,023	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△57,675,944	1,964,125,640

（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	(1)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、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第3期計算期間は2020年 7月11日から2021年 7月12日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第2期 (2020年 7月10日現在)		第3期 (2021年 7月12日現在)	
１．計算期間の末日における受益権の総数		11,844,702,620口		10,867,635,054口
２．「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55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	57,675,944円	元本の欠損	－円
３．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	0.9951円	1口当たり純資産額	1.1807円
	(1万口当たり純資産額)	(9,951円)	(1万口当たり純資産額)	(11,807円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第2期 自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日	第3期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	－円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	69,224,791円
分配準備積立金額	D	72,311,332円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	141,536,123円
当ファンドの期末残存口数	F	11,844,702,620口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	119円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	137,722,390円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,349,715,548円
収益調整金額	C	420,871,721円
分配準備積立金額	D	55,815,981円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,964,125,640円
当ファンドの期末残存口数	F	10,867,635,054口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,807円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	第3期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第3期 (2021年 7月12日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第2期 自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日	第3期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	8,733,251,025円	11,844,702,620円
期中追加設定元本額	6,207,727,771円	1,926,137,065円
期中一部解約元本額	3,096,276,176円	2,903,204,631円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第2期 (2020年 7月10日現在)	第3期 (2021年 7月12日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	7,681,812	287,136,981
投資証券	1,697,766	8,439,101
親投資信託受益証券	△94,713,785	1,749,102,862
合計	△85,334,207	2,044,678,944

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	ノムラＦＯＦｓ用　日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	457,986,944	448,415,016	
	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	818,704,679	932,750,240	
	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	23,417.361	299,765,638	
	大和住銀／ウエリントン・ワールド・ボンド（適格機関投資家専用）	10,816,219	10,937,360	
	グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	219,239,671	325,395,519	
	ＬＭ・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	178,480,244	214,836,669	
	FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド　為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	71,276,709	76,009,482	
	ＦＯＦｓ用　ピクテ　マルチストラテジー　リンクファンド（適格機関投資家専用）	408,019,816	439,314,935	
	ＦＯＦｓ用世界物価連動債ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	23,114,900	26,147,574	
	マニュライフＦＯＦｓ用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	212,116,993	212,413,956	
投資信託受益証券合計		2,399,779,592.361	2,985,986,389	
投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY	15,838.964	169,241,547	

	MA Hedge Fund Strategies Limited	8,028	82,293,355	
投資証券合計		23,866.964	251,534,902	
親投資信託受益証券	Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	409,005,482	937,317,863	
	グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	408,099,388	929,936,075	
	国内株式インデックス　マザーファンド	1,178,861,159	2,223,803,690	
	外国株式インデックス　マザーファンド	664,326,699	2,580,842,792	
	外国債券インデックス　マザーファンド	271,449,363	835,303,979	
	グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド	663,375,528	253,210,439	
	新興国債券インデックス　マザーファンド	43,103,997	75,940,621	
	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	557,552,669	704,969,594	
	コモディティＬＳアルファ・マザーファンド	275,252,897	311,145,874	
	米国株式ＬＳマザーファンド	295,448,402	286,939,488	
	日本債券ツイン戦略マザーファンド	201,073,191	200,771,581	
	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	100,000,000	89,510,000	
親投資信託受益証券合計		5,067,548,775	9,429,691,996	
合計			12,667,213,287	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。
なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,036,524,443
株式	470,454,256,330
派生商品評価勘定	12,344,400
未収入金	45,360,000

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
未収配当金	577,542,549
差入委託証拠金	148,229,200
流動資産合計	474,274,256,922
資産合計	474,274,256,922
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,783,650
前受金	9,593,200
未払金	22,430,051
未払解約金	580,835,014
未払利息	4,633
流動負債合計	615,646,548
負債合計	615,646,548
純資産の部	
元本等	
元本	251,095,419,520
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	222,563,190,854
元本等合計	473,658,610,374
純資産合計	473,658,610,374
負債純資産合計	474,274,256,922

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 7月12日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	251,095,419,520口
2．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　1.8864円 (1万口当たり純資産額)　(18,864円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

	2021年 7月12日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	217,285,082,423円
期中追加設定元本額	82,161,229,057円
期中一部解約元本額	48,350,891,960円
期末元本額	251,095,419,520円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	424,283,019円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,876,273,577円

区分	2021年 7月12日現在
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	12,736,963円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	10,649,883,524円
世界経済インデックスファンド	2,822,073,484円
日本株式インデックス・オープン	3,539,191,471円
ＤＣマイセレクション２５	6,087,143,675円
ＤＣマイセレクション５０	18,004,570,102円
ＤＣマイセレクション７５	17,667,305,362円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	5,812,599,819円
ＤＣマイセレクションＳ２５	2,953,579,919円
ＤＣマイセレクションＳ５０	8,433,783,508円
ＤＣマイセレクションＳ７５	6,024,260,455円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	7,695,131,908円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	252,406,297円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	683,382,112円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	481,050,238円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,246,862,263円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,547,256,898円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	6,195,294円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	26,725,162円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	20,457,639円
日本株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	197,410,242円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	2,358,345円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	48,505,703円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	169,859,479円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	30,037,864円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	96,601,348円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,147,888,465円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	480,637,604円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,052,300,259円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	224,991,134円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	28,726,222円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	551,680,127円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	317,581,585円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	398,555,983円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	41,816,544円
ＦＯＦｓ用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	646,457,353円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	3,796,671,426円
日本株式ファンド・シリーズ２	1,961,744,624円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,492,806,352円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,088,522,067円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,004,794,091円
分散投資コア戦略ファンドＳ	7,145,826,516円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	418,281,188円

区分	2021年 7月12日現在
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	392,521,843円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,042,957,008円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	206,246,216円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,357,359円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	59,761,332円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	24,692,828,613円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	604,397,930円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	35,074,403円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	118,270,617円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	21,455,096円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	6,106,757円
グローバル経済コア	235,284,349円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	22,575,482円
ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	62,537,046円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	18,037,076円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,178,861,159円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	134,932,760円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	4,291,324円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	2,896,942円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	1,352,118円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	1,188,065円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	42,618,131,726円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	1,180,760,727円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	167,958,933円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	27,254,880円
ＳＭＴＡＭ日本株式インデックスファンドＶＬ－Ｐ（適格機関投資家専用）	46,638,172,549円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	7,226,127,298
合計	7,226,127,298

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 7月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,130,711,800	－	3,140,305,000	9,593,200
合計		3,130,711,800	－	3,140,305,000	9,593,200

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	7,700	2,912.00	22,422,400	
日本水産	221,300	537.00	118,838,100	
マルハニチロ	37,300	2,379.00	88,736,700	
雪国まいたけ	19,600	1,682.00	32,967,200	
カネコ種苗	7,200	1,467.00	10,562,400	
サカタのタネ	28,400	3,755.00	106,642,000	
ホクト	20,000	1,937.00	38,740,000	
ホクリヨウ	3,700	823.00	3,045,100	
住石ホールディングス	41,700	128.00	5,337,600	
日鉄鉱業	5,500	5,910.00	32,505,000	
三井松島ホールディングス	10,000	1,015.00	10,150,000	
ＩＮＰＥＸ	876,600	813.00	712,675,800	
石油資源開発	31,100	1,912.00	59,463,200	
K&Oエナジーグループ	11,600	1,319.00	15,300,400	
ヒノキヤグループ	5,900	2,383.00	14,059,700	
ショーボンドホールディングス	34,000	4,740.00	161,160,000	
ミライト・ホールディングス	82,600	2,073.00	171,229,800	
タマホーム	14,400	2,336.00	33,638,400	
サンヨーホームズ	2,800	721.00	2,018,800	
日本アクア	9,500	536.00	5,092,000	
ファーストコーポレーション	7,300	786.00	5,737,800	
ベステラ	4,600	1,470.00	6,762,000	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	44,700	232.00	10,370,400	
キャンディル	4,100	582.00	2,386,200	

スペースバリューホールディングス	29,100	740.00	21,534,000	
ダイセキ環境ソリューション	4,600	1,180.00	5,428,000	
第一カッター興業	5,900	1,350.00	7,965,000	
安藤・間	152,800	860.00	131,408,000	
東急建設	69,800	813.00	56,747,400	
コムシスホールディングス	84,500	3,085.00	260,682,500	
ビーアールホールディングス	31,900	477.00	15,216,300	
高松コンストラクショングループ	14,800	2,049.00	30,325,200	
東建コーポレーション	7,300	10,340.00	75,482,000	
ソネック	2,500	1,016.00	2,540,000	
ヤマウラ	10,400	911.00	9,474,400	
オリエンタル白石	80,100	281.00	22,508,100	
大成建設	171,300	3,790.00	649,227,000	
大林組	550,500	914.00	503,157,000	
清水建設	515,600	891.00	459,399,600	
飛島建設	15,800	1,089.00	17,206,200	
長谷工コーポレーション	180,300	1,506.00	271,531,800	
松井建設	21,700	798.00	17,316,600	
錢高組	2,400	4,065.00	9,756,000	
鹿島建設	403,300	1,439.00	580,348,700	
不動テトラ	13,500	1,850.00	24,975,000	
大末建設	6,900	987.00	6,810,300	
鉄建建設	11,100	1,894.00	21,023,400	
西松建設	39,400	3,660.00	144,204,000	
三井住友建設	133,000	492.00	65,436,000	
大豊建設	12,100	4,275.00	51,727,500	
前田建設工業	137,900	973.00	134,176,700	
佐田建設	12,700	482.00	6,121,400	
ナカノフドー建設	13,200	422.00	5,570,400	
奥村組	30,300	2,979.00	90,263,700	
東鉄工業	23,600	2,363.00	55,766,800	
イチケン	4,000	1,868.00	7,472,000	
富士ピー・エス	7,100	550.00	3,905,000	
淺沼組	6,600	4,685.00	30,921,000	
戸田建設	228,600	774.00	176,936,400	
熊谷組	25,500	2,854.00	72,777,000	
北野建設	3,400	2,333.00	7,932,200	
植木組	4,900	1,456.00	7,134,400	
矢作建設工業	24,300	731.00	17,763,300	
ピーエス三菱	18,100	619.00	11,203,900	
日本ハウスホールディングス	37,600	404.00	15,190,400	
大東建託	60,100	13,060.00	784,906,000	

新日本建設	23,400	859.00	20,100,600	
ＮＩＰＰＯ	45,500	3,140.00	142,870,000	
東亜道路工業	3,400	4,635.00	15,759,000	
前田道路	34,000	2,205.00	74,970,000	
日本道路	5,300	8,000.00	42,400,000	
東亜建設工業	14,700	2,497.00	36,705,900	
日本国土開発	53,500	585.00	31,297,500	
若築建設	9,900	1,672.00	16,552,800	
東洋建設	61,700	580.00	35,786,000	
五洋建設	233,800	772.00	180,493,600	
世紀東急工業	26,400	873.00	23,047,200	
福田組	6,400	4,940.00	31,616,000	
住友林業	140,800	2,037.00	286,809,600	
日本基礎技術	16,800	572.00	9,609,600	
巴コーポレーション	24,400	381.00	9,296,400	
大和ハウス工業	508,300	3,381.00	1,718,562,300	
ライト工業	31,500	1,905.00	60,007,500	
積水ハウス	597,000	2,293.00	1,368,921,000	
日特建設	14,200	770.00	10,934,000	
北陸電気工事	9,500	1,295.00	12,302,500	
ユアテック	31,500	737.00	23,215,500	
日本リーテック	11,500	1,685.00	19,377,500	
四電工	3,000	3,005.00	9,015,000	
中電工	25,300	2,301.00	58,215,300	
関電工	89,500	895.00	80,102,500	
きんでん	111,800	1,836.00	205,264,800	
東京エネシス	18,300	959.00	17,549,700	
トーエネック	5,500	3,785.00	20,817,500	
住友電設	15,500	2,307.00	35,758,500	
日本電設工業	30,200	1,936.00	58,467,200	
協和エクシオ	83,500	2,747.00	229,374,500	
新日本空調	14,600	2,112.00	30,835,200	
九電工	38,600	3,645.00	140,697,000	
三機工業	39,000	1,448.00	56,472,000	
日揮ホールディングス	183,600	1,028.00	188,740,800	
中外炉工業	6,000	1,933.00	11,598,000	
ヤマト	17,600	816.00	14,361,600	
太平電業	12,200	2,677.00	32,659,400	
高砂熱学工業	49,800	1,918.00	95,516,400	
三晃金属工業	2,200	2,375.00	5,225,000	
朝日工業社	4,100	3,210.00	13,161,000	
明星工業	35,600	745.00	26,522,000	

大氣社	26,800	3,415.00	91,522,000	
ダイダン	12,200	2,618.00	31,939,600	
日比谷総合設備	17,700	1,838.00	32,532,600	
フィル・カンパニー	3,100	2,695.00	8,354,500	
テスホールディングス	10,000	2,084.00	20,840,000	
東洋エンジニアリング	23,100	722.00	16,678,200	
レイズネクスト	29,500	1,181.00	34,839,500	
ニップン	51,500	1,582.00	81,473,000	
日清製粉グループ本社	199,000	1,674.00	333,126,000	
日東富士製粉	1,300	6,930.00	9,009,000	
昭和産業	14,800	3,045.00	45,066,000	
鳥越製粉	15,600	791.00	12,339,600	
中部飼料	21,500	1,153.00	24,789,500	
フィード・ワン	23,700	745.00	17,656,500	
東洋精糖	3,000	1,198.00	3,594,000	
日本甜菜製糖	9,200	1,659.00	15,262,800	
DM三井製糖ホールディングス	13,900	1,864.00	25,909,600	
塩水港精糖	21,000	222.00	4,662,000	
日新製糖	8,300	1,703.00	14,134,900	
森永製菓	41,300	3,675.00	151,777,500	
中村屋	4,200	3,840.00	16,128,000	
江崎グリコ	48,500	4,215.00	204,427,500	
名糖産業	7,800	1,591.00	12,409,800	
井村屋グループ	10,000	2,335.00	23,350,000	
不二家	11,200	2,222.00	24,886,400	
山崎製パン	132,000	1,551.00	204,732,000	
第一屋製パン	3,400	939.00	3,192,600	
モロゾフ	2,800	5,350.00	14,980,000	
亀田製菓	10,000	4,595.00	45,950,000	
寿スピリッツ	17,000	7,700.00	130,900,000	
カルビー	80,300	2,578.00	207,013,400	
森永乳業	32,600	5,980.00	194,948,000	
六甲バター	11,700	1,533.00	17,936,100	
ヤクルト本社	121,200	6,460.00	782,952,000	
明治ホールディングス	116,500	6,800.00	792,200,000	
雪印メグミルク	42,400	2,092.00	88,700,800	
プリマハム	24,800	2,976.00	73,804,800	
日本ハム	67,300	4,325.00	291,072,500	
林兼産業	5,800	582.00	3,375,600	
丸大食品	17,300	1,729.00	29,911,700	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	15,800	3,355.00	53,009,000	
柿安本店	6,100	2,509.00	15,304,900	

伊藤ハム米久ホールディングス	113,400	731.00	82,895,400	
サッポロホールディングス	60,100	2,344.00	140,874,400	
アサヒグループホールディングス	384,900	5,106.00	1,965,299,400	
キリンホールディングス	747,100	2,111.50	1,577,501,650	
宝ホールディングス	130,600	1,368.00	178,660,800	
オエノンホールディングス	50,000	378.00	18,900,000	
養命酒製造	5,400	1,823.00	9,844,200	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	134,900	1,749.00	235,940,100	
サントリー食品インターナショナル	117,900	4,155.00	489,874,500	
ダイドーグループホールディングス	9,900	5,000.00	49,500,000	
伊藤園	53,500	6,650.00	355,775,000	
キーコーヒー	17,300	2,136.00	36,952,800	
ユニカフェ	5,300	996.00	5,278,800	
ジャパンフーズ	2,500	1,225.00	3,062,500	
日清オイリオグループ	22,200	3,060.00	67,932,000	
不二製油グループ本社	42,900	2,540.00	108,966,000	
かどや製油	1,900	4,080.00	7,752,000	
Ｊ－オイルミルズ	16,400	1,863.00	30,553,200	
キッコーマン	126,800	7,110.00	901,548,000	
味の素	419,000	2,879.50	1,206,510,500	
ブルドックソース	8,000	2,355.00	18,840,000	
キユーピー	98,100	2,486.00	243,876,600	
ハウス食品グループ本社	65,900	3,450.00	227,355,000	
カゴメ	72,000	2,899.00	208,728,000	
焼津水産化学工業	8,500	964.00	8,194,000	
アリアケジャパン	16,100	7,030.00	113,183,000	
ピエトロ	2,300	1,721.00	3,958,300	
エバラ食品工業	3,900	2,634.00	10,272,600	
やまみ	1,900	1,921.00	3,649,900	
ニチレイ	83,900	2,951.00	247,588,900	
東洋水産	90,600	4,235.00	383,691,000	
イートアンドホールディングス	6,100	1,955.00	11,925,500	
大冷	2,000	2,004.00	4,008,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,900	742.00	7,345,800	
日清食品ホールディングス	69,100	7,920.00	547,272,000	
永谷園ホールディングス	8,600	2,169.00	18,653,400	
一正蒲鉾	6,800	932.00	6,337,600	
フジッコ	19,100	1,930.00	36,863,000	
ロック・フィールド	19,000	1,523.00	28,937,000	
日本たばこ産業	944,600	2,120.00	2,002,552,000	
ケンコーマヨネーズ	10,800	1,548.00	16,718,400	
わらべや日洋ホールディングス	11,500	2,380.00	27,370,000	

なとり	9,800	1,941.00	19,021,800	
イフジ産業	2,700	954.00	2,575,800	
ピックルスコーポレーション	4,200	3,425.00	14,385,000	
ファーマフーズ	16,600	2,960.00	49,136,000	
北の達人コーポレーション	61,500	478.00	29,397,000	
ユーグレナ	89,700	1,073.00	96,248,100	
紀文食品	10,300	1,331.00	13,709,300	
ミヨシ油脂	6,200	1,278.00	7,923,600	
理研ビタミン	16,600	1,597.00	26,510,200	
片倉工業	23,400	1,490.00	34,866,000	
グンゼ	12,700	4,670.00	59,309,000	
東洋紡	68,300	1,319.00	90,087,700	
ユニチカ	51,700	336.00	17,371,200	
富士紡ホールディングス	8,400	3,870.00	32,508,000	
倉敷紡績	15,900	1,958.00	31,132,200	
シキボウ	9,700	942.00	9,137,400	
日本毛織	57,100	981.00	56,015,100	
トーア紡コーポレーション	6,800	444.00	3,019,200	
帝国繊維	19,600	2,115.00	41,454,000	
帝人	162,100	1,649.00	267,302,900	
東レ	1,245,400	723.00	900,424,200	
サカイオーベックス	4,700	3,100.00	14,570,000	
住江織物	3,800	2,039.00	7,748,200	
日本フエルト	10,800	442.00	4,773,600	
イチカワ	2,600	1,346.00	3,499,600	
日東製網	1,800	1,524.00	2,743,200	
アツギ	13,600	622.00	8,459,200	
ダイニック	6,500	754.00	4,901,000	
セーレン	42,500	2,163.00	91,927,500	
ソトー	7,100	804.00	5,708,400	
東海染工	2,400	1,138.00	2,731,200	
小松マテーレ	28,500	929.00	26,476,500	
ワコールホールディングス	43,000	2,544.00	109,392,000	
ホギメディカル	23,200	3,455.00	80,156,000	
ＴＳＩホールディングス	52,800	379.00	20,011,200	
マツオカコーポレーション	5,600	1,658.00	9,284,800	
ワールド	22,600	1,463.00	33,063,800	
三陽商会	8,900	1,061.00	9,442,900	
ナイガイ	6,900	343.00	2,366,700	
オンワードホールディングス	103,900	352.00	36,572,800	
ルックホールディングス	6,000	1,440.00	8,640,000	
ゴールドウイン	28,500	6,300.00	179,550,000	

デサント	29,400	2,982.00	87,670,800	
キング	9,600	483.00	4,636,800	
ヤマトインターナショナル	15,700	341.00	5,353,700	
特種東海製紙	10,600	4,525.00	47,965,000	
王子ホールディングス	773,900	642.00	496,843,800	
日本製紙	76,000	1,253.00	95,228,000	
三菱製紙	24,400	352.00	8,588,800	
北越コーポレーション	123,000	600.00	73,800,000	
中越パルプ工業	6,500	1,271.00	8,261,500	
巴川製紙所	5,700	797.00	4,542,900	
大王製紙	82,900	1,838.00	152,370,200	
阿波製紙	4,400	402.00	1,768,800	
レンゴー	177,300	916.00	162,406,800	
トーモク	10,500	1,937.00	20,338,500	
ザ・パック	13,000	2,754.00	35,802,000	
クラレ	270,700	1,018.00	275,572,600	
旭化成	1,139,400	1,210.50	1,379,243,700	
共和レザー	9,300	716.00	6,658,800	
昭和電工	130,500	3,265.00	426,082,500	
住友化学	1,353,200	571.00	772,677,200	
住友精化	8,400	3,680.00	30,912,000	
日産化学	94,200	5,350.00	503,970,000	
ラサ工業	5,600	1,846.00	10,337,600	
クレハ	14,700	6,650.00	97,755,000	
多木化学	6,700	5,210.00	34,907,000	
テイカ	12,600	1,310.00	16,506,000	
石原産業	30,800	1,115.00	34,342,000	
片倉コープアグリ	4,400	1,214.00	5,341,600	
日本曹達	24,000	3,240.00	77,760,000	
東ソー	265,700	1,995.00	530,071,500	
トクヤマ	51,100	2,266.00	115,792,600	
セントラル硝子	32,800	2,157.00	70,749,600	
東亞合成	104,900	1,153.00	120,949,700	
大阪ソーダ	17,500	2,424.00	42,420,000	
関東電化工業	40,800	1,007.00	41,085,600	
デンカ	62,700	3,700.00	231,990,000	
信越化学工業	317,900	18,310.00	5,820,749,000	
日本カーバイド工業	6,300	1,291.00	8,133,300	
堺化学工業	12,000	1,871.00	22,452,000	
第一稀元素化学工業	17,300	1,793.00	31,018,900	
エア・ウォーター	175,300	1,659.00	290,822,700	
日本酸素ホールディングス	141,600	2,359.00	334,034,400	

日本化学工業	4,900	3,135.00	15,361,500	
東邦アセチレン	2,600	1,187.00	3,086,200	
日本パーカライジング	86,700	1,136.00	98,491,200	
高圧ガス工業	27,300	676.00	18,454,800	
チタン工業	2,100	1,858.00	3,901,800	
四国化成工業	22,800	1,319.00	30,073,200	
戸田工業	3,700	2,649.00	9,801,300	
ステラ　ケミファ	9,400	2,839.00	26,686,600	
保土谷化学工業	5,000	3,955.00	19,775,000	
日本触媒	31,100	5,280.00	164,208,000	
大日精化工業	14,200	2,325.00	33,015,000	
カネカ	44,500	4,530.00	201,585,000	
三菱瓦斯化学	172,200	2,341.00	403,120,200	
三井化学	148,400	3,680.00	546,112,000	
ＪＳＲ	172,500	3,565.00	614,962,500	
東京応化工業	29,500	7,170.00	211,515,000	
大阪有機化学工業	15,900	3,730.00	59,307,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,149,200	942.30	1,082,891,160	
ＫＨネオケム	28,300	2,556.00	72,334,800	
ダイセル	231,100	928.00	214,460,800	
住友ベークライト	27,000	4,895.00	132,165,000	
積水化学工業	359,800	1,918.00	690,096,400	
日本ゼオン	155,000	1,482.00	229,710,000	
アイカ工業	47,900	3,915.00	187,528,500	
宇部興産	86,800	2,237.00	194,171,600	
積水樹脂	28,100	2,148.00	60,358,800	
タキロンシーアイ	37,200	602.00	22,394,400	
旭有機材	9,700	1,356.00	13,153,200	
ニチバン	9,000	1,775.00	15,975,000	
リケンテクノス	41,900	589.00	24,679,100	
大倉工業	8,100	2,442.00	19,780,200	
積水化成品工業	23,000	610.00	14,030,000	
群栄化学工業	3,900	2,491.00	9,714,900	
タイガースポリマー	9,000	479.00	4,311,000	
ミライアル	5,500	1,283.00	7,056,500	
ダイキアクシス	6,600	841.00	5,550,600	
ダイキョーニシカワ	36,200	700.00	25,340,000	
竹本容器	6,100	993.00	6,057,300	
森六ホールディングス	9,200	2,294.00	21,104,800	
恵和	3,400	3,485.00	11,849,000	
日本化薬	106,400	1,093.00	116,295,200	
カーリットホールディングス	17,000	746.00	12,682,000	

日本精化	12,400	1,607.00	19,926,800	
扶桑化学工業	13,500	4,255.00	57,442,500	
トリケミカル研究所	15,900	3,140.00	49,926,000	
ＡＤＥＫＡ	79,100	2,123.00	167,929,300	
日油	64,700	5,780.00	373,966,000	
新日本理化	28,400	269.00	7,639,600	
ハリマ化成グループ	12,800	885.00	11,328,000	
花王	420,300	6,802.00	2,858,880,600	
第一工業製薬	5,800	3,220.00	18,676,000	
石原ケミカル	4,300	2,154.00	9,262,200	
日華化学	5,800	1,329.00	7,708,200	
ニイタカ	3,600	2,091.00	7,527,600	
三洋化成工業	10,300	5,370.00	55,311,000	
有機合成薬品工業	13,200	386.00	5,095,200	
大日本塗料	19,400	857.00	16,625,800	
日本ペイントホールディングス	709,200	1,381.00	979,405,200	
関西ペイント	193,100	2,783.00	537,397,300	
神東塗料	13,500	193.00	2,605,500	
中国塗料	41,400	872.00	36,100,800	
日本特殊塗料	12,900	1,110.00	14,319,000	
藤倉化成	23,200	515.00	11,948,000	
太陽ホールディングス	12,600	5,120.00	64,512,000	
ＤＩＣ	72,600	2,763.00	200,593,800	
サカタインクス	37,500	1,020.00	38,250,000	
東洋インキＳＣホールディングス	36,300	1,965.00	71,329,500	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	12,000	853.00	10,236,000	
富士フイルムホールディングス	308,500	8,190.00	2,526,615,000	
資生堂	348,800	8,000.00	2,790,400,000	
ライオン	228,200	1,973.00	450,238,600	
高砂香料工業	11,000	2,708.00	29,788,000	
マンダム	36,800	1,989.00	73,195,200	
ミルボン	23,500	6,180.00	145,230,000	
ファンケル	63,900	3,570.00	228,123,000	
コーセー	33,000	17,580.00	580,140,000	
コタ	11,100	1,414.00	15,695,400	
シーボン	2,300	1,978.00	4,549,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	74,900	2,878.00	215,562,200	
ノエビアホールディングス	14,900	5,660.00	84,334,000	
アジュバンコスメジャパン	3,900	1,036.00	4,040,400	
新日本製薬	4,800	2,085.00	10,008,000	
エステー	11,300	1,721.00	19,447,300	
アグロ　カネショウ	6,600	1,409.00	9,299,400	

コニシ	28,800	1,615.00	46,512,000	
長谷川香料	30,300	2,514.00	76,174,200	
星光ＰＭＣ	10,100	935.00	9,443,500	
小林製薬	49,200	9,390.00	461,988,000	
荒川化学工業	14,600	1,190.00	17,374,000	
メック	12,000	3,320.00	39,840,000	
日本高純度化学	4,800	2,901.00	13,924,800	
タカラバイオ	45,900	2,913.00	133,706,700	
ＪＣＵ	19,700	3,725.00	73,382,500	
新田ゼラチン	11,000	635.00	6,985,000	
ＯＡＴアグリオ	3,300	1,401.00	4,623,300	
デクセリアルズ	49,100	2,379.00	116,808,900	
アース製薬	13,200	6,470.00	85,404,000	
北興化学工業	16,300	1,075.00	17,522,500	
大成ラミック	5,400	2,748.00	14,839,200	
クミアイ化学工業	72,600	854.00	62,000,400	
日本農薬	31,300	513.00	16,056,900	
アキレス	12,100	1,388.00	16,794,800	
有沢製作所	24,400	891.00	21,740,400	
日東電工	106,100	8,290.00	879,569,000	
レック	20,800	1,146.00	23,836,800	
三光合成	18,400	443.00	8,151,200	
きもと	26,900	280.00	7,532,000	
藤森工業	15,800	4,190.00	66,202,000	
前澤化成工業	11,100	1,262.00	14,008,200	
未来工業	6,300	1,700.00	10,710,000	
ウェーブロックホールディングス	6,100	697.00	4,251,700	
ＪＳＰ	10,300	1,648.00	16,974,400	
エフピコ	32,300	4,110.00	132,753,000	
天馬	13,200	2,629.00	34,702,800	
信越ポリマー	27,000	1,046.00	28,242,000	
東リ	43,700	241.00	10,531,700	
ニフコ	64,400	3,945.00	254,058,000	
バルカー	14,300	2,168.00	31,002,400	
ユニ・チャーム	372,200	4,482.00	1,668,200,400	
ショーエイコーポレーション	3,900	964.00	3,759,600	
協和キリン	176,600	3,990.00	704,634,000	
武田薬品工業	1,460,400	3,698.00	5,400,559,200	
アステラス製薬	1,521,900	1,918.50	2,919,765,150	
大日本住友製薬	130,100	2,215.00	288,171,500	
塩野義製薬	220,700	5,824.00	1,285,356,800	
わかもと製薬	20,900	329.00	6,876,100	

日本新薬	49,800	8,770.00	436,746,000	
ビオフェルミン製薬	3,000	2,993.00	8,979,000	
中外製薬	549,000	4,238.00	2,326,662,000	
科研製薬	30,000	4,795.00	143,850,000	
エーザイ	193,900	10,530.00	2,041,767,000	
ロート製薬	83,700	3,020.00	252,774,000	
小野薬品工業	403,100	2,524.50	1,017,625,950	
久光製薬	51,100	5,390.00	275,429,000	
持田製薬	24,400	3,725.00	90,890,000	
参天製薬	305,500	1,541.00	470,775,500	
扶桑薬品工業	5,700	2,237.00	12,750,900	
日本ケミファ	2,100	2,249.00	4,722,900	
ツムラ	58,600	3,470.00	203,342,000	
日医工	49,700	862.00	42,841,400	
キッセイ薬品工業	31,100	2,219.00	69,010,900	
生化学工業	31,000	1,111.00	34,441,000	
栄研化学	30,800	2,170.00	66,836,000	
日水製薬	6,500	1,006.00	6,539,000	
鳥居薬品	11,000	2,444.00	26,884,000	
ＪＣＲファーマ	49,500	3,660.00	181,170,000	
東和薬品	25,300	2,549.00	64,489,700	
富士製薬工業	10,800	1,144.00	12,355,200	
ゼリア新薬工業	31,800	2,083.00	66,239,400	
第一三共	1,379,400	2,309.00	3,185,034,600	
キョーリン製薬ホールディングス	38,700	1,804.00	69,814,800	
大幸薬品	21,600	965.00	20,844,000	
ダイト	11,200	3,465.00	38,808,000	
大塚ホールディングス	364,800	4,390.00	1,601,472,000	
大正製薬ホールディングス	41,800	6,020.00	251,636,000	
ペプチドリーム	92,100	4,910.00	452,211,000	
あすか製薬ホールディングス	20,000	965.00	19,300,000	
サワイグループホールディングス	38,400	4,730.00	181,632,000	
日本コークス工業	148,300	101.00	14,978,300	
ニチレキ	20,700	1,351.00	27,965,700	
ユシロ化学工業	9,800	1,195.00	11,711,000	
ビーピー・カストロール	6,300	1,343.00	8,460,900	
富士石油	42,600	261.00	11,118,600	
ＭＯＲＥＳＣＯ	6,300	1,091.00	6,873,300	
出光興産	194,800	2,622.00	510,765,600	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,640,500	470.50	1,242,355,250	
コスモエネルギーホールディングス	55,400	2,542.00	140,826,800	
横浜ゴム	101,600	2,285.00	232,156,000	

ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	92,400	2,225.00	205,590,000	
ブリヂストン	466,700	4,960.00	2,314,832,000	
住友ゴム工業	157,700	1,500.00	236,550,000	
藤倉コンポジット	15,300	488.00	7,466,400	
オカモト	10,600	4,165.00	44,149,000	
フコク	7,700	930.00	7,161,000	
ニッタ	18,100	2,700.00	48,870,000	
住友理工	34,000	724.00	24,616,000	
三ツ星ベルト	21,300	1,827.00	38,915,100	
バンドー化学	30,900	919.00	28,397,100	
日東紡績	26,200	3,210.00	84,102,000	
ＡＧＣ	161,200	4,665.00	751,998,000	
日本板硝子	89,100	606.00	53,994,600	
石塚硝子	3,000	1,877.00	5,631,000	
日本山村硝子	7,400	920.00	6,808,000	
日本電気硝子	65,100	2,509.00	163,335,900	
オハラ	7,000	1,444.00	10,108,000	
住友大阪セメント	31,600	3,000.00	94,800,000	
太平洋セメント	99,800	2,487.00	248,202,600	
日本ヒューム	16,100	733.00	11,801,300	
日本コンクリート工業	38,100	318.00	12,115,800	
三谷セキサン	8,200	4,345.00	35,629,000	
アジアパイルホールディングス	27,200	455.00	12,376,000	
東海カーボン	171,700	1,498.00	257,206,600	
日本カーボン	9,700	4,095.00	39,721,500	
東洋炭素	10,300	2,781.00	28,644,300	
ノリタケカンパニーリミテド	9,700	4,295.00	41,661,500	
ＴＯＴＯ	125,400	5,790.00	726,066,000	
日本碍子	193,200	1,848.00	357,033,600	
日本特殊陶業	133,600	1,618.00	216,164,800	
ＭＡＲＵＷＡ	6,100	11,050.00	67,405,000	
品川リフラクトリーズ	4,100	3,965.00	16,256,500	
黒崎播磨	3,000	4,795.00	14,385,000	
ヨータイ	12,600	1,330.00	16,758,000	
イソライト工業	7,900	682.00	5,387,800	
東京窯業	22,700	319.00	7,241,300	
ニッカトー	8,100	687.00	5,564,700	
フジミインコーポレーテッド	14,100	4,845.00	68,314,500	
クニミネ工業	5,600	1,184.00	6,630,400	
エーアンドエーマテリアル	3,400	1,013.00	3,444,200	
ニチアス	44,400	2,816.00	125,030,400	
ニチハ	24,400	2,900.00	70,760,000	

日本製鉄	828,700	1,828.50	1,515,277,950	
神戸製鋼所	317,800	704.00	223,731,200	
中山製鋼所	24,300	396.00	9,622,800	
合同製鐵	9,400	1,634.00	15,359,600	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	502,300	1,292.00	648,971,600	
東京製鐵	67,700	1,070.00	72,439,000	
共英製鋼	19,600	1,402.00	27,479,200	
大和工業	36,900	3,600.00	132,840,000	
東京鐵鋼	6,700	1,581.00	10,592,700	
大阪製鐵	9,300	1,114.00	10,360,200	
淀川製鋼所	22,800	2,332.00	53,169,600	
丸一鋼管	56,400	2,660.00	150,024,000	
モリ工業	5,200	2,328.00	12,105,600	
大同特殊鋼	28,400	5,330.00	151,372,000	
日本高周波鋼業	6,600	385.00	2,541,000	
日本冶金工業	13,600	2,280.00	31,008,000	
山陽特殊製鋼	20,800	1,577.00	32,801,600	
愛知製鋼	9,800	3,060.00	29,988,000	
日立金属	163,700	2,130.00	348,681,000	
日本金属	4,400	952.00	4,188,800	
大平洋金属	11,800	1,681.00	19,835,800	
新日本電工	112,300	300.00	33,690,000	
栗本鐵工所	7,900	1,690.00	13,351,000	
虹技	2,500	1,111.00	2,777,500	
三菱製鋼	12,900	1,097.00	14,151,300	
日亜鋼業	25,700	291.00	7,478,700	
日本精線	2,500	4,530.00	11,325,000	
エンビプロ・ホールディングス	7,400	1,240.00	9,176,000	
シンニッタン	21,300	250.00	5,325,000	
新家工業	4,300	1,587.00	6,824,100	
大紀アルミニウム工業所	26,300	1,146.00	30,139,800	
日本軽金属ホールディングス	47,400	1,877.00	88,969,800	
三井金属鉱業	46,900	3,050.00	143,045,000	
東邦亜鉛	9,700	1,875.00	18,187,500	
三菱マテリアル	114,700	2,246.00	257,616,200	
住友金属鉱山	221,900	4,405.00	977,469,500	
ＤＯＷＡホールディングス	43,900	4,280.00	187,892,000	
古河機械金属	28,800	1,257.00	36,201,600	
大阪チタニウムテクノロジーズ	18,200	780.00	14,196,000	
東邦チタニウム	31,200	1,021.00	31,855,200	
ＵＡＣＪ	26,400	2,872.00	75,820,800	
ＣＫサンエツ	3,700	3,035.00	11,229,500	

古河電気工業	54,000	2,766.00	149,364,000	
住友電気工業	605,800	1,595.50	966,553,900	
フジクラ	209,900	560.00	117,544,000	
昭和電線ホールディングス	16,900	1,824.00	30,825,600	
東京特殊電線	2,300	2,597.00	5,973,100	
タツタ電線	30,800	557.00	17,155,600	
カナレ電気	3,000	1,677.00	5,031,000	
平河ヒューテック	9,700	1,205.00	11,688,500	
リョービ	21,400	1,521.00	32,549,400	
アーレスティ	21,600	485.00	10,476,000	
アサヒホールディングス	65,200	2,265.00	147,678,000	
稲葉製作所	9,800	1,536.00	15,052,800	
宮地エンジニアリンググループ	5,700	2,456.00	13,999,200	
トーカロ	44,800	1,416.00	63,436,800	
アルファＣｏ	6,100	1,135.00	6,923,500	
ＳＵＭＣＯ	221,400	2,713.00	600,658,200	
川田テクノロジーズ	3,500	3,725.00	13,037,500	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	5,600	6,250.00	35,000,000	
ジェイテックコーポレーション	1,900	3,270.00	6,213,000	
信和	9,200	706.00	6,495,200	
東洋製罐グループホールディングス	110,600	1,427.00	157,826,200	
ホッカンホールディングス	8,800	1,413.00	12,434,400	
コロナ	9,600	930.00	8,928,000	
横河ブリッジホールディングス	29,800	2,079.00	61,954,200	
駒井ハルテック	3,500	1,699.00	5,946,500	
高田機工	1,600	2,734.00	4,374,400	
三和ホールディングス	163,600	1,348.00	220,532,800	
文化シヤッター	51,100	1,171.00	59,838,100	
三協立山	22,400	865.00	19,376,000	
アルインコ	11,500	1,023.00	11,764,500	
東洋シヤッター	3,800	639.00	2,428,200	
ＬＩＸＩＬ	239,000	2,954.00	706,006,000	
日本フイルコン	12,100	519.00	6,279,900	
ノーリツ	36,000	1,859.00	66,924,000	
長府製作所	17,600	2,048.00	36,044,800	
リンナイ	33,800	10,530.00	355,914,000	
ダイニチ工業	8,300	758.00	6,291,400	
日東精工	21,800	595.00	12,971,000	
三洋工業	2,100	1,897.00	3,983,700	
岡部	35,200	658.00	23,161,600	
ジーテクト	21,500	1,544.00	33,196,000	
東プレ	32,400	1,566.00	50,738,400	

高周波熱錬	33,400	577.00	19,271,800	
東京製綱	12,400	1,117.00	13,850,800	
サンコール	14,800	455.00	6,734,000	
モリテック　スチール	13,500	476.00	6,426,000	
パイオラックス	25,700	1,515.00	38,935,500	
エイチワン	17,000	747.00	12,699,000	
日本発條	172,900	863.00	149,212,700	
中央発條	8,400	1,406.00	11,810,400	
アドバネクス	2,500	1,283.00	3,207,500	
立川ブラインド工業	7,600	1,332.00	10,123,200	
三益半導体工業	13,500	2,584.00	34,884,000	
日本ドライケミカル	4,400	1,800.00	7,920,000	
日本製鋼所	52,800	2,809.00	148,315,200	
三浦工業	75,200	4,965.00	373,368,000	
タクマ	58,900	1,714.00	100,954,600	
ツガミ	36,100	1,658.00	59,853,800	
オークマ	20,300	5,480.00	111,244,000	
芝浦機械	18,100	2,569.00	46,498,900	
アマダ	254,600	1,141.00	290,498,600	
アイダエンジニアリング	45,700	966.00	44,146,200	
滝澤鉄工所	5,100	1,123.00	5,727,300	
ＦＵＪＩ	69,300	2,577.00	178,586,100	
牧野フライス製作所	20,400	4,400.00	89,760,000	
オーエスジー	85,700	2,067.00	177,141,900	
ダイジェット工業	2,100	1,313.00	2,757,300	
旭ダイヤモンド工業	46,000	523.00	24,058,000	
DMG森精機	110,000	1,848.00	203,280,000	
ソディック	41,800	1,032.00	43,137,600	
ディスコ	23,600	33,250.00	784,700,000	
日東工器	8,400	1,878.00	15,775,200	
日進工具	13,700	1,468.00	20,111,600	
パンチ工業	14,600	630.00	9,198,000	
冨士ダイス	8,900	669.00	5,954,100	
豊和工業	9,900	820.00	8,118,000	
ＯＫＫ	6,700	440.00	2,948,000	
東洋機械金属	12,600	509.00	6,413,400	
津田駒工業	3,300	881.00	2,907,300	
エンシュウ	4,400	862.00	3,792,800	
島精機製作所	25,500	1,915.00	48,832,500	
オプトラン	21,800	2,412.00	52,581,600	
ＮＣホールディングス	5,300	1,235.00	6,545,500	
イワキポンプ	11,100	913.00	10,134,300	

フリュー	17,000	1,376.00	23,392,000	
ヤマシンフィルタ	35,100	727.00	25,517,700	
日阪製作所	21,500	832.00	17,888,000	
やまびこ	33,700	1,238.00	41,720,600	
平田機工	8,200	6,510.00	53,382,000	
ペガサスミシン製造	17,800	478.00	8,508,400	
マルマエ	7,200	2,142.00	15,422,400	
タツモ	7,400	1,727.00	12,779,800	
ナブテスコ	102,300	4,215.00	431,194,500	
三井海洋開発	18,500	1,978.00	36,593,000	
レオン自動機	17,100	1,387.00	23,717,700	
ＳＭＣ	51,400	67,860.00	3,488,004,000	
ホソカワミクロン	6,100	6,190.00	37,759,000	
ユニオンツール	6,500	4,080.00	26,520,000	
オイレス工業	24,400	1,607.00	39,210,800	
日精エー・エス・ビー機械	5,900	4,830.00	28,497,000	
サトーホールディングス	22,900	2,725.00	62,402,500	
技研製作所	15,300	4,860.00	74,358,000	
日本エアーテック	5,800	1,260.00	7,308,000	
カワタ	4,800	882.00	4,233,600	
日精樹脂工業	13,500	1,374.00	18,549,000	
オカダアイヨン	5,600	1,339.00	7,498,400	
ワイエイシイホールディングス	6,900	1,105.00	7,624,500	
小松製作所	795,400	2,731.50	2,172,635,100	
住友重機械工業	100,500	3,115.00	313,057,500	
日立建機	82,100	3,305.00	271,340,500	
日工	26,500	692.00	18,338,000	
巴工業	6,900	2,290.00	15,801,000	
井関農機	17,700	1,480.00	26,196,000	
ＴＯＷＡ	16,400	2,258.00	37,031,200	
丸山製作所	3,700	1,774.00	6,563,800	
北川鉄工所	8,000	1,672.00	13,376,000	
ローツェ	7,700	9,600.00	73,920,000	
タカキタ	6,300	612.00	3,855,600	
クボタ	922,200	2,272.50	2,095,699,500	
荏原実業	8,900	2,843.00	25,302,700	
三菱化工機	5,700	2,532.00	14,432,400	
月島機械	32,500	1,194.00	38,805,000	
帝国電機製作所	12,300	1,245.00	15,313,500	
新東工業	41,900	803.00	33,645,700	
澁谷工業	15,400	3,180.00	48,972,000	
アイチ　コーポレーション	30,100	855.00	25,735,500	

小森コーポレーション	44,800	824.00	36,915,200	
鶴見製作所	13,600	1,715.00	23,324,000	
住友精密工業	2,600	2,910.00	7,566,000	
日本ギア工業	7,300	322.00	2,350,600	
酒井重工業	3,200	2,653.00	8,489,600	
荏原製作所	72,900	5,450.00	397,305,000	
石井鐵工所	2,600	3,050.00	7,930,000	
西島製作所	17,800	875.00	15,575,000	
北越工業	18,200	1,085.00	19,747,000	
ダイキン工業	223,600	22,025.00	4,924,790,000	
オルガノ	5,700	6,100.00	34,770,000	
トーヨーカネツ	6,700	2,435.00	16,314,500	
栗田工業	95,000	5,550.00	527,250,000	
椿本チエイン	25,100	3,270.00	82,077,000	
大同工業	8,500	1,123.00	9,545,500	
木村化工機	14,900	863.00	12,858,700	
アネスト岩田	29,700	1,050.00	31,185,000	
ダイフク	96,600	10,000.00	966,000,000	
サムコ	4,400	3,240.00	14,256,000	
加藤製作所	9,800	993.00	9,731,400	
油研工業	3,100	1,756.00	5,443,600	
タダノ	84,900	1,151.00	97,719,900	
フジテック	60,500	2,474.00	149,677,000	
ＣＫＤ	40,800	2,306.00	94,084,800	
キトー	14,800	1,682.00	24,893,600	
平和	49,000	2,018.00	98,882,000	
理想科学工業	12,900	1,759.00	22,691,100	
ＳＡＮＫＹＯ	41,800	2,878.00	120,300,400	
日本金銭機械	19,600	618.00	12,112,800	
マースグループホールディングス	11,200	1,624.00	18,188,800	
フクシマガリレイ	12,000	4,485.00	53,820,000	
オーイズミ	7,600	386.00	2,933,600	
ダイコク電機	8,200	921.00	7,552,200	
竹内製作所	29,400	2,904.00	85,377,600	
アマノ	46,000	2,866.00	131,836,000	
ＪＵＫＩ	24,400	797.00	19,446,800	
蛇の目ミシン工業	16,100	753.00	12,123,300	
マックス	23,600	1,837.00	43,353,200	
グローリー	45,100	2,374.00	107,067,400	
新晃工業	16,400	1,934.00	31,717,600	
大和冷機工業	28,300	1,066.00	30,167,800	
セガサミーホールディングス	159,700	1,494.00	238,591,800	

日本ピストンリング	6,500	1,284.00	8,346,000	
リケン	8,200	2,603.00	21,344,600	
ＴＰＲ	23,700	1,499.00	35,526,300	
ツバキ・ナカシマ	33,900	1,698.00	57,562,200	
ホシザキ	55,300	9,420.00	520,926,000	
大豊工業	14,400	941.00	13,550,400	
日本精工	360,600	917.00	330,670,200	
ＮＴＮ	406,200	292.00	118,610,400	
ジェイテクト	168,500	1,147.00	193,269,500	
不二越	16,300	4,320.00	70,416,000	
日本トムソン	48,200	662.00	31,908,400	
ＴＨＫ	109,500	3,425.00	375,037,500	
ユーシン精機	11,800	829.00	9,782,200	
前澤給装工業	12,300	1,063.00	13,074,900	
イーグル工業	21,800	1,124.00	24,503,200	
前澤工業	10,700	692.00	7,404,400	
日本ピラー工業	17,800	2,293.00	40,815,400	
キッツ	54,300	774.00	42,028,200	
マキタ	228,900	5,500.00	1,258,950,000	
日立造船	139,500	792.00	110,484,000	
三菱重工業	275,800	3,236.00	892,488,800	
ＩＨＩ	118,100	2,551.00	301,273,100	
スター精密	27,100	1,698.00	46,015,800	
日清紡ホールディングス	107,400	944.00	101,385,600	
イビデン	84,600	6,070.00	513,522,000	
コニカミノルタ	357,900	612.00	219,034,800	
ブラザー工業	214,800	2,246.00	482,440,800	
ミネベアミツミ	302,900	3,125.00	946,562,500	
日立製作所	843,900	6,729.00	5,678,603,100	
東芝	347,400	4,935.00	1,714,419,000	
三菱電機	1,755,300	1,484.50	2,605,742,850	
富士電機	105,800	5,230.00	553,334,000	
東洋電機製造	7,000	1,157.00	8,099,000	
安川電機	189,000	5,760.00	1,088,640,000	
シンフォニアテクノロジー	22,800	1,282.00	29,229,600	
明電舎	29,800	2,241.00	66,781,800	
オリジン	4,900	1,344.00	6,585,600	
山洋電気	8,600	7,760.00	66,736,000	
デンヨー	15,000	2,005.00	30,075,000	
東芝テック	18,900	4,650.00	87,885,000	
芝浦メカトロニクス	3,200	7,880.00	25,216,000	
マブチモーター	48,800	4,225.00	206,180,000	

日本電産	422,500	13,115.00	5,541,087,500	
トレックス・セミコンダクター	9,800	3,000.00	29,400,000	
東光高岳	9,700	1,353.00	13,124,100	
ダイヘン	19,200	4,800.00	92,160,000	
ヤーマン	29,400	1,350.00	39,690,000	
ＪＶＣケンウッド	156,400	235.00	36,754,000	
ミマキエンジニアリング	17,100	788.00	13,474,800	
Ｉ－ＰＥＸ	8,600	2,384.00	20,502,400	
日新電機	41,200	1,364.00	56,196,800	
大崎電気工業	35,100	629.00	22,077,900	
オムロン	146,100	9,370.00	1,368,957,000	
日東工業	25,800	1,882.00	48,555,600	
ＩＤＥＣ	23,600	2,253.00	53,170,800	
正興電機製作所	6,100	1,741.00	10,620,100	
不二電機工業	3,700	1,290.00	4,773,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	63,500	2,803.00	177,990,500	
サクサホールディングス	4,200	1,338.00	5,619,600	
メルコホールディングス	6,300	5,650.00	35,595,000	
テクノメディカ	4,600	1,611.00	7,410,600	
日本電気	223,100	5,660.00	1,262,746,000	
富士通	157,900	21,165.00	3,341,953,500	
沖電気工業	71,400	1,024.00	73,113,600	
岩崎通信機	7,700	942.00	7,253,400	
電気興業	8,500	2,253.00	19,150,500	
サンケン電気	20,500	5,490.00	112,545,000	
ナカヨ	3,500	1,430.00	5,005,000	
アイホン	10,000	2,041.00	20,410,000	
ルネサスエレクトロニクス	841,700	1,213.00	1,020,982,100	
セイコーエプソン	217,800	1,957.00	426,234,600	
ワコム	128,600	710.00	91,306,000	
アルバック	32,300	5,600.00	180,880,000	
アクセル	8,500	882.00	7,497,000	
ＥＩＺＯ	14,900	4,935.00	73,531,500	
日本信号	41,100	926.00	38,058,600	
京三製作所	38,000	424.00	16,112,000	
能美防災	23,700	2,126.00	50,386,200	
ホーチキ	13,600	1,178.00	16,020,800	
星和電機	10,700	515.00	5,510,500	
エレコム	40,700	2,086.00	84,900,200	
パナソニック	1,872,000	1,327.50	2,485,080,000	
シャープ	233,500	1,785.00	416,797,500	
アンリツ	105,600	2,048.00	216,268,800	

富士通ゼネラル	53,600	2,924.00	156,726,400	
ソニーグループ	1,099,600	11,485.00	12,628,906,000	
ＴＤＫ	84,800	13,500.00	1,144,800,000	
帝国通信工業	8,700	1,123.00	9,770,100	
タムラ製作所	63,300	956.00	60,514,800	
アルプスアルパイン	144,300	1,151.00	166,089,300	
池上通信機	5,600	835.00	4,676,000	
鈴木	9,000	950.00	8,550,000	
日本トリム	4,100	3,800.00	15,580,000	
ローランド　ディー．ジー．	10,700	2,708.00	28,975,600	
フォスター電機	17,800	949.00	16,892,200	
ＳＭＫ	4,500	2,450.00	11,025,000	
ヨコオ	14,200	2,554.00	36,266,800	
ホシデン	48,600	1,025.00	49,815,000	
ヒロセ電機	27,100	16,580.00	449,318,000	
日本航空電子工業	40,300	1,844.00	74,313,200	
ＴＯＡ	20,800	857.00	17,825,600	
マクセルホールディングス	35,700	1,282.00	45,767,400	
古野電気	23,700	1,031.00	24,434,700	
ユニデンホールディングス	4,500	2,592.00	11,664,000	
スミダコーポレーション	15,800	1,224.00	19,339,200	
アイコム	7,300	2,404.00	17,549,200	
リオン	7,800	2,762.00	21,543,600	
本多通信工業	15,800	486.00	7,678,800	
横河電機	175,700	1,668.00	293,067,600	
新電元工業	6,800	4,490.00	30,532,000	
アズビル	118,700	4,580.00	543,646,000	
東亜ディーケーケー	10,000	813.00	8,130,000	
日本光電工業	72,900	3,335.00	243,121,500	
チノー	5,600	1,492.00	8,355,200	
共和電業	18,700	385.00	7,199,500	
日本電子材料	7,300	1,796.00	13,110,800	
堀場製作所	34,800	7,170.00	249,516,000	
アドバンテスト	130,500	9,680.00	1,263,240,000	
小野測器	9,200	581.00	5,345,200	
エスペック	16,000	2,236.00	35,776,000	
キーエンス	172,300	58,470.00	10,074,381,000	
日置電機	8,600	7,120.00	61,232,000	
シスメックス	137,100	13,100.00	1,796,010,000	
日本マイクロニクス	31,300	1,444.00	45,197,200	
メガチップス	17,900	3,325.00	59,517,500	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	8,200	3,930.00	32,226,000	

澤藤電機	2,400	2,146.00	5,150,400	
原田工業	8,300	911.00	7,561,300	
コーセル	22,400	1,024.00	22,937,600	
イリソ電子工業	14,900	5,320.00	79,268,000	
オプテックスグループ	29,400	1,810.00	53,214,000	
千代田インテグレ	8,000	1,771.00	14,168,000	
アイ・オー・データ機器	7,500	1,010.00	7,575,000	
レーザーテック	77,100	22,230.00	1,713,933,000	
スタンレー電気	123,200	3,120.00	384,384,000	
岩崎電気	7,000	1,993.00	13,951,000	
ウシオ電機	90,500	2,087.00	188,873,500	
岡谷電機産業	15,400	375.00	5,775,000	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	19,300	341.00	6,581,300	
エノモト	5,500	1,732.00	9,526,000	
日本セラミック	18,200	2,919.00	53,125,800	
遠藤照明	10,300	729.00	7,508,700	
古河電池	13,200	1,508.00	19,905,600	
双信電機	10,500	543.00	5,701,500	
山一電機	12,100	1,630.00	19,723,000	
図研	11,700	3,405.00	39,838,500	
日本電子	32,100	6,630.00	212,823,000	
カシオ計算機	141,200	1,898.00	267,997,600	
ファナック	154,000	27,535.00	4,240,390,000	
日本シイエムケイ	40,300	422.00	17,006,600	
エンプラス	8,200	3,495.00	28,659,000	
大真空	6,200	3,740.00	23,188,000	
ローム	73,100	10,220.00	747,082,000	
浜松ホトニクス	126,100	6,660.00	839,826,000	
三井ハイテック	17,400	6,160.00	107,184,000	
新光電気工業	59,200	3,990.00	236,208,000	
京セラ	267,700	6,833.00	1,829,194,100	
太陽誘電	78,200	5,500.00	430,100,000	
村田製作所	515,700	9,113.00	4,699,574,100	
双葉電子工業	31,400	791.00	24,837,400	
北陸電気工業	7,600	1,030.00	7,828,000	
ニチコン	56,100	1,182.00	66,310,200	
日本ケミコン	17,700	2,636.00	46,657,200	
ＫＯＡ	24,900	1,635.00	40,711,500	
市光工業	27,800	693.00	19,265,400	
小糸製作所	105,300	6,580.00	692,874,000	
ミツバ	32,300	794.00	25,646,200	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	30,500	10,310.00	314,455,000	

キヤノン電子	16,700	1,694.00	28,289,800	
キヤノン	872,300	2,505.00	2,185,111,500	
リコー	446,600	1,226.00	547,531,600	
象印マホービン	48,100	1,610.00	77,441,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	2,900	1,600.00	4,640,000	
東京エレクトロン	102,800	46,710.00	4,801,788,000	
トヨタ紡織	51,200	2,238.00	114,585,600	
芦森工業	3,400	1,188.00	4,039,200	
ユニプレス	28,900	967.00	27,946,300	
豊田自動織機	142,100	9,420.00	1,338,582,000	
モリタホールディングス	28,200	1,624.00	45,796,800	
三櫻工業	24,300	1,186.00	28,819,800	
デンソー	386,500	7,519.00	2,906,093,500	
東海理化電機製作所	46,300	1,754.00	81,210,200	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	67,900	530.00	35,987,000	
川崎重工業	136,600	2,391.00	326,610,600	
名村造船所	52,700	187.00	9,854,900	
日本車輌製造	6,400	2,107.00	13,484,800	
三菱ロジスネクスト	23,200	1,023.00	23,733,600	
近畿車輛	3,000	1,188.00	3,564,000	
日産自動車	2,070,100	586.00	1,213,078,600	
いすゞ自動車	466,000	1,494.00	696,204,000	
トヨタ自動車	1,778,200	9,815.00	17,453,033,000	
日野自動車	219,200	967.00	211,966,400	
三菱自動車工業	649,700	309.00	200,757,300	
エフテック	12,300	839.00	10,319,700	
レシップホールディングス	7,000	569.00	3,983,000	
ＧＭＢ	3,200	1,238.00	3,961,600	
ファルテック	3,200	727.00	2,326,400	
武蔵精密工業	39,200	2,366.00	92,747,200	
日産車体	25,700	733.00	18,838,100	
新明和工業	49,600	961.00	47,665,600	
極東開発工業	30,300	1,571.00	47,601,300	
トピー工業	14,500	1,282.00	18,589,000	
ティラド	5,500	2,668.00	14,674,000	
曙ブレーキ工業	96,300	172.00	16,563,600	
タチエス	27,000	1,395.00	37,665,000	
ＮＯＫ	85,000	1,356.00	115,260,000	
フタバ産業	44,100	531.00	23,417,100	
ＫＹＢ	19,700	3,745.00	73,776,500	
大同メタル工業	36,400	597.00	21,730,800	
プレス工業	87,200	358.00	31,217,600	

ミクニ	22,600	310.00	7,006,000	
太平洋工業	36,800	1,192.00	43,865,600	
河西工業	23,900	397.00	9,488,300	
アイシン	128,500	4,735.00	608,447,500	
マツダ	550,900	1,061.00	584,504,900	
今仙電機製作所	15,500	702.00	10,881,000	
本田技研工業	1,382,000	3,565.00	4,926,830,000	
スズキ	347,900	4,730.00	1,645,567,000	
ＳＵＢＡＲＵ	503,000	2,149.00	1,080,947,000	
安永	8,500	1,155.00	9,817,500	
ヤマハ発動機	248,000	2,837.00	703,576,000	
ＴＢＫ	21,100	414.00	8,735,400	
エクセディ	23,900	1,638.00	39,148,200	
豊田合成	56,700	2,645.00	149,971,500	
愛三工業	27,600	874.00	24,122,400	
盟和産業	2,800	1,002.00	2,805,600	
日本プラスト	14,900	705.00	10,504,500	
ヨロズ	15,100	1,206.00	18,210,600	
エフ・シー・シー	28,700	1,569.00	45,030,300	
シマノ	65,700	28,460.00	1,869,822,000	
テイ・エス　テック	81,600	1,652.00	134,803,200	
ジャムコ	10,300	1,101.00	11,340,300	
テルモ	538,100	4,412.00	2,374,097,200	
クリエートメディック	5,800	985.00	5,713,000	
日機装	56,700	1,145.00	64,921,500	
日本エム・ディ・エム	10,100	2,252.00	22,745,200	
島津製作所	225,900	4,400.00	993,960,000	
ＪＭＳ	14,900	813.00	12,113,700	
長野計器	12,800	1,052.00	13,465,600	
ブイ・テクノロジー	8,200	5,150.00	42,230,000	
東京計器	11,200	1,068.00	11,961,600	
愛知時計電機	2,300	4,305.00	9,901,500	
インターアクション	8,800	2,473.00	21,762,400	
オーバル	15,800	289.00	4,566,200	
東京精密	29,600	4,950.00	146,520,000	
マニー	69,900	2,591.00	181,110,900	
ニコン	268,100	1,096.00	293,837,600	
トプコン	88,400	1,627.00	143,826,800	
オリンパス	971,200	2,226.00	2,161,891,200	
理研計器	15,500	2,743.00	42,516,500	
タムロン	14,200	2,457.00	34,889,400	
ＨＯＹＡ	342,500	15,030.00	5,147,775,000	

シード	6,900	774.00	5,340,600	
ノーリツ鋼機	15,800	2,554.00	40,353,200	
エー・アンド・デイ	14,800	991.00	14,666,800	
朝日インテック	186,000	2,835.00	527,310,000	
シチズン時計	222,800	417.00	92,907,600	
リズム	5,500	777.00	4,273,500	
大研医器	14,000	551.00	7,714,000	
メニコン	27,000	7,840.00	211,680,000	
シンシア	1,900	608.00	1,155,200	
松風	8,100	2,050.00	16,605,000	
セイコーホールディングス	24,800	2,403.00	59,594,400	
ニプロ	130,800	1,363.00	178,280,400	
中本パックス	4,500	1,760.00	7,920,000	
スノーピーク	10,400	3,605.00	37,492,000	
パラマウントベッドホールディングス	33,700	2,008.00	67,669,600	
トランザクション	9,600	1,300.00	12,480,000	
粧美堂	5,100	419.00	2,136,900	
ニホンフラッシュ	15,000	1,258.00	18,870,000	
前田工繊	19,300	3,610.00	69,673,000	
永大産業	22,900	299.00	6,847,100	
アートネイチャー	16,900	692.00	11,694,800	
バンダイナムコホールディングス	145,200	7,411.00	1,076,077,200	
アイフィスジャパン	4,500	682.00	3,069,000	
共立印刷	29,300	140.00	4,102,000	
ＳＨＯＥＩ	16,500	4,255.00	70,207,500	
フランスベッドホールディングス	22,600	935.00	21,131,000	
パイロットコーポレーション	29,600	3,835.00	113,516,000	
萩原工業	9,700	1,451.00	14,074,700	
トッパン・フォームズ	31,300	1,082.00	33,866,600	
フジシールインターナショナル	36,100	2,250.00	81,225,000	
タカラトミー	78,700	957.00	75,315,900	
廣済堂	12,200	861.00	10,504,200	
エステールホールディングス	4,700	649.00	3,050,300	
タカノ	6,000	657.00	3,942,000	
プロネクサス	14,100	1,044.00	14,720,400	
ホクシン	10,800	158.00	1,706,400	
ウッドワン	5,900	1,213.00	7,156,700	
大建工業	11,800	2,104.00	24,827,200	
凸版印刷	266,800	1,810.00	482,908,000	
大日本印刷	207,500	2,448.00	507,960,000	
共同印刷	5,400	2,740.00	14,796,000	
ＮＩＳＳＨＡ	36,000	1,609.00	57,924,000	

光村印刷	1,500	1,642.00	2,463,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	8,600	1,819.00	15,643,400	
アシックス	155,200	2,590.00	401,968,000	
ツツミ	4,400	2,390.00	10,516,000	
ローランド	13,700	5,440.00	74,528,000	
小松ウオール工業	5,300	2,057.00	10,902,100	
ヤマハ	104,400	6,050.00	631,620,000	
河合楽器製作所	4,900	4,075.00	19,967,500	
クリナップ	16,300	550.00	8,965,000	
ピジョン	112,700	3,265.00	367,965,500	
オリバー	3,700	3,780.00	13,986,000	
兼松サステック	1,100	1,800.00	1,980,000	
キングジム	14,300	892.00	12,755,600	
リンテック	37,600	2,407.00	90,503,200	
イトーキ	34,800	357.00	12,423,600	
任天堂	100,500	63,720.00	6,403,860,000	
三菱鉛筆	28,900	1,461.00	42,222,900	
タカラスタンダード	36,300	1,600.00	58,080,000	
コクヨ	84,200	1,807.00	152,149,400	
ナカバヤシ	17,300	600.00	10,380,000	
グローブライド	8,500	4,900.00	41,650,000	
オカムラ	60,300	1,516.00	91,414,800	
美津濃	17,400	2,610.00	45,414,000	
東京電力ホールディングス	1,488,800	329.00	489,815,200	
中部電力	537,000	1,336.00	717,432,000	
関西電力	665,000	1,047.00	696,255,000	
中国電力	253,200	1,017.00	257,504,400	
北陸電力	160,500	610.00	97,905,000	
東北電力	411,100	861.00	353,957,100	
四国電力	145,900	754.00	110,008,600	
九州電力	387,600	842.00	326,359,200	
北海道電力	164,300	514.00	84,450,200	
沖縄電力	34,100	1,421.00	48,456,100	
電源開発	139,700	1,624.00	226,872,800	
エフオン	10,600	980.00	10,388,000	
イーレックス	25,800	2,937.00	75,774,600	
レノバ	29,800	4,885.00	145,573,000	
東京瓦斯	337,600	2,058.50	694,949,600	
大阪瓦斯	317,900	2,024.00	643,429,600	
東邦瓦斯	86,300	5,560.00	479,828,000	
北海道瓦斯	9,400	1,585.00	14,899,000	
広島ガス	36,200	377.00	13,647,400	

西部ガスホールディングス	19,800	2,515.00	49,797,000	
静岡ガス	49,800	1,064.00	52,987,200	
メタウォーター	19,700	2,048.00	40,345,600	
ＳＢＳホールディングス	13,000	3,305.00	42,965,000	
東武鉄道	182,900	2,925.00	534,982,500	
相鉄ホールディングス	60,200	2,211.00	133,102,200	
東急	442,700	1,582.00	700,351,400	
京浜急行電鉄	225,400	1,391.00	313,531,400	
小田急電鉄	281,100	2,842.00	798,886,200	
京王電鉄	98,100	6,560.00	643,536,000	
京成電鉄	131,500	3,645.00	479,317,500	
富士急行	23,900	5,170.00	123,563,000	
新京成電鉄	4,500	2,114.00	9,513,000	
東日本旅客鉄道	308,900	8,099.00	2,501,781,100	
西日本旅客鉄道	156,400	6,516.00	1,019,102,400	
東海旅客鉄道	145,900	17,185.00	2,507,291,500	
西武ホールディングス	211,500	1,350.00	285,525,000	
鴻池運輸	27,900	1,222.00	34,093,800	
西日本鉄道	48,700	2,757.00	134,265,900	
ハマキョウレックス	13,500	3,220.00	43,470,000	
サカイ引越センター	8,100	5,780.00	46,818,000	
近鉄グループホールディングス	166,200	4,000.00	664,800,000	
阪急阪神ホールディングス	221,700	3,505.00	777,058,500	
南海電気鉄道	78,800	2,407.00	189,671,600	
京阪ホールディングス	74,000	3,365.00	249,010,000	
神戸電鉄	4,000	3,530.00	14,120,000	
名古屋鉄道	136,700	2,050.00	280,235,000	
山陽電気鉄道	11,900	1,938.00	23,062,200	
アルプス物流	11,600	948.00	10,996,800	
日本通運	57,500	8,240.00	473,800,000	
ヤマトホールディングス	232,900	3,370.00	784,873,000	
山九	42,600	5,000.00	213,000,000	
丸運	9,500	273.00	2,593,500	
丸全昭和運輸	13,500	3,285.00	44,347,500	
センコーグループホールディングス	91,700	1,082.00	99,219,400	
トナミホールディングス	4,000	5,180.00	20,720,000	
ニッコンホールディングス	55,800	2,418.00	134,924,400	
日本石油輸送	1,800	2,588.00	4,658,400	
福山通運	21,300	4,130.00	87,969,000	
セイノーホールディングス	124,500	1,402.00	174,549,000	
エスライン	4,500	910.00	4,095,000	
神奈川中央交通	4,100	3,560.00	14,596,000	

日立物流	36,500	4,500.00	164,250,000	
丸和運輸機関	35,100	1,533.00	53,808,300	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	16,800	1,605.00	26,964,000	
九州旅客鉄道	128,600	2,593.00	333,459,800	
ＳＧホールディングス	314,100	3,015.00	947,011,500	
日本郵船	139,300	5,270.00	734,111,000	
商船三井	99,000	4,980.00	493,020,000	
川崎汽船	51,200	3,550.00	181,760,000	
ＮＳユナイテッド海運	8,600	2,278.00	19,590,800	
飯野海運	81,300	428.00	34,796,400	
共栄タンカー	5,000	864.00	4,320,000	
乾汽船	11,400	1,224.00	13,953,600	
日本航空	405,000	2,471.00	1,000,755,000	
ＡＮＡホールディングス	448,700	2,724.00	1,222,258,800	
パスコ	3,200	1,530.00	4,896,000	
トランコム	5,100	8,500.00	43,350,000	
日新	13,300	1,505.00	20,016,500	
三菱倉庫	57,500	3,330.00	191,475,000	
三井倉庫ホールディングス	17,600	2,595.00	45,672,000	
住友倉庫	58,700	1,589.00	93,274,300	
澁澤倉庫	9,100	2,137.00	19,446,700	
東陽倉庫	27,900	316.00	8,816,400	
日本トランスシティ	36,600	557.00	20,386,200	
ケイヒン	3,200	1,367.00	4,374,400	
中央倉庫	10,100	1,017.00	10,271,700	
川西倉庫	3,000	1,158.00	3,474,000	
安田倉庫	13,600	954.00	12,974,400	
ファイズホールディングス	2,900	799.00	2,317,100	
東洋埠頭	5,100	1,481.00	7,553,100	
宇徳	11,800	532.00	6,277,600	
上組	91,400	2,312.00	211,316,800	
サンリツ	4,300	762.00	3,276,600	
キムラユニティー	4,400	1,305.00	5,742,000	
キユーソー流通システム	4,100	1,690.00	6,929,000	
近鉄エクスプレス	31,400	2,546.00	79,944,400	
東海運	9,500	310.00	2,945,000	
エーアイテイー	10,400	1,098.00	11,419,200	
内外トランスライン	5,800	1,937.00	11,234,600	
日本コンセプト	5,300	1,832.00	9,709,600	
ＮＥＣネッツエスアイ	57,200	1,796.00	102,731,200	
クロスキャット	4,900	974.00	4,772,600	
システナ	61,600	2,207.00	135,951,200	

デジタルアーツ	10,100	8,370.00	84,537,000	
日鉄ソリューションズ	25,000	3,505.00	87,625,000	
キューブシステム	9,400	1,024.00	9,625,600	
WOW　WORLD	2,900	1,963.00	5,692,700	
コア	7,600	1,446.00	10,989,600	
ラクーンホールディングス	12,400	2,357.00	29,226,800	
ソリトンシステムズ	8,900	1,584.00	14,097,600	
ソフトクリエイトホールディングス	6,900	2,744.00	18,933,600	
ＴＩＳ	172,400	2,913.00	502,201,200	
ＪＮＳホールディングス	8,500	600.00	5,100,000	
グリー	106,300	607.00	64,524,100	
GMOペパボ	1,600	4,620.00	7,392,000	
コーエーテクモホールディングス	45,900	5,130.00	235,467,000	
三菱総合研究所	7,500	4,170.00	31,275,000	
電算	2,100	2,321.00	4,874,100	
ＡＧＳ	9,200	883.00	8,123,600	
ファインデックス	14,900	1,208.00	17,999,200	
ブレインパッド	4,500	4,800.00	21,600,000	
ＫＬａｂ	31,600	638.00	20,160,800	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	23,300	1,071.00	24,954,300	
イーブックイニシアティブジャパン	2,900	3,325.00	9,642,500	
ネクソン	436,400	2,325.00	1,014,630,000	
アイスタイル	53,300	494.00	26,330,200	
エムアップホールディングス	4,600	3,470.00	15,962,000	
エイチーム	12,100	1,522.00	18,416,200	
エニグモ	16,600	1,440.00	23,904,000	
テクノスジャパン	14,000	611.00	8,554,000	
コロプラ	57,100	815.00	46,536,500	
ブロードリーフ	86,100	521.00	44,858,100	
クロス・マーケティンググループ	8,200	667.00	5,469,400	
デジタルハーツホールディングス	8,100	1,551.00	12,563,100	
システム情報	13,300	929.00	12,355,700	
メディアドゥ	6,800	4,730.00	32,164,000	
じげん	43,500	455.00	19,792,500	
ブイキューブ	9,600	2,458.00	23,596,800	
エンカレッジ・テクノロジ	3,600	644.00	2,318,400	
サイバーリンクス	5,900	1,532.00	9,038,800	
フィックスターズ	18,800	840.00	15,792,000	
CARTA　HOLDINGS	7,200	1,957.00	14,090,400	
オプティム	12,200	2,133.00	26,022,600	
セレス	5,800	3,240.00	18,792,000	
ＳＨＩＦＴ	8,700	20,680.00	179,916,000	

ティーガイア	18,500	2,007.00	37,129,500	
セック	2,700	2,665.00	7,195,500	
日本アジアグループ	16,600	960.00	15,936,000	
テクマトリックス	26,900	1,889.00	50,814,100	
プロシップ	5,300	1,423.00	7,541,900	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41,700	2,077.00	86,610,900	
GMOペイメントゲートウェイ	33,400	14,090.00	470,606,000	
ザッパラス	7,500	516.00	3,870,000	
システムリサーチ	5,200	2,248.00	11,689,600	
インターネットイニシアティブ	46,000	3,675.00	169,050,000	
さくらインターネット	19,100	617.00	11,784,700	
ヴィンクス	5,200	949.00	4,934,800	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,900	4,695.00	18,310,500	
ＳＲＡホールディングス	9,300	2,742.00	25,500,600	
システムインテグレータ	5,400	654.00	3,531,600	
朝日ネット	14,500	689.00	9,990,500	
ｅＢＡＳＥ	21,000	844.00	17,724,000	
アバント	18,700	1,672.00	31,266,400	
アドソル日進	6,300	2,239.00	14,105,700	
ＯＤＫソリューションズ	4,100	794.00	3,255,400	
フリービット	10,700	784.00	8,388,800	
コムチュア	16,000	2,441.00	39,056,000	
サイバーコム	3,300	1,460.00	4,818,000	
アステリア	12,900	834.00	10,758,600	
アイル	9,800	1,390.00	13,622,000	
マークラインズ	7,300	2,951.00	21,542,300	
メディカル・データ・ビジョン	19,800	2,071.00	41,005,800	
ｇｕｍｉ	24,300	769.00	18,686,700	
ショーケース	4,300	712.00	3,061,600	
モバイルファクトリー	4,200	1,141.00	4,792,200	
テラスカイ	5,700	2,410.00	13,737,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,800	1,916.00	14,944,800	
ＰＣＩホールディングス	8,000	1,164.00	9,312,000	
パイプドＨＤ	3,800	2,280.00	8,664,000	
アイビーシー	3,200	950.00	3,040,000	
ネオジャパン	3,500	1,471.00	5,148,500	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,800	3,310.00	12,578,000	
ラクス	52,000	3,415.00	177,580,000	
ランドコンピュータ	3,000	1,108.00	3,324,000	
ダブルスタンダード	2,300	5,560.00	12,788,000	
オープンドア	10,400	2,336.00	24,294,400	
マイネット	5,600	695.00	3,892,000	

アカツキ	7,000	3,415.00	23,905,000	
ベネフィットジャパン	1,500	1,982.00	2,973,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,600	3,715.00	17,089,000	
カナミックネットワーク	19,000	627.00	11,913,000	
ノムラシステムコーポレーション	8,900	298.00	2,652,200	
チェンジ	31,800	2,754.00	87,577,200	
シンクロ・フード	11,300	369.00	4,169,700	
オークネット	9,400	1,414.00	13,291,600	
キャピタル・アセット・プランニング	3,800	999.00	3,796,200	
セグエグループ	4,800	1,082.00	5,193,600	
エイトレッド	3,400	2,286.00	7,772,400	
マクロミル	35,700	842.00	30,059,400	
ビーグリー	3,600	1,536.00	5,529,600	
オロ	5,500	3,860.00	21,230,000	
ユーザーローカル	5,400	2,004.00	10,821,600	
テモナ	4,100	1,109.00	4,546,900	
ニーズウェル	4,100	631.00	2,587,100	
サインポスト	4,100	789.00	3,234,900	
電算システムホールディングス	6,600	3,000.00	19,800,000	
ソルクシーズ	7,000	958.00	6,706,000	
フェイス	5,800	714.00	4,141,200	
プロトコーポレーション	20,900	1,368.00	28,591,200	
ハイマックス	5,200	1,109.00	5,766,800	
野村総合研究所	299,300	3,640.00	1,089,452,000	
サイバネットシステム	12,800	687.00	8,793,600	
ＣＥホールディングス	9,800	566.00	5,546,800	
日本システム技術	3,300	1,507.00	4,973,100	
インテージホールディングス	21,700	1,580.00	34,286,000	
東邦システムサイエンス	4,900	956.00	4,684,400	
ソースネクスト	83,000	314.00	26,062,000	
インフォコム	15,800	2,887.00	45,614,600	
ＨＥＲＯＺ	5,100	2,158.00	11,005,800	
ラクスル	18,800	5,820.00	109,416,000	
ＩＰＳ	4,200	2,985.00	12,537,000	
ＦＩＧ	20,100	280.00	5,628,000	
システムサポート	5,400	1,345.00	7,263,000	
イーソル	9,700	1,056.00	10,243,200	
アルテリア・ネットワークス	19,300	1,927.00	37,191,100	
ＥｄｕＬａｂ	1,700	5,370.00	9,129,000	
東海ソフト	2,900	1,515.00	4,393,500	
ウイングアーク１ｓｔ	9,200	2,140.00	19,688,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,100	2,161.00	8,860,100	

サーバーワークス	1,800	4,010.00	7,218,000	
東名	2,000	1,063.00	2,126,000	
ヴィッツ	1,800	2,038.00	3,668,400	
トビラシステムズ	2,600	1,310.00	3,406,000	
Ｓａｎｓａｎ	15,300	8,720.00	133,416,000	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	3,400	1,644.00	5,589,600	
ギフティ	10,500	3,695.00	38,797,500	
ベース	2,000	5,380.00	10,760,000	
フォーカスシステムズ	11,900	986.00	11,733,400	
クレスコ	11,500	1,910.00	21,965,000	
フジ・メディア・ホールディングス	179,000	1,243.00	222,497,000	
オービック	54,300	20,800.00	1,129,440,000	
ジャストシステム	24,600	6,510.00	160,146,000	
ＴＤＣソフト	15,500	1,032.00	15,996,000	
Ｚホールディングス	2,367,000	559.70	1,324,809,900	
トレンドマイクロ	92,100	5,820.00	536,022,000	
ＩＤホールディングス	10,300	927.00	9,548,100	
日本オラクル	35,000	8,230.00	288,050,000	
アルファシステムズ	4,700	3,750.00	17,625,000	
フューチャー	21,000	1,954.00	41,034,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	11,500	1,460.00	16,790,000	
ＳＢテクノロジー	6,300	3,030.00	19,089,000	
トーセ	5,200	802.00	4,170,400	
オービックビジネスコンサルタント	17,300	6,510.00	112,623,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	78,600	3,460.00	271,956,000	
アイティフォー	23,000	786.00	18,078,000	
東計電算	2,600	4,545.00	11,817,000	
エックスネット	3,100	1,031.00	3,196,100	
大塚商会	93,300	5,830.00	543,939,000	
サイボウズ	20,300	2,537.00	51,501,100	
電通国際情報サービス	21,400	4,735.00	101,329,000	
ＡＣＣＥＳＳ	22,000	887.00	19,514,000	
デジタルガレージ	28,500	4,990.00	142,215,000	
ＥＭシステムズ	28,900	839.00	24,247,100	
ウェザーニューズ	5,200	5,610.00	29,172,000	
ＣＩＪ	12,100	846.00	10,236,600	
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,185.00	5,733,000	
日本エンタープライズ	19,400	213.00	4,132,200	
WOWOW	8,400	2,468.00	20,731,200	
スカラ	15,900	775.00	12,322,500	
インテリジェント　ウェイブ	10,700	597.00	6,387,900	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	15,500	439.00	6,804,500	

ネットワンシステムズ	70,400	3,815.00	268,576,000	
システムソフト	37,900	256.00	9,702,400	
アルゴグラフィックス	13,500	3,545.00	47,857,500	
マーベラス	27,600	767.00	21,169,200	
エイベックス	29,900	1,746.00	52,205,400	
日本ユニシス	59,900	3,480.00	208,452,000	
兼松エレクトロニクス	9,500	3,695.00	35,102,500	
都築電気	7,900	1,619.00	12,790,100	
ＴＢＳホールディングス	114,500	1,735.00	198,657,500	
日本テレビホールディングス	144,100	1,277.00	184,015,700	
朝日放送グループホールディングス	17,700	706.00	12,496,200	
テレビ朝日ホールディングス	53,500	1,743.00	93,250,500	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	114,400	412.00	47,132,800	
テレビ東京ホールディングス	12,500	2,148.00	26,850,000	
日本ＢＳ放送	6,200	1,099.00	6,813,800	
ビジョン	21,700	1,083.00	23,501,100	
スマートバリュー	5,100	677.00	3,452,700	
ワイヤレスゲート	8,000	434.00	3,472,000	
コネクシオ	10,000	1,564.00	15,640,000	
クロップス	3,600	887.00	3,193,200	
日本電信電話	2,014,700	2,882.00	5,806,365,400	
ＫＤＤＩ	1,381,400	3,492.00	4,823,848,800	
ソフトバンク	1,565,500	1,470.00	2,301,285,000	
光通信	20,300	20,610.00	418,383,000	
エムティーアイ	17,300	689.00	11,919,700	
GMOインターネット	61,100	2,997.00	183,116,700	
ファイバーゲート	5,800	1,481.00	8,589,800	
アイドママーケティングコミュニケーション	5,400	402.00	2,170,800	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	44,700	4,300.00	192,210,000	
学研ホールディングス	24,600	1,334.00	32,816,400	
ゼンリン	31,600	1,151.00	36,371,600	
昭文社ホールディングス	7,800	490.00	3,822,000	
インプレスホールディングス	14,300	246.00	3,517,800	
アイネット	9,100	1,460.00	13,286,000	
松竹	11,400	12,690.00	144,666,000	
東宝	101,700	4,640.00	471,888,000	
東映	5,700	20,290.00	115,653,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	458,800	1,754.00	804,735,200	
ピー・シー・エー	2,600	3,885.00	10,101,000	
ビジネスブレイン太田昭和	6,100	1,762.00	10,748,200	
ＤＴＳ	35,900	2,722.00	97,719,800	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	73,500	5,280.00	388,080,000	

シーイーシー	18,700	1,637.00	30,611,900	
カプコン	147,800	3,095.00	457,441,000	
アイ・エス・ビー	8,200	1,532.00	12,562,400	
ジャステック	11,300	1,243.00	14,045,900	
ＳＣＳＫ	39,800	6,830.00	271,834,000	
日本システムウエア	5,900	2,324.00	13,711,600	
アイネス	17,200	1,408.00	24,217,600	
ＴＫＣ	29,300	3,360.00	98,448,000	
富士ソフト	18,400	5,680.00	104,512,000	
ＮＳＤ	55,600	1,853.00	103,026,800	
コナミホールディングス	62,600	6,300.00	394,380,000	
福井コンピュータホールディングス	8,000	4,305.00	34,440,000	
ＪＢＣＣホールディングス	11,900	1,476.00	17,564,400	
ミロク情報サービス	17,300	1,725.00	29,842,500	
ソフトバンクグループ	1,366,800	7,540.00	10,305,672,000	
ホウスイ	1,400	940.00	1,316,000	
高千穂交易	6,700	1,148.00	7,691,600	
オルバヘルスケアホールディングス	2,800	1,691.00	4,734,800	
伊藤忠食品	4,200	5,320.00	22,344,000	
エレマテック	13,900	1,253.00	17,416,700	
ＪＡＬＵＸ	4,900	1,801.00	8,824,900	
あらた	13,800	4,310.00	59,478,000	
トーメンデバイス	2,200	4,105.00	9,031,000	
東京エレクトロン　デバイス	5,700	5,410.00	30,837,000	
フィールズ	15,100	536.00	8,093,600	
双日	954,800	338.00	322,722,400	
アルフレッサ　ホールディングス	179,300	1,716.00	307,678,800	
横浜冷凍	48,500	900.00	43,650,000	
ラサ商事	9,200	902.00	8,298,400	
アルコニックス	18,400	1,475.00	27,140,000	
神戸物産	119,300	3,845.00	458,708,500	
ハイパー	3,600	544.00	1,958,400	
あい　ホールディングス	24,700	2,167.00	53,524,900	
ディーブイエックス	5,300	1,000.00	5,300,000	
ダイワボウホールディングス	78,800	2,015.00	158,782,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	41,200	2,617.00	107,820,400	
ラクト・ジャパン	7,600	2,755.00	20,938,000	
グリムス	5,100	1,971.00	10,052,100	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30,100	754.00	22,695,400	
八洲電機	13,400	970.00	12,998,000	
メディアスホールディングス	9,800	1,046.00	10,250,800	
レスターホールディングス	18,000	1,950.00	35,100,000	

ジューテックホールディングス	4,000	1,038.00	4,152,000	
大光	6,700	685.00	4,589,500	
ＯＣＨＩホールディングス	5,000	1,282.00	6,410,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	83,800	913.00	76,509,400	
黒谷	4,700	905.00	4,253,500	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	3,100	730.00	2,263,000	
三洋貿易	17,400	1,264.00	21,993,600	
ビューティガレージ	2,800	4,470.00	12,516,000	
ウイン・パートナーズ	12,500	1,015.00	12,687,500	
ミタチ産業	4,800	808.00	3,878,400	
シップヘルスケアホールディングス	61,000	2,709.00	165,249,000	
明治電機工業	6,000	1,407.00	8,442,000	
デリカフーズホールディングス	6,800	652.00	4,433,600	
スターティアホールディングス	3,400	2,017.00	6,857,800	
コメダホールディングス	37,700	2,084.00	78,566,800	
ピーバンドットコム	2,400	787.00	1,888,800	
アセンテック	4,500	1,205.00	5,422,500	
富士興産	5,300	1,089.00	5,771,700	
協栄産業	1,900	1,435.00	2,726,500	
小野建	15,500	1,305.00	20,227,500	
南陽	3,500	2,006.00	7,021,000	
佐鳥電機	10,800	818.00	8,834,400	
エコートレーディング	3,700	661.00	2,445,700	
伯東	10,600	1,523.00	16,143,800	
コンドーテック	13,400	1,011.00	13,547,400	
中山福	10,000	435.00	4,350,000	
ナガイレーベン	22,900	2,572.00	58,898,800	
三菱食品	19,000	2,826.00	53,694,000	
松田産業	12,600	2,201.00	27,732,600	
第一興商	34,000	4,350.00	147,900,000	
メディパルホールディングス	173,300	2,163.00	374,847,900	
ＳＰＫ	7,400	1,377.00	10,189,800	
萩原電気ホールディングス	6,400	2,267.00	14,508,800	
アズワン	12,400	15,050.00	186,620,000	
スズデン	6,000	1,472.00	8,832,000	
尾家産業	5,100	1,235.00	6,298,500	
シモジマ	10,600	1,079.00	11,437,400	
ドウシシャ	16,300	1,722.00	28,068,600	
小津産業	3,800	1,950.00	7,410,000	
高速	9,200	1,468.00	13,505,600	
たけびし	6,100	1,559.00	9,509,900	
リックス	3,900	1,517.00	5,916,300	

丸文	15,400	642.00	9,886,800	
ハピネット	14,400	1,493.00	21,499,200	
橋本総業ホールディングス	3,500	2,766.00	9,681,000	
日本ライフライン	55,900	1,400.00	78,260,000	
タカショー	11,300	870.00	9,831,000	
マルカ	5,600	2,510.00	14,056,000	
ＩＤＯＭ	58,300	691.00	40,285,300	
進和	10,200	2,247.00	22,919,400	
エスケイジャパン	4,300	482.00	2,072,600	
ダイトロン	7,300	1,980.00	14,454,000	
シークス	22,000	1,438.00	31,636,000	
田中商事	5,400	669.00	3,612,600	
オーハシテクニカ	8,900	1,543.00	13,732,700	
白銅	6,200	2,188.00	13,565,600	
ダイコー通産	2,100	1,298.00	2,725,800	
伊藤忠商事	1,209,200	3,245.00	3,923,854,000	
丸紅	1,704,800	966.20	1,647,177,760	
高島	2,800	1,844.00	5,163,200	
長瀬産業	94,900	1,681.00	159,526,900	
蝶理	11,100	1,774.00	19,691,400	
豊田通商	173,700	5,240.00	910,188,000	
三共生興	26,200	570.00	14,934,000	
兼松	69,100	1,464.00	101,162,400	
ツカモトコーポレーション	2,900	1,426.00	4,135,400	
三井物産	1,379,100	2,562.50	3,533,943,750	
日本紙パルプ商事	9,000	3,680.00	33,120,000	
カメイ	22,600	1,185.00	26,781,000	
東都水産	2,000	5,070.00	10,140,000	
ＯＵＧホールディングス	2,700	2,872.00	7,754,400	
スターゼン	12,800	2,168.00	27,750,400	
山善	67,600	1,018.00	68,816,800	
椿本興業	3,200	3,420.00	10,944,000	
住友商事	1,091,000	1,495.50	1,631,590,500	
内田洋行	7,400	4,950.00	36,630,000	
三菱商事	1,052,500	3,104.00	3,266,960,000	
第一実業	7,900	4,410.00	34,839,000	
キヤノンマーケティングジャパン	42,900	2,596.00	111,368,400	
西華産業	9,100	1,653.00	15,042,300	
佐藤商事	14,300	1,129.00	16,144,700	
菱洋エレクトロ	13,200	2,604.00	34,372,800	
東京産業	15,700	630.00	9,891,000	
ユアサ商事	17,700	3,080.00	54,516,000	

神鋼商事	3,900	2,391.00	9,324,900	
トルク	10,500	235.00	2,467,500	
阪和興業	34,600	3,120.00	107,952,000	
正栄食品工業	11,200	3,915.00	43,848,000	
カナデン	14,100	1,066.00	15,030,600	
菱電商事	12,500	1,653.00	20,662,500	
フルサト工業	8,800	1,966.00	17,300,800	
岩谷産業	41,500	6,380.00	264,770,000	
ナイス	6,800	1,992.00	13,545,600	
ニチモウ	2,700	2,080.00	5,616,000	
極東貿易	5,000	2,635.00	13,175,000	
アステナホールディングス	25,300	608.00	15,382,400	
三愛石油	42,600	1,392.00	59,299,200	
稲畑産業	41,600	1,683.00	70,012,800	
ＧＳＩクレオス	8,500	963.00	8,185,500	
明和産業	16,000	473.00	7,568,000	
クワザワホールディングス	6,200	619.00	3,837,800	
ヤマエ久野	12,600	1,196.00	15,069,600	
ワキタ	34,100	1,022.00	34,850,200	
東邦ホールディングス	55,500	1,892.00	105,006,000	
サンゲツ	46,500	1,611.00	74,911,500	
ミツウロコグループホールディングス	25,500	1,316.00	33,558,000	
シナネンホールディングス	6,400	3,150.00	20,160,000	
伊藤忠エネクス	38,300	993.00	38,031,900	
サンリオ	48,600	2,012.00	97,783,200	
サンワテクノス	11,400	1,290.00	14,706,000	
リョーサン	19,100	2,158.00	41,217,800	
新光商事	23,400	781.00	18,275,400	
トーホー	7,800	1,585.00	12,363,000	
三信電気	9,300	2,154.00	20,032,200	
東陽テクニカ	17,100	1,115.00	19,066,500	
モスフードサービス	24,400	3,170.00	77,348,000	
加賀電子	15,700	2,944.00	46,220,800	
ソーダニッカ	16,500	555.00	9,157,500	
立花エレテック	12,800	1,470.00	18,816,000	
フォーバル	6,100	959.00	5,849,900	
ＰＡＬＴＡＣ	27,700	5,350.00	148,195,000	
三谷産業	22,800	385.00	8,778,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	3,900	2,749.00	10,721,100	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,600	1,999.00	3,198,400	
コーア商事ホールディングス	13,000	665.00	8,645,000	
国際紙パルプ商事	37,000	259.00	9,583,000	

ヤマタネ	7,400	1,538.00	11,381,200	
丸紅建材リース	1,700	1,895.00	3,221,500	
日鉄物産	12,300	4,470.00	54,981,000	
泉州電業	4,900	3,850.00	18,865,000	
トラスコ中山	39,600	2,824.00	111,830,400	
オートバックスセブン	63,500	1,545.00	98,107,500	
モリト	12,700	615.00	7,810,500	
加藤産業	25,000	3,380.00	84,500,000	
北恵	4,400	972.00	4,276,800	
イノテック	9,700	1,367.00	13,259,900	
イエローハット	32,700	2,054.00	67,165,800	
ＪＫホールディングス	15,700	815.00	12,795,500	
日伝	14,400	2,192.00	31,564,800	
北沢産業	11,900	251.00	2,986,900	
杉本商事	8,700	2,291.00	19,931,700	
因幡電機産業	46,100	2,637.00	121,565,700	
東テク	5,700	2,818.00	16,062,600	
ミスミグループ本社	216,900	3,985.00	864,346,500	
アルテック	12,800	318.00	4,070,400	
タキヒヨー	5,700	1,893.00	10,790,100	
蔵王産業	3,400	1,508.00	5,127,200	
スズケン	73,200	3,350.00	245,220,000	
ジェコス	12,000	897.00	10,764,000	
グローセル	18,800	440.00	8,272,000	
ローソン	43,800	5,320.00	233,016,000	
サンエー	13,200	4,155.00	54,846,000	
カワチ薬品	12,200	2,196.00	26,791,200	
エービーシー・マート	27,100	6,410.00	173,711,000	
ハードオフコーポレーション	8,100	777.00	6,293,700	
アスクル	28,200	1,634.00	46,078,800	
ゲオホールディングス	23,400	1,228.00	28,735,200	
アダストリア	24,100	1,979.00	47,693,900	
くら寿司	20,400	4,175.00	85,170,000	
キャンドゥ	8,400	1,913.00	16,069,200	
アイケイ	5,500	775.00	4,262,500	
パルグループホールディングス	15,400	1,704.00	26,241,600	
エディオン	73,600	1,093.00	80,444,800	
サーラコーポレーション	35,800	613.00	21,945,400	
ワッツ	8,800	914.00	8,043,200	
ハローズ	7,100	2,785.00	19,773,500	
フジオフードグループ本社	14,600	1,305.00	19,053,000	
あみやき亭	3,900	2,945.00	11,485,500	

大黒天物産	5,600	6,320.00	35,392,000	
ハニーズホールディングス	14,100	1,213.00	17,103,300	
ファーマライズホールディングス	4,700	736.00	3,459,200	
アルペン	13,400	3,050.00	40,870,000	
ハブ	6,100	700.00	4,270,000	
クオールホールディングス	23,600	1,512.00	35,683,200	
ジンズホールディングス	11,800	8,170.00	96,406,000	
ビックカメラ	102,900	1,135.00	116,791,500	
ＤＣＭホールディングス	107,100	1,084.00	116,096,400	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	246,000	2,639.00	649,194,000	
東京一番フーズ	5,100	593.00	3,024,300	
きちりホールディングス	4,600	596.00	2,741,600	
アークランドサービスホールディングス	14,600	2,223.00	32,455,800	
Ｊ．フロント　リテイリング	206,800	1,025.00	211,970,000	
ドトール・日レスホールディングス	27,600	1,759.00	48,548,400	
マツモトキヨシホールディングス	71,500	4,850.00	346,775,000	
ブロンコビリー	9,200	2,402.00	22,098,400	
ＺＯＺＯ	102,000	3,535.00	360,570,000	
トレジャー・ファクトリー	5,500	994.00	5,467,000	
物語コーポレーション	9,300	7,390.00	68,727,000	
ココカラファイン	15,500	8,180.00	126,790,000	
三越伊勢丹ホールディングス	303,000	823.00	249,369,000	
Ｈａｍｅｅ	4,700	1,479.00	6,951,300	
マーケットエンタープライズ	1,500	1,135.00	1,702,500	
ウエルシアホールディングス	91,500	3,375.00	308,812,500	
クリエイトＳＤホールディングス	25,600	3,200.00	81,920,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	20,200	402.00	8,120,400	
ミサワ	4,100	699.00	2,865,900	
ティーライフ	2,600	1,556.00	4,045,600	
チムニー	5,300	1,420.00	7,526,000	
シュッピン	12,100	1,070.00	12,947,000	
オイシックス・ラ・大地	22,900	4,250.00	97,325,000	
ネクステージ	30,700	2,170.00	66,619,000	
ジョイフル本田	50,900	1,376.00	70,038,400	
鳥貴族ホールディングス	6,600	1,866.00	12,315,600	
ホットランド	13,200	1,331.00	17,569,200	
すかいらーくホールディングス	220,600	1,514.00	333,988,400	
ＳＦＰホールディングス	8,400	1,501.00	12,608,400	
綿半ホールディングス	13,300	1,238.00	16,465,400	
ヨシックスホールディングス	3,600	2,350.00	8,460,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	50,600	1,019.00	51,561,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,200	1,762.00	16,210,400	

ＢＥＥＮＯＳ	8,800	3,530.00	31,064,000	
あさひ	13,200	1,359.00	17,938,800	
日本調剤	10,700	1,670.00	17,869,000	
コスモス薬品	17,500	16,220.00	283,850,000	
トーエル	8,900	827.00	7,360,300	
オンリー	3,800	474.00	1,801,200	
セブン&アイ・ホールディングス	676,300	5,088.00	3,441,014,400	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	92,900	983.00	91,320,700	
ツルハホールディングス	37,700	12,550.00	473,135,000	
サンマルクホールディングス	13,900	1,603.00	22,281,700	
フェリシモ	4,100	1,693.00	6,941,300	
トリドールホールディングス	43,000	1,904.00	81,872,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	16,200	686.00	11,113,200	
ウイルプラスホールディングス	3,100	1,038.00	3,217,800	
ＪＭホールディングス	11,800	2,134.00	25,181,200	
サツドラホールディングス	2,800	2,011.00	5,630,800	
アレンザホールディングス	13,500	1,258.00	16,983,000	
串カツ田中ホールディングス	4,800	1,863.00	8,942,400	
バロックジャパンリミテッド	12,500	819.00	10,237,500	
クスリのアオキホールディングス	17,200	7,300.00	125,560,000	
力の源ホールディングス	7,900	619.00	4,890,100	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	101,300	4,240.00	429,512,000	
メディカルシステムネットワーク	15,600	746.00	11,637,600	
はるやまホールディングス	8,700	641.00	5,576,700	
ノジマ	30,900	2,782.00	85,963,800	
カッパ・クリエイト	24,200	1,460.00	35,332,000	
ライトオン	12,900	723.00	9,326,700	
良品計画	199,100	2,093.00	416,716,300	
三城ホールディングス	22,900	269.00	6,160,100	
アドヴァングループ	18,000	924.00	16,632,000	
アルビス	5,700	2,324.00	13,246,800	
コナカ	20,400	350.00	7,140,000	
ハウス　オブ　ローゼ	2,400	1,653.00	3,967,200	
Ｇ－７ホールディングス	8,500	3,455.00	29,367,500	
イオン北海道	23,000	1,053.00	24,219,000	
コジマ	30,300	684.00	20,725,200	
ヒマラヤ	6,400	1,059.00	6,777,600	
コーナン商事	24,700	3,785.00	93,489,500	
エコス	6,600	1,913.00	12,625,800	
ワタミ	22,700	965.00	21,905,500	
マルシェ	4,500	501.00	2,254,500	

パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	345,700	2,409.00	832,791,300	
西松屋チェーン	38,200	1,399.00	53,441,800	
ゼンショーホールディングス	93,000	2,820.00	262,260,000	
幸楽苑ホールディングス	11,000	1,529.00	16,819,000	
ハークスレイ	4,000	976.00	3,904,000	
サイゼリヤ	25,800	2,680.00	69,144,000	
ＶＴホールディングス	66,000	459.00	30,294,000	
魚力	5,600	2,092.00	11,715,200	
フジ・コーポレーション	9,500	1,266.00	12,027,000	
ユナイテッドアローズ	20,000	2,121.00	42,420,000	
ハイデイ日高	25,200	1,875.00	47,250,000	
京都きもの友禅	12,600	261.00	3,288,600	
コロワイド	57,400	2,028.00	116,407,200	
ピーシーデポコーポレーション	21,000	491.00	10,311,000	
壱番屋	12,300	4,965.00	61,069,500	
ＰＬＡＮＴ	5,000	719.00	3,595,000	
スギホールディングス	34,600	7,790.00	269,534,000	
薬王堂ホールディングス	7,700	2,311.00	17,794,700	
スクロール	25,200	856.00	21,571,200	
ヨンドシーホールディングス	16,100	1,832.00	29,495,200	
木曽路	22,800	2,415.00	55,062,000	
ＳＲＳホールディングス	23,000	815.00	18,745,000	
リテールパートナーズ	21,300	1,200.00	25,560,000	
ケーヨー	32,200	851.00	27,402,200	
上新電機	20,000	2,662.00	53,240,000	
日本瓦斯	84,800	1,838.00	155,862,400	
ロイヤルホールディングス	30,200	2,065.00	62,363,000	
いなげや	19,400	1,467.00	28,459,800	
チヨダ	18,200	883.00	16,070,600	
ライフコーポレーション	17,100	3,390.00	57,969,000	
リンガーハット	21,300	2,339.00	49,820,700	
ＭｒＭａｘＨＤ	24,400	646.00	15,762,400	
ＡＯＫＩホールディングス	34,900	673.00	23,487,700	
オークワ	27,300	1,095.00	29,893,500	
コメリ	26,800	2,616.00	70,108,800	
青山商事	39,000	749.00	29,211,000	
しまむら	20,200	10,120.00	204,424,000	
はせがわ	10,700	276.00	2,953,200	
高島屋	126,100	1,264.00	159,390,400	
松屋	37,900	1,028.00	38,961,200	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	82,100	949.00	77,912,900	
近鉄百貨店	6,700	3,165.00	21,205,500	

丸井グループ	146,300	2,090.00	305,767,000	
アクシアル　リテイリング	14,500	3,825.00	55,462,500	
イオン	665,300	2,929.00	1,948,663,700	
イズミ	35,200	4,095.00	144,144,000	
平和堂	32,000	2,052.00	65,664,000	
フジ	21,000	1,946.00	40,866,000	
ヤオコー	19,700	6,230.00	122,731,000	
ゼビオホールディングス	21,300	1,005.00	21,406,500	
ケーズホールディングス	147,500	1,243.00	183,342,500	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	9,500	760.00	7,220,000	
日産東京販売ホールディングス	27,100	242.00	6,558,200	
シルバーライフ	3,700	2,059.00	7,618,300	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	7,700	4,095.00	31,531,500	
ナルミヤ・インターナショナル	3,700	1,119.00	4,140,300	
ブックオフグループホールディングス	10,100	972.00	9,817,200	
ギフト	2,300	2,416.00	5,556,800	
アインホールディングス	25,200	6,650.00	167,580,000	
元気寿司	5,000	2,546.00	12,730,000	
ヤマダホールディングス	580,200	502.00	291,260,400	
アークランドサカモト	27,300	1,474.00	40,240,200	
ニトリホールディングス	68,600	19,695.00	1,351,077,000	
グルメ杵屋	12,800	969.00	12,403,200	
愛眼	13,800	226.00	3,118,800	
ケーユーホールディングス	9,500	960.00	9,120,000	
吉野家ホールディングス	57,000	2,142.00	122,094,000	
松屋フーズホールディングス	8,400	3,610.00	30,324,000	
サガミホールディングス	24,900	1,024.00	25,497,600	
関西スーパーマーケット	13,500	992.00	13,392,000	
王将フードサービス	11,500	5,840.00	67,160,000	
プレナス	19,600	2,075.00	40,670,000	
ミニストップ	12,900	1,393.00	17,969,700	
アークス	33,200	2,218.00	73,637,600	
バローホールディングス	35,500	2,206.00	78,313,000	
ベルク	8,600	5,180.00	44,548,000	
大庄	9,600	1,067.00	10,243,200	
ファーストリテイリング	23,100	80,610.00	1,862,091,000	
サンドラッグ	65,200	3,485.00	227,222,000	
サックスバー　ホールディングス	15,300	617.00	9,440,100	
ヤマザワ	4,300	1,705.00	7,331,500	
やまや	3,500	2,315.00	8,102,500	
ベルーナ	37,500	932.00	34,950,000	
島根銀行	6,000	617.00	3,702,000	

じもとホールディングス	11,700	642.00	7,511,400	
めぶきフィナンシャルグループ	899,500	237.00	213,181,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,700	1,524.00	33,070,800	
九州フィナンシャルグループ	353,500	394.00	139,279,000	
ゆうちょ銀行	490,500	928.00	455,184,000	
富山第一銀行	41,300	278.00	11,481,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,054,700	401.00	422,934,700	
西日本フィナンシャルホールディングス	113,100	628.00	71,026,800	
三十三フィナンシャルグループ	15,000	1,382.00	20,730,000	
第四北越フィナンシャルグループ	28,200	2,429.00	68,497,800	
ひろぎんホールディングス	255,300	588.00	150,116,400	
新生銀行	141,200	1,466.00	206,999,200	
あおぞら銀行	103,100	2,485.00	256,203,500	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	11,842,500	593.10	7,023,786,750	
りそなホールディングス	1,997,900	420.80	840,716,320	
三井住友トラスト・ホールディングス	327,200	3,558.00	1,164,177,600	
三井住友フィナンシャルグループ	1,198,100	3,769.00	4,515,638,900	
千葉銀行	577,700	652.00	376,660,400	
群馬銀行	356,300	349.00	124,348,700	
武蔵野銀行	25,800	1,695.00	43,731,000	
千葉興業銀行	44,100	257.00	11,333,700	
筑波銀行	72,000	172.00	12,384,000	
七十七銀行	54,300	1,171.00	63,585,300	
青森銀行	13,400	2,113.00	28,314,200	
秋田銀行	10,400	1,411.00	14,674,400	
山形銀行	19,500	860.00	16,770,000	
岩手銀行	11,300	1,716.00	19,390,800	
東邦銀行	154,800	212.00	32,817,600	
東北銀行	8,300	1,010.00	8,383,000	
みちのく銀行	11,100	914.00	10,145,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	156,200	1,876.00	293,031,200	
静岡銀行	421,600	831.00	350,349,600	
十六銀行	21,700	1,953.00	42,380,100	
スルガ銀行	151,800	326.00	49,486,800	
八十二銀行	389,900	359.00	139,974,100	
山梨中央銀行	20,100	825.00	16,582,500	
大垣共立銀行	34,200	1,870.00	63,954,000	
福井銀行	14,800	1,396.00	20,660,800	
北國銀行	16,100	2,132.00	34,325,200	
清水銀行	7,100	1,542.00	10,948,200	
富山銀行	3,300	2,257.00	7,448,100	
滋賀銀行	34,700	1,934.00	67,109,800	

南都銀行	25,200	1,874.00	47,224,800	
百五銀行	155,800	310.00	48,298,000	
京都銀行	62,000	4,955.00	307,210,000	
紀陽銀行	61,300	1,502.00	92,072,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	115,200	806.00	92,851,200	
山陰合同銀行	109,100	547.00	59,677,700	
中国銀行	149,000	870.00	129,630,000	
鳥取銀行	5,500	1,118.00	6,149,000	
伊予銀行	229,400	546.00	125,252,400	
百十四銀行	18,400	1,511.00	27,802,400	
四国銀行	24,500	702.00	17,199,000	
阿波銀行	26,500	2,051.00	54,351,500	
大分銀行	10,000	1,703.00	17,030,000	
宮崎銀行	10,800	2,004.00	21,643,200	
佐賀銀行	9,800	1,372.00	13,445,600	
沖縄銀行	15,900	2,548.00	40,513,200	
琉球銀行	37,600	716.00	26,921,600	
セブン銀行	578,400	234.00	135,345,600	
みずほフィナンシャルグループ	2,352,400	1,586.50	3,732,082,600	
高知銀行	6,300	807.00	5,084,100	
山口フィナンシャルグループ	216,100	633.00	136,791,300	
長野銀行	5,700	1,087.00	6,195,900	
名古屋銀行	13,900	2,522.00	35,055,800	
北洋銀行	261,000	239.00	62,379,000	
愛知銀行	5,800	2,831.00	16,419,800	
中京銀行	6,200	1,430.00	8,866,000	
大光銀行	5,900	1,319.00	7,782,100	
愛媛銀行	24,200	766.00	18,537,200	
トマト銀行	6,700	1,032.00	6,914,400	
京葉銀行	73,800	411.00	30,331,800	
栃木銀行	83,600	172.00	14,379,200	
北日本銀行	5,400	1,628.00	8,791,200	
東和銀行	30,400	497.00	15,108,800	
福島銀行	19,800	237.00	4,692,600	
大東銀行	8,300	613.00	5,087,900	
トモニホールディングス	133,800	297.00	39,738,600	
フィデアホールディングス	168,100	122.00	20,508,200	
池田泉州ホールディングス	199,100	160.00	31,856,000	
ＦＰＧ	58,600	746.00	43,715,600	
ジャパンインベストメントアドバイザー	11,800	1,506.00	17,770,800	
マーキュリアホールディングス	7,100	737.00	5,232,700	
ＳＢＩホールディングス	213,400	2,630.00	561,242,000	

ジャフコ　グループ	24,800	6,460.00	160,208,000	
大和証券グループ本社	1,297,000	575.80	746,812,600	
野村ホールディングス	2,643,700	552.20	1,459,851,140	
岡三証券グループ	148,100	422.00	62,498,200	
丸三証券	51,900	621.00	32,229,900	
東洋証券	58,700	158.00	9,274,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	185,300	393.00	72,822,900	
光世証券	4,600	588.00	2,704,800	
水戸証券	47,100	300.00	14,130,000	
いちよし証券	35,100	592.00	20,779,200	
松井証券	85,100	819.00	69,696,900	
マネックスグループ	155,600	719.00	111,876,400	
極東証券	23,500	835.00	19,622,500	
岩井コスモホールディングス	17,900	1,673.00	29,946,700	
藍澤證券	31,300	1,060.00	33,178,000	
マネーパートナーズグループ	19,600	226.00	4,429,600	
スパークス・グループ	81,000	254.00	20,574,000	
かんぽ生命保険	214,600	1,980.00	424,908,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	305,200	4,341.00	1,324,873,200	
アニコム　ホールディングス	48,700	899.00	43,781,300	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	420,400	3,309.00	1,391,103,600	
第一生命ホールディングス	852,000	1,962.00	1,671,624,000	
東京海上ホールディングス	570,200	5,139.00	2,930,257,800	
Ｔ＆Ｄホールディングス	517,400	1,407.00	727,981,800	
アドバンスクリエイト	8,300	980.00	8,134,000	
全国保証	45,100	4,930.00	222,343,000	
あんしん保証	6,700	336.00	2,251,200	
イントラスト	5,300	677.00	3,588,100	
日本モーゲージサービス	9,100	1,012.00	9,209,200	
Ｃａｓａ	5,100	989.00	5,043,900	
アルヒ	25,700	1,425.00	36,622,500	
プレミアグループ	8,100	3,465.00	28,066,500	
クレディセゾン	101,300	1,347.00	136,451,100	
芙蓉総合リース	18,200	7,080.00	128,856,000	
みずほリース	26,800	3,605.00	96,614,000	
東京センチュリー	40,300	6,000.00	241,800,000	
日本証券金融	73,600	824.00	60,646,400	
アイフル	291,200	371.00	108,035,200	
リコーリース	13,700	3,460.00	47,402,000	
イオンフィナンシャルサービス	106,100	1,382.00	146,630,200	
アコム	348,500	470.00	163,795,000	
ジャックス	19,200	2,575.00	49,440,000	

オリエントコーポレーション	470,100	148.00	69,574,800	
オリックス	1,051,100	1,890.50	1,987,104,550	
三菱ＨＣキャピタル	599,200	600.00	359,520,000	
九州リースサービス	8,900	649.00	5,776,100	
日本取引所グループ	467,800	2,509.50	1,173,944,100	
イー・ギャランティ	20,400	2,376.00	48,470,400	
アサックス	9,400	684.00	6,429,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	7,200	2,162.00	15,566,400	
いちご	197,200	364.00	71,780,800	
日本駐車場開発	199,500	168.00	33,516,000	
スター・マイカ・ホールディングス	10,300	1,197.00	12,329,100	
ＳＲＥホールディングス	2,800	7,390.00	20,692,000	
ＡＤワークスグループ	35,100	157.00	5,510,700	
ヒューリック	368,500	1,275.00	469,837,500	
三栄建築設計	7,700	2,044.00	15,738,800	
野村不動産ホールディングス	99,900	2,779.00	277,622,100	
三重交通グループホールディングス	38,500	472.00	18,172,000	
サムティ	25,300	2,297.00	58,114,100	
ディア・ライフ	25,700	476.00	12,233,200	
日本商業開発	11,900	1,719.00	20,456,100	
プレサンスコーポレーション	29,600	1,551.00	45,909,600	
ハウスコム	4,300	1,235.00	5,310,500	
日本管理センター	10,600	1,300.00	13,780,000	
サンセイランディック	6,900	874.00	6,030,600	
フージャースホールディングス	28,200	747.00	21,065,400	
オープンハウス	55,300	5,320.00	294,196,000	
東急不動産ホールディングス	473,200	655.00	309,946,000	
飯田グループホールディングス	145,000	2,670.00	387,150,000	
イーグランド	4,400	1,033.00	4,545,200	
ムゲンエステート	13,800	509.00	7,024,200	
ハウスドゥ	8,500	1,007.00	8,559,500	
シーアールイー	5,500	1,587.00	8,728,500	
グッドコムアセット	9,400	1,458.00	13,705,200	
ジェイ・エス・ビー	3,600	3,905.00	14,058,000	
テンポイノベーション	6,700	895.00	5,996,500	
フェイスネットワーク	2,600	1,365.00	3,549,000	
パーク２４	93,700	2,067.00	193,677,900	
パラカ	5,400	1,700.00	9,180,000	
三井不動産	789,700	2,686.00	2,121,134,200	
三菱地所	1,138,200	1,781.50	2,027,703,300	
平和不動産	30,100	3,805.00	114,530,500	
東京建物	172,000	1,648.00	283,456,000	

ダイビル	45,000	1,439.00	64,755,000	
京阪神ビルディング	31,000	1,432.00	44,392,000	
住友不動産	389,600	3,842.00	1,496,843,200	
テーオーシー	36,400	677.00	24,642,800	
東京楽天地	3,200	4,150.00	13,280,000	
スターツコーポレーション	21,200	2,898.00	61,437,600	
フジ住宅	22,600	634.00	14,328,400	
空港施設	20,100	588.00	11,818,800	
明和地所	10,800	630.00	6,804,000	
ゴールドクレスト	16,600	1,680.00	27,888,000	
エスリード	7,800	1,600.00	12,480,000	
日神グループホールディングス	29,100	466.00	13,560,600	
日本エスコン	31,400	773.00	24,272,200	
タカラレーベン	72,500	346.00	25,085,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	10,700	910.00	9,737,000	
イオンモール	87,700	1,678.00	147,160,600	
毎日コムネット	8,100	731.00	5,921,100	
ファースト住建	8,700	1,169.00	10,170,300	
カチタス	43,400	3,260.00	141,484,000	
トーセイ	25,300	1,199.00	30,334,700	
穴吹興産	4,600	1,982.00	9,117,200	
サンフロンティア不動産	22,700	1,098.00	24,924,600	
エフ・ジェー・ネクスト	18,600	1,037.00	19,288,200	
インテリックス	3,900	710.00	2,769,000	
ランドビジネス	7,300	330.00	2,409,000	
サンネクスタグループ	7,100	985.00	6,993,500	
グランディハウス	15,500	431.00	6,680,500	
日本空港ビルデング	60,500	5,230.00	316,415,000	
明豊ファシリティワークス	8,000	874.00	6,992,000	
日本工営	10,400	3,080.00	32,032,000	
ＬＩＦＵＬＬ	52,200	345.00	18,009,000	
ミクシィ	42,700	2,807.00	119,858,900	
ジェイエイシーリクルートメント	11,700	1,814.00	21,223,800	
日本M&Aセンター	275,200	3,110.00	855,872,000	
メンバーズ	5,100	3,410.00	17,391,000	
中広	3,200	360.00	1,152,000	
ＵＴグループ	24,300	3,425.00	83,227,500	
アイティメディア	5,800	2,079.00	12,058,200	
タケエイ	18,900	1,734.00	32,772,600	
Ｅ・Ｊホールディングス	9,100	1,095.00	9,964,500	
夢真ビーネックスグループ	44,900	1,314.00	58,998,600	
コシダカホールディングス	45,300	628.00	28,448,400	

アルトナー	4,400	846.00	3,722,400	
パソナグループ	18,300	2,338.00	42,785,400	
ＣＤＳ	4,400	1,550.00	6,820,000	
リンクアンドモチベーション	30,800	878.00	27,042,400	
ＧＣＡ	22,300	1,091.00	24,329,300	
エス・エム・エス	57,100	3,375.00	192,712,500	
サニーサイドアップグループ	6,200	738.00	4,575,600	
パーソルホールディングス	167,800	2,290.00	384,262,000	
リニカル	9,800	989.00	9,692,200	
クックパッド	54,000	253.00	13,662,000	
アイ・ケイ・ケイ	8,600	680.00	5,848,000	
学情	6,200	1,338.00	8,295,600	
スタジオアリス	8,600	2,542.00	21,861,200	
シミックホールディングス	9,500	1,571.00	14,924,500	
エプコ	4,400	875.00	3,850,000	
ＮＪＳ	4,300	1,930.00	8,299,000	
綜合警備保障	66,800	5,020.00	335,336,000	
カカクコム	124,000	3,240.00	401,760,000	
アイロムグループ	6,000	2,019.00	12,114,000	
セントケア・ホールディング	12,600	985.00	12,411,000	
サイネックス	3,300	700.00	2,310,000	
ルネサンス	10,700	1,337.00	14,305,900	
ディップ	26,300	3,545.00	93,233,500	
デジタルホールディングス	11,800	2,233.00	26,349,400	
新日本科学	20,800	1,031.00	21,444,800	
キャリアデザインセンター	4,500	1,078.00	4,851,000	
ベネフィット・ワン	61,100	3,435.00	209,878,500	
エムスリー	296,000	7,807.00	2,310,872,000	
ツカダ・グローバルホールディング	13,300	385.00	5,120,500	
アウトソーシング	96,200	2,138.00	205,675,600	
ウェルネット	17,500	525.00	9,187,500	
ワールドホールディングス	5,800	3,190.00	18,502,000	
ディー・エヌ・エー	71,100	2,264.00	160,970,400	
博報堂ＤＹホールディングス	233,600	1,726.00	403,193,600	
ぐるなび	29,800	544.00	16,211,200	
タカミヤ	20,900	525.00	10,972,500	
ジャパンベストレスキューシステム	11,300	953.00	10,768,900	
ファンコミュニケーションズ	46,900	398.00	18,666,200	
ライク	4,600	2,147.00	9,876,200	
ビジネス・ブレークスルー	7,800	418.00	3,260,400	
エスプール	43,400	1,033.00	44,832,200	
ＷＤＢホールディングス	7,800	3,050.00	23,790,000	

手間いらず	2,200	6,390.00	14,058,000	
ティア	10,500	469.00	4,924,500	
ＣＤＧ	1,700	1,590.00	2,703,000	
アドウェイズ	27,600	824.00	22,742,400	
バリューコマース	11,400	3,115.00	35,511,000	
インフォマート	170,000	938.00	159,460,000	
ＪＰホールディングス	49,100	273.00	13,404,300	
エコナックホールディングス	34,000	90.00	3,060,000	
レッグス	4,300	2,631.00	11,313,300	
プレステージ・インターナショナル	63,300	734.00	46,462,200	
アミューズ	9,300	2,378.00	22,115,400	
ドリームインキュベータ	5,400	989.00	5,340,600	
クイック	10,700	1,213.00	12,979,100	
ＴＡＣ	10,500	232.00	2,436,000	
電通グループ	188,700	4,005.00	755,743,500	
イオンファンタジー	6,600	2,154.00	14,216,400	
シーティーエス	19,300	835.00	16,115,500	
ネクシィーズグループ	6,200	919.00	5,697,800	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	47,100	2,832.00	133,387,200	
アルプス技研	15,000	1,999.00	29,985,000	
ダイオーズ	3,600	1,044.00	3,758,400	
日本空調サービス	18,000	725.00	13,050,000	
オリエンタルランド	178,400	16,090.00	2,870,456,000	
ダスキン	39,000	2,568.00	100,152,000	
明光ネットワークジャパン	20,200	588.00	11,877,600	
ファルコホールディングス	8,200	1,684.00	13,808,800	
ラウンドワン	57,400	1,425.00	81,795,000	
リゾートトラスト	77,100	1,868.00	144,022,800	
ビー・エム・エル	21,700	3,905.00	84,738,500	
りらいあコミュニケーションズ	25,700	1,384.00	35,568,800	
リソー教育	86,100	333.00	28,671,300	
早稲田アカデミー	7,500	934.00	7,005,000	
ユー・エス・エス	187,900	1,889.00	354,943,100	
東京個別指導学院	15,300	619.00	9,470,700	
サイバーエージェント	413,500	2,329.00	963,041,500	
楽天グループ	783,900	1,328.00	1,041,019,200	
クリーク・アンド・リバー社	9,000	1,713.00	15,417,000	
モーニングスター	25,100	470.00	11,797,000	
テー・オー・ダブリュー	30,300	321.00	9,726,300	
山田コンサルティンググループ	10,000	1,200.00	12,000,000	
セントラルスポーツ	6,400	2,450.00	15,680,000	
フルキャストホールディングス	14,400	2,300.00	33,120,000	

エン・ジャパン	29,900	3,920.00	117,208,000	
リソルホールディングス	1,900	3,985.00	7,571,500	
テクノプロ・ホールディングス	100,600	2,735.00	275,141,000	
アトラグループ	3,900	331.00	1,290,900	
インターワークス	5,600	415.00	2,324,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	6,800	14,460.00	98,328,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	10,900	3,005.00	32,754,500	
ファーストロジック	3,700	790.00	2,923,000	
三機サービス	3,600	1,077.00	3,877,200	
Ｇｕｎｏｓｙ	10,800	921.00	9,946,800	
デザインワン・ジャパン	5,500	245.00	1,347,500	
イー・ガーディアン	6,900	2,814.00	19,416,600	
リブセンス	10,700	220.00	2,354,000	
ジャパンマテリアル	51,800	1,352.00	70,033,600	
ベクトル	21,200	945.00	20,034,000	
ウチヤマホールディングス	9,100	372.00	3,385,200	
チャーム・ケア・コーポレーション	12,700	1,196.00	15,189,200	
キャリアリンク	5,600	2,093.00	11,720,800	
ＩＢＪ	14,000	1,155.00	16,170,000	
アサンテ	6,200	1,764.00	10,936,800	
バリューＨＲ	6,900	1,677.00	11,571,300	
M&Aキャピタルパートナーズ	13,900	5,660.00	78,674,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,700	1,397.00	9,359,900	
ＥＲＩホールディングス	5,200	654.00	3,400,800	
アビスト	2,700	2,988.00	8,067,600	
シグマクシス	9,300	2,359.00	21,938,700	
ウィルグループ	12,600	1,010.00	12,726,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	26,100	250.00	6,525,000	
メドピア	13,000	4,445.00	57,785,000	
レアジョブ	3,300	1,700.00	5,610,000	
リクルートホールディングス	1,201,500	5,709.00	6,859,363,500	
エラン	23,400	1,273.00	29,788,200	
土木管理総合試験所	9,000	399.00	3,591,000	
ネットマーケティング	8,900	401.00	3,568,900	
日本郵政	1,269,400	921.50	1,169,752,100	
ベルシステム２４ホールディングス	28,300	1,792.00	50,713,600	
鎌倉新書	17,200	1,007.00	17,320,400	
ＳＭＮ	4,000	797.00	3,188,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	3,400	986.00	3,352,400	
エアトリ	10,600	2,783.00	29,499,800	
アトラエ	11,800	2,311.00	27,269,800	
ストライク	6,400	3,780.00	24,192,000	

ソラスト	41,400	1,411.00	58,415,400	
セラク	5,400	2,176.00	11,750,400	
インソース	16,400	2,557.00	41,934,800	
ベイカレント・コンサルティング	11,000	35,750.00	393,250,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,800	2,995.00	11,381,000	
アイモバイル	5,000	1,573.00	7,865,000	
キャリアインデックス	7,200	935.00	6,732,000	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	7,100	1,227.00	8,711,700	
船場	3,700	833.00	3,082,100	
グレイステクノロジー	17,200	1,574.00	27,072,800	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	48,500	2,561.00	124,208,500	
フルテック	2,600	1,369.00	3,559,400	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	5,500	589.00	3,239,500	
ソウルドアウト	4,200	1,773.00	7,446,600	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	3,200	601.00	1,923,200	
ウェルビー	6,400	1,362.00	8,716,800	
エル・ティー・エス	1,700	4,080.00	6,936,000	
ミダック	7,400	4,340.00	32,116,000	
日総工産	13,500	834.00	11,259,000	
キュービーネットホールディングス	7,900	1,672.00	13,208,800	
ＲＰＡホールディングス	20,600	779.00	16,047,400	
スプリックス	5,000	1,200.00	6,000,000	
マネジメントソリューションズ	8,300	2,889.00	23,978,700	
プロレド・パートナーズ	3,200	2,797.00	8,950,400	
テノ．ホールディングス	2,100	1,184.00	2,486,400	
フロンティア・マネジメント	4,000	1,140.00	4,560,000	
ピアラ	1,500	1,043.00	1,564,500	
コプロ・ホールディングス	2,400	1,376.00	3,302,400	
ギークス	3,000	1,888.00	5,664,000	
カーブスホールディングス	46,400	982.00	45,564,800	
フォーラムエンジニアリング	12,000	935.00	11,220,000	
ダイレクトマーケティングミックス	9,000	3,930.00	35,370,000	
ポピンズホールディングス	4,500	4,640.00	20,880,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	6,800	5,440.00	36,992,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	8,800	1,106.00	9,732,800	
リログループ	91,800	2,474.00	227,113,200	
東祥	10,600	1,961.00	20,786,600	
エイチ・アイ・エス	26,800	2,600.00	69,680,000	
ラックランド	4,900	2,702.00	13,239,800	
共立メンテナンス	27,900	3,875.00	108,112,500	
イチネンホールディングス	17,700	1,237.00	21,894,900	
建設技術研究所	10,900	2,345.00	25,560,500	

スペース	11,200	900.00	10,080,000	
長大	6,800	1,945.00	13,226,000	
燦ホールディングス	7,600	1,239.00	9,416,400	
スバル興業	1,100	8,170.00	8,987,000	
東京テアトル	6,600	1,258.00	8,302,800	
タナベ経営	3,400	1,422.00	4,834,800	
ナガワ	5,400	8,710.00	47,034,000	
東京都競馬	11,000	4,540.00	49,940,000	
カナモト	29,700	2,564.00	76,150,800	
西尾レントオール	15,600	3,075.00	47,970,000	
トランス・コスモス	16,100	3,115.00	50,151,500	
乃村工藝社	72,200	885.00	63,897,000	
藤田観光	6,700	2,308.00	15,463,600	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	8,900	1,318.00	11,730,200	
日本管財	18,100	2,567.00	46,462,700	
トーカイ	16,300	2,426.00	39,543,800	
セコム	165,300	8,521.00	1,408,521,300	
セントラル警備保障	8,200	3,070.00	25,174,000	
丹青社	32,000	882.00	28,224,000	
メイテック	20,300	6,210.00	126,063,000	
応用地質	19,100	1,304.00	24,906,400	
船井総研ホールディングス	34,500	2,497.00	86,146,500	
進学会ホールディングス	7,300	424.00	3,095,200	
オオバ	12,200	826.00	10,077,200	
いであ	4,300	1,807.00	7,770,100	
学究社	5,100	1,363.00	6,951,300	
ベネッセホールディングス	61,600	2,753.00	169,584,800	
イオンディライト	20,800	3,640.00	75,712,000	
ナック	8,300	915.00	7,594,500	
ダイセキ	28,200	4,895.00	138,039,000	
ステップ	6,300	1,675.00	10,552,500	
合　計	184,040,800		470,454,256,330	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本債券ツイン戦略マザーファンド

貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,009,913,621
国債証券	16,897,865,900
社債券	48,771,097,000
コール・オプション（買）	4,465,000
プット・オプション（買）	19,345,000
未収入金	698,519,000
未収利息	107,943,349
前払金	5,100,000
前払費用	10,208,593
差入委託証拠金	4,500,000
流動資産合計	67,528,957,463
資産合計	67,528,957,463
負債の部	
流動負債	
コール・オプション（売）	15,090,000
プット・オプション（売）	5,683,000
派生商品評価勘定	5,101,980
未払金	300,000,000
未払解約金	2,488,987
未払利息	1,541
流動負債合計	328,365,508
負債合計	328,365,508
純資産の部	
元本等	
元本	67,304,440,043
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△103,848,088
元本等合計	67,200,591,955
純資産合計	67,200,591,955
負債純資産合計	67,528,957,463

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

	2021年 7月12日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。 (2)債券店頭オプション取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額で評価しております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 7月12日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	67,304,440,043口
2.	「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55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 103,848,088円
3.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9985円 (1万口当たり純資産額) (9,985円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2021年 7月12日現在
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従って債券先物取引、債券店頭オプション取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。債券店頭オプション取引に係る主要なリスクは、オプション相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

	2021年 7月12日現在

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	31,218,365,178円
期中追加設定元本額	42,024,918,927円
期中一部解約元本額	5,938,844,062円
期末元本額	67,304,440,043円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,995,188,157円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,148,854,615円
国内債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	43,963,326,688円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,335,832,972円
債券コア戦略ファンド	705,054,464円
債券コア・セレクション	3,996,512,029円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	201,073,191円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	23,577,601円
日本債券ツイン戦略ファンド（ＳＭＡ専用）	202,686,918円
日本債券ツイン戦略ファンド（適格機関投資家専用）	464,315,281円
ＦＯＦｓ用　日本債券ツイン戦略ファンドＳ（適格機関投資家専用）	1,343,432,967円
私募日本債券ツイン戦略ファンド（適格機関投資家専用）	6,924,585,160円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	202,052,300
社債券	350,582,000
合計	552,634,300

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2021年 7月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	売建	908,040,000	－	913,140,000	△5,100,000
市場取引以外の取引	債券店頭オプション取引				
	買建				
	コール	4,820,796,000	－	4,465,000	4,417,000
	プット	3,221,959,000	－	19,345,000	2,363,000
	売建				
	コール	3,221,959,000	－	15,090,000	△2,616,000
	プット	4,820,796,000	－	5,683,000	△4,352,000
合計		16,993,550,000	－	957,723,000	△5,288,000

(注)1.時価の算定方法

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

債券店頭オプション取引の時価については、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額で評価しております。

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

債券店頭オプション取引の契約額等は、行使価格ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第２回利付国債（４０年）	410,000,000	575,996,700	
	第４回利付国債（４０年）	150,000,000	212,076,000	
	第１２回利付国債（４０年）	550,000,000	510,350,500	
	第１３回利付国債（４０年）	200,000,000	185,006,000	
	第３５１回利付国債（１０年）	300,000,000	304,509,000	
	第３６１回利付国債（１０年）	100,000,000	100,943,000	
	第３６２回利付国債（１０年）	550,000,000	554,521,000	
	第６回利付国債（３０年）	200,000,000	248,678,000	
	第１８回利付国債（３０年）	300,000,000	385,974,000	
	第２９回利付国債（３０年）	100,000,000	134,767,000	
	第３１回利付国債（３０年）	230,000,000	304,584,400	
	第３４回利付国債（３０年）	150,000,000	200,550,000	
	第３５回利付国債（３０年）	100,000,000	130,375,000	
	第３７回利付国債（３０年）	280,000,000	361,687,200	
	第４１回利付国債（３０年）	450,000,000	566,370,000	
	第４６回利付国債（３０年）	200,000,000	243,902,000	
	第４７回利付国債（３０年）	290,000,000	360,507,700	
	第４８回利付国債（３０年）	80,000,000	95,950,400	
	第５１回利付国債（３０年）	420,000,000	396,538,800	
	第５２回利付国債（３０年）	420,000,000	415,350,600	
	第５５回利付国債（３０年）	80,000,000	84,539,200	
	第５８回利付国債（３０年）	290,000,000	305,448,300	
	第６１回利付国債（３０年）	90,000,000	92,228,400	
	第６４回利付国債（３０年）	470,000,000	442,533,200	
	第６５回利付国債（３０年）	70,000,000	65,799,300	
	第６７回利付国債（３０年）	100,000,000	98,782,000	
	第６９回利付国債（３０年）	520,000,000	525,772,000	
	第７０回利付国債（３０年）	1,650,000,000	1,666,368,000	
	第１４７回利付国債（２０年）	440,000,000	519,807,200	
	第１５０回利付国債（２０年）	200,000,000	232,332,000	
	第１５２回利付国債（２０年）	250,000,000	284,437,500	
	第１５８回利付国債（２０年）	190,000,000	197,527,800	
	第１６０回利付国債（２０年）	460,000,000	491,238,600	
	第１６３回利付国債（２０年）	510,000,000	535,642,800	
	第１６５回利付国債（２０年）	500,000,000	515,700,000	
	第１６９回利付国債（２０年）	800,000,000	793,248,000	
	第１７１回利付国債（２０年）	360,000,000	355,647,600	
	第１７２回利付国債（２０年）	270,000,000	271,177,200	
	第１７３回利付国債（２０年）	1,050,000,000	1,052,772,000	
	第１７４回利付国債（２０年）	500,000,000	500,445,000	
	第１７５回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,476,143,500	

	第１７６回利付国債（２０年）	100,000,000	101,639,000	
国債証券合計		15,830,000,000	16,897,865,900	
社債券	第６回みずほＦＧ任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	1,000,000,000	1,010,300,000	
	第８回みずほＦＧ任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	600,000,000	604,674,000	
	第２回野村ホールディングス任意償還・無担保永久社債（劣後特約	100,000,000	102,358,000	
	第３回野村ホールディングス任意償還・無担保永久社債（劣後特約	800,000,000	808,912,000	
	第１回大和証券任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	100,000,000	99,644,000	
	第５回Ａ号太陽生命利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	700,014,000	
	第３回第一生命ＨＤ利払繰延・任意償還付永久社債（劣後）	500,000,000	510,470,000	
	第１回大樹生命保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	402,164,000	
	第２回ＤＭＧ森精機利払繰延・任意償還付無担保永久社債（劣後）	200,000,000	200,324,000	
	第３回ＤＭＧ森精機利払繰延・任意償還付無担保永久社債（劣後）	300,000,000	317,508,000	
	第８回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	300,000,000	301,179,000	
	第７回クレディ・アグリコル期限前償還非上位円貨社債	200,000,000	206,172,000	
	第１回バンコ・サンタンデール・エセ・アー円貨社債	200,000,000	200,882,000	
	第２３回ルノー円貨社債	1,000,000,000	1,000,740,000	
	第２４回ルノー円貨社債	500,000,000	500,580,000	
	第１４回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	200,000,000	201,832,000	
	第１６回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	200,000,000	200,758,000	
	第１回大和ハウス工業利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	400,476,000	
	第１回積水ハウス利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	703,444,000	
	ソシエテ・ジェネラル　０．４７２％　２０２５／０２／２７	200,000,000	199,066,000	
	ＢＮＰパリバ　０．５５７％　２０２７／０５／２０	1,000,000,000	1,001,680,000	
	第１回アサヒグループＨＤ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,000,000,000	1,019,020,000	
	第１回サントリーＨＤ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	401,700,000	
	第３回日鉄興和不動産株式会社無担保社債	200,000,000	201,030,000	
	第１回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	300,000,000	300,639,000	
	第２回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	100,000,000	100,552,000	

第２回ヒューリック利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	306,555,000	
第３回ヒューリック利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	308,085,000	
第４回ヒューリック利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	104,044,000	
第１０回Ｊ．フロント　リテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	100,536,000	
第１０回日本プロロジスリート投資法人無担保投資法人債	100,000,000	100,238,000	
第１１回日本プロロジスリート投資法人無担保投資法人債	200,000,000	201,084,000	
第１回東急不動産ホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後特	200,000,000	203,170,000	
第２回東急不動産ホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後特	300,000,000	306,816,000	
第５回日本土地建物株式会社無担保社債	100,000,000	99,067,000	
第４０回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,659,000	
第４回株式会社マクロミル無担保社債	400,000,000	400,596,000	
第１回住友化学利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	416,488,000	
第２回住友化学利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	600,000,000	604,422,000	
第１６回株式会社ダイセル無担保社債	100,000,000	101,208,000	
第１７回株式会社ダイセル無担保社債	100,000,000	101,740,000	
第１回積水化成品工業株式会社無担保社債	300,000,000	300,012,000	
第１回大日本住友製薬利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	310,044,000	
第２回大日本住友製薬利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	313,128,000	
第１４回Ｚホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,017,000	
第１５回Ｚホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,192,000	
第１７回Ｚホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	303,786,000	
第１回楽天利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	104,368,000	
第４回楽天利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,200,000,000	1,235,328,000	
第６回楽天利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	225,508,000	
第１回ＥＮＥＯＳホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後）	500,000,000	502,750,000	
第２回ＥＮＥＯＳホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後）	600,000,000	610,470,000	
第３回ＥＮＥＯＳホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後）	800,000,000	824,104,000	
第１回ＪＦＥホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後特約付	400,000,000	401,236,000	
	300,000,000	300,522,000	

	第２回株式会社小森コーポレーション無担保社債			
	第１０回日本トムソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,099,000	
	第２２回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,655,000	
	第２回かんぽ生命保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	203,862,000	
	第１回アイシン精機利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	299,565,000	
	第１回住友生命第１回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣	400,000,000	400,124,000	
	第１回明治安田生命２０１９基金特定目的会社特定社債	300,000,000	300,099,000	
	第３回楽天カード株式会社無担保社債	200,000,000	199,586,000	
	第１回日本生命第５回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣	600,000,000	614,898,000	
	第１回住友生命第２回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣	300,000,000	308,316,000	
	第１回日本生命第６回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣	500,000,000	509,050,000	
	第２回シークス株式会社無担保社債	100,000,000	100,233,000	
	第１回ＮＩＳＳＨＡ株式会社無担保社債	100,000,000	100,122,000	
	第１回丸紅利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	202,212,000	
	第１回ニプロ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	306,711,000	
	第８６回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	99,769,000	
	第８７回株式会社クレディセゾン無担保社債	200,000,000	201,134,000	
	第７回イオン利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	600,000,000	619,800,000	
	第１２回株式会社新生銀行無担保社債	200,000,000	200,964,000	
	第２０回みずほフィナンシャルグループ期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	700,511,000	
	第２３回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	400,000,000	401,944,000	
	第１７回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	201,856,000	
	第１８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	202,702,000	
	第２回東京センチュリー利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	500,000,000	507,720,000	
	第３回東京センチュリー利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	311,418,000	
	第３２回東京センチュリー株式会社無担保社債	200,000,000	199,440,000	
	第３３回東京センチュリー株式会社無担保社債	200,000,000	200,738,000	
	第１７回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	500,000,000	500,270,000	
	第１９回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,128,000	
		200,000,000	200,900,000	

第２１回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債			
第２３回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	400,000,000	401,704,000	
第２４回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	400,000,000	403,684,000	
第１０回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	300,000,000	299,973,000	
第２８回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	200,000,000	203,346,000	
第１回オリックス利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	298,239,000	
第２回オリックス利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	199,068,000	
第２０１回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,768,000	
第２回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,162,000	
第１回ＭＳ＆ＡＤインシュアランス利払繰延・期限前償還（劣後特	1,000,000,000	1,003,330,000	
第１回東京海上日動火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	2,000,000,000	2,042,060,000	
第３回三井住友海上火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	500,000,000	503,000,000	
第５回三井住友海上火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,200,000,000	1,226,928,000	
第１回あいおいニッセイ同和損害保険利払繰延・期限前償還（劣	500,000,000	501,445,000	
第２回Ｔ＆Ｄホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後特約付	100,000,000	100,258,000	
第３回Ｔ＆Ｄホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後特約付	100,000,000	100,148,000	
第５回三菱地所株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	200,728,000	
第６回三菱地所株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	102,382,000	
第４０回平和不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,090,000	
第３回東京建物利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	201,648,000	
第３２回東京建物株式会社無担保社債	100,000,000	100,304,000	
第２６回イオンモール株式会社無担保社債	400,000,000	401,220,000	
第１回株式会社東祥無担保社債	100,000,000	100,279,000	
第１回日本都市ファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	100,240,000	
第１７回オリックス不動産投資法人無担保投資法人債	100,000,000	100,240,000	
第７回日本ロジスティクスファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	99,954,000	
第１６７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	296,016,000	
第１７２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	312,354,000	
第７６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	199,000,000	

第７７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	196,382,000	
第１回西日本鉄道株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	200,040,000	
第２回西日本鉄道株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	100,075,000	
第１回商船三井利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	411,168,000	
第１０回日本航空株式会社無担保社債	100,000,000	100,124,000	
第４回株式会社ヤマタネ無担保社債	300,000,000	300,150,000	
第３回ソフトバンク株式会社無担保社債	300,000,000	301,095,000	
第９回ソフトバンク株式会社無担保社債	600,000,000	603,948,000	
第１２回ソフトバンク株式会社無担保社債	300,000,000	300,909,000	
第１３回ソフトバンク株式会社無担保社債	300,000,000	301,137,000	
第２８回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	207,328,000	
第３１回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	101,603,000	
第３３回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	100,368,000	
第３４回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	200,736,000	
第１回ＧＭＯインターネット無担保社債	200,000,000	200,034,000	
第２回ＧＭＯインターネット無担保社債	200,000,000	200,200,000	
第５２９回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,904,000	
第６回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	205,212,000	
第１１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	700,000,000	714,224,000	
第２５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	207,094,000	
第３５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	209,748,000	
第４１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	700,000,000	710,479,000	
第４２回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,049,000	
第４４回東京電力パワーグリッド株式会社社債	500,000,000	502,025,000	
第４５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	303,582,000	
第４６回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	203,784,000	
第１３回コナミホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,363,000	
第３回株式会社バローホールディングス無担保社債	100,000,000	100,123,000	
第１回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	100,601,000	
第２回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債（劣後特約付）	300,000,000	302,451,000	
第３回ソフトバンクグループ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	790,000,000	792,054,000	
第４回ソフトバンクグループ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	205,006,000	

	第４８回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債	600,000,000	610,416,000	
社債券合計		48,190,000,000	48,771,097,000	
合計			65,668,962,900	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	9,020,072,467
コール・ローン	462,251,836
株式	508,808,969,774
投資信託受益証券	308,071,067
投資証券	11,835,425,758
派生商品評価勘定	249,819,571
未収入金	1,503,700
未収配当金	378,733,681
差入委託証拠金	3,500,964,135
流動資産合計	534,565,811,989
資産合計	534,565,811,989
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	26,787,065
前受金	222,995,129
未払金	647,594
未払解約金	359,433,251
未払利息	705
流動負債合計	609,863,744
負債合計	609,863,744
純資産の部	
元本等	
元本	137,442,391,078
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	396,513,557,167
元本等合計	533,955,948,245
純資産合計	533,955,948,245
負債純資産合計	534,565,811,989

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2 .デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3 .外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4 .収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金

	2021年 7月12日現在
	株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 7月12日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	137,442,391,078口
2．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.8849円 (1万口当たり純資産額) (38,849円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2021年 7月12日現在
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	150,285,284,851円
期中追加設定元本額	18,234,274,317円
期中一部解約元本額	31,077,168,090円
期末元本額	137,442,391,078円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,001,406,518円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,331,893円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	27,876,434,113円
世界経済インデックスファンド	8,547,243,595円
外国株式インデックス・オープン	825,570,999円
ＤＣマイセレクション２５	844,802,816円
ＤＣマイセレクション５０	4,033,137,357円
ＤＣマイセレクション７５	4,496,571,805円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	11,103,954,181円
ＤＣマイセレクションＳ２５	407,977,046円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,888,439,666円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,487,974,575円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	68,758,692円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	185,340,786円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	130,628,490円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	10,066,044,781円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,838,874,226円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	6,345,507円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	5,085,097円
外国株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	30,705,658円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	24,672,922円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	88,492,989円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	14,696,140円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	47,259,488円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	386,385,088円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	216,808,865円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,565,927,676円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	548,489,178円

区分	2021年 7月12日現在
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	42,014,656円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	208,460,816円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	72,760,304円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	1,233,470,256円
ＦＯＦｓ用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,381,308,862円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,128,481,876円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,244,951,979円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,587,531,564円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,876,550,513円
分散投資コア戦略ファンドＳ	9,350,780,542円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,307,478,553円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,152,455,706円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,025,879,041円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	638,825,685円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,983,860円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	171,672,657円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	704,178,481円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	26,606,548,980円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	162,076,375円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	553,432,498円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	101,637,381円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	3,382,730円
ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	112,255,264円
グローバル経済コア	682,428,715円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	11,653,306円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	4,607,222円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	664,326,699円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	74,667,735円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	12,842,844円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	8,707,619円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	4,100,299円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	3,668,613円
ＦＯＦｓ用　外国株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	573,562,496円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	868,719,467円
外株インデックス・ファンド２（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,292,498,999円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	802,652,216円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	125,840,782円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	5,394,645円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	286,317,818円
ＳＭＴＡＭバランスファンド２００２（適格機関投資家専用）	441,289,364円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０５（適格機関投資家専用）	294,802,711円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	284,799,149円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	282,822,494円

区分	2021年 7月12日現在
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	275,209,159円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	17,098,547,422
投資信託受益証券	13,514,806
投資証券	683,505,358
合計	17,795,567,586

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 7月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	13,058,845,866	－	13,281,840,995	222,995,129
合計		13,058,845,866	－	13,281,840,995	222,995,129

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2021年 7月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	418,338,960	－	418,376,337	37,377
	アメリカドル	220,320,000	－	220,334,800	14,800
	ユーロ	52,321,600	－	52,328,760	7,160
	スイスフラン	51,820,160	－	51,820,977	817

	スウェーデンクローナ	41,107,200	—	41,120,000	12,800
	デンマーククローネ	52,770,000	—	52,771,800	1,800
合計		418,338,960	—	418,376,337	37,377

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数（株）	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	57,980	22.73	1,317,885.40	
	CHENIERE ENERGY INC	19,034	88.01	1,675,182.34	
	CHEVRON CORP	166,092	104.07	17,285,194.44	
	CONOCOPHILLIPS	117,327	60.13	7,054,872.51	
	DEVON ENERGY CORPORATION	57,000	28.65	1,633,050.00	
	EOG RESOURCES INC	51,325	82.59	4,238,931.75	
	EXXON MOBIL	365,193	61.23	22,360,767.39	
	HALLIBURTON CO	77,539	22.38	1,735,322.82	
	HESS CORP	24,844	84.01	2,087,144.44	
	KINDER MORGAN INC	179,427	18.67	3,349,902.09	
	MARATHON PETROLEUM CORP	57,189	58.68	3,355,850.52	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	79,106	30.24	2,392,165.44	
	ONEOK INC	37,709	57.52	2,169,021.68	
	PHILLIPS 66	38,113	82.70	3,151,945.10	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	17,954	158.00	2,836,732.00	
	SCHLUMBERGER	122,666	31.19	3,825,952.54	
	VALERO ENERGY CORP	34,683	72.30	2,507,580.90	
	WILLIAMS COS	104,984	26.70	2,803,072.80	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	19,118	291.67	5,576,147.06	
	ALBEMARLE CORP	10,180	175.51	1,786,691.80	
	AMCOR PLC	132,975	11.51	1,530,542.25	
	AVERY DENNISON CORP	7,457	210.35	1,568,579.95	
	BALL CORP	27,925	84.79	2,367,760.75	

CELANESE CORP-SERIES A	9,842	153.53	1,511,042.26	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	50.66	966,136.86	
CORTEVA INC	64,900	43.45	2,819,905.00	
CROWN HOLDINGS INC	11,212	105.57	1,183,650.84	
DOW INC	63,659	63.08	4,015,609.72	
DUPONT DE NEMOURS INC	46,139	78.48	3,620,988.72	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	12,641	114.95	1,453,082.95	
ECOLAB INC	22,189	212.76	4,720,931.64	
FMC CORP	12,118	107.66	1,304,623.88	
FREEPORT-MCMORAN INC	125,342	36.50	4,574,983.00	
INT'L PAPER CO	33,803	62.24	2,103,898.72	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	21,184	147.70	3,128,876.80	
LINDE PLC	45,090	292.71	13,198,293.90	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,673	102.73	2,329,197.29	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,321	357.92	1,904,492.32	
MOSAIC CO/THE	31,911	31.79	1,014,450.69	
NEWMONT CORPORATION	68,576	63.98	4,387,492.48	
NUCOR CORP	25,565	97.17	2,484,151.05	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	138.63	1,232,420.70	
PPG INDUSTRIES INC	20,538	171.41	3,520,418.58	
RPM INTERNATIONAL INC	12,430	90.52	1,125,163.60	
SEALED AIR CORP	14,689	58.40	857,837.60	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21,917	276.22	6,053,913.74	
STEEL DYNAMICS INC	18,273	61.50	1,123,789.50	
VULCAN MATERIALS CO	11,347	174.93	1,984,930.71	
WESTROCK CO	24,734	52.87	1,307,686.58	
3 M COMPANY	50,115	201.00	10,073,115.00	
ALLEGION PLC	7,601	138.27	1,050,990.27	
AMETEK INC	19,666	135.47	2,664,153.02	
BOEING CO	47,686	239.59	11,425,088.74	
CARRIER GLOBAL CORP	70,603	48.27	3,408,006.81	
CATERPILLAR	47,231	217.42	10,268,964.02	
CUMMINS INC	12,914	242.70	3,134,227.80	
DEERE&CO	25,864	349.48	9,038,950.72	
DOVER CORP	12,202	153.46	1,872,518.92	
EATON CORP	34,431	153.56	5,287,224.36	
EMERSON ELECTRIC CO	51,393	97.61	5,016,470.73	
FASTENAL CO	48,796	53.84	2,627,176.64	
FORTIVE CORP	25,722	70.68	1,818,030.96	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	98.49	1,261,656.90	
GENERAC HOLDINGS INC	5,800	436.37	2,530,946.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	21,212	190.22	4,034,946.64	

GENERAL ELECTRIC CO	761,269	13.16	10,018,300.04	
GRAINGER (WW) INC	3,846	456.83	1,756,968.18	
HEICO CORP	3,640	142.20	517,608.00	
HEICO CORP-CLASS A	6,449	130.22	839,788.78	
HONEYWELL INTL INC	59,921	224.34	13,442,677.14	
HOWMET AEROSPACE INC	36,550	33.95	1,240,872.50	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	206.22	726,306.84	
IDEX CORP	6,916	224.27	1,551,051.32	
ILLINOIS TOOL WORKS	27,403	227.38	6,230,894.14	
INGERSOLL-RAND INC	31,562	49.38	1,558,531.56	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	63.93	1,284,993.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	63,375	70.06	4,440,052.50	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,086	223.99	4,051,083.14	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,062	342.15	1,047,663.30	
LOCKHEED MARTIN CORP	21,652	383.11	8,295,097.72	
MASCO CORP	23,467	58.45	1,371,646.15	
NORDSON CORP	4,880	221.30	1,079,944.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,571	371.82	5,045,969.22	
OTIS WORLDWIDE CORP	35,040	83.82	2,937,052.80	
OWENS CORNING	8,642	96.35	832,656.70	
PACCAR INC	30,155	87.50	2,638,562.50	
PARKER HANNIFIN CORP	11,234	311.57	3,500,177.38	
PENTAIR PLC	14,533	69.30	1,007,136.90	
PLUG POWER INC	41,884	29.39	1,230,970.76	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	131,986	86.38	11,400,950.68	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,938	291.20	2,893,945.60	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,326	481.18	4,487,484.68	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	57.74	798,428.72	
SMITH (A.O.) CORP	12,146	70.75	859,329.50	
SNAP-ON INC	4,900	227.65	1,115,485.00	
STANLEY BLACK&DECKER	13,718	208.53	2,860,614.54	
SUNRUN INC	13,917	52.58	731,755.86	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	426.79	1,664,054.21	
TEXTRON	18,893	67.70	1,279,056.10	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	20,642	190.32	3,928,585.44	
TRANSDIGM GROUP INC	4,425	660.06	2,920,765.50	
UNITED RENTALS INC	6,103	317.48	1,937,580.44	
WABTEC CORP	15,024	82.85	1,244,738.40	
XYLEM INC	15,209	121.05	1,841,049.45	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	88.80	1,009,123.20	
CINTAS CORP	8,043	388.32	3,123,257.76	
CLARIVATE PLC	27,357	26.34	720,583.38	

COPART INC	18,067	138.49	2,502,098.83	
COSTAR GROUP INC	34,030	86.28	2,936,108.40	
EQUIFAX INC	10,409	248.54	2,587,052.86	
IHS MARKIT LTD	32,602	113.52	3,700,979.04	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	134.65	1,619,300.90	
LEIDOS HOLDINGS	11,220	104.84	1,176,304.80	
REPUBLIC SERVICES INC	20,007	112.67	2,254,188.69	
ROBERT HALF INTL INC	9,566	88.45	846,112.70	
ROLLINS INC	21,849	35.39	773,236.11	
TRANSUNION	17,091	113.84	1,945,639.44	
VERISK ANALYTICS INC	13,390	181.71	2,433,096.90	
WASTE CONNECTIONS INC	22,454	122.14	2,742,531.56	
WASTE MANAGEMENT INC	36,263	143.04	5,187,059.52	
AMERCO	1,000	584.00	584,000.00	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,292	93.17	1,052,075.64	
CSX CORP	197,466	31.83	6,285,342.78	
DELTA AIR LINES INC	14,609	42.92	627,018.28	
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	128.40	1,832,524.80	
FEDEX CORP	21,597	296.40	6,401,350.80	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	165.78	1,169,080.56	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,965	273.95	2,182,011.75	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	49.78	532,646.00	
LYFT INC-A	21,288	60.06	1,278,557.28	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,987	263.64	5,796,652.68	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	260.58	2,085,421.74	
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	52.84	715,083.72	
UBER TECHNOLOGIES INC	103,109	49.07	5,059,558.63	
UNION PACIFIC CORP	57,701	221.69	12,791,734.69	
UNITED PARCEL SERVICE B	62,170	213.92	13,299,406.40	
XPO LOGISTICS INC	8,001	141.10	1,128,941.10	
APTIV PLC	23,540	155.61	3,663,059.40	
AUTOLIV INC	6,776	96.04	650,767.04	
BORGWARNER INC	19,781	47.80	945,531.80	
FORD MOTOR COMPANY	334,463	14.48	4,843,024.24	
GENERAL MOTORS CO	114,044	58.76	6,701,225.44	
LEAR CORP	5,287	174.03	920,096.61	
TESLA INC	66,189	656.95	43,482,863.55	
DR HORTON INC	29,632	89.57	2,654,138.24	
GARMIN LTD	12,854	148.81	1,912,803.74	
HASBRO INC	12,468	97.98	1,221,614.64	
LENNAR CORP-CL A	24,928	98.93	2,466,127.04	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,777	377.42	4,067,455.34	

MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	198.95	1,007,084.90	
NEWELL BRANDS INC	31,461	27.03	850,390.83	
NIKE B	109,235	161.00	17,586,835.00	
NVR INC	297	5,060.84	1,503,069.48	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	117.84	2,561,370.24	
PULTE GROUP INC	24,818	53.23	1,321,062.14	
VF CORP	28,638	83.07	2,378,958.66	
WHIRLPOOL CORP	5,220	225.02	1,174,604.40	
AIRBNB INC-CLASS A	4,665	149.64	698,070.60	
ARAMARK	20,955	35.92	752,703.60	
BOOKING HOLDINGS INC	3,556	2,194.99	7,805,384.44	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	96.86	1,700,861.60	
CARNIVAL CORPORATION	70,520	24.26	1,710,815.20	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,399	1,592.25	3,819,807.75	
DARDEN RESTAURANTS INC	12,063	148.58	1,792,320.54	
DOMINO'S PIZZA INC	3,251	477.56	1,552,547.56	
DRAFTKINGS INC - CL A	15,674	49.09	769,436.66	
EXPEDIA GROUP INC	11,638	167.74	1,952,158.12	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,788	126.05	2,998,477.40	
LAS VEGAS SANDS CORP	29,370	51.33	1,507,562.10	
MARRIOTT INTL A	24,361	142.48	3,470,955.28	
MCDONALD'S CORP	64,866	235.68	15,287,618.88	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	16.12	284,711.44	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,064	41.60	1,375,462.40	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,267	82.33	1,586,252.11	
STARBUCKS CORP	102,054	117.47	11,988,283.38	
VAIL RESORTS INC	3,574	325.63	1,163,801.62	
WYNN RESORTS LTD	9,302	113.87	1,059,218.74	
YUM BRANDS INC	25,844	118.58	3,064,581.52	
ACTIVISION BLIZZARD INC	66,954	92.38	6,185,210.52	
ALPHABET INC-CL A	25,977	2,510.37	65,211,881.49	
ALPHABET INC-CL C	25,465	2,591.49	65,992,292.85	
ALTICE USA INC- A	22,505	34.80	783,174.00	
CABLE ONE INC	445	1,933.00	860,185.00	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	11,659	736.47	8,586,503.73	
COMCAST CORP-CL A	394,334	58.03	22,883,202.02	
DISCOVERY INC - A	12,804	29.30	375,157.20	
DISCOVERY INC-C	28,190	27.77	782,836.30	
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	41.50	835,478.00	
ELECTRONIC ARTS INC	24,944	140.99	3,516,854.56	
FACEBOOK INC-A	207,790	350.42	72,813,771.80	
FOX CORP - CLASS A	27,658	36.45	1,008,134.10	

FOX CORP- CLASS B	15,092	34.51	520,824.92	
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	144.15	968,832.15	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	33.08	1,119,228.72	
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	172.67	445,315.93	
LIBERTY BROADBAND-C	13,516	178.64	2,414,498.24	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	48.88	913,713.84	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	17,264	46.52	803,121.28	
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	46.89	299,345.76	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	13,908	83.66	1,163,543.28	
MATCH GROUP INC	21,851	162.63	3,553,628.13	
NETFLIX INC	38,504	535.98	20,637,373.92	
NEWS CORP-CLASS A	33,479	25.52	854,384.08	
OMNICOM GROUP	18,031	80.05	1,443,381.55	
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	76.99	3,523,601.33	
ROKU INC	9,741	431.61	4,204,313.01	
SEA LTD-ADR	638	275.70	175,896.60	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	99,548	6.56	653,034.88	
SNAP INC - A	81,742	65.81	5,379,441.02	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	9,738	170.37	1,659,063.06	
THE WALT DISNEY CO	156,656	177.04	27,734,378.24	
TWITTER INC	70,140	68.97	4,837,555.80	
VIACOMCBS INC-CLASS B	48,586	42.77	2,078,023.22	
ZILLOW GROUP INC-A	5,497	116.59	640,895.23	
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	115.29	1,547,998.83	
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	213.47	1,320,525.42	
AMAZON.COM	36,986	3,719.34	137,563,509.24	
AUTOZONE INC	1,986	1,564.53	3,107,156.58	
BEST BUY COMPANY INC	19,870	110.86	2,202,788.20	
BURLINGTON STORES INC	5,808	329.89	1,916,001.12	
CARMAX INC	13,891	134.84	1,873,062.44	
CARVANA CO	5,700	323.42	1,843,494.00	
CHEWY INC - CLASS A	6,878	85.57	588,550.46	
DOLLAR GENERAL CORP	20,962	220.77	4,627,780.74	
DOLLAR TREE INC	20,151	99.51	2,005,226.01	
EBAY	59,339	69.46	4,121,686.94	
ETSY INC	11,000	195.09	2,145,990.00	
GENUINE PARTS CO	12,119	129.52	1,569,652.88	
HOME DEPOT	92,922	322.09	29,929,246.98	
L BRANDS INC	19,806	73.50	1,455,741.00	
LKQ CORP	26,705	50.97	1,361,153.85	
LOWES COMPANIES	63,738	195.33	12,449,943.54	
MERCADOLIBRE INC	3,877	1,554.97	6,028,618.69	

O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,067	591.65	3,589,540.55	
POOL CORP	3,700	476.24	1,762,088.00	
ROSS STORES INC	31,643	124.77	3,948,097.11	
TARGET (DAYTON HUDSON)	43,484	248.58	10,809,252.72	
TJX COMPANIES INC	103,121	68.36	7,049,351.56	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,932	186.91	1,856,390.12	
ULTA BEAUTY INC	4,520	343.65	1,553,298.00	
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	303.90	1,823,400.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	38,401	412.37	15,835,420.37	
KROGER CO	61,306	38.27	2,346,180.62	
SYSCO CORP	43,568	76.14	3,317,267.52	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,310	47.41	3,001,527.10	
WALMART INC	134,198	140.30	18,827,979.40	
ALTRIA GROUP INC	161,290	47.40	7,645,146.00	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,339	60.32	2,915,808.48	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	744	973.58	724,343.52	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26,220	74.12	1,943,426.40	
BUNGE LIMITED	11,604	77.45	898,729.80	
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	45.64	724,261.16	
COCA-COLA CO	355,696	54.46	19,371,204.16	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	19,221	61.39	1,179,977.19	
CONAGRA BRANDS INC	41,157	36.12	1,486,590.84	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,911	227.69	3,395,085.59	
GENERAL MILLS INC	53,282	59.70	3,180,935.40	
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,532	176.75	2,215,031.00	
HORMEL FOODS CORP	27,157	47.44	1,288,328.08	
JM SMUCKER CO	9,145	130.85	1,196,623.25	
KELLOGG CO	21,630	64.28	1,390,376.40	
KEURIG DR PEPPER INC	59,596	35.00	2,085,860.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	57,338	39.95	2,290,653.10	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	80.82	1,044,517.68	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,088	87.10	1,836,764.80	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	53.18	968,035.54	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	121,364	63.02	7,648,359.28	
MONSTER BEVERAGE CORP	34,258	90.24	3,091,441.92	
PEPSICO INC	118,953	149.48	17,781,094.44	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	135,448	99.40	13,463,531.20	
TYSON FOODS INC	25,074	73.55	1,844,192.70	
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,055	86.98	1,831,363.90	
CLOROX COMPANY	10,830	180.88	1,958,930.40	
COLGATE-PALMOLIVE CO	70,441	82.43	5,806,451.63	
ESTEE LAUDER CO-CL A	20,159	317.87	6,407,941.33	

KIMBERLY-CLARK CORP	28,913	135.02	3,903,833.26	
PROCTER & GAMBLE CO	212,538	137.03	29,124,082.14	
ABBOTT LABORATORIES	152,754	119.74	18,290,763.96	
ABIOMED INC	3,781	324.77	1,227,955.37	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,653	627.19	4,172,695.07	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	115.13	1,484,716.48	
ANTHEM INC	21,058	388.61	8,183,349.38	
BAXTER INTERNATIONAL	44,024	80.43	3,540,850.32	
BECTON DICKINSON & CO	25,112	249.80	6,272,977.60	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	123,665	43.59	5,390,557.35	
CARDINAL HEALTH	24,692	57.18	1,411,888.56	
CENTENE CORP	51,303	73.51	3,771,283.53	
CERNER CORP	27,382	79.57	2,178,785.74	
CIGNA CORP	30,245	234.90	7,104,550.50	
CVS HEALTH CORP	113,622	81.32	9,239,741.04	
DANAHER CORP	55,620	277.47	15,432,881.40	
DAVITA INC	5,784	122.09	706,168.56	
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	62.42	1,260,134.96	
DEXCOM INC	8,405	440.73	3,704,335.65	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	53,513	107.51	5,753,182.63	
HCA HEALTHCARE INC	23,291	218.79	5,095,837.89	
HENRY SCHEIN INC	11,747	76.81	902,287.07	
HOLOGIC INC	21,687	69.31	1,503,125.97	
HUMANA INC	11,040	455.65	5,030,376.00	
IDEXX LABORATORIES INC	7,438	667.03	4,961,369.14	
INSULET CORP	5,923	280.69	1,662,526.87	
INTUITIVE SURGICAL INC	10,199	950.78	9,697,005.22	
LABORATORY CRP OF AMER	8,285	281.03	2,328,333.55	
MASIMO CORP	4,835	260.33	1,258,695.55	
MCKESSON CORP	13,893	189.10	2,627,166.30	
MEDTRONIC PLC	117,112	128.17	15,010,245.04	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,940	257.25	1,270,815.00	
NOVOCURE LTD	7,933	194.55	1,543,365.15	
OAK STREET HEALTH INC	7,613	59.57	453,506.41	
QUEST DIAGNOSTICS	11,335	135.04	1,530,678.40	
RESMED INC	12,370	247.68	3,063,801.60	
STERIS PLC	7,163	211.24	1,513,112.12	
STRYKER CORP	29,094	264.43	7,693,326.42	
TELADOC HEALTH INC	11,375	158.60	1,804,075.00	
TELEFLEX INC	3,934	422.82	1,663,373.88	
THE COOPER COS INC	4,134	411.23	1,700,024.82	
UNITEDHEALTH GROUP INC	81,910	412.11	33,755,930.10	

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	153.95	1,115,829.60	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,775	321.41	3,784,602.75	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,317	374.19	2,363,758.23	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,277	159.31	2,911,708.87	
10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	190.41	1,076,768.55	
ABBVIE INC	152,263	116.58	17,750,820.54	
AGILENT TECHNOLOGIES	26,029	150.03	3,905,130.87	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,936	184.20	3,488,011.20	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,665	176.74	1,884,932.10	
AMGEN	49,749	245.20	12,198,454.80	
AVANTOR INC	47,985	36.08	1,731,298.80	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	675.17	1,251,090.01	
BIO-TECHNE CORP	3,245	465.39	1,510,190.55	
BIOGEN INC	13,488	358.16	4,830,862.08	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	17,171	83.62	1,435,839.02	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	193,007	67.16	12,962,350.12	
CATALENT INC	15,232	113.25	1,725,024.00	
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	384.89	1,618,077.56	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	34.64	1,249,153.04	
EXACT SCIENCES CORP	14,756	119.70	1,766,293.20	
GILEAD SCIENCES INC	107,975	68.22	7,366,054.50	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	95.28	1,707,989.28	
ILLUMINA INC	12,501	476.80	5,960,476.80	
INCYTE CORP	17,504	82.04	1,436,028.16	
IQVIA HOLDINGS INC	16,726	251.16	4,200,902.16	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	183.99	914,614.29	
JOHNSON & JOHNSON	226,967	169.75	38,527,648.25	
LILLY (ELI) & CO	70,198	234.99	16,495,828.02	
MERCK & CO	218,163	77.99	17,014,532.37	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,051	1,435.41	2,944,025.91	
MODERNA INC	27,089	232.81	6,306,590.09	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	99.03	839,180.22	
NOVAVAX INC	5,754	188.59	1,085,146.86	
PERKINELMER INC	9,372	153.96	1,442,913.12	
PFIZER	484,175	39.61	19,178,171.75	
PPD INC	11,027	45.85	505,587.95	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,176	580.40	5,325,750.40	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	15,534	41.77	648,855.18	
SEAGEN INC	11,471	148.50	1,703,443.50	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	9.30	747,729.30	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,944	517.26	17,557,873.44	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,458	198.16	4,450,277.28	

VIATRIS INC	103,541	14.31	1,481,671.71	
WATERS CORP	5,228	369.40	1,931,223.20	
ZOETIS INC	40,822	197.50	8,062,345.00	
BANK OF AMERICA CORP	670,589	40.04	26,850,383.56	
CITIGROUP	181,157	68.45	12,400,196.65	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,041	45.31	1,633,017.71	
FIFTH THIRD BANCORP	61,361	38.08	2,336,626.88	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,827	194.49	2,883,703.23	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	127,582	14.27	1,820,595.14	
JPMORGAN CHASE & CO	263,503	155.77	41,045,862.31	
KEY CORP	83,212	20.17	1,678,386.04	
M & T BANK CORP	11,721	142.33	1,668,249.93	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	36,707	189.67	6,962,216.69	
REGIONS FINL CORP	81,824	19.87	1,625,842.88	
SVB FINANCIAL GROUP	4,393	575.24	2,527,029.32	
TRUIST FINANCIAL CORP	115,723	55.21	6,389,066.83	
US BANCORP	122,617	56.97	6,985,490.49	
WELLS FARGO & CO	356,388	43.91	15,648,997.08	
ALLY FINANCIAL INC	31,445	51.28	1,612,499.60	
AMERICAN EXPRESS	59,420	171.94	10,216,674.80	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,185	248.95	2,535,555.75	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,153	61.17	926,909.01	
BANK NEW YORK CO	71,298	49.93	3,559,909.14	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	118,353	280.49	33,196,832.97	
BLACKROCK INC	13,255	901.31	11,946,864.05	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	40,302	160.55	6,470,486.10	
CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	47.71	600,907.45	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	118.79	1,054,261.25	
CME GROUP INC	31,096	209.62	6,518,343.52	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	26,121	122.40	3,197,210.40	
EQUITABLE HOLDINGS INC	32,815	29.65	972,964.75	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	343.20	1,080,393.60	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	32.15	838,150.50	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	139.75	603,161.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,769	371.76	11,066,923.44	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	48,552	118.97	5,776,231.44	
INVESCO LTD	35,765	26.33	941,692.45	
KKR & CO INC	43,643	59.10	2,579,301.30	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	460.77	1,477,689.39	
MOODY'S CORP	14,787	375.59	5,553,849.33	
MORGAN STANLEY	122,211	90.33	11,039,319.63	
MSCI INC	7,235	560.23	4,053,264.05	

NASDAQ INC	9,657	175.77	1,697,410.89	
NORTHERN TRUST CORP	17,625	115.55	2,036,568.75	
PRICE T ROWE GROUP INC	20,087	205.20	4,121,852.40	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,324	132.02	1,362,974.48	
S&P GLOBAL INC	20,689	414.68	8,579,314.52	
SCHWAB (CHARLES) CORP	124,071	70.55	8,753,209.05	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,261	62.12	761,653.32	
STATE STREET CORP	29,894	84.11	2,514,384.34	
SYNCHRONY FINANCIAL	49,509	48.73	2,412,573.57	
THE BLACKSTONE GROUP INC	58,748	99.73	5,858,938.04	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	87.06	788,850.66	
VOYA FINANCIAL INC	10,050	62.33	626,416.50	
AFLAC	58,037	53.35	3,096,273.95	
ALLEGHANY CORP	1,276	673.67	859,602.92	
ALLSTATE CORP	26,425	133.47	3,526,944.75	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	123.43	779,954.17	
AMERICAN INT'L GROUP	75,227	46.87	3,525,889.49	
AON PLC	19,359	236.31	4,574,725.29	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,031	38.50	1,310,193.50	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	140.50	2,298,439.50	
ASSURANT INC	4,726	156.99	741,934.74	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	10,207	66.92	683,052.44	
BROWN & BROWN INC	19,873	52.95	1,052,275.35	
CHUBB LTD	38,652	162.73	6,289,839.96	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	118.87	1,520,466.17	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	188.22	407,684.52	
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	247.86	814,963.68	
FNF GROUP	24,961	44.20	1,103,276.20	
GLOBE LIFE INC	8,106	94.46	765,692.76	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	30,371	61.58	1,870,246.18	
LINCOLN NATIONAL CORP	16,364	62.01	1,014,731.64	
LOEWS CORP	18,851	54.71	1,031,338.21	
MARKEL CORP	1,156	1,238.29	1,431,463.24	
MARSH & MCLENNAN COS	44,622	142.60	6,363,097.20	
METLIFE INC	64,294	58.86	3,784,344.84	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,072	61.99	1,430,233.28	
PROGRESSIVE CORP	50,582	99.63	5,039,484.66	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,851	100.58	3,505,313.58	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	6,652	112.82	750,478.64	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,864	151.04	734,658.56	
TRAVELERS COS INC/THE	22,437	153.33	3,440,265.21	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,021	228.21	2,515,102.41	

WR BERKLEY CORP	11,715	75.62	885,888.30	
CBRE GROUP INC-A	30,111	85.83	2,584,427.13	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.74	467,838.00	
WEYERHAEUSER CO	63,665	35.82	2,280,480.30	
ACCENTURE PLC-CL A	55,165	312.62	17,245,682.30	
ADOBE INC	41,289	604.50	24,959,200.50	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	13,673	117.90	1,612,046.70	
ANSYS INC	7,474	353.76	2,644,002.24	
AUTODESK INC	18,964	295.38	5,601,586.32	
AUTOMATIC DATA PROCESS	36,764	203.72	7,489,562.08	
AVALARA INC	7,698	161.28	1,241,533.44	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	64.20	898,543.20	
BLACK KNIGHT INC	14,413	80.94	1,166,588.22	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	168.70	1,643,475.40	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	24,740	138.50	3,426,490.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	12,296	99.22	1,220,009.12	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,486	123.80	1,298,166.80	
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	116.17	1,213,279.48	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	17,762	108.97	1,935,525.14	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	46,007	69.14	3,180,923.98	
COUPA SOFTWARE INC	6,059	266.64	1,615,571.76	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,694	264.44	4,150,121.36	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	139.61	432,791.00	
DATADOG INC - CLASS A	15,807	108.12	1,709,052.84	
DOCUSIGN INC	15,540	288.02	4,475,830.80	
DROPBOX INC-CLASS A	28,845	31.05	895,637.25	
DYNATRACE INC	17,890	61.81	1,105,780.90	
EPAM SYSTEMS INC	4,753	527.82	2,508,728.46	
FAIR ISAAC CORP	2,615	524.05	1,370,390.75	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	53,834	144.42	7,774,706.28	
FISERV INC	51,693	108.94	5,631,435.42	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,154	253.03	1,810,176.62	
FORTINET INC	12,295	256.81	3,157,478.95	
GARTNER INC	7,500	256.87	1,926,525.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	25,292	190.37	4,814,838.04	
GODADDY INC - CLASS A	15,914	87.43	1,391,361.02	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,923	111.66	884,682.18	
HUBSPOT INC	4,000	602.90	2,411,600.00	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	77,449	141.52	10,960,582.48	
INTUIT INC	23,568	503.93	11,876,622.24	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	167.38	1,052,987.58	
MASTERCARD INC-CLASS A	76,521	372.94	28,537,741.74	

MICROSOFT CORP	619,180	277.94	172,094,889.20	
MONGODB INC	4,623	353.70	1,635,155.10	
NORTONLIFELOCK INC	50,376	27.66	1,393,400.16	
OKTA INC	10,230	251.84	2,576,323.20	
ORACLE CORP	164,854	87.76	14,467,587.04	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	43,290	23.29	1,008,224.10	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,311	390.24	3,243,284.64	
PAYCHEX INC	27,703	111.90	3,099,965.70	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	383.59	1,624,503.65	
PAYPAL HOLDINGS INC	95,999	300.21	28,819,859.79	
PTC INC	9,984	145.14	1,449,077.76	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	294.81	1,884,720.33	
SALESFORCE.COM INC	79,266	245.06	19,424,925.96	
SERVICENOW INC	16,939	566.37	9,593,741.43	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	41,035	44.47	1,824,826.45	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,960	269.49	528,200.40	
SPLUNK INC	14,752	138.37	2,041,234.24	
SQUARE INC - A	33,292	241.89	8,053,001.88	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	73.55	1,422,089.25	
SYNOPSYS INC	13,492	280.75	3,787,879.00	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	35,780	77.95	2,789,051.00	
TWILIO INC - A	13,692	392.27	5,370,960.84	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,713	478.84	1,777,932.92	
UNITY SOFTWARE INC	4,329	106.53	461,168.37	
VERISIGN INC	8,760	233.03	2,041,342.80	
VISA INC-CLASS A SHARES	146,419	238.47	34,916,538.93	
VMWARE INC-CLASS A	7,867	159.48	1,254,629.16	
WESTERN UNION CO	38,757	23.31	903,425.67	
WIX.COM LTD	5,010	294.81	1,476,998.10	
WORKDAY INC-CLASS A	15,505	239.94	3,720,269.70	
ZENDESK INC	10,500	143.48	1,506,540.00	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,545	385.08	6,756,228.60	
ZSCALER INC	6,234	227.79	1,420,042.86	
AMPHENOL CORPORATION	51,451	70.31	3,617,519.81	
APPLE INC	1,450,831	145.11	210,530,086.41	
ARISTA NETWORKS INC	5,179	378.03	1,957,817.37	
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	113.38	691,618.00	
CDW CORP/DE	11,982	177.98	2,132,556.36	
CISCO SYSTEMS	364,089	53.74	19,566,142.86	
COGNEX CORP	16,230	86.58	1,405,193.40	
CORNING	64,989	41.03	2,666,498.67	
DELL TECHNOLOGIES -C	21,530	100.25	2,158,382.50	

F5 NETWORKS INC	5,350	190.86	1,021,101.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	109,149	14.58	1,591,392.42	
HP INC	106,353	30.04	3,194,844.12	
IPG PHOTONICS CORP	3,207	207.41	665,163.87	
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	27.62	864,616.48	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	16,004	155.81	2,493,583.24	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,918	224.52	3,349,389.36	
NETAPP INC	20,586	82.57	1,699,786.02	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	17,940	87.96	1,578,002.40	
TE CONNECTIVITY LTD	29,387	138.00	4,055,406.00	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	83.26	1,763,113.76	
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	70.17	1,809,684.30	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,612	547.73	2,526,130.76	
AT&T INC	614,997	28.45	17,496,664.65	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	26.49	411,018.84	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	33,680	26.44	890,499.20	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	86,131	13.51	1,163,629.81	
T-MOBILE US INC	53,388	146.01	7,795,181.88	
VERIZON COMMUNICATIONS	356,926	56.07	20,012,840.82	
AES CORP	61,761	25.73	1,589,110.53	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	56.76	1,179,359.28	
AMEREN CORPORATION	20,898	81.92	1,711,964.16	
AMERICAN ELECTRIC POWER	44,128	85.39	3,768,089.92	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,464	162.28	2,509,497.92	
ATMOS ENERGY CORP	11,419	98.53	1,125,114.07	
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	25.47	1,226,686.14	
CMS ENERGY CORP	26,742	60.31	1,612,810.02	
CONSOLIDATED EDISON INC	28,745	73.30	2,107,008.50	
DOMINION ENERGY INC	69,073	75.55	5,218,465.15	
DTE ENERGY COMPANY	16,240	115.60	1,877,344.00	
DUKE ENERGY CORP	66,012	100.66	6,644,767.92	
EDISON INTL	32,117	58.28	1,871,778.76	
ENTERGY CORP	16,926	102.92	1,742,023.92	
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	47.94	998,781.96	
EVERGY INC	21,330	61.79	1,317,980.70	
EVERSOURCE ENERGY	29,303	82.63	2,421,306.89	
EXELON CORP	86,723	44.91	3,894,729.93	
FIRSTENERGY CORP	45,787	37.53	1,718,386.11	
NEXTERA ENERGY INC	170,459	74.99	12,782,720.41	
NISOURCE INC	35,781	25.14	899,534.34	
NRG ENERGY INC	23,078	41.97	968,583.66	
PG&E CORP	135,327	10.37	1,403,340.99	

	PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	83.65	901,077.80	
	PPL CORPORATION	69,904	28.44	1,988,069.76	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	43,258	60.49	2,616,676.42	
	SEMPRA ENERGY	27,056	132.86	3,594,660.16	
	SOUTHERN CO	91,389	61.47	5,617,681.83	
	UGI CORP	18,019	46.54	838,604.26	
	VISTRA CORP	37,797	19.32	730,238.04	
	WEC ENERGY GROUP INC	26,821	91.84	2,463,240.64	
	XCEL ENERGY INC	46,423	67.67	3,141,444.41	
	ADVANCED MICRO DEVICES	104,401	90.90	9,490,050.90	
	ANALOG DEVICES	31,938	166.27	5,310,331.26	
	APPLIED MATERIALS	79,412	134.90	10,712,678.80	
	BROADCOM INC	35,233	480.18	16,918,181.94	
	ENPHASE ENERGY INC	11,000	183.80	2,021,800.00	
	INTEL CORP	350,418	55.99	19,619,903.82	
	KLA CORP	13,649	308.76	4,214,265.24	
	LAM RESEARCH CORP	12,499	612.85	7,660,012.15	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	70,440	57.00	4,015,080.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	22,641	100.03	2,264,779.23	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,404	144.02	3,226,624.08	
	MICRON TECHNOLOGY	96,673	78.74	7,612,032.02	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,953	382.60	1,512,417.80	
	NVIDIA CORP	53,433	802.01	42,853,800.33	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	24,180	200.35	4,844,463.00	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	37.75	1,358,849.00	
	QORVO INC	9,678	192.94	1,867,273.32	
	QUALCOMM	98,431	141.43	13,921,096.33	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,359	189.57	2,722,035.63	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	4,600	267.68	1,231,328.00	
	TERADYNE INC	14,398	125.70	1,809,828.60	
	TEXAS INSTRUMENTS	79,929	190.27	15,208,090.83	
	XILINX INC	20,982	135.59	2,844,949.38	
アメリカドル 小計		27,570,759		3,343,499,419.84 (368,353,331,083)	
カナダドル	CAMECO CORP	26,880	22.79	612,595.20	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	102,786	44.51	4,575,004.86	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	11.37	1,099,092.42	
	ENBRIDGE	173,165	50.11	8,677,298.15	
	IMPERIAL OIL	24,763	36.45	902,611.35	
	INTER PIPELINE LTD	35,455	20.12	713,354.60	
	KEYERA CORP	18,607	33.08	615,519.56	
	PARKLAND CORP	14,075	39.68	558,496.00	

PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	39.91	1,822,530.06	
SUNCOR ENERGY	132,181	28.97	3,829,283.57	
TC ENERGY CORP	82,366	62.56	5,152,816.96	
AGNICO EAGLE MINES	20,293	76.52	1,552,820.36	
B2GOLD CORP	90,243	5.06	456,629.58	
BARRICK GOLD CORP	153,589	26.32	4,042,462.48	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	68.64	901,860.96	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,000	28.85	1,586,750.00	
FRANCO-NEVADA CORP	16,953	183.35	3,108,332.55	
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	9.20	476,992.40	
KINROSS GOLD CORP	108,451	7.86	852,424.86	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,428	49.03	1,148,674.84	
LUNDIN MINING CORP	62,243	11.54	718,284.22	
NUTRIEN LTD	48,966	76.22	3,732,188.52	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	35.44	652,485.84	
TECK RESOURCES LTD-CL B	40,561	29.28	1,187,626.08	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	93.46	728,988.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	39,528	55.32	2,186,688.96	
YAMANA GOLD INC	81,672	5.25	428,778.00	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	19,724	21.15	417,162.60	
CAE INC	25,999	38.55	1,002,261.45	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,705	104.71	806,790.55	
WSP GLOBAL INC	10,656	149.91	1,597,440.96	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	39.50	533,447.50	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	74.32	761,408.40	
THOMSON REUTERS CORP	15,013	126.31	1,896,292.03	
AIR CANADA	13,805	25.75	355,478.75	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,870	133.74	8,140,753.80	
CP RAILWAY LIMITED	57,581	93.04	5,357,336.24	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	112.87	2,627,839.34	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	44.16	754,208.64	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	80.10	1,848,147.30	
QUEBECOR INC -CL B	15,200	33.05	502,360.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	36.18	1,281,567.96	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	193.87	1,048,642.83	
DOLLARAMA INC	26,700	57.18	1,526,706.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	74,153	46.34	3,436,250.02	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	39.86	607,984.58	
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	78.57	1,014,574.41	
METRO INC	18,840	60.52	1,140,196.80	
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	119.30	821,141.90	
SAPUTO INC	24,489	37.00	906,093.00	

	BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	36.47	1,013,866.00	
	CANOPY GROWTH CORP	20,989	27.59	579,086.51	
	BANK MONTREAL	55,894	126.12	7,049,351.28	
	BANK NOVA SCOTIA	104,760	78.90	8,265,564.00	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	38,790	141.87	5,503,137.30	
	NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	93.50	2,551,521.50	
	ROYAL BANK OF CANADA	122,804	126.37	15,518,741.48	
	TORONTO-DOMINION BANK	156,322	84.70	13,240,473.40	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	110,862	63.85	7,078,538.70	
	IGM FINANCIAL INC	7,685	43.98	337,986.30	
	ONEX CORP	6,603	90.06	594,666.18	
	TMX GROUP LTD	4,685	129.31	605,817.35	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	548.49	1,169,929.17	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	36.78	874,922.64	
	IA FINANCIAL CORP INC	10,099	67.15	678,147.85	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,043	172.03	2,243,787.29	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	163,056	23.99	3,911,713.44	
	POWER CORP OF CANADA	51,551	38.99	2,009,973.49	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	50,702	63.29	3,208,929.58	
	FIRSTSERVICE CORP	3,690	222.08	819,475.20	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	14.69	578,786.00	
	CGI INC - CL A	18,428	114.49	2,109,821.72	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,661	1,919.74	3,188,688.14	
	LIGHTSPEED POS INC-SUB VOTE	8,296	106.02	879,541.92	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	103.49	445,110.49	
	OPEN TEXT CORP	24,643	64.15	1,580,848.45	
	SHOPIFY INC - CLASS A	9,710	1,862.97	18,089,438.70	
	BCE INC	6,203	61.99	384,523.97	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,584	66.69	2,039,646.96	
	TELUS CORP	32,908	27.96	920,107.68	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	18.77	972,623.86	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	26.49	646,223.55	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	44.26	231,966.66	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	50.87	574,576.65	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	34.97	361,030.28	
	EMERA INC	23,704	57.09	1,353,261.36	
	FORTIS INC	42,633	55.61	2,370,821.13	
	HYDRO ONE LTD	32,299	30.47	984,150.53	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	42.87	765,400.98	
カナダドル 小計		3,516,775		206,436,873.13 (18,257,277,059)	
ユーロ	ENI	218,529	10.08	2,202,772.32	

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	8.97	441,663.73	
NESTE OIL OYJ	37,233	52.28	1,946,541.24	
OMV AG	12,549	47.04	590,304.96	
REPSOL SA	127,332	9.84	1,253,965.53	
TENARIS SA	40,648	9.00	365,913.29	
TOTALENERGIES SE	217,070	37.45	8,129,271.50	
VOPAK	6,360	38.13	242,506.80	
AIR LIQUIDE	40,492	147.92	5,989,576.64	
AKZO NOBEL	15,301	105.25	1,610,430.25	
ARCELORMITTAL	61,651	26.29	1,620,804.79	
ARKEMA	5,949	106.80	635,353.20	
BASF SE	78,752	68.01	5,355,923.52	
COVESTRO AG	17,254	56.14	968,639.56	
CRH PLC	64,773	42.40	2,746,375.20	
EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	28.73	567,532.42	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	41.06	236,587.72	
HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	74.62	973,119.42	
KONINKLIJKE DSM NV	14,947	158.15	2,363,868.05	
LANXESS	7,293	58.42	426,057.06	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	23,039	46.39	1,068,779.21	
SOLVAY SA	6,906	110.00	759,660.00	
STORA ENSO OYJ R	54,792	16.11	882,699.12	
SYMRISE AG	11,456	120.20	1,377,011.20	
UMICORE	17,605	51.34	903,840.70	
UPM KYMMENE OYJ	45,603	33.19	1,513,563.57	
VOESTALPINE AG	7,152	35.58	254,468.16	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	19,693	22.12	435,609.16	
ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	19,693	1.25	24,616.25	
AIRBUS SE	50,151	112.76	5,655,026.76	
ALSTOM	24,388	37.83	922,598.04	
BOUYGUES ORD	21,446	31.76	681,124.96	
BRENNTAG SE	12,514	81.86	1,024,396.04	
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	13.67	1,272,130.55	
DASSAULT AVIATION SA	213	988.00	210,444.00	
EIFFAGE	7,964	86.90	692,071.60	
FERROVIAL SA	41,438	25.46	1,055,011.48	
GEA GROUP AG	13,382	35.07	469,306.74	
KINGSPAN GROUP PLC	14,482	84.86	1,228,942.52	
KION GROUP AG	5,887	92.26	543,134.62	
KNORR-BREMSE AG	6,822	96.16	656,003.52	
KONE OYJ-B	29,051	69.76	2,026,597.76	
LEGRAND SA	21,768	91.70	1,996,125.60	

MTU AERO ENGINES AG	4,753	213.80	1,016,191.40	
PRYSMIAN SPA	21,155	30.52	645,650.60	
RATIONAL AG	483	798.60	385,723.80	
SAFRAN SA	28,410	119.92	3,406,927.20	
SAINT-GOBAIN	43,973	57.75	2,539,440.75	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,506	137.02	6,372,252.12	
SIEMENS	66,090	132.84	8,779,395.60	
SIEMENS ENERGY AG	36,181	25.88	936,364.28	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	26.93	604,174.55	
THALES SA	9,665	89.82	868,110.30	
VINCI S.A.	45,934	91.74	4,213,985.16	
WARTSILA OYJ	41,917	12.78	535,908.84	
BUREAU VERITAS SA	25,073	26.85	673,210.05	
RANDSTAD NV	11,218	65.16	730,964.88	
TELEPERFORMANCE	4,734	348.00	1,647,432.00	
WOLTERS KLUWER	22,949	86.60	1,987,383.40	
ADP	2,382	111.05	264,521.10	
AENA SME SA	6,542	138.65	907,048.30	
ATLANTIA SPA	46,597	15.44	719,457.68	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	10.05	234,023.23	
DEUTSCHE POST AG-REG	85,364	58.27	4,974,160.28	
GETLINK	44,101	13.86	611,239.86	
INPOST SA	12,480	17.69	220,846.08	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,684	87.68	2,515,013.12	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	75.00	374,325.00	
CONTINENTAL AG	9,928	118.64	1,177,857.92	
DAIMLER AG	73,367	72.89	5,347,720.63	
FAURECIA	10,948	40.36	441,861.28	
FERRARI NV	10,170	176.00	1,789,920.00	
MICHELIN	13,839	137.10	1,897,326.90	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	92.90	1,303,201.20	
RENAULT SA	17,362	33.50	581,627.00	
STELLANTIS NV	170,174	16.48	2,805,488.56	
VALEO SA	21,538	24.98	538,019.24	
VOLKSWAGEN AG-PFD	16,304	212.35	3,462,154.40	
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	281.20	699,063.20	
ADIDAS AG	16,242	318.45	5,172,264.90	
ESSILORLUXOTTICA	25,177	154.34	3,885,818.18	
HERMES INTERNATIONAL	2,731	1,235.50	3,374,150.50	
KERING	6,473	731.20	4,733,057.60	
LVMH	24,043	662.40	15,926,083.20	
MONCLER SPA	18,219	56.36	1,026,822.84	

PUMA SE	9,220	102.90	948,738.00	
SEB SA	2,282	148.70	339,333.40	
ACCOR	14,436	31.41	453,434.76	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	14,518	150.80	2,189,314.40	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	49.03	397,535.24	
SODEXO	8,135	76.12	619,236.20	
BOLLORE	83,646	4.49	375,905.12	
PUBLICIS GROUPE	17,077	53.16	907,813.32	
SCOUT24 AG	7,492	70.82	530,583.44	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	59.78	422,704.38	
VIVENDI	61,243	28.25	1,730,114.75	
DELIVERY HERO SE	13,414	119.15	1,598,278.10	
HELLOFRESH SE	13,805	82.34	1,136,703.70	
INDITEX	95,060	29.73	2,826,133.80	
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	74.89	1,166,187.08	
PROSUS	43,038	77.36	3,329,419.68	
ZALANDO SE	17,664	101.50	1,792,896.00	
CARREFOUR	52,544	16.35	859,094.40	
COLRUYT SA	5,424	46.90	254,385.60	
JERONIMO MARTINS	24,901	16.63	414,228.13	
KESKO OYJ-B SHS	25,583	32.17	823,005.11	
KONINKLIJKE AHOLD NV	87,400	25.34	2,214,716.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,788	58.88	3,755,837.44	
DANONE (GROUPE)	54,643	59.46	3,249,072.78	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	11.18	548,680.86	
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	84.30	902,094.30	
HEINEKEN NV	22,407	99.14	2,221,429.98	
JDE PEET'S BV	7,000	31.13	217,910.00	
KERRY GROUP PLC-A	13,050	120.50	1,572,525.00	
PERNOD-RICARD	18,224	180.85	3,295,810.40	
REMY COINTREAU	2,382	178.40	424,948.80	
BEIERSDORF AG	9,190	102.15	938,758.50	
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	78.35	687,913.00	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	87.76	1,267,166.64	
LOREAL	21,631	371.80	8,042,405.80	
AMPLIFON SPA	11,650	38.07	443,515.50	
BIOMERIEUX	4,175	93.82	391,698.50	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	166.25	570,237.50	
DIASORIN SPA	2,070	160.65	332,545.50	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,472	69.00	1,205,568.00	
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	44.51	1,499,497.39	
KONINKLIJKE PHILIPS	77,215	39.06	3,016,017.90	

ORPEA	4,336	106.65	462,434.40	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,224	465.00	1,034,160.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	24,546	53.22	1,306,338.12	
ARGENX SE	4,178	261.90	1,094,218.20	
BAYER	83,832	50.83	4,261,180.56	
EUROFINS SCIENTIFIC	12,420	101.58	1,261,623.60	
GRIFOLS SA	27,685	21.68	600,210.80	
IPSEN	3,532	88.00	310,816.00	
MERCK KGAA	10,555	169.50	1,789,072.50	
ORION OYJ-CLASS B	9,854	37.21	366,667.34	
QIAGEN N.V.	21,801	42.70	930,902.70	
RECORDATI SPA	9,859	50.20	494,921.80	
SANOFI	97,536	87.22	8,507,089.92	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,419	434.30	1,050,571.70	
UCB (GROUPE)	11,875	90.30	1,072,312.50	
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	10.05	401,206.05	
BANCO BILBAO VIZCAYA	576,942	5.22	3,015,675.83	
BANCO SANTANDER SA	1,470,387	3.12	4,601,576.11	
BNP PARIBAS	97,090	50.93	4,944,793.70	
CAIXABANK	380,168	2.55	971,329.24	
COMMERZBANK AG	94,388	5.70	538,577.92	
CREDIT AGRICOLE SA	107,463	11.79	1,267,418.62	
ERSTE GROUP BANK AG	23,905	31.09	743,206.45	
FINECOBANK SPA	53,120	14.95	794,144.00	
ING GROEP NV-CVA	343,429	10.87	3,735,133.80	
INTESA SANPAOLO	1,441,455	2.28	3,292,283.22	
KBC GROEP NV	21,052	66.30	1,395,747.60	
MEDIOBANCA	53,990	9.75	526,510.48	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	18.89	235,936.10	
SOCIETE GENERALE	67,846	24.77	1,680,884.65	
UNICREDIT SPA	189,030	9.74	1,842,097.35	
AMUNDI SA	6,226	75.80	471,930.80	
DEUTSCHE BANK NAMEN	177,263	10.50	1,861,261.50	
DEUTSCHE BOERSE	16,510	144.45	2,384,869.50	
EURAZEO SA	3,357	73.80	247,746.60	
EXOR NV	10,345	66.70	690,011.50	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10,615	95.38	1,012,458.70	
NATIXIS	89,751	4.00	359,093.75	
SOFINA	1,238	367.60	455,088.80	
WENDEL	2,023	109.70	221,923.10	
AEGON	166,267	3.55	590,912.91	
AGEAS	16,065	46.84	752,484.60	

ALLIANZ SE-REG	35,536	212.10	7,537,185.60	
ASSICURAZIONI GENERALI	97,567	16.88	1,647,418.79	
AXA SA	166,887	21.81	3,640,639.90	
CNP ASSURANCES	16,287	14.67	238,930.29	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	146.00	845,194.00	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,376	230.85	2,856,999.60	
NN GROUP NV	22,611	40.62	918,458.82	
POSTE ITALIANE SPA	46,035	10.99	506,154.82	
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	39.65	1,707,923.75	
SCOR SE	13,354	25.59	341,728.86	
AROUNDTOWN SA	94,068	6.66	626,869.15	
DEUTSCHE WOHNEN SE	28,092	51.58	1,448,985.36	
LEG IMMOBILIEN SE	6,992	130.80	914,553.60	
VONOVIA SE	45,080	57.62	2,597,509.60	
ADYEN NV	1,666	2,118.50	3,529,421.00	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	39,094	57.58	2,251,032.52	
ATOS SE	9,750	52.74	514,215.00	
BECHTLE AG	2,553	161.35	411,926.55	
CAPGEMINI SA	13,914	167.05	2,324,333.70	
DASSAULT SYSTEMES SA	57,125	42.62	2,434,953.12	
EDENRED	22,756	48.61	1,106,169.16	
NEMETSCHEK SE	5,455	67.00	365,485.00	
NEXI SPA	41,348	18.54	766,591.92	
SAP SE	90,249	124.72	11,255,855.28	
TEAMVIEWER AG	14,174	28.12	398,572.88	
WORLDLINE SA	20,332	80.83	1,643,435.56	
NOKIA OYJ	450,608	4.65	2,097,354.93	
CELLNEX TELECOM SA	41,435	54.56	2,260,693.60	
DEUTSCHE TELEKOM	285,034	18.00	5,130,612.00	
ELISA A	13,387	51.52	689,698.24	
ILIAD SA	1,253	120.55	151,049.15	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.70	294,698.25	
KPN (KON.)	282,927	2.68	759,376.06	
ORANGE	171,535	9.48	1,627,009.47	
PROXIMUS	13,141	16.54	217,417.84	
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.39	333,688.85	
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.42	201,646.04	
TELEFONICA	456,377	3.76	1,717,803.02	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.43	239,877.45	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	33.94	322,871.22	
E.ON SE	185,377	10.12	1,877,498.25	
EDP RENOVAVEIS SA	21,466	20.48	439,623.68	

	ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	11.37	449,551.37	
	ELIA GROUP SA/NV	2,925	90.65	265,151.25	
	ENAGAS	25,299	18.33	463,730.67	
	ENDESA	25,972	21.25	551,905.00	
	ENEL	692,930	7.92	5,490,777.32	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.63	1,046,590.90	
	ENGIE	158,224	11.60	1,836,347.74	
	FORTUM OYJ	41,901	23.06	966,237.06	
	IBERDROLA SA	498,312	10.28	5,122,647.36	
	IBERDROLA SA-RTS	498,312	0.25	127,069.56	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	23,310	22.07	514,451.70	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	15.75	624,204.00	
	RWE STAMM	55,390	31.27	1,732,045.30	
	SNAM SPA	189,497	4.89	927,019.32	
	SUEZ	32,549	19.54	636,170.20	
	TERNA SPA	130,230	6.42	836,337.06	
	UNIPER SE	7,335	31.65	232,152.75	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,427	25.95	1,126,930.65	
	VERBUND AG	6,430	80.45	517,293.50	
	ASM INTERNATIONAL NV	4,217	278.70	1,175,277.90	
	ASML HOLDING NV	36,125	583.10	21,064,487.50	
	INFINEON TECHNOLOGIES	112,361	33.11	3,720,272.71	
	STMICROELECTRONICS	55,076	32.11	1,768,765.74	
ユーロ 小計		16,893,642		410,523,651.75 (53,704,704,121)	
イギリスポンド	BP PLC	1,757,685	3.10	5,464,642.66	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	354,259	14.68	5,201,939.15	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	320,099	14.33	4,587,018.67	
	ANGLO AMERICAN PLC	108,946	29.91	3,258,574.86	
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	14.42	517,222.80	
	BHP GROUP PLC	182,400	22.62	4,125,888.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	13,112	76.38	1,001,494.56	
	EVRAZ PLC	43,000	6.15	264,536.00	
	GLENCORE PLC	875,677	3.19	2,796,912.33	
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	31.62	532,733.76	
	MONDI PLC	36,710	19.79	726,490.90	
	RIO TINTO PLC REG	96,096	61.06	5,867,621.76	
	ASHTEAD GROUP PLC	37,034	55.32	2,048,720.88	
	BAE SYSTEMS PLC	260,104	5.38	1,399,359.52	
	BUNZL PLC	24,880	25.56	635,932.80	
	DCC PLC	9,127	59.60	543,969.20	
	FERGUSON PLC	19,417	103.50	2,009,659.50	

MELROSE INDUSTRIES PLC	456,624	1.59	728,315.28	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	786,119	1.01	793,980.19	
SMITHS GROUP PLC	37,146	16.21	602,136.66	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	140.10	772,511.40	
EXPERIAN PLC	79,162	29.38	2,325,779.56	
INTERTEK GROUP PLC	13,890	56.02	778,117.80	
RELX PLC	166,847	20.08	3,350,287.76	
RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	5.07	712,514.56	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	7.05	680,878.20	
BURBERRY GROUP PLC	29,776	20.63	614,278.88	
PERSIMMON PLC	25,686	30.04	771,607.44	
TAYLOR WIMPEY PLC	355,934	1.64	585,867.36	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,829	47.58	562,823.82	
COMPASS GROUP PLC	155,632	15.25	2,373,388.00	
ENTAIN PLC	49,630	18.70	928,081.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	48.23	773,657.43	
WHITBREAD PLC	17,434	31.36	546,730.24	
AUTO TRADER GROUP PLC	97,321	6.40	623,438.32	
INFORMA PLC	141,175	5.07	716,886.65	
PEARSON	66,305	8.21	544,629.27	
WPP PLC	113,065	9.67	1,094,016.94	
JD SPORTS FASHION PLC	41,365	9.57	395,863.05	
KINGFISHER PLC	198,587	3.67	730,005.81	
NEXT PLC	11,468	78.40	899,091.20	
OCADO GROUP PLC	44,612	19.09	851,643.08	
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	2.64	554,613.18	
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.84	421,568.07	
TESCO PLC	666,000	2.37	1,583,082.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	33,490	21.85	731,756.50	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	188,273	27.72	5,219,868.92	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	25.73	462,110.80	
DIAGEO	200,801	34.34	6,895,506.34	
IMPERIAL BRANDS PLC	80,986	15.84	1,283,223.17	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	60,534	64.32	3,893,546.88	
UNILEVER PLC	227,095	42.95	9,753,730.25	
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	15.70	1,077,284.47	
ASTRAZENECA	113,182	86.48	9,787,979.36	
GLAXOSMITHKLINE	430,042	14.35	6,171,962.78	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	26.23	431,588.42	
BARCLAYS	1,516,252	1.73	2,628,574.46	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,754,485	4.14	7,265,322.38	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,190,268	0.46	2,891,474.18	

	NATWEST GROUP PLC	369,149	2.02	747,157.57	
	STANDARD CHARTERED PLC	212,446	4.54	964,717.28	
	3I GROUP PLC	88,121	12.02	1,059,655.02	
	ABRDN PLC	210,980	2.83	598,550.26	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	16.53	546,961.26	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	27,592	78.72	2,172,042.24	
	M&G PLC	229,107	2.27	521,905.74	
	SCHRODERS PLC	11,794	35.94	423,876.36	
	ST JAMES'S PLACE PLC	50,535	15.18	767,121.30	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	31.21	507,318.55	
	AVIVA PIC	332,730	4.05	1,347,556.50	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.92	332,502.66	
	LEGAL & GENERAL GROUP	514,539	2.65	1,367,644.66	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.89	351,600.89	
	PRUDENTIAL	225,330	13.79	3,107,300.70	
	AVEVA GROUP PLC	10,917	39.24	428,383.08	
	SAGE GROUP PLC	95,210	6.93	660,566.98	
	HALMA PLC	31,069	27.75	862,164.75	
	BT GROUP PLC	769,485	1.87	1,443,169.11	
	VODAFONE GROUP PLC	2,359,596	1.18	2,799,424.69	
	NATIONAL GRID PLC	306,760	9.39	2,882,316.96	
	SEVERN TRENT PLC	22,468	26.47	594,727.96	
	SSE PLC	92,294	15.29	1,411,175.26	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.31	604,252.70	
イギリスポンド 小計		25,504,232		152,294,531.89 (23,317,815,777)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	18.69	325,168.62	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	937.00	537,838.00	
	GIVAUDAN-REG	795	4,333.00	3,444,735.00	
	HOLCIM LTD	45,387	53.64	2,434,558.68	
	SIKA AG-BR	12,505	309.10	3,865,295.50	
	ABB LTD	149,042	32.85	4,896,029.70	
	GEBERIT AG-REG	2,964	710.40	2,105,625.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	272.00	574,464.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	280.70	1,057,677.60	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,573	62.58	911,978.34	
	SGS SA	506	2,896.00	1,465,376.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	314.60	1,439,924.20	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	45,940	110.65	5,083,261.00	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	310.20	770,226.60	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	59.55	234,507.90	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,208.00	618,240.00	

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	99,200.00	992,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	9,525.00	781,050.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	248,795	115.20	28,661,184.00	
	ALCON INC	42,603	64.42	2,744,485.26	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,677	330.20	1,544,345.40	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	854	1,545.00	1,319,430.00	
	LONZA GROUP AG-REG	6,536	666.80	4,358,204.80	
	NOVARTIS	191,990	84.94	16,307,630.60	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,799	381.40	1,067,538.60	
	ROCHE HOLDING GENUSS	60,854	353.10	21,487,547.40	
	VIFOR PHARMA AG	4,486	123.90	555,815.40	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,854	81.00	231,174.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	9.19	1,960,622.17	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	57.60	1,088,467.20	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,941	1,420.00	2,756,220.00	
	UBS GROUP AG	315,017	13.67	4,307,857.47	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,362	144.30	629,436.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,849	453.30	1,291,451.70	
	SWISS RE LTD	24,674	84.20	2,077,550.80	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,740	365.10	4,651,374.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	7,458	94.60	705,526.80	
	TEMENOS AG - REG	6,511	147.15	958,093.65	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	114.95	1,688,155.70	
	SWISSCOM	2,187	535.80	1,171,794.60	
スイスフラン 小計		1,498,047		133,101,862.89 (16,040,105,496)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	295.90	5,095,989.80	
	BOLIDEN AB	23,903	332.50	7,947,747.50	
	SCA SV CELLULOSA B	56,967	149.85	8,536,504.95	
	ALFA LAVAL AB	27,268	311.80	8,502,162.40	
	ASSA ABLOY AB-B	86,548	268.30	23,220,828.40	
	ATLAS COPCO A	58,390	543.00	31,705,770.00	
	ATLAS COPCO B	31,902	458.70	14,633,447.40	
	EPIROC AB-A	58,039	203.80	11,828,348.20	
	EPIROC AB-B	37,972	173.10	6,572,953.20	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	292.70	4,098,385.40	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	107,624	90.34	9,722,752.16	
	SANDVIK AB	96,684	223.50	21,608,874.00	
	SKANSKA B	32,007	234.90	7,518,444.30	
	SKF AB-B	35,405	220.60	7,810,343.00	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	217.80	2,943,349.20	
	VOLVO B	123,279	211.95	26,128,984.05	

	SECURITAS B	29,533	140.20	4,140,526.60	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	239.50	5,093,925.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	115.90	4,486,720.80	
	EVOLUTION AB	14,096	1,422.80	20,055,788.80	
	EMBRACER GROUP AB	18,755	222.90	4,180,489.50	
	HENNES & MAURITZ B	65,999	198.38	13,092,881.62	
	ICA GRUPPEN AB	9,493	401.20	3,808,591.60	
	SWEDISH MATCH AB	127,270	75.46	9,603,794.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	286.60	14,179,248.40	
	NORDEA BANK ABP	280,957	95.40	26,803,297.80	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,470	111.75	15,474,022.50	
	SVENSKA HANDELSBK A	131,166	98.60	12,932,967.60	
	SWEDBANK AB-A	72,526	163.80	11,879,758.80	
	EQT AB	20,102	342.30	6,880,914.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,115	330.60	3,344,019.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	312.20	3,486,649.60	
	INVESTOR AB-B SHS	157,664	205.20	32,352,652.80	
	KINNEVIK AB - B	18,792	343.90	6,462,568.80	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	571.00	4,156,880.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	9,450	587.40	5,550,930.00	
	SINCH AB	33,150	141.25	4,682,437.50	
	ERICSSON (LM) B	253,862	112.14	28,468,084.68	
	HEXAGON AB-B SHS	169,708	131.20	22,265,689.60	
	TELE2 AB-B SHS	50,012	120.05	6,003,940.60	
	TELIA CO AB	230,643	38.41	8,860,150.84	
スウェーデンクローナ 小計		2,790,392		476,121,815.70 (6,118,165,331)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	76,370	177.66	13,567,894.20	
	NORSK HYDRO	126,800	56.40	7,151,520.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,408	476.60	7,820,052.80	
	ADEVINTA ASA	19,117	173.05	3,308,196.85	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	399.60	3,705,890.40	
	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	448.00	3,172,736.00	
	MOWI ASA	40,968	223.80	9,168,638.40	
	ORKLA	69,804	89.68	6,260,022.72	
	DNB BANK ASA	85,517	186.95	15,987,403.15	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	201.60	3,744,518.40	
	TELENOR ASA	65,744	149.65	9,838,589.60	
ノルウェークローネ 小計		535,658		83,725,462.52 (1,062,476,119)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,347	561.80	5,812,944.60	
	NOVOZYMES A/S	19,125	474.30	9,070,987.50	

	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	755	3,200.00	2,416,000.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	87,375	241.70	21,118,537.50	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	17,450.00	5,217,550.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	514	18,045.00	9,275,130.00	
	DSV PANALPINA A S	18,142	1,519.50	27,566,769.00	
	PANDORA A/S	9,401	857.80	8,064,177.80	
	CARLSBERG AS-B	8,646	1,158.50	10,016,391.00	
	AMBU A/S-B	13,555	224.50	3,043,097.50	
	COLOPLAST-B	9,208	1,049.50	9,663,796.00	
	DEMANT A/S	11,604	337.10	3,911,708.40	
	GN STORE NORD A/S	11,967	551.40	6,598,603.80	
	GENMAB A/S	5,192	2,689.00	13,961,288.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	147,877	544.60	80,533,814.20	
	DANSKE BANK A/S	64,813	113.60	7,362,756.80	
	TRYG A/S	29,772	157.90	4,700,998.80	
	ORSTED A/S	15,439	926.60	14,305,777.40	
デンマーククローネ 小計		464,031		242,640,328.30 (4,268,043,374)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	29.09	600,097.61	
	OIL SEARCH LTD	186,117	3.89	723,995.13	
	SANTOS	156,437	7.12	1,113,831.44	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	33.60	430,516.80	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,404	23.44	1,744,029.76	
	BHP GROUP LTD	252,353	49.48	12,486,426.44	
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	21.26	1,048,713.28	
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	4.57	558,243.78	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,483	23.87	3,305,589.21	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	44.01	1,626,081.48	
	NEWCREST MINING LIMITED	74,098	25.71	1,905,059.58	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	10.10	1,026,442.80	
	ORICA LTD	38,288	13.27	508,081.76	
	RIO TINTO LTD	32,028	125.40	4,016,311.20	
	SOUTH32 LTD	341,133	2.93	999,519.69	
	REECE LTD	16,814	22.99	386,553.86	
	BRAMBLES LTD	137,883	11.39	1,570,487.37	
	AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	3.75	718,091.25	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	4.72	401,200.00	
	TRANSURBAN GROUP	233,493	14.42	3,366,969.06	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	41.70	2,199,758.40	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	10.99	333,304.72	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	114.72	406,223.52	
	TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	4.78	870,022.14	

	REA GROUP LTD	5,276	165.08	870,962.08	
	SEEK LTD	31,593	31.94	1,009,080.42	
	WESFARMERS LTD	100,575	58.00	5,833,350.00	
	COLES GROUP LTD	115,478	16.85	1,945,804.30	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	6.25	686,881.25	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	109,901	38.07	4,183,931.07	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	11.90	839,402.20	
	COCHLEAR LIMITED	6,220	243.26	1,513,077.20	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	63.26	1,027,848.48	
	SONIC HEALTHCARE LTD	40,076	38.03	1,524,090.28	
	CSL LIMITED	38,878	275.47	10,709,722.66	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	239,681	27.85	6,675,115.85	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	152,346	98.59	15,019,792.14	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	278,638	26.08	7,266,879.04	
	WESTPAC BANKING	318,928	25.37	8,091,203.36	
	ASX LTD	18,195	75.54	1,374,450.30	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,813	154.19	4,596,866.47	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	51.21	558,803.52	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	229,407	4.87	1,117,212.09	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	3.24	874,346.40	
	QBE INSURANCE GROUP	138,071	10.50	1,449,745.50	
	SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	11.27	1,345,119.58	
	AFTERPAY LTD	19,934	117.51	2,342,444.34	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	16.00	710,016.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	30.63	422,724.63	
	XERO LTD	11,340	134.28	1,522,735.20	
	TELSTRA CORP	308,467	3.75	1,156,751.25	
	AGL ENERGY LTD	64,235	8.14	522,872.90	
	AUSNET SERVICES	187,145	1.75	328,439.47	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	4.55	753,457.25	
オーストラリアドル 小計		5,834,938		128,618,675.51 (10,594,320,301)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.46	879,317.66	
	A2 MILK CO LTD	66,854	7.60	508,090.40	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	30.00	1,635,600.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	13.09	475,389.53	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.89	846,547.02	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.55	423,215.15	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.22	577,039.68	
ニュージーランドドル 小計		623,837		5,345,199.44 (411,526,904)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	229,496	57.65	13,230,444.40	

	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	117,500	131.30	15,427,750.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	30.95	5,323,400.00	
	MTR CORP	151,000	44.20	6,674,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	59.60	10,370,400.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	30.85	6,108,300.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	8.17	1,078,440.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	11.64	1,638,912.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	17.10	2,944,620.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	23.60	3,443,240.00	
	WH GROUP LTD	936,500	6.61	6,190,265.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	13.72	1,497,675.20	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	25.40	7,150,100.00	
	HANG SENG BANK	59,400	152.50	9,058,500.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	104,100	490.00	51,009,000.00	
	AIA GROUP LTD	1,045,200	94.55	98,823,660.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	207,496	52.90	10,976,538.40	
	ESR CAYMAN LTD	157,000	24.70	3,877,900.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	18.18	3,145,140.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	36.40	4,558,299.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	37.35	5,093,606.25	
	SINO LAND CO	315,400	12.48	3,936,192.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	118,500	113.50	13,449,750.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	51.50	2,085,750.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	22.35	2,150,070.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	157,000	43.75	6,868,750.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	45.25	3,054,375.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	77.25	10,621,875.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	12.24	11,073,001.68	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	137,500	47.30	6,503,750.00	
香港ドル 小計		6,942,612		327,363,904.13 (4,642,020,160)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	137,300	5.24	719,452.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.94	580,756.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.02	543,826.64	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.84	516,600.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.51	805,486.00	
	DBS GROUP	155,200	29.66	4,603,232.00	
	OCBC BANK	291,200	11.91	3,468,192.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	25.74	2,416,986.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	11.16	873,828.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	3.76	840,360.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.99	299,172.00	

	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.31	347,225.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	18.92	486,244.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.26	1,700,069.18	
シンガポールドル 小計		2,896,975		18,201,428.82 (1,483,962,491)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	21.85	1,480,468.60	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	417.50	895,955.00	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	26.80	2,634,708.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	25.24	2,747,727.36	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	15.55	1,547,225.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	99.50	1,244,048.50	
	AZRIELI GROUP	4,323	240.20	1,038,384.60	
	NICE LTD	5,891	836.00	4,924,876.00	
イスラエルシェケル 小計		399,293		16,513,393.06 (555,221,558)	
合　計		95,471,191		508,808,969,774 (508,808,969,774)	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	114,413	1,042,302.43	
		LENDLEASE GROUP	64,786	755,404.76	
		SYDNEY AIRPORT	124,551	965,270.25	
	オーストラリアドル 小計		303,750	2,762,977.44 (227,586,451)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,730,925.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	3,945,000.00	
	香港ドル 小計		595,500	5,675,925.00 (80,484,616)	
投資信託受益証券合計			899,250	308,071,067 (308,071,067)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	781,331.40	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,971	2,090,524.05	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	38,586	10,744,271.70	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,116,663.57	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,025	2,655,480.75	
		BOSTON PROPERTIES	13,029	1,526,607.93	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	1,240,689.84	
		CROWN CASTLE INTL CORP	36,859	7,435,197.48	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,924	3,726,402.24	

	DUKE REALTY CORP	31,540	1,572,269.00	
	EQUINIX INC	7,704	6,319,745.28	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,564	1,300,936.56	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	32,077	2,621,011.67	
	ESSEX PROPERTY TRUST	5,510	1,764,522.40	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,882,228.92	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,573,411.40	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	1,158,500.99	
	INVITATION HOMES INC	51,458	2,053,174.20	
	IRON MOUNTAIN INC	27,546	1,204,862.04	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	1,025,738.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,603	1,735,262.10	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	780,506.53	
	PROLOGIS INC	63,163	7,920,008.57	
	PUBLIC STORAGE	13,912	4,336,092.16	
	REALTY INCOME CORP	31,608	2,176,842.96	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	813,340.11	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,586	3,156,957.38	
	SIMON PROPERTY GROUP	28,176	3,654,145.44	
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,639,586.55	
	UDR INC	28,059	1,457,945.64	
	VENTAS INC	31,565	1,850,971.60	
	VEREIT INC	21,159	1,008,014.76	
	VICI PROPERTIES INC	49,459	1,554,990.96	
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	715,942.80	
	WELLTOWER INC	35,679	3,083,735.97	
	WP CAREY INC	16,500	1,286,505.00	
アメリカドル 小計		1,058,468	90,964,417.95 (10,021,549,925)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	544,684.23	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	356,270.00	
カナダドル 小計		24,377	900,954.23 (79,680,392)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	384,555.00	
	GECINA SA	4,459	592,378.15	
	KLEPIERRE	17,225	381,706.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	788,620.65	
ユーロ 小計		37,101	2,147,259.80 (280,904,527)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	409,140.92	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	66,349	457,011.91	
	SEGRO PLC	106,999	1,246,003.35	

	イギリスポンド 小計		252,762	2,112,156.18 (323,392,232)	
	オーストラリアドル	DEXUS	94,090	971,949.70	
		GOODMAN GROUP	139,848	2,984,356.32	
		GPT GROUP	167,884	812,558.56	
		MIRVAC GROUP	392,919	1,151,252.67	
		SCENTRE GROUP	486,663	1,318,856.73	
		STOCKLAND	207,412	939,576.36	
		VICINITY CENTERS	365,149	567,806.69	
	オーストラリアドル 小計		1,853,965	8,746,357.03 (720,437,428)	
	香港ドル	LINK REIT	170,500	12,642,575.00	
	香港ドル 小計		170,500	12,642,575.00 (179,271,713)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	855,255.38	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	426,560	912,838.40	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	481,800.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	273,085	573,478.50	
	シンガポールドル 小計		1,203,783	2,823,372.28 (230,189,541)	
投資証券合計			4,600,956	11,835,425,758 (11,835,425,758)	
合計				12,143,496,825 (12,143,496,825)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式　601銘柄	97.4%	—	—	70.7%
	投資証券　36銘柄	—	—	2.6%	1.9%
カナダドル	株式　89銘柄	99.6%	—	—	3.5%
	投資証券　2銘柄	—	—	0.4%	0.0%
ユーロ	株式　234銘柄	99.5%	—	—	10.3%
	投資証券　4銘柄	—	—	0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式　83銘柄	98.6%	—	—	4.5%

	投資証券　3銘柄	—	—	1.4%	0.1%
スイスフラン	株式　40銘柄	100.0%	—	—	3.1%
スウェーデンクローナ	株式　41銘柄	100.0%	—	—	1.2%
ノルウェークローネ	株式　11銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式　18銘柄	100.0%	—	—	0.8%
オーストラリアドル	株式　54銘柄	91.8%	—	—	2.0%
	投資信託受益証券　3銘柄	—	2.0%	—	0.0%
	投資証券　7銘柄	—	—	6.2%	0.1%
ニュージーランドドル	株式　7銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式　30銘柄	94.7%	—	—	0.9%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.6%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	3.7%	0.0%
シンガポールドル	株式　14銘柄	86.6%	—	—	0.3%
	投資証券　4銘柄	—	—	13.4%	0.0%
イスラエルシェケル	株式　8銘柄	100.0%	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	134,550,430
コール・ローン	3,592,971,376
国債証券	304,053,521,125
派生商品評価勘定	27,629,899
未収入金	30,699,204
未収利息	1,698,989,686
前払費用	58,151,440
差入委託証拠金	471,893,246
流動資産合計	310,068,406,406
資産合計	310,068,406,406
負債の部	

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
流動負債	
派生商品評価勘定	19,835,838
前受金	26,585,246
未払金	29,137,423
未払解約金	49,264,669
未払利息	5,482
流動負債合計	124,828,658
負債合計	124,828,658
純資産の部	
元本等	
元本	100,722,788,748
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	209,220,789,000
元本等合計	309,943,577,748
純資産合計	309,943,577,748
負債純資産合計	310,068,406,406

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

	2021年 7月12日現在
4 .収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 7月12日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	100,722,788,748口
2．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.0772円 (1万口当たり純資産額) (30,772円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2021年 7月12日現在
期首	2020年 7月11日
期首元本額	96,491,687,491円
期中追加設定元本額	17,610,847,912円
期中一部解約元本額	13,379,746,655円
期末元本額	100,722,788,748円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,423,389,430円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	610,286,906円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	397,686,870円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,066,930,698円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	7,388,253円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	7,332,425,280円
世界経済インデックスファンド	9,853,732,322円
ＤＣマイセレクション２５	1,906,152,059円
ＤＣマイセレクション５０	1,606,575,780円
ＤＣマイセレクション７５	1,091,766,842円
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	2,175,375,656円
ＤＣマイセレクションＳ２５	891,567,483円
ＤＣマイセレクションＳ５０	684,698,901円
ＤＣマイセレクションＳ７５	363,886,754円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	38,615,318円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	85,329,117円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	42,644,496円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	11,360,195,746円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	674,428,066円
外国債券インデックス　為替ヘッジあり（ＳＭＡ専用）	3,958,991円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,388,520円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,233,869円
外国債券インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	32,048,627円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	65,820,388円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	106,184,045円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	88,474,208円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	94,847,807円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,572,386,113円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	479,351,456円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,896,249,373円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	345,283,694円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	61,692,978円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	498,829,966円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	190,310,335円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	230,132,357円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	801,684,522円

区分	2021年 7月12日現在
グローバル債券ファンド・シリーズ１（適格機関投資家専用）	1,741,615,177円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	774,648,652円
外国債券ファンド・シリーズ１	628,379,698円
コア投資戦略ファンド（安定型）	911,972,296円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,419,366,371円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,164,439,715円
分散投資コア戦略ファンドＳ	2,447,192,293円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	475,380,191円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,712,455,883円
コア投資戦略ファンド（切替型）	950,325,514円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	229,042,787円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	101,090,206円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,250,887,185円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	194,848,396円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	20,880,259,904円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	183,472,103円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	202,716,747円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	325,343,765円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	3,460,450円
グローバル経済コア	766,071,712円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	12,281,967円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	1,241,837円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	271,449,363円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	30,730,194円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	4,671,165円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	3,599,664円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	1,892,494円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	1,784,854円
ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	510,300,812円
ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	10,569,126,292円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	337,289,328円
外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	340,159,039円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	191,339,468円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,993,642,041
合計	2,993,642,041

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2021年 7月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	3,689,091,536	－	3,715,676,782	26,585,246
合計		3,689,091,536	－	3,715,676,782	26,585,246

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2021年 7月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,589,875,952	－	3,571,084,767	△18,791,185
	アメリカドル	1,642,705,873	－	1,635,966,585	△6,739,288
	カナダドル	165,370,970	－	163,610,485	△1,760,485
	ユーロ	1,519,819,558	－	1,509,696,266	△10,123,292
	イギリスポンド	261,979,551	－	261,811,431	△168,120
合計		3,589,875,952	－	3,571,084,767	△18,791,185

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	10,000,000.00	9,953,906.30	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,687,369.91	
		T 0.125% 04/30/23	5,000,000.00	4,993,945.30	
		T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,490,771.47	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	8,038,590.62	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,975,000.00	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,237,050.79	
		T 0.125% 12/31/22	6,400,000.00	6,398,000.00	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,970,546.94	
		T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,162,291.04	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,964,453.10	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	8,006,562.48	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	985,859.38	
		T 0.25% 07/31/25	10,000,000.00	9,848,046.90	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	7,372,265.62	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,534,750.00	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,874,375.04	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	7,003,281.25	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,940,312.48	
		T 0.375% 07/31/27	9,500,000.00	9,168,613.30	
		T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	7,696,562.48	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,958,984.39	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,941,406.24	
		T 0.5% 02/28/26	11,500,000.00	11,376,914.12	
		T 0.5% 03/15/23	7,770,000.00	7,813,099.25	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,206,180.48	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,868,911.71	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,410,312.50	
		T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	6,912,238.29	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,524,022.64	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	7,262,695.35	
		T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	13,299,164.13	
		T 0.625% 08/15/30	15,950,000.00	14,997,984.37	
		T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,437,695.32	

		T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	9,738,671.90	
		T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	8,335,976.60	
		T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	11,000,000.00	
		T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,998,476.57	
		T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	10,699,644.58	
		T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	14,745,472.73	
		T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	8,033,125.04	
		T 1.125% 05/15/40	8,060,000.00	7,072,020.35	
		T 1.125% 08/15/40	9,300,000.00	8,131,687.50	
		T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	5,208,339.86	
		T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	8,085,625.04	
		T 1.25% 05/15/50	10,650,000.00	8,866,957.08	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,645,798.83	
		T 1.375% 01/31/25	9,000,000.00	9,270,000.00	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,114,941.40	
		T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	8,507,039.11	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,560,742.20	
		T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,099,218.76	
		T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,079,394.55	
		T 1.375% 11/15/40	13,000,000.00	11,870,625.00	
		T 1.5% 01/15/23	6,200,000.00	6,326,906.25	
		T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	6,201,796.86	
		T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,588,279.68	
		T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,970,472.66	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,091,015.64	
		T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,153,906.30	
		T 1.5% 08/15/26	8,400,000.00	8,690,718.79	
		T 1.5% 09/15/22	9,500,000.00	9,655,117.23	
		T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,786,542.99	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,430,328.12	
		T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,590,371.08	
		T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,363,194.14	
		T 1.625% 05/15/31	9,470,000.00	9,701,571.14	
		T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,026,738.28	
		T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,541,845.70	
		T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,957,246.12	
		T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,086,425.80	
		T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,578,027.35	
		T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,599,128.88	
		T 1.625% 11/15/22	8,080,000.00	8,243,178.10	
		T 1.625% 11/15/50	8,050,000.00	7,364,492.18	
		T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,138,402.32	

		T 1.625% 12/15/22	3,600,000.00	3,676,500.00	
		T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,737,275.40	
		T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,795,438.87	
		T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,113,339.87	
		T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,496,281.25	
		T 1.75% 07/15/22	8,320,000.00	8,459,587.46	
		T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,252,899.42	
		T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,121,406.25	
		T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	7,856,179.72	
		T 1.875% 02/15/51	9,900,000.00	9,620,015.61	
		T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,169,453.17	
		T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,468,354.28	
		T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,080,703.12	
		T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,269,765.64	
		T 1.875% 09/30/22	2,660,000.00	2,717,096.47	
		T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,620,389.62	
		T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,340,855.45	
		T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,755,835.95	
		T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,540,812.51	
		T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,834,562.50	
		T 2.125% 06/30/22	6,000,000.00	6,118,828.14	
		T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,049,750.00	
		T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,428,750.00	
		T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,797,564.06	
		T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,474,612.50	
		T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,197,656.24	
		T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,616,355.51	
		T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	8,025,585.97	
		T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,368,593.75	
		T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,196,593.75	
		T 2.25% 08/15/46	7,290,000.00	7,664,182.06	
		T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	5,798,203.12	
		T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,668,894.54	
		T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,747,898.43	
		T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,697,343.77	
		T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,234,507.81	
		T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,716,035.14	
		T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,906,296.89	
		T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,172,363.30	
		T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,069,150.02	
		T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,798,453.13	
		T 2.375% 05/15/27	10,750,000.00	11,636,035.21	
		T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	8,708,997.69	

		T 2.375% 05/15/51	2,750,000.00	2,988,476.56	
		T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	5,300,976.55	
		T 2.375% 11/15/49	7,500,000.00	8,124,609.37	
		T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,663,154.28	
		T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,350,000.00	
		T 2.5% 02/15/45	3,210,000.00	3,527,489.06	
		T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	4,403,437.52	
		T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,211,525.38	
		T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,378,320.35	
		T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	5,560,128.93	
		T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,765,414.06	
		T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,091,947.67	
		T 2.625% 02/15/29	9,990,000.00	11,037,389.06	
		T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,456,300.77	
		T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,803,945.31	
		T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,132,080.07	
		T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,700,292.96	
		T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,313,790.62	
		T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,188,906.25	
		T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	7,263,847.68	
		T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,765,656.26	
		T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,066,118.75	
		T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,963,203.12	
		T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,051,757.81	
		T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,486,062.50	
		T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	5,721,890.62	
		T 2.75% 08/31/23	7,500,000.00	7,901,367.22	
		T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,495,125.00	
		T 2.75% 11/15/23	6,120,000.00	6,474,290.65	
		T 2.75% 11/15/42	2,820,000.00	3,223,612.50	
		T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	3,528,707.04	
		T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,348,125.00	
		T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,119,289.09	
		T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	4,842,531.25	
		T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	6,630,040.62	
		T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,157,532.83	
		T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,952,253.12	
		T 2.875% 08/15/28	8,920,000.00	9,989,006.25	
		T 2.875% 08/15/45	4,300,000.00	5,048,804.70	
		T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,025,537.09	
		T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,649,511.72	
		T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,267,638.27	

		T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	8,210,156.25	
		T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,146,093.75	
		T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,902,167.22	
		T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,000,000.00	
		T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,515,217.18	
		T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,463,992.58	
		T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,760,390.62	
		T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,060,351.57	
		T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,271,910.56	
		T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,244,726.60	
		T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,834,796.87	
		T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,051,875.00	
		T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,270,910.16	
		T 3.125% 02/15/43	3,500,000.00	4,242,109.37	
		T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	7,349,493.75	
		T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	5,043,037.50	
		T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	9,569,437.50	
		T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,115,449.22	
		T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	3,807,885.17	
		T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	6,875,507.83	
		T 3.5% 02/15/39	770,000.00	975,674.22	
		T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,145,500.00	
		T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,611,562.50	
		T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,633,906.26	
		T 3.75% 11/15/43	4,500,000.00	5,990,273.46	
		T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,930,992.18	
		T 3% 02/15/47	2,800,000.00	3,378,812.50	
		T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,389,367.18	
		T 3% 02/15/49	7,000,000.00	8,517,031.25	
		T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,924,003.12	
		T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,191,250.00	
		T 3% 05/15/47	5,710,000.00	6,897,055.49	
		T 3% 08/15/48	5,450,000.00	6,615,363.30	
		T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,610,156.25	
		T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,494,726.55	
		T 3% 11/15/44	2,800,000.00	3,346,656.26	
		T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,247,062.50	
		T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,283,574.23	
		T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,392,812.50	
		T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,688,054.69	
		T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,774,332.04	
		T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,774,828.12	
		T 4.5% 02/15/36	1,590,000.00	2,205,752.35	

	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	777,476.56	
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,426,617.19	
	T 4.625% 02/15/40	2,380,000.00	3,458,623.44	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,113,867.18	
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,620,609.37	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,679,640.62	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,669,824.22	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,562,156.25	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,106,472.65	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,909,128.91	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,490,671.87	
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,857,796.87	
アメリカドル 小計		1,200,330,000.00	1,254,878,264.13 (138,249,938,359)	
カナダドル	CAN 0.25% 02/01/23	3,060,000.00	3,052,472.40	
	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,208,864.00	
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,373,600.00	
	CAN 0.25% 05/01/23	2,600,000.00	2,589,106.00	
	CAN 0.25% 08/01/22	910,000.00	909,572.30	
	CAN 0.25% 11/01/22	1,770,000.00	1,767,327.30	
	CAN 0.5% 09/01/25	3,990,000.00	3,930,668.70	
	CAN 0.5% 12/01/30	2,420,000.00	2,244,477.40	
	CAN 1.25% 03/01/25	2,400,000.00	2,440,080.00	
	CAN 1.25% 06/01/30	5,620,000.00	5,608,029.40	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,090,511.90	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,396,162.40	
	CAN 1.5% 06/01/31	1,400,000.00	1,416,380.00	
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	614,790.00	
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,697,974.80	
	CAN 1% 06/01/27	1,730,000.00	1,725,761.50	
	CAN 1% 09/01/22	2,500,000.00	2,519,600.00	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,398,049.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,900,908.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,361,455.20	
	CAN 2.5% 06/01/24	300,000.00	315,750.00	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,880,000.00	2,268,069.60	
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	707,358.40	
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,386,438.50	
	CAN 2% 09/01/23	4,310,000.00	4,443,954.80	
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	4,911,964.80	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,480,000.00	1,985,938.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,458,450.00	

	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,571,017.50	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,410,000.00	2,063,450.40	
	CAN 5% 06/01/37	820,000.00	1,212,394.60	
カナダドル 小計		64,090,000.00	67,570,576.90 (5,975,941,821)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	10,897,915.50	
	MBONO 10% 12/05/24	29,660,000.00	33,099,966.80	
	MBONO 5.75% 03/05/26	45,980,000.00	44,754,173.20	
	MBONO 6.75% 03/09/23	29,950,000.00	30,454,058.50	
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	40,626,320.10	
	MBONO 7.75% 05/29/31	24,180,000.00	25,746,622.20	
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	25,158,809.50	
	MBONO 7.75% 11/23/34	14,100,000.00	15,080,373.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	39,970,000.00	44,366,700.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,220,000.00	29,241,592.80	
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	36,255,890.70	
	MBONO 8% 11/07/47	24,630,000.00	26,292,771.30	
	MBONO 8% 12/07/23	34,870,000.00	36,461,466.80	
メキシコペソ 小計		375,680,000.00	398,436,660.40 (2,208,056,284)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,398,441.20	
	BGB 0.2% 10/22/23	980,000.00	999,698.00	
	BGB 0.4% 06/22/40	710,000.00	695,132.60	
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,681,430.40	
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	551,443.20	
	BGB 0.8% 06/22/25	2,520,000.00	2,659,910.40	
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,815,279.70	
	BGB 0.8% 06/22/28	2,090,000.00	2,257,367.20	
	BGB 0.9% 06/22/29	2,360,000.00	2,573,627.20	
	BGB 0% 10/22/27	430,000.00	440,745.70	
	BGB 0% 10/22/31	630,000.00	629,029.80	
	BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,709,430.00	
	BGB 1.45% 06/22/37	720,000.00	843,091.20	
	BGB 1.6% 06/22/47	1,380,000.00	1,662,237.60	
	BGB 1.7% 06/22/50	1,140,000.00	1,405,677.00	
	BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,308,625.50	
	BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,452,755.60	
	BGB 1% 06/22/31	1,980,000.00	2,189,246.40	
	BGB 2.15% 06/22/66	870,000.00	1,250,250.90	
	BGB 2.25% 06/22/23	1,850,000.00	1,956,689.50	
	BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	1,097,781.30	
	BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,347,751.20	
	BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	2,027,124.00	

		BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,405,084.80	
		BGB 4.25% 03/28/41	2,400,000.00	4,087,224.00	
		BGB 4.25% 09/28/22	2,100,000.00	2,226,525.00	
		BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,416,119.40	
		BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,546,786.80	
		BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,909,041.40	
		BGB 5% 03/28/35	2,690,000.00	4,454,155.80	
		BKO 0% 03/10/23	1,210,000.00	1,223,745.60	
		BKO 0% 12/15/22	4,950,000.00	4,998,955.50	
		BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,044,595.70	
		BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,668,424.80	
		BTPS 0.3% 08/15/23	1,850,000.00	1,874,882.50	
		BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	590,028.20	
		BTPS 0.5% 02/01/26	3,710,000.00	3,790,544.10	
		BTPS 0.5% 07/15/28	620,000.00	623,844.00	
		BTPS 0.6% 06/15/23	1,110,000.00	1,131,123.30	
		BTPS 0.6% 08/01/31	1,850,000.00	1,821,269.50	
		BTPS 0.65% 10/15/23	2,170,000.00	2,218,152.30	
		BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,332,620.00	
		BTPS 0.9% 04/01/31	3,800,000.00	3,865,512.00	
		BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,225,187.80	
		BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,044,180.00	
		BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	980,750.40	
		BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,638,127.40	
		BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,290,299.20	
		BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,477,818.00	
		BTPS 0.95% 12/01/31	1,700,000.00	1,725,007.00	
		BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	1,006,620.00	
		BTPS 0% 04/15/24	2,000,000.00	2,012,240.00	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,065,576.50	
		BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	2,064,742.00	
		BTPS 1.45% 03/01/36	1,450,000.00	1,509,044.00	
		BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,436,436.00	
		BTPS 1.45% 09/15/22	1,990,000.00	2,034,138.20	
		BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,530,368.00	
		BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,559,926.10	
		BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	3,040,014.30	
		BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,268,589.10	
		BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,762,681.80	
		BTPS 1.7% 09/01/51	1,120,000.00	1,104,902.40	
		BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,386,496.00	
		BTPS 1.8% 03/01/41	1,810,000.00	1,915,740.20	
		BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,118,420.00	

		BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,905,254.00	
		BTPS 1% 07/15/22	2,160,000.00	2,192,011.20	
		BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	3,036,111.80	
		BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,521,280.00	
		BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	728,131.20	
		BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,544,662.40	
		BTPS 2.25% 09/01/36	1,840,000.00	2,114,380.80	
		BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	3,091,308.00	
		BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	2,105,174.80	
		BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	3,090,245.40	
		BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,274,146.00	
		BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,216,621.00	
		BTPS 2.7% 03/01/47	2,510,000.00	3,053,866.80	
		BTPS 2.8% 03/01/67	1,320,000.00	1,587,735.60	
		BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,215,306.80	
		BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,563,648.00	
		BTPS 2% 02/01/28	2,690,000.00	2,982,725.80	
		BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,274,672.40	
		BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,813,964.80	
		BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,593,285.50	
		BTPS 3.35% 03/01/35	2,220,000.00	2,854,143.00	
		BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,926,172.40	
		BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,936,773.60	
		BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,417,632.00	
		BTPS 3.85% 09/01/49	2,160,000.00	3,194,532.00	
		BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	4,019,702.40	
		BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,095,647.50	
		BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,512,411.20	
		BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,897,689.20	
		BTPS 4.75% 08/01/23	4,950,000.00	5,472,175.50	
		BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,737,295.20	
		BTPS 4.75% 09/01/44	3,050,000.00	4,937,736.50	
		BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	4,936,594.50	
		BTPS 5.0% 08/01/39	3,300,000.00	5,237,397.00	
		BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,929,994.80	
		BTPS 5.5% 09/01/22	1,400,000.00	1,494,878.00	
		BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,716,823.00	
		BTPS 5.75% 02/01/33	3,080,000.00	4,724,997.20	
		BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,345,261.80	
		BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	4,407,361.20	
		BTPS 5% 09/01/40	3,190,000.00	5,117,876.50	
		BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,995,180.00	

		BTPS 6% 05/01/31	3,940,000.00	5,924,459.80	
		BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,929,032.00	
		BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	971,832.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	4,080,493.30	
		DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,112,741.40	
		DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,302,210.80	
		DBR 0.5% 02/15/25	3,000,000.00	3,132,510.00	
		DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,164,070.00	
		DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,559,451.00	
		DBR 0.5% 08/15/27	5,690,000.00	6,071,628.30	
		DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,701,625.90	
		DBR 0% 02/15/31	800,000.00	826,480.00	
		DBR 0% 05/15/35	2,820,000.00	2,860,185.00	
		DBR 0% 05/15/36	1,670,000.00	1,679,552.40	
		DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,492,767.00	
		DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,629,185.00	
		DBR 0% 08/15/30	6,450,000.00	6,677,620.50	
		DBR 0% 08/15/30	670,000.00	697,791.60	
		DBR 0% 08/15/50	4,420,000.00	4,166,645.60	
		DBR 0% 11/15/27	2,160,000.00	2,236,528.80	
		DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	4,609,751.20	
		DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,064,280.80	
		DBR 1.5% 05/15/23	3,020,000.00	3,143,820.00	
		DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,436,353.90	
		DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,871,092.00	
		DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,757,332.50	
		DBR 1.75% 07/04/22	2,090,000.00	2,140,160.00	
		DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,107,940.00	
		DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,911,297.60	
		DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,524,028.40	
		DBR 2.5% 08/15/46	3,980,000.00	6,335,762.00	
		DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,024,621.60	
		DBR 3.25% 07/04/42	2,580,000.00	4,339,714.80	
		DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,828,669.30	
		DBR 4.25% 07/04/39	2,720,000.00	4,854,710.40	
		DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,521,193.00	
		DBR 4.75% 07/04/34	3,390,000.00	5,636,790.30	
		DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,430,430.40	
		DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	4,478,282.40	
		DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	3,338,102.00	
		DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,794,959.30	
		DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,984,062.50	
		DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,407,436.80	

		FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,855,032.00	
		FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,819,972.60	
		FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,336,610.50	
		FRTR 0.5% 05/25/29	5,350,000.00	5,645,320.00	
		FRTR 0.5% 05/25/40	2,150,000.00	2,140,239.00	
		FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	792,089.10	
		FRTR 0.5% 06/25/44	1,230,000.00	1,197,528.00	
		FRTR 0.75% 05/25/28	6,870,000.00	7,369,105.50	
		FRTR 0.75% 05/25/52	3,800,000.00	3,711,422.00	
		FRTR 0.75% 11/25/28	6,200,000.00	6,661,342.00	
		FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,071,607.00	
		FRTR 0% 02/25/24	3,500,000.00	3,556,070.00	
		FRTR 0% 02/25/26	5,210,000.00	5,328,840.10	
		FRTR 0% 02/25/27	950,000.00	970,539.00	
		FRTR 0% 03/25/23	5,290,000.00	5,348,190.00	
		FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,050,436.00	
		FRTR 0% 03/25/25	6,690,000.00	6,829,687.20	
		FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,322,857.00	
		FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	6,065,307.60	
		FRTR 0% 11/25/31	2,910,000.00	2,894,606.10	
		FRTR 1.25% 05/25/34	5,110,000.00	5,783,191.40	
		FRTR 1.25% 05/25/36	4,830,000.00	5,474,466.90	
		FRTR 1.5% 05/25/31	5,890,000.00	6,774,089.00	
		FRTR 1.5% 05/25/50	4,090,000.00	4,845,259.40	
		FRTR 1.75% 05/25/23	5,380,000.00	5,622,207.60	
		FRTR 1.75% 05/25/66	1,630,000.00	2,107,981.20	
		FRTR 1.75% 06/25/39	3,820,000.00	4,699,402.20	
		FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,492,841.60	
		FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,033,206.50	
		FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,636,558.40	
		FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,441,776.00	
		FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	5,955,537.00	
		FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000.00	7,873,749.40	
		FRTR 2.75% 10/25/27	5,970,000.00	7,157,015.10	
		FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	4,665,914.00	
		FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	5,300,303.00	
		FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,580,058.50	
		FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,588,213.80	
		FRTR 4.5% 04/25/41	4,720,000.00	8,285,771.20	
		FRTR 4.75% 04/25/35	3,680,000.00	5,952,768.00	
		FRTR 4% 04/25/55	2,660,000.00	5,129,863.20	
		FRTR 4% 04/25/60	2,180,000.00	4,399,915.80	

		FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,410,737.20	
		FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,504,720.30	
		FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,137,650.80	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,439,961.00	
		FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,164,530.00	
		IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	960,327.30	
		IRISH 0.2% 10/18/30	1,030,000.00	1,049,734.80	
		IRISH 0.4% 05/15/35	760,000.00	769,386.00	
		IRISH 0.55% 04/22/41	490,000.00	488,588.80	
		IRISH 0.9% 05/15/28	1,070,000.00	1,155,268.30	
		IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	534,123.40	
		IRISH 0% 10/18/31	730,000.00	723,276.70	
		IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,317,972.00	
		IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	759,150.20	
		IRISH 1.35% 03/18/31	860,000.00	973,399.60	
		IRISH 1.5% 05/15/50	780,000.00	924,183.00	
		IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	984,770.80	
		IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,520,649.60	
		IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,476,526.70	
		IRISH 2% 02/18/45	1,150,000.00	1,497,656.50	
		IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,074,081.00	
		IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,087,285.20	
		IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,841,656.40	
		NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,393,714.40	
		NETHER 0.25% 07/15/29	1,710,000.00	1,792,011.60	
		NETHER 0.5% 01/15/40	1,440,000.00	1,542,556.80	
		NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,448,412.00	
		NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,272,406.70	
		NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,756,663.20	
		NETHER 0% 01/15/24	2,060,000.00	2,097,244.80	
		NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,893,507.20	
		NETHER 0% 01/15/38	700,000.00	687,526.00	
		NETHER 0% 01/15/52	980,000.00	899,679.20	
		NETHER 0% 07/15/30	1,920,000.00	1,965,696.00	
		NETHER 0% 07/15/31	1,500,000.00	1,526,715.00	
		NETHER 1.75% 07/15/23	1,940,000.00	2,036,825.40	
		NETHER 2.25% 07/15/22	1,220,000.00	1,256,526.80	
		NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,639,635.00	
		NETHER 2.75% 01/15/47	2,360,000.00	3,872,170.00	
		NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,153,558.10	
		NETHER 3.75% 01/15/23	2,330,000.00	2,488,812.80	
		NETHER 3.75% 01/15/42	2,060,000.00	3,580,712.60	
		NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	3,531,970.60	

		NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,415,374.10	
		NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	225,014.00	
		OBL 0% 04/05/24	4,250,000.00	4,333,002.50	
		OBL 0% 04/10/26	4,070,000.00	4,196,251.40	
		OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,848,437.50	
		OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,247,838.80	
		OBL 0% 10/07/22	4,160,000.00	4,196,316.80	
		OBL 0% 10/10/25	4,340,000.00	4,466,641.20	
		OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,535,005.60	
		OBL 0% 10/18/24	3,490,000.00	3,571,247.20	
		RAGB 0.5% 02/20/29	1,770,000.00	1,873,987.50	
		RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	940,427.40	
		RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,742,326.20	
		RAGB 0.75% 03/20/51	790,000.00	832,596.80	
		RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,219,214.40	
		RAGB 0.85% 06/30/20	400,000.00	386,060.00	
		RAGB 0% 02/20/30	1,450,000.00	1,472,533.00	
		RAGB 0% 02/20/31	740,000.00	746,275.20	
		RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	950,934.30	
		RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,520,580.00	
		RAGB 0% 07/15/24	1,350,000.00	1,376,203.50	
		RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	322,662.40	
		RAGB 0% 10/20/40	420,000.00	390,196.80	
		RAGB 1.2% 10/20/25	1,430,000.00	1,541,068.10	
		RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	1,159,719.30	
		RAGB 1.5% 11/02/86	330,000.00	448,839.60	
		RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,065,863.70	
		RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,404,333.70	
		RAGB 2.1% 09/20/17	780,000.00	1,345,507.80	
		RAGB 2.4% 05/23/34	1,260,000.00	1,633,905.00	
		RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,336,017.80	
		RAGB 3.4% 11/22/22	2,360,000.00	2,491,876.80	
		RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	998,721.80	
		RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,936,060.40	
		RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,646,735.50	
		RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,663,115.60	
		RFGB 0.125% 04/15/36	540,000.00	535,345.20	
		RFGB 0.125% 04/15/52	490,000.00	441,793.80	
		RFGB 0.125% 09/15/31	400,000.00	407,464.00	
		RFGB 0.25% 09/15/40	400,000.00	396,588.00	
		RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	651,775.00	
		RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	921,573.60	

		RFGB 0.5% 09/15/28	1,030,000.00	1,094,169.00	
		RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	808,001.60	
		RFGB 0.75% 04/15/31	620,000.00	673,747.80	
		RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	732,918.00	
		RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	548,132.40	
		RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	428,925.00	
		RFGB 0% 09/15/30	630,000.00	639,147.60	
		RFGB 1.125% 04/15/34	710,000.00	805,750.60	
		RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	611,157.40	
		RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	675,194.00	
		RFGB 1.625% 09/15/22	930,000.00	955,128.60	
		RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	872,090.80	
		RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	514,365.60	
		RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	784,954.40	
		RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	985,268.10	
		SPGB 0.1% 04/30/31	2,180,000.00	2,127,265.80	
		SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,338,364.80	
		SPGB 0.35% 07/30/23	3,590,000.00	3,652,932.70	
		SPGB 0.45% 10/31/22	3,060,000.00	3,101,677.20	
		SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,970,093.00	
		SPGB 0.5% 10/31/31	430,000.00	433,487.30	
		SPGB 0.6% 10/31/29	3,400,000.00	3,523,352.00	
		SPGB 0.8% 07/30/27	2,000,000.00	2,111,320.00	
		SPGB 0.85% 07/30/37	960,000.00	955,420.80	
		SPGB 0% 01/31/25	2,350,000.00	2,384,239.50	
		SPGB 0% 01/31/26	1,410,000.00	1,428,428.70	
		SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,933,589.80	
		SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,402,372.00	
		SPGB 0% 05/31/24	1,260,000.00	1,275,724.80	
		SPGB 1.2% 10/31/40	1,910,000.00	1,962,372.20	
		SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,320,718.00	
		SPGB 1.3% 10/31/26	3,450,000.00	3,734,038.50	
		SPGB 1.4% 04/30/28	2,490,000.00	2,730,459.30	
		SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,625,446.00	
		SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,973,257.00	
		SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,337,160.00	
		SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	596,732.40	
		SPGB 1.5% 04/30/27	2,650,000.00	2,909,223.00	
		SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,285,033.00	
		SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	3,168,852.50	
		SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,113,985.80	
		SPGB 1.95% 07/30/30	2,940,000.00	3,390,466.80	
		SPGB 1% 10/31/50	2,430,000.00	2,242,015.20	

	SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	3,115,924.70	
	SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,953,400.40	
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	2,468,547.50	
	SPGB 2.75% 10/31/24	3,600,000.00	3,983,724.00	
	SPGB 2.9% 10/31/46	2,250,000.00	3,085,785.00	
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,940,000.00	3,047,759.40	
	SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,823,458.40	
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,807,346.40	
	SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,996,337.20	
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,425,380.80	
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,407,981.60	
	SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,726,184.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,550,000.00	4,314,268.50	
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,290,000.00	5,896,090.20	
	SPGB 5.15% 10/31/44	2,100,000.00	3,838,128.00	
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,100,000.00	2,294,880.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,220,000.00	5,072,433.80	
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,572,024.00	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,522,783.50	
ユーロ 小計		799,230,000.00	936,692,830.50 (122,538,156,086)	
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	2,820,000.00	2,798,680.80	
	UKT 0.125% 01/31/23	4,510,000.00	4,512,886.40	
	UKT 0.125% 01/31/24	2,970,000.00	2,966,762.70	
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,208,359.00	
	UKT 0.25% 07/31/31	2,110,000.00	2,006,441.20	
	UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,352,409.40	
	UKT 0.5% 07/22/22	3,150,000.00	3,164,175.00	
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	1,082,639.60	
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,727,506.00	
	UKT 0.625% 07/31/35	2,950,000.00	2,805,922.00	
	UKT 0.625% 10/22/50	2,360,000.00	2,040,786.40	
	UKT 0.75% 07/22/23	2,910,000.00	2,950,274.40	
	UKT 0.875% 01/31/46	1,260,000.00	1,176,008.40	
	UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,738,573.00	
	UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,141,772.40	
	UKT 1.25% 07/31/51	180,000.00	183,061.80	
	UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,854,096.00	
	UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,118,980.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	2,550,000.00	2,736,201.00	
	UKT 1.625% 10/22/28	2,200,000.00	2,378,706.00	
	UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	2,098,191.60	

		UKT 1.625% 10/22/71	1,040,000.00	1,290,525.60	
		UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,477,671.00	
		UKT 1.75% 07/22/57	2,530,000.00	2,992,534.60	
		UKT 1.75% 09/07/22	3,120,000.00	3,180,559.20	
		UKT 1.75% 09/07/37	2,930,000.00	3,234,134.00	
		UKT 1% 04/22/24	1,600,000.00	1,638,496.00	
		UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,616,975.00	
		UKT 2.5% 07/22/65	1,920,000.00	2,872,185.60	
		UKT 2.75% 09/07/24	1,620,000.00	1,751,738.40	
		UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,910,580.80	
		UKT 3.25% 01/22/44	2,810,000.00	3,976,150.00	
		UKT 3.5% 01/22/45	2,550,000.00	3,778,717.50	
		UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	3,664,915.60	
		UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,679,072.00	
		UKT 4.25% 03/07/36	2,390,000.00	3,461,915.00	
		UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,862,258.00	
		UKT 4.25% 09/07/39	1,820,000.00	2,776,009.60	
		UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,701,498.90	
		UKT 4.25% 12/07/40	1,900,000.00	2,947,926.00	
		UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	3,654,944.40	
		UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	2,640,476.60	
		UKT 4.25% 12/07/55	2,210,000.00	4,163,816.80	
		UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,561,172.30	
		UKT 4.5% 12/07/42	2,340,000.00	3,839,776.20	
		UKT 4.75% 12/07/30	1,780,000.00	2,443,904.40	
		UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,626,602.00	
		UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	2,937,550.00	
		UKT 5% 03/07/25	1,800,000.00	2,114,712.00	
		UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,747,187.50	
	イギリスポンド 小計		105,880,000.00	128,586,438.10 (19,687,869,537)	
	スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	5,970,000.00	5,930,956.20	
		SGB 0.75% 05/12/28	9,380,000.00	9,858,849.00	
		SGB 0.75% 11/12/29	7,430,000.00	7,817,251.60	
		SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,028,375.00	
		SGB 1% 11/12/26	9,010,000.00	9,553,032.70	
		SGB 2.25% 06/01/32	3,750,000.00	4,546,837.50	
		SGB 2.5% 05/12/25	10,050,000.00	11,113,591.50	
		SGB 3.5% 03/30/39	5,860,000.00	8,764,333.20	
	スウェーデンクローナ 小計		63,950,000.00	70,613,226.70 (907,379,963)	
	ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,000,000.00	2,999,130.00	
		NGB 1.375% 08/19/30	5,040,000.00	5,108,392.80	

	NGB 1.5% 02/19/26	5,740,000.00	5,867,255.80	
	NGB 1.75% 02/17/27	6,060,000.00	6,286,280.40	
	NGB 1.75% 03/13/25	4,770,000.00	4,908,425.40	
	NGB 1.75% 09/06/29	7,640,000.00	7,978,375.60	
	NGB 2% 04/26/28	6,100,000.00	6,444,284.00	
	NGB 2% 05/24/23	11,260,000.00	11,542,288.20	
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	7,780,403.20	
ノルウェークローネ 小計		56,970,000.00	58,914,835.40 (747,629,261)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/22	8,020,000.00	8,109,342.80	
	DGB 0.25% 11/15/52	3,870,000.00	3,688,845.30	
	DGB 0.5% 11/15/27	10,420,000.00	10,967,779.40	
	DGB 0.5% 11/15/29	14,260,000.00	15,083,515.00	
	DGB 0% 11/15/31	3,110,000.00	3,115,660.20	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,420,000.00	7,782,986.40	
	DGB 1.75% 11/15/25	7,280,000.00	7,994,896.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	15,750,000.00	28,050,907.50	
デンマーククローネ 小計		70,130,000.00	84,793,932.60 (1,491,525,274)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,900,000.00	1,793,353.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,542,912.00	
	POLGB 0% 04/25/23	1,230,000.00	1,221,943.50	
	POLGB 1.25% 10/25/30	2,600,000.00	2,505,672.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,116,792.90	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,060,998.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	6,050,000.00	6,363,934.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	6,421,176.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	4,016,968.20	
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,030,000.00	6,537,123.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,520,000.00	7,107,452.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,260,000.00	6,807,311.80	
	POLGB 4% 10/25/23	3,760,000.00	4,066,214.40	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	783,318.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,410,000.00	3,642,152.80	
ポーランドズロチ 小計		61,550,000.00	64,987,322.10 (1,869,451,302)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,930,000.00	2,919,598.50	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,307,544.20	
	ACGB 0.5% 09/21/26	3,040,000.00	3,001,027.20	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,697,310.80	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	3,238,838.90	
	ACGB 1.75% 06/21/51	2,090,000.00	1,894,585.00	
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,610,000.00	1,661,053.10	

	ACGB 1% 11/21/31	3,750,000.00	3,614,812.50	
	ACGB 1% 12/21/30	4,320,000.00	4,203,489.60	
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,560,000.00	2,771,660.80	
	ACGB 2.25% 11/21/22	3,160,000.00	3,255,716.40	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,193,521.30	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,481,609.40	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,828,061.30	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,230,000.00	1,402,778.10	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	2,148,823.40	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,858,370.00	
	ACGB 2.75% 11/21/29	3,150,000.00	3,542,710.50	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,844,182.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	3,200,000.00	3,709,248.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	980,000.00	1,180,733.40	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,064,349.80	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,964,457.60	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,820,000.00	3,297,736.20	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,543,508.80	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,835,388.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,500,000.00	2,741,475.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,350,000.00	3,543,630.00	
オーストラリアドル 小計		70,360,000.00	75,746,219.80 (6,239,216,124)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	390,000.00	385,741.20	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	816,912.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	420,000.00	428,437.80	
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	784,096.60	
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	948,695.50	
	SIGB 2.375% 06/01/25	490,000.00	521,732.40	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	468,983.80	
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,150,747.50	
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,240,000.00	1,460,930.80	
	SIGB 2.75% 04/01/42	900,000.00	1,043,631.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,118,834.80	
	SIGB 2.875% 07/01/29	590,000.00	661,702.70	
	SIGB 2.875% 09/01/30	760,000.00	856,383.20	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	425,612.80	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,350,000.00	1,392,727.50	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	990,322.80	
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	1,000,172.80	
	SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,708,900.20	
シンガポールドル 小計		14,830,000.00	16,164,565.40	

			(1,317,897,017)	
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,527,000.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	724,843.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,330,000.00	2,413,996.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,561,732.60	
	MGS 3.733% 06/15/28	3,430,000.00	3,596,835.20	
	MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,125,250.60	
	MGS 3.757% 05/22/40	550,000.00	531,344.00	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,536,630.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	965,665.50	
	MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,375,826.50	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,082,437.30	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,586,505.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,194,692.50	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,085,481.40	
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,540,296.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	636,384.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	2,380,000.00	2,517,564.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	2,003,664.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	760,000.00	749,329.60	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,349,414.40	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,158,080.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	2,030,000.00	2,146,501.70	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,910,000.00	3,141,490.50	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	3,143,883.60	
	MGS 4.642% 11/07/33	2,830,000.00	3,075,361.00	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,571,449.20	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,487,890.40	
	MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,524,321.80	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,826,596.80	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,560,000.00	1,706,998.80	
マレーシアリンギット 小計		51,820,000.00	54,887,465.90 (1,445,016,826)	
イスラエルシェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	700,000.00	700,964.66	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,440,570.00	
	ILGOV 0.75% 07/31/22	6,490,000.00	6,541,208.69	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	2,113,512.06	
	ILGOV 1.5% 11/30/23	1,750,000.00	1,808,265.37	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,080,000.00	1,147,173.07	
	ILGOV 1% 03/31/30	2,920,000.00	2,917,308.04	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,880,000.00	3,178,746.71	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,477,464.62	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	4,094,095.71	

		ILGOV 5.5% 01/31/42	2,580,000.00	4,157,899.62	
		ILGOV 6.25% 10/30/26	5,620,000.00	7,331,209.07	
	イスラエルシェケル 小計		35,840,000.00	40,908,417.62 (1,375,443,271)	
合計				304,053,521,125 (304,053,521,125)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券　216銘柄	100.0%	45.5%
カナダドル	国債証券　31銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券　13銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券　340銘柄	100.0%	40.3%
イギリスポンド	国債証券　50銘柄	100.0%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券　9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券　15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券　28銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券　18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券　30銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券　12銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	760,211,286
コール・ローン	929,766,625
国債証券	69,702,775,676
未収利息	816,283,886
前払費用	82,543,739
流動資産合計	72,291,581,212
資産合計	72,291,581,212
負債の部	
流動負債	
未払金	272,103,080
未払解約金	22,428,929
未払利息	1,418
流動負債合計	294,533,427
負債合計	294,533,427
純資産の部	
元本等	
元本	40,865,028,836
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	31,132,018,949
元本等合計	71,997,047,785
純資産合計	71,997,047,785
負債純資産合計	72,291,581,212

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益

	2021年 7月12日現在
	約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 7月12日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	40,865,028,836口
2．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　1.7618円 (1万口当たり純資産額)　(17,618円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	35,367,224,488円
期中追加設定元本額	7,992,318,525円
期中一部解約元本額	2,494,514,177円
期末元本額	40,865,028,836円
期末元本額の内訳	
ＳＭＴ　新興国債券インデックス・オープン	4,467,278,189円
世界経済インデックスファンド	8,212,947,094円

区分	2021年 7月12日現在
ＤＣ新興国債券インデックス・オープン	4,943,087,552円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	9,437,298,073円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,808,232,006円
コア投資戦略ファンド（安定型）	146,670,330円
コア投資戦略ファンド（成長型）	399,809,303円
新興国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	80,389,900円
分散投資コア戦略ファンドＡ	224,890,391円
分散投資コア戦略ファンドＳ	482,336,271円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	387,931,776円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,150,771,687円
コア投資戦略ファンド（切替型）	114,516,341円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	186,174,908円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	86,348,368円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	159,936,836円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	3,176,467,356円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	231,593,608円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	255,612,685円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	412,172,168円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,971,163円
グローバル経済コア	638,220,943円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	43,103,997円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	5,024,122円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	6,695,243円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	4,148,784円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	1,858,486円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	1,562,890円
ＦＯＦｓ用　新興国債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	77,033,105円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	245,807,993円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	301,296,923円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０５（適格機関投資家専用）	301,183,796円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	290,856,697円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	289,032,886円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	288,766,966円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△2,489,346,619
合計	△2,489,346,619

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	30,800,000.00	39,257,988.00	
		MBONO 10% 12/05/24	100,250,000.00	111,876,995.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	116,300,000.00	113,199,442.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	103,700,000.00	104,674,780.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	92,600,000.00	94,158,458.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000.00	113,442,551.50	
		MBONO 7.75% 05/29/31	60,400,000.00	64,313,316.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	77,000,000.00	80,083,850.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	32,600,000.00	34,866,678.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	116,900,000.00	129,759,000.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	64,400,000.00	71,821,456.00	
		MBONO 8% 09/05/24	73,900,000.00	77,728,759.00	
		MBONO 8% 11/07/47	64,800,000.00	69,174,648.00	
		MBONO 8% 12/07/23	97,950,000.00	102,420,438.00	
	メキシコペソ 小計		1,140,250,000.00	1,206,778,359.50 (6,687,724,312)	
	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/24	83,800,000.00	69,032,956.73	
		BLTN 0% 07/01/22	22,350,000.00	20,948,107.42	
		BLTN 0% 07/01/23	51,200,000.00	44,069,621.76	
		BLTN 0% 07/01/24	13,500,000.00	10,643,764.50	
		BNTNF 10% 01/01/23	39,550,000.00	40,886,227.04	
		BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000.00	33,313,131.95	
		BNTNF 10% 01/01/27	31,400,000.00	32,979,852.25	
		BNTNF 10% 01/01/29	17,400,000.00	18,307,164.06	
		BNTNF 10% 01/01/31	7,450,000.00	7,766,690.30	

	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,457,750.00	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,935,625.00	
ブラジルレアル 小計		301,750,000.00	281,340,891.01 (5,892,459,889)	
チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	375,000,000.00	326,239,726.12	
	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,535,000,000.00	2,458,469,391.88	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,690,000,000.00	1,742,056,630.60	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,480,000,000.00	1,502,235,480.04	
	BTPCL 4% 03/01/23	840,000,000.00	860,961,912.72	
	BTPCL 5% 03/01/35	1,890,000,000.00	1,900,717,853.58	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,480,000,000.00	1,647,079,835.88	
チリペソ 小計		10,290,000,000.00	10,437,760,830.82 (1,536,177,450)	
コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	72,300,000,000.00	85,541,745,000.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	11,000,000,000.00	11,229,900,000.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	19,300,000,000.00	19,252,329,000.00	
コロンビアペソ 小計		102,600,000,000.00	116,023,974,000.00 (3,334,412,988)	
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	3,950,000.00	3,369,152.50	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	5,600,000.00	5,104,568.00	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,200,000.00	3,535,968.00	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	6,970,000.00	7,387,781.80	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	6,300,000.00	6,388,767.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	7,700,000.00	8,371,748.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	6,950,000.00	7,094,560.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	6,450,000.00	7,071,264.00	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	5,650,000.00	6,839,720.50	
ペルーヌエボソル 小計		52,770,000.00	55,163,529.80 (1,531,146,514)	
ウルグアイペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	25,510,000.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	12,500,000.00	12,983,375.00	
ウルグアイペソ 小計		37,500,000.00	38,493,375.00 (96,706,906)	
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	21,452,640.00	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	25,000,000.00	28,375,750.00	
ドミニカペソ 小計		45,400,000.00	49,828,390.00 (96,567,419)	
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,950,000.00	3,362,951.00	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,650,000.00	6,450,997.00	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,950,000.00	7,783,188.50	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	6,850,000.00	6,363,650.00	
	TURKGB 11.7% 11/13/30	12,400,000.00	9,408,500.00	
	TURKGB 11% 02/24/27	7,400,000.00	5,701,626.00	

	TURKGB 11% 03/02/22	7,350,000.00	7,044,019.50	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	9,194,823.00	
	TURKGB 12.4% 03/08/28	4,700,000.00	3,832,615.00	
	TURKGB 12.6% 10/01/25	14,400,000.00	12,273,120.00	
	TURKGB 16.2% 06/14/23	7,100,000.00	6,919,731.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	5,276,262.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	5,100,000.00	4,607,136.00	
	TURKGB 8% 03/12/25	8,300,000.00	6,207,155.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	10,750,000.00	8,670,412.50	
トルコリラ 小計		123,000,000.00	103,096,186.50 (1,312,661,884)	
チェココルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	31,100,000.00	27,123,865.00	
	CZGB 0.25% 02/10/27	53,700,000.00	49,770,771.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	47,000,000.00	46,118,750.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	46,900,000.00	43,857,597.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	46,000,000.00	43,754,280.00	
	CZGB 1% 06/26/26	59,200,000.00	57,464,848.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	42,900,000.00	44,295,537.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	51,000,000.00	53,703,510.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	50,300,000.00	54,192,717.00	
	CZGB 2% 10/13/33	52,200,000.00	53,272,188.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	28,000,000.00	36,608,600.00	
	CZGB 4.7% 09/12/22	35,800,000.00	37,619,714.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	37,700,000.00	42,366,506.00	
チェココルナ 小計		581,800,000.00	590,148,883.00 (2,997,956,325)	
ハンガリーフォリント	HGB 1.5% 04/22/26	458,500,000.00	447,454,735.00	
	HGB 1.5% 08/23/23	322,500,000.00	324,473,700.00	
	HGB 1.5% 08/26/26	274,000,000.00	266,495,140.00	
	HGB 1.75% 10/26/22	275,000,000.00	278,668,500.00	
	HGB 1% 11/26/25	475,000,000.00	455,995,250.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	382,000,000.00	361,127,520.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	560,806,760.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	470,500,000.00	485,518,360.00	
	HGB 2% 05/23/29	173,000,000.00	168,680,190.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	587,000,000.00	623,775,550.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	417,823,175.00	
	HGB 3% 08/21/30	555,000,000.00	580,824,150.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	617,384,960.00	
	HGB 3% 10/27/38	340,000,000.00	333,567,200.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	749,456,400.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	471,000,000.00	520,831,800.00	

	HGB 6.75% 10/22/28	262,000,000.00	338,430,640.00	
	HGB 7% 06/24/22	280,000,000.00	296,494,800.00	
ハンガリーフォリント 小計		7,528,000,000.00	7,827,808,830.00 (2,879,099,398)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	10,500,000.00	9,910,635.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	12,850,000.00	12,788,320.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	14,100,000.00	13,588,452.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	12,000,000.00	12,217,440.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	13,800,000.00	14,455,914.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000.00	20,582,570.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	14,250,000.00	14,989,432.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000.00	25,536,360.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	14,400,000.00	15,302,736.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	14,200,000.00	15,394,220.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	21,550,000.00	23,491,655.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000.00	14,408,447.50	
	POLGB 4% 10/25/23	10,850,000.00	11,733,624.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	10,850,000.00	11,588,668.00	
ポーランドズロチ 小計		206,600,000.00	215,988,474.00 (6,213,210,838)	
ロシアルーブル	RFLB 4.5% 07/16/25	195,500,000.00	179,420,125.00	
	RFLB 5.7% 05/17/28	219,000,000.00	204,088,290.00	
	RFLB 6.1% 07/18/35	192,000,000.00	175,067,520.00	
	RFLB 6.5% 02/28/24	149,000,000.00	147,784,160.00	
	RFLB 6.9% 05/23/29	158,000,000.00	157,492,820.00	
	RFLB 6% 10/06/27	217,500,000.00	207,442,800.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	146,000,000.00	146,671,600.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	165,100,000.00	166,318,438.00	
	RFLB 7.15% 11/12/25	210,400,000.00	212,529,248.00	
	RFLB 7.25% 05/10/34	160,500,000.00	162,478,965.00	
	RFLB 7.4% 07/17/24	202,200,000.00	205,220,868.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	165,100,000.00	167,254,555.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	117,700,000.00	119,157,126.00	
	RFLB 7.65% 04/10/30	221,500,000.00	230,519,480.00	
	RFLB 7.7% 03/16/39	133,500,000.00	140,700,990.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	158,000,000.00	165,201,640.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	141,500,000.00	146,521,835.00	
	RFLB 7.95% 10/07/26	181,000,000.00	189,009,250.00	
	RFLB 7% 01/25/23	71,200,000.00	71,642,152.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	107,791,744.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	156,000,000.00	164,667,360.00	
	RFLB 8.5% 09/17/31	116,650,000.00	128,576,296.00	
		3,584,550,000.00	3,595,557,262.00	

ロシアルーブル 小計			(5,321,424,747)	
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	7,700,000.00	7,379,449.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,332,773.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	22,850,000.00	23,673,742.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	9,450,000.00	9,773,757.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	6,950,000.00	7,288,048.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	5,006,849.00	
	MGS 3.757% 05/22/40	7,550,000.00	7,293,904.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	7,100,000.00	7,372,285.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,242,312.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	27,250,000.00	28,821,507.50	
	MGS 3.899% 11/16/27	14,800,000.00	15,667,576.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,610,682.50	
	MGS 3.906% 07/15/26	8,700,000.00	9,227,568.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000.00	27,502,800.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	8,500,000.00	8,963,760.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	5,900,000.00	5,817,164.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	7,600,000.00	8,012,148.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	9,600,000.00	10,150,944.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	5,850,000.00	6,383,403.00	
マレーシアリンギット 小計		202,050,000.00	210,520,673.00 (5,542,356,706)	
タイバーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	90,500,000.00	91,043,905.00	
	THAIGB 0.95% 06/17/25	116,700,000.00	118,029,213.00	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	99,000,000.00	101,858,130.00	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	56,800,000.00	53,205,696.00	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	44,100,000.00	41,598,648.00	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	85,100,000.00	85,810,585.00	
	THAIGB 1.875% 06/17/22	59,300,000.00	60,083,353.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	106,100,000.00	113,130,186.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	91,000,000.00	95,117,750.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	83,200,000.00	92,523,392.00	
	THAIGB 2% 06/17/42	61,600,000.00	57,377,936.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	53,500,000.00	54,662,555.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	178,700,000.00	203,081,828.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	119,200,000.00	136,927,424.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	89,024,040.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	97,300,000.00	114,698,213.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	89,400,000.00	106,984,086.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	97,400,000.00	110,605,492.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	105,500,000.00	132,089,165.00	
タイバーツ 小計		1,718,400,000.00	1,857,851,597.00 (6,260,959,881)	

フィリピンペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	15,123,450.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	23,891,200.00	
フィリピンペソ 小計		35,000,000.00	39,014,650.00 (85,843,934)	
インドネシアルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	9,307,938,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	19,530,234,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	33,500,000,000.00	33,684,250,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	52,500,000,000.00	53,779,950,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	45,000,000,000.00	45,113,850,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	17,593,698,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	39,000,000,000.00	38,931,360,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	62,100,000,000.00	65,284,488,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	24,000,000,000.00	23,973,600,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	35,058,080,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	21,000,000,000.00	21,639,240,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	27,200,000,000.00	28,159,888,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	21,900,000,000.00	23,072,307,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	35,900,000,000.00	37,004,284,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	36,800,000,000.00	39,164,400,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	54,000,000,000.00	56,041,740,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	35,600,000,000.00	38,898,340,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	31,700,000,000.00	35,396,220,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	31,800,000,000.00	35,086,212,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	18,400,000,000.00	20,491,896,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	46,600,000,000.00	51,009,292,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000.00	57,560,360,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	23,534,120,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	29,100,000,000.00	32,802,393,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	34,700,000,000.00	40,165,597,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,714,770,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	19,700,000,000.00	22,883,717,000.00	
インドネシアルピア 小計		860,400,000,000.00	918,882,224,000.00 (6,983,504,902)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	121,100,000.00	137,530,848.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	43,600,000.00	30,973,004.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	34,100,000.00	22,883,146.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	44,900,000.00	46,671,305.00	
	SAGB 7% 02/28/31	40,200,000.00	34,545,468.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	67,700,000.00	61,889,309.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	68,700,000.00	59,071,695.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000.00	57,701,974.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	97,100,000.00	82,094,166.00	

		SAGB 8.875% 02/28/35	61,700,000.00	56,102,576.00	
		SAGB 8% 01/31/30	95,200,000.00	90,438,096.00	
		SAGB 9% 01/31/40	48,450,000.00	42,626,310.00	
	南アフリカランド 小計		790,950,000.00	722,527,897.00 (5,577,915,364)	
	香港・オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	20,000,000.00	19,406,000.00	
		CGB 2.36% 07/02/23	18,000,000.00	17,917,740.00	
		CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	26,470,080.00	
		CGB 2.84% 04/08/24	4,700,000.00	4,721,009.00	
		CGB 2.85% 06/04/27	30,500,000.00	30,330,420.00	
		CGB 2.88% 11/05/23	16,900,000.00	16,989,570.00	
		CGB 2.94% 10/17/24	34,000,000.00	34,216,580.00	
		CGB 3.01% 05/13/28	5,000,000.00	5,008,150.00	
		CGB 3.02% 05/27/31	5,000,000.00	5,015,700.00	
		CGB 3.02% 10/22/25	28,000,000.00	28,202,440.00	
		CGB 3.03% 03/11/26	8,000,000.00	8,068,320.00	
		CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,207,200.00	
		CGB 3.13% 11/21/29	20,700,000.00	20,798,532.00	
		CGB 3.19% 04/11/24	29,400,000.00	29,816,598.00	
		CGB 3.22% 12/06/25	12,000,000.00	12,211,200.00	
		CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,400,400.00	
		CGB 3.25% 11/22/28	14,900,000.00	15,167,455.00	
		CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,460,680.00	
		CGB 3.28% 12/03/27	20,000,000.00	20,409,200.00	
		CGB 3.29% 05/23/29	26,000,000.00	26,509,340.00	
		CGB 3.29% 10/18/23	16,000,000.00	16,254,080.00	
		CGB 3.72% 04/12/51	5,100,000.00	5,249,634.00	
		CGB 3.81% 09/14/50	23,700,000.00	24,675,729.00	
	香港・オフショア人民元 小計		429,200,000.00	432,506,057.00 (7,352,646,219)	
合計				69,702,775,676 (69,702,775,676)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券　　14銘柄	100.0%	9.6%
ブラジルレアル	国債証券　　11銘柄	100.0%	8.5%

チリペソ	国債証券　7銘柄	100.0%	2.2%
コロンビアペソ	国債証券　3銘柄	100.0%	4.8%
ペルーヌエボソル	国債証券　9銘柄	100.0%	2.2%
ウルグアイペソ	国債証券　2銘柄	100.0%	0.1%
ドミニカペソ	国債証券　2銘柄	100.0%	0.1%
トルコリラ	国債証券　15銘柄	100.0%	1.9%
チェココルナ	国債証券　13銘柄	100.0%	4.3%
ハンガリーフォリント	国債証券　18銘柄	100.0%	4.1%
ポーランドズロチ	国債証券　14銘柄	100.0%	8.9%
ロシアルーブル	国債証券　22銘柄	100.0%	7.6%
マレーシアリンギット	国債証券　19銘柄	100.0%	8.0%
タイバーツ	国債証券　19銘柄	100.0%	9.0%
フィリピンペソ	国債証券　2銘柄	100.0%	0.1%
インドネシアルピア	国債証券　27銘柄	100.0%	10.0%
南アフリカランド	国債証券　12銘柄	100.0%	8.0%
香港・オフショア人民元	国債証券　23銘柄	100.0%	10.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,283,917,299
投資証券	108,677,185,200
派生商品評価勘定	164,872,800
未収入金	388,319,977
未収配当金	698,732,434
差入委託証拠金	221,238,000
流動資産合計	113,434,265,710
資産合計	113,434,265,710
負債の部	
流動負債	
前受金	164,872,800
未払解約金	233,269,396
未払利息	5,011

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	398,147,207
負債合計	398,147,207
純資産の部	
元本等	
元本	49,323,843,791
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	63,712,274,712
元本等合計	113,036,118,503
純資産合計	113,036,118,503
負債純資産合計	113,434,265,710

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 7月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		49,323,843,791口
2.	1口当たり純資産額	2.2917円

	2021年 7月12日現在
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額) (22,917円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	2021年 7月12日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	67,089,596,986円
期中追加設定元本額	5,714,855,447円
期中一部解約元本額	23,480,608,642円
期末元本額	49,323,843,791円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,642,287,080円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,366,440円
ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・オープン	15,942,983,060円
Ｊリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	23,336,027,727円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,308,419,559円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,930,352,237円
分散投資コア戦略ファンドＡ	410,633,592円

区分	2021年 7月12日現在
分散投資コア戦略ファンドＳ	823,636,982円
コア投資戦略ファンド（切替型）	810,853,753円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	27,209,188円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	271,547,410円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,362,280円
グローバル経済コア	260,522,228円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	9,761,833円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	409,005,482円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	44,199,142円
ＦＯＦｓ用　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	496,637,523円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	10,004,860円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－０５（適格機関投資家専用）	893,261,362円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－１１（適格機関投資家専用）	378,268,198円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１９－０３（適格機関投資家専用）	307,503,855円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	22,791,488,383
合計	22,791,488,383

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

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2021年 7月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	3,807,313,200	－	3,972,186,000	164,872,800
合計		3,807,313,200	－	3,972,186,000	164,872,800

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	1,504	224,848,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	2,252	301,092,400	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	2,420	409,948,000	
	東海道リート投資法人	248	28,569,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,172	2,201,368,000	
	森ヒルズリート投資法人	10,812	1,816,416,000	
	産業ファンド投資法人	13,010	2,807,558,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	8,743	3,383,541,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,273	1,510,538,400	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	4,612	2,370,568,000	
	ＧＬＰ投資法人	29,705	5,688,507,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,138	1,564,164,000	
	日本プロロジスリート投資法人	14,551	5,187,431,500	
	星野リゾート・リート投資法人	1,400	989,800,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	1,435	491,487,500	
	イオンリート投資法人	9,336	1,558,178,400	
	ヒューリックリート投資法人	7,630	1,435,966,000	
	日本リート投資法人	2,990	1,320,085,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	58,490	1,326,553,200	
	積水ハウス・リート投資法人	27,072	2,612,448,000	
	トーセイ・リート投資法人	2,036	292,573,200	
	ケネディクス商業リート投資法人	3,661	1,097,567,800	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	1,963	306,816,900	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	1,772	230,005,600	
	野村不動産マスターファンド投資法人	29,764	5,271,204,400	
	いちごホテルリート投資法人	1,609	156,073,000	
	ラサールロジポート投資法人	11,134	2,174,470,200	
	スターアジア不動産投資法人	9,457	608,085,100	
	マリモ地方創生リート投資法人	862	115,077,000	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,212	1,917,564,000	
	大江戸温泉リート投資法人	1,486	127,944,600	

	投資法人みらい	9,940	553,658,000	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	1,993	280,614,400	
	三菱地所物流リート投資法人	2,315	1,113,515,000	
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	2,945	587,822,000	
	ザイマックス・リート投資法人	1,410	177,660,000	
	タカラレーベン不動産投資法人	2,766	362,899,200	
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,570	586,551,000	
	日本ビルファンド投資法人	10,359	7,292,736,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	9,204	6,461,208,000	
	日本都市ファンド投資法人	45,846	5,432,751,000	
	オリックス不動産投資法人	18,339	3,900,705,300	
	日本プライムリアルティ投資法人	5,730	2,481,090,000	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	8,313	1,371,645,000	
	東急リアル・エステート投資法人	6,171	1,261,969,500	
	グローバル・ワン不動産投資法人	6,391	811,017,900	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	19,684	3,330,532,800	
	森トラスト総合リート投資法人	6,578	1,055,769,000	
	インヴィンシブル投資法人	38,486	1,758,810,200	
	フロンティア不動産投資法人	3,227	1,658,678,000	
	平和不動産リート投資法人	5,947	1,066,297,100	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,014	2,029,725,000	
	福岡リート投資法人	4,760	888,216,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	2,847	2,263,365,000	
	いちごオフィスリート投資法人	7,542	751,937,400	
	大和証券オフィス投資法人	1,946	1,547,070,000	
	阪急阪神リート投資法人	4,157	715,419,700	
	スターツプロシード投資法人	1,433	360,542,800	
	大和ハウスリート投資法人	13,132	4,215,372,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	29,652	2,010,405,600	
	大和証券リビング投資法人	12,019	1,490,356,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	8,541	1,332,396,000	
合計		578,006	108,677,185,200	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	283,310,998
コール・ローン	34,345,067
投資証券	93,684,589,683
未収入金	1,097,099
未収配当金	306,860,242
流動資産合計	94,310,203,089
資産合計	94,310,203,089
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	59,501
未払株式払込金	3,471,644
未払解約金	50,482,858
未払利息	52
流動負債合計	54,014,055
負債合計	54,014,055
純資産の部	
元本等	
元本	41,364,083,335
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	52,892,105,699
元本等合計	94,256,189,034
純資産合計	94,256,189,034
負債純資産合計	94,310,203,089

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
２.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。

	2021年 7月12日現在
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 7月12日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	41,364,083,335口
2．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　2.2787円 (1万口当たり純資産額)　(22,787円)

（金融商品に関する注記）
1．金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2021年 7月12日現在
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	56,703,060,151円
期中追加設定元本額	5,933,734,007円
期中一部解約元本額	21,272,710,823円
期末元本額	41,364,083,335円
期末元本額の内訳	
グローバル３資産バランスオープン	71,453,859円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	111,784,396円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,674,023,062円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,558,605円
ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス・オープン	11,895,193,707円
グローバルリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	19,452,704,405円
コア投資戦略ファンド（安定型）	878,873,279円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,924,492,863円
分散投資コア戦略ファンドＡ	345,347,104円
分散投資コア戦略ファンドＳ	767,067,340円
コア投資戦略ファンド（切替型）	781,748,503円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	151,113,822円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	268,792,026円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,782,584円
グローバル経済コア	263,391,588円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	10,128,689円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	408,099,388円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	44,971,190円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,152,266,960円
ＦＯＦｓ用　グローバルＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	428,372,456円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	93,284,369円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	4,065,754円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	126,865,565円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０５（適格機関投資家専用）	129,296,887円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	124,909,598円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	124,042,433円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	120,452,903円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	18,775,970,474
合計	18,775,970,474

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2021年 7月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	25,279,300	－	25,338,801	△59,501
	アメリカドル	25,279,300	－	25,338,801	△59,501
合計		25,279,300	－	25,338,801	△59,501

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	46,940	1,025,639.00	
		AGREE REALTY CORP	38,105	2,759,945.15	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	41,570	765,719.40	

		ALEXANDER'S INC	1,190	321,311.90	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	75,750	14,434,162.50	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	27,157	1,026,263.03	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	74,992	3,694,105.92	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	59,590	495,788.80	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	152,482	6,288,357.68	
		AMERICOLD REALTY TRUST	138,199	5,409,108.86	
		APARTMENT INCOME REIT CO	86,759	4,333,612.05	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	76,106	547,202.14	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	115,391	1,735,480.64	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	30,500	412,360.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	77,519	17,118,520.77	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	156,964.50	
		BOSTON PROPERTIES	79,055	9,262,874.35	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	1,305,999.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	162,046	3,757,846.74	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	86,966	2,126,318.70	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	24,100	457,418.00	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	88,550.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	53,609	7,568,518.62	
		CARETRUST REIT INC	52,477	1,245,803.98	
		CENTERSPACE	7,499	616,267.82	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,360	315,732.00	
		CIM COMMERCIAL TRUST CORP	13,000	112,450.00	
		CITY OFFICE REIT INC	25,050	306,612.00	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	57,743.00	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	60,331	1,035,883.27	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	11,605	574,215.40	
		COREPOINT LODGING INC	22,000	247,280.00	
		CORESITE REALTY CORP	23,959	3,314,248.47	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	63,159	1,852,453.47	
		COUSINS PROPERTIES INC	83,426	3,176,862.08	
		CTO REALTY GROWTH INC	2,800	154,140.00	
		CUBESMART	112,530	5,458,830.30	
		CYRUSONE INC	67,819	5,059,975.59	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	1,073,856.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	156,215	24,332,048.40	
		DIGITALBRIDGE GROUP INC	263,096	2,023,208.24	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	132,800	547,136.00	
		DOUGLAS EMMETT INC-W/I	92,547	3,163,256.46	
		DUKE REALTY CORP	208,631	10,400,255.35	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	40,415.00	

		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	47,668	1,027,245.40	
		EASTGROUP PROPERTIES,INC	22,329	3,819,598.74	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	993,695.50	
		EPR PROPERTIES	41,912	2,206,247.68	
		EQUINIX INC	49,526	40,627,168.32	
		EQUITY COMMONWEALTH	67,845	1,818,246.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	94,289	7,405,458.06	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	189,646	15,495,974.66	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	63,742	1,783,501.16	
		ESSEX PROPERTY TRUST	36,145	11,575,074.80	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	73,703	12,764,622.57	
		FARMLAND PARTNERS INC	12,200	152,012.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	39,320	4,641,726.00	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	70,298	3,796,092.00	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	40,250	1,159,602.50	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	57,973	306,677.17	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	121,511	5,692,790.35	
		GEO GROUP INC/THE	64,306	459,144.84	
		GETTY REALTY CORP	21,985	712,094.15	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	454,987.00	
		GLADSTONE LAND CORP	15,500	362,390.00	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	27,530	419,006.60	
		GLOBAL NET LEASE INC	51,412	955,749.08	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	78,310	2,401,767.70	
		HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	119,276	3,251,463.76	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	299,842	10,422,507.92	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	21,650	223,861.00	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	58,422	2,696,759.52	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	393,361	6,730,406.71	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	84,730	2,365,661.60	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	59,131	1,121,715.07	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	37,941	1,009,230.60	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	13,388	2,730,884.24	
		INVITATION HOMES INC	314,773	12,559,442.70	
		IRON MOUNTAIN INC	158,471	6,931,521.54	
		JBG SMITH PROPERTIES	62,238	1,981,657.92	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	350,000	281,750.00	
		KILROY REALTY CORPORATION	57,829	4,091,401.75	
		KIMCO REALTY CORP	239,966	5,089,678.86	
		KITE REALTY GROUP TRUST	46,370	996,955.00	
		LEXINGTON CORP PROPERTIES	152,908	1,874,652.08	

		LIFE STORAGE INC	42,485	4,843,290.00	
		LTC PROPERTIES INC	20,326	792,104.22	
		MACERICH CO/THE	92,542	1,654,650.96	
		MACK-CALI REALTY CORP	50,236	880,637.08	
		MANULIFE US REAL ESTATE INV	736,564	589,251.20	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	328,046	6,724,943.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	63,511	11,476,437.70	
		MONMOUTH REIT -CL A	54,952	1,028,701.44	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	95,939	4,573,412.13	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	38,720	2,040,544.00	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	25,030	1,687,022.00	
		NETSTREIT CORP	14,992	366,854.24	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	45,000	406,800.00	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	707,164.12	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	806,791.70	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	130,489	4,852,885.91	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	250,660.85	
		PARAMOUNT GROUP INC	89,726	908,027.12	
		PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	133,133	2,616,063.45	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,613	1,647,099.00	
		PENN REAL ESTATE INVEST TST	35,000	78,750.00	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	118,562	2,209,995.68	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	1,273,575.00	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,900	330,243.00	
		PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	29,639	302,614.19	
		PRIME US REIT	295,000	250,750.00	
		PROLOGIS INC	409,939	51,402,251.21	
		PS BUSINESS PARKS INC	11,172	1,713,449.64	
		PUBLIC STORAGE	84,437	26,317,324.16	
		QTS REALTY TRUST INC	38,049	2,953,363.38	
		REALTY INCOME CORP	207,543	14,293,486.41	
		REGENCY CENTERS CORP	87,710	5,702,027.10	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	62,989	1,116,794.97	
		RETAIL PROPERTISE OF AME-A	115,918	1,343,489.62	
		RETAIL VALUE	9,529	205,921.69	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	73,995	4,347,946.20	
		RLJ LODGING TRUST	92,291	1,328,067.49	
		RPT REALTY	43,950	570,031.50	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,696	2,390,911.44	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	118,636	2,199,511.44	
		SAFEHOLD INC	8,340	700,643.40	

		SAUL CENTERS INC	6,800	310,216.00	
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	19,900	344,668.00	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	94,169	1,176,170.81	
		SIMON PROPERTY GROUP	182,255	23,636,650.95	
		SITE CENTERS CORP	91,820	1,390,154.80	
		SL GREEN REALTY CORP	38,945	3,068,476.55	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	63,982	3,116,563.22	
		STAG INDUSTRIAL INC	89,179	3,481,548.16	
		STORE CAPITAL CORP	135,047	4,846,836.83	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	63,470	581,385.20	
		SUN COMMUNITIES INC	62,196	11,249,390.52	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	116,130	1,401,689.10	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	57,370	1,087,161.50	
		TERRENO REALTY CORP	38,649	2,582,139.69	
		UDR INC	163,050	8,472,078.00	
		UMH PROPERTIES INC	21,320	469,679.60	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	431,558.97	
		URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	1,133,559.00	
		URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	287,906.50	
		VENTAS INC	208,066	12,200,990.24	
		VEREIT INC	127,247	6,062,047.08	
		VICI PROPERTIES INC	295,341	9,285,521.04	
		VORNADO REALTY TRUST	85,675	3,985,601.00	
		WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	45,570	1,112,819.40	
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	66,885	2,177,106.75	
		WELLTOWER INC	231,721	20,027,646.03	
		WHITESTONE REIT	19,090	154,819.90	
		WP CAREY INC	98,450	7,676,146.50	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,030	1,162,903.50	
	アメリカドル 小計		13,867,875	638,389,085.61 (70,331,325,561)	
	カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	33,942	1,566,423.30	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	40,330	471,861.00	
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	152,640.00	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	14,060	626,935.40	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	46,320	2,838,952.80	
		CHOICE PROPERTIES REIT	86,170	1,282,209.60	
		COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	55,620	633,511.80	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	489,548.34	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	472,796.50	
			51,250	825,125.00	

		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR			
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	322,420.60	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	1,047,741.10	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,805	1,539,242.25	
		H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	81,039	1,377,663.00	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	40,490	724,771.00	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	628,939.50	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	273,171.00	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	229,313.10	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	48,470	632,048.80	
		PLAZA RETAIL REIT	25,000	115,000.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	83,631	1,923,513.00	
		SLATE GROCERY REIT	10,300	136,475.00	
		SLATE OFFICE REI	17,000	91,800.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	37,476	1,140,769.44	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	867,150.00	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	192,726.00	
		WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	23,500	539,795.00	
	カナダドル 小計		976,675	21,142,542.53 (1,869,846,461)	
	ユーロ	AEDIFICA	19,825	2,337,367.50	
		ALSTRIA OFFICE REIT -AG	98,200	1,639,940.00	
		ALTAREA	2,230	422,362.00	
		BEFIMMO S.C.A.	14,010	505,060.50	
		CARE PROPERTY INVEST	15,000	416,250.00	
		CARMILA	25,000	296,500.00	
		COFINIMMO	16,333	2,172,289.00	
		COVIVIO(FP)	26,742	2,072,505.00	
		CROMWELL REIT EUR	160,000	403,200.00	
		EUROCOMMERCIAL	20,783	456,394.68	
		GECINA SA	30,422	4,041,562.70	
		HAMBORNER REIT AG	37,000	341,547.00	
		HIBERNIA REIT PLC	365,550	470,828.40	
		ICADE	17,080	1,295,518.00	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	141,411.15	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	141,062	1,275,200.48	
		INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	298,870.00	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	260,000	416,000.00	

		KLEPIERRE	111,130	2,462,640.80	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	179,860.00	
		MERCIALYS	19,000	202,160.00	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	180,986	1,675,930.36	
		MONTEA NV	5,300	562,860.00	
		NSI NV	10,050	361,297.50	
		RETAIL ESTATES	6,400	472,320.00	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	77,158	5,820,027.94	
		VASTNED RETAIL	10,650	278,497.50	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	75,470	2,588,621.00	
		WERELDHAVE NV	22,670	340,276.70	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	10,440	559,584.00	
	ユーロ 小計		1,858,381	34,506,882.21 (4,514,190,330)	
	イギリスポンド	AEW UK REIT PLC	118,000	117,292.00	
		ASSURA PLC	1,467,040	1,123,019.12	
		BIG YELLOW GROUP PLC	89,146	1,240,912.32	
		BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	435,000	408,900.00	
		BRITISH LAND CO PLC	524,845	2,704,001.44	
		CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	470,297	810,321.73	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	384,197.98	
		CUSTODIAN REIT PLC	234,276	233,104.62	
		DERWENT LONDON PLC	61,915	2,157,118.60	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	277,542.00	
		GCP STUDENT LIVING PLC	264,000	512,160.00	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	144,780	1,088,745.60	
		HAMMERSON PLC	2,291,000	884,326.00	
		HOME REIT PLC	132,934	150,880.09	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	177,355	204,312.96	
		INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	419,205	2,887,484.04	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	497,660	1,222,252.96	
		LXI REIT PLC	344,008	491,931.44	
		NEWRIVER REIT PL	186,000	161,820.00	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	330,000	309,540.00	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	728,888	1,153,829.70	
		REGIONAL REIT LTD	222,000	200,910.00	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	116,037	1,185,898.14	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	172,550.00	
		SEGRO PLC	660,723	7,694,119.33	
		SHAFTESBURY PLC	168,693	1,026,496.90	
		STANDARD LIFE INV PROP INC	260,756	190,351.88	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	466,000	552,210.00	

	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	213,043.72	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	947,658	1,959,756.74	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	392,000	315,560.00	
	UNITE GROUP PLC	221,192	2,533,754.36	
	WORKSPACE GROUP PLC	70,347	601,466.85	
イギリスポンド 小計		14,153,068	35,179,080.52 (5,386,269,018)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	232,716	744,691.20	
	APN INDUSTRIA REIT	75,000	250,500.00	
	ARENA REIT	201,053	743,896.10	
	AVENTUS GROUP	193,500	607,590.00	
	BWP TRUST	254,160	1,082,721.60	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	321,000	959,790.00	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	266,606	989,108.26	
	CENTURIA OFFICE REIT	220,945	536,896.35	
	CHARTER HALL GROUP	258,140	3,926,309.40	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	294,312	1,436,242.56	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	296,160	1,092,830.40	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	687,340.50	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	1,102,633	992,369.70	
	DEXUS	590,307	6,097,871.31	
	GDI PROPERTY GROUP	324,500	356,950.00	
	GOODMAN GROUP	926,628	19,774,241.52	
	GPT GROUP	1,055,317	5,107,734.28	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	662,037.20	
	HOME CONSORTIUM	91,000	487,760.00	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	268,642	400,276.58	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	82,885	268,547.40	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	156,788	940,728.00	
	IRONGATE GROUP	272,000	402,560.00	
	MIRVAC GROUP	2,193,770	6,427,746.10	
	NATIONAL STORAGE REIT	601,340	1,250,787.20	
	RURAL FUNDS GROUP	212,766	529,787.34	
	SCENTRE GROUP	2,887,179	7,824,255.09	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	585,060	1,398,293.40	
	STOCKLAND	1,308,941	5,929,502.73	
	VICINITY CENTERS	2,158,040	3,355,752.20	
	WAYPOINT REIT LTD	455,796	1,189,627.56	
オーストラリアドル 小計		18,243,294	76,454,743.98 (6,297,577,261)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	502,278	848,849.82	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	600,300	1,464,732.00	

	KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	1,017,310.65	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	682,894	1,160,919.80	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	223,349	738,168.44	
ニュージーランドドル 小計		2,867,311	5,229,980.71 (402,656,214)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,138,000	4,973,060.00	
	FORTUNE REIT	756,000	6,357,960.00	
	LINK REIT	1,146,400	85,005,560.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	2,256,000.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	2,642,310.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	818,000	3,247,460.00	
香港ドル 小計		5,171,400	104,482,350.00 (1,481,559,723)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	431,750.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	744,977	655,579.76	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,819,618	5,477,050.18	
	ASCOTT TRUST	991,877	1,051,389.62	
	CAPITALAND CHINA TRUST	507,721	695,577.77	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,477,444	5,301,730.16	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	525,672.00	
	EC WORLD REIT	180,000	146,700.00	
	ESR REIT	1,404,065	631,829.25	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	318,600.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	142,596.50	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	734,262	1,820,969.76	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	241,500.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	1,581,096	2,355,833.04	
	IREIT GLOBAL	405,985	259,830.40	
	KEPPEL DC REIT	688,603	1,776,595.74	
	KEPPEL REIT	1,051,400	1,251,166.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	555,000	485,625.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	2,480,400	158,745.60	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,210,473	2,650,935.87	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,073,963	3,071,534.18	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,618,200	3,398,220.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,212,100	1,248,463.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	554,035.14	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	203,000	956,130.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	205,772.20	

		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	286,926.00	
		SPH REIT	576,800	533,540.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	859,400	507,046.00	
		SUNTEC REIT	1,180,700	1,794,664.00	
	シンガポールドル 小計		27,835,368	38,936,007.17 (3,174,452,664)	
	韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	54,685	418,340,250.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	63,691,980.00	
		JR REIT XXVII	64,338	340,348,020.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	20,000	123,800,000.00	
		LOTTE REIT CO LTD	72,480	433,430,400.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	199,932,250.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,093	149,880,050.00	
	韓国ウォン 小計		284,799	1,729,422,950.00 (166,370,487)	
	イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	103,500	1,794,690.00	
	イスラエルシェケル 小計		103,500	1,794,690.00 (60,341,964)	
合計			85,361,671	93,684,589,683 (93,684,589,683)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券　156銘柄	100.0%	75.1%
カナダドル	投資証券　27銘柄	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券　30銘柄	100.0%	4.8%
イギリスポンド	投資証券　34銘柄	100.0%	5.7%
オーストラリアドル	投資証券　31銘柄	100.0%	6.7%
ニュージーランドドル	投資証券　5銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券　6銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	投資証券　30銘柄	100.0%	3.4%
韓国ウォン	投資証券　7銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券　1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	265,631,875
コール・ローン	303,118,513
社債券	19,445,506,273
流動資産合計	20,014,256,661
資産合計	20,014,256,661
負債の部	
流動負債	
未払解約金	319,000
未払利息	462
流動負債合計	319,462
負債合計	319,462
純資産の部	
元本等	
元本	52,438,950,106
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△32,425,012,907
元本等合計	20,013,937,199
純資産合計	20,013,937,199
負債純資産合計	20,014,256,661

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。 為替予約取引

	2021年 7月12日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 7月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		52,438,950,106口
2. 「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55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	32,425,012,907円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	0.3817円
	(1万口当たり純資産額)	(3,817円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2021年 7月12日現在
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	80,389,097,985円
期中追加設定元本額	4,875,413,197円
期中一部解約元本額	32,825,561,076円
期末元本額	52,438,950,106円
期末元本額の内訳	
コモディティ・オープン（ＳＭＡ専用）	38,256,168,956円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,678,129,478円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,864,539,915円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,531,251,194円
ＳＭＴＡＭコモディティ・オープン	1,942,100,760円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	663,375,528円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	75,100,783円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	2,411,114,317円
ＦＯＦｓ用　グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	1,017,169,175円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	450,372,757
合計	450,372,757

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	BAR USD COM 038 08/31/21	7,000,000.00	9,187,850.00	
		CS USD COM 017 07/30/21	7,000,000.00	9,474,500.00	
		ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000.00	3,860,000.00	
		IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000.00	4,036,500.00	
		SG ISSUER 021 11/30/21	11,000,000.00	13,852,300.00	
		SG ISSUER 022 01/31/22	15,000,000.00	17,305,500.00	
		SG ISSUER 023 03/31/22	21,000,000.00	23,438,100.00	
		SG ISSUER 024 05/31/22	19,000,000.00	19,115,900.00	
		STAR HELIOS 008 10/22/21	59,000,000.00	76,233,900.00	
	アメリカドル 小計		194,000,000.00	176,504,550.00 (19,445,506,273)	
合計				19,445,506,273 (19,445,506,273)	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	社債券　　9銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,719,731
コール・ローン	106,703,091
投資信託受益証券	35,718,965,831
派生商品評価勘定	287,627,218
流動資産合計	36,120,015,871
資産合計	36,120,015,871
負債の部	
流動負債	
未払解約金	5,850,289
未払利息	162
流動負債合計	5,850,451
負債合計	5,850,451
純資産の部	
元本等	
元本	28,562,552,203
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	7,551,613,217
元本等合計	36,114,165,420
純資産合計	36,114,165,420
負債純資産合計	36,120,015,871

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

	2021年 7月12日現在
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 7月12日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	28,562,552,203口
2．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　1.2644円 (1万口当たり純資産額)　(12,644円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	22,572,469,512円
期中追加設定元本額	9,867,819,725円

区分	2021年 7月12日現在
期中一部解約元本額	3,877,737,034円
期末元本額	28,562,552,203円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,248,503,799円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,329,169,406円
分散投資コア戦略ファンドＡ	3,137,168,962円
分散投資コア戦略ファンドＳ	12,026,495,095円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,376,230,479円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	531,632,248円
グローバル経済コア	1,187,625,868円
ＳＭＴ　ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	2,241,421,226円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	557,552,669円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	67,659,411円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	138,698,918円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	1,720,394,122円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	△352,728,678
合計	△352,728,678

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2021年 7月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	35,023,344,558	－	34,735,717,340	287,627,218
	アメリカドル	35,023,344,558	－	34,735,717,340	287,627,218
合計		35,023,344,558	－	34,735,717,340	287,627,218

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST	9,416,695	324,216,808.85	
	アメリカドル 小計		9,416,695	324,216,808.85 (35,718,965,831)	
合計			9,416,695	35,718,965,831 (35,718,965,831)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

米国株式ＬＳマザーファンド

貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	364,972,470
社債券	17,984,693,717
派生商品評価勘定	53,806,300
流動資産合計	18,403,472,487
資産合計	18,403,472,487
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,565,284
未払利息	556
流動負債合計	4,565,840
負債合計	4,565,840
純資産の部	
元本等	
元本	18,944,877,100
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△545,970,453
元本等合計	18,398,906,647
純資産合計	18,398,906,647
負債純資産合計	18,403,472,487

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
２.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。

	2021年 7月12日現在
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 7月12日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	18,944,877,100口
2.	「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55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 545,970,453円
3.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9712円 (1万口当たり純資産額) (9,712円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2021年 7月12日現在
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	23,891,809,833円
期中追加設定元本額	4,111,127,112円
期中一部解約元本額	9,058,059,845円
期末元本額	18,944,877,100円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,868,581,812円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,194,805,213円
コア投資戦略ファンド（切替型）	856,603,646円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	347,642,415円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	12,253,598,460円
米国株式ＬＳファンド（ＳＭＡ専用）	495,037,942円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	295,448,402円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	31,174,763円
ＦＯＦｓ用　米国株式ＬＳファンドＳ（適格機関投資家専用）	601,984,447円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	△442,249,041
合計	△442,249,041

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2021年 7月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	18,005,208,200	－	17,951,401,900	53,806,300
	アメリカドル	18,005,208,200	－	17,951,401,900	53,806,300
合計		18,005,208,200	－	17,951,401,900	53,806,300

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	STAR HELIOS 004 10/18/22	154,000,000.00	163,244,928.00	
	アメリカドル 小計		154,000,000.00	163,244,928.00 (17,984,693,717)	
合計				17,984,693,717 (17,984,693,717)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	社債券　　1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	209,012,255
社債券	20,363,101,000
流動資産合計	20,572,113,255
資産合計	20,572,113,255
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,384,586
未払利息	318
流動負債合計	1,384,904
負債合計	1,384,904
純資産の部	
元本等	
元本	18,197,417,712
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,373,310,639
元本等合計	20,570,728,351
純資産合計	20,570,728,351
負債純資産合計	20,572,113,255

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 7月12日現在
１．　計算期間の末日における受益権の総数	18,197,417,712口

	2021年 7月12日現在	
2． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	1.1304円
	(1万口当たり純資産額)	(11,304円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2021年 7月12日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	12,609,230,404円
期中追加設定元本額	6,854,538,950円
期中一部解約元本額	1,266,351,642円
期末元本額	18,197,417,712円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,766,479,321円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,067,900,925円
コア投資戦略ファンド（切替型）	843,205,185円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	325,142,098円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	11,954,581,336円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	275,252,897円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	31,841,868円
コモディティＬＳアルファ・ファンド（ＳＭＡ専用）	353,628,251円
ＦＯＦｓ用　コモディティＬＳアルファ・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	579,385,831円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	249,227,000
合計	249,227,000

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	ＳＴＡＲ　ＨＥＬＩＯＳ　０％　０７／１３／２２	17,930,000,000	20,363,101,000	
合計		17,930,000,000	20,363,101,000	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	886,001,346
社債券	18,025,929,000

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	18,911,930,346
資産合計	18,911,930,346
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,409,251
未払利息	1,352
流動負債合計	1,410,603
負債合計	1,410,603
純資産の部	
元本等	
元本	21,125,701,112
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△2,215,181,369
元本等合計	18,910,519,743
純資産合計	18,910,519,743
負債純資産合計	18,911,930,346

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 7月12日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		21,125,701,112口
2． 「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55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	2,215,181,369円
3． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	0.8951円
	(1万口当たり純資産額)	(8,951円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在

1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 10月6日
期首元本額	495,000円
期中追加設定元本額	21,314,923,722円
期中一部解約元本額	189,717,610円
期末元本額	21,125,701,112円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	620,000,000円
コア投資戦略ファンド（成長型）	755,000,000円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,026,367,965円
分散投資コア戦略ファンドＳ	8,997,719,621円
コア投資戦略ファンド（切替型）	280,000,000円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	159,246,941円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	6,835,083,213円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	100,000,000円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	11,350,833円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（ＳＭＡ専用）	257,979,579円
ＦＯＦｓ用　米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドＳ（適格機関投資家専用）	205,748,207円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（適格機関投資家専用）	877,204,753円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	△351,701,000
合計	△351,701,000

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	ＳＴＡＲ　ＨＥＬＩＯＳ　０％　１０／１８／２１	20,170,000,000	18,025,929,000	
合計		20,170,000,000	18,025,929,000	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）】

【純資産額計算書】

（2021年 7月30日現在）

Ⅰ　資産総額	12,947,264,968円
Ⅱ　負債総額	27,323,783円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	12,919,941,185円
Ⅳ　発行済口数	10,962,241,758口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1786円
（1万口当たり純資産額）	（11,786円）

（参考）

国内株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

Ⅰ　資産総額	464,224,984,794円
Ⅱ　負債総額	1,364,308,081円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	462,860,676,713円
Ⅳ　発行済口数	252,090,254,402口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8361円
（1万口当たり純資産額）	（18,361円）

日本債券ツイン戦略マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

Ⅰ　資産総額	68,903,373,330円
Ⅱ　負債総額	1,126,761,165円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	67,776,612,165円
Ⅳ　発行済口数	67,731,919,537口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0007円
（1万口当たり純資産額）	（10,007円）

外国株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

Ⅰ　資産総額	539,353,356,044円
Ⅱ　負債総額	527,976,732円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	538,825,379,312円
Ⅳ　発行済口数	137,922,426,477口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.9067円
（1万口当たり純資産額）	（39,067円）

外国債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

Ⅰ　資産総額	313,126,284,146円
Ⅱ　負債総額	9,399,803,770円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	303,726,480,376円
Ⅳ　発行済口数	98,391,992,936口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.0869円
（1万口当たり純資産額）	（30,869円）

新興国債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

Ⅰ　資産総額	74,304,365,110円
Ⅱ　負債総額	5,944,645円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	74,298,420,465円
Ⅳ　発行済口数	42,138,983,496口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7632円
（1万口当たり純資産額）	（17,632円）

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

Ⅰ　資産総額	112,733,555,223円
Ⅱ　負債総額	3,503,814,323円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	109,229,740,900円
Ⅳ　発行済口数	47,994,232,137口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2759円
（1万口当たり純資産額）	（22,759円）

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

Ⅰ　資産総額	94,990,226,122円
Ⅱ　負債総額	17,445,449円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	94,972,780,673円
Ⅳ　発行済口数	41,566,618,257口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2848円
（1万口当たり純資産額）	（22,848円）

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

Ⅰ　資産総額	20,749,952,436円
Ⅱ　負債総額	200,310円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	20,749,752,126円
Ⅳ　発行済口数	52,486,635,194口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.3953円
（1万口当たり純資産額）	（3,953円）

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

Ⅰ　資産総額	36,899,784,182円
Ⅱ　負債総額	37,098,393円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	36,862,685,789円

Ⅳ　発行済口数	28,836,846,033口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2783円
（1万口当たり純資産額）	（12,783円）

米国株式ＬＳマザーファンド

純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

Ⅰ　資産総額	18,688,903,247円
Ⅱ　負債総額	716円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	18,688,902,531円
Ⅳ　発行済口数	18,947,246,460口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9864円
（1万口当たり純資産額）	（9,864円）

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

Ⅰ　資産総額	20,589,095,609円
Ⅱ　負債総額	407円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	20,589,095,202円
Ⅳ　発行済口数	18,196,627,524口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1315円
（1万口当たり純資産額）	（11,315円）

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 7月30日現在）

Ⅰ　資産総額	19,245,694,429円
Ⅱ　負債総額	222,075,747円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	19,023,618,682円
Ⅳ　発行済口数	21,380,416,911口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8898円
（1万口当たり純資産額）	（8,898円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

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

②受益権の譲渡

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

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

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

③受益権の譲渡の対抗要件

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

④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。

⑤償還金

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

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2021年 7月30日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

会社に取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。
取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。
また、監査等委員以外の取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席し、その議決権の３分の２以上をもって行います。
取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。
監査等委員である取締役の任期は、選任後２年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。
取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長１名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。
取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。
取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。
取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

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

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

［DO（実行）］

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

［CHECK（検証・評価）］

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

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

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

委託会社の機構は2021年10月12日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年7月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	530	14,468,851
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	77	287,195
単位型公社債投資信託	49	314,283
合計	656	15,070,328

3【委託会社等の経理状況】

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

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

		前事業年度 （2020年3月31日）		当事業年度 （2021年3月31日）
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		24,869		21,589
金銭の信託		5,823		10,857
前払費用		348		397
未収委託者報酬		7,284		8,471
未収運用受託報酬		5,842		6,151
未収収益		190		177
その他		4,624		3,428
流動資産合計		48,983		51,072
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	256	※1	301
器具備品	※1	576	※1	692
その他	※1	0	※1	0
有形固定資産合計		832		993
無形固定資産				
ソフトウェア		3,030		4,104
その他		40		41
無形固定資産合計		3,070		4,145
投資その他の資産				
投資有価証券		8,469		9,950
関係会社株式		5,636		5,636
繰延税金資産		700		311
その他		35		39
投資その他の資産合計		14,842		15,937
固定資産合計		18,745		21,077
資産合計		67,729		72,149

（単位：百万円）

	前事業年度 （2020年3月31日）	当事業年度 （2021年3月31日）
負債の部		
流動負債		
預り金	38	44
未払金	7,988	7,572
未払収益分配金	0	0
未払手数料	3,355	4,154
その他未払金	4,632	3,417
未払費用	204	1,046
未払法人税等	897	517
賞与引当金	324	556
その他	1,070	818
流動負債合計	10,524	10,555
固定負債		
退職給付引当金	600	626
資産除去債務	132	133
その他	7	8
固定負債合計	740	768
負債合計	11,264	11,324
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	305	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	35,122	38,258
利益剰余金合計	37,528	40,858
株主資本合計	56,767	60,098
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△587	791
繰延ヘッジ損益	284	△65
評価・換算差額等合計	△302	726
純資産合計	56,464	60,824
負債・純資産合計	67,729	72,149

（2）【損益計算書】

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）	当事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	34,967	37,224
運用受託報酬	11,091	10,982
その他営業収益	500	403
営業収益合計	46,559	48,611
営業費用		
支払手数料	15,998	17,936
広告宣伝費	331	203
公告費	0	－
調査費	5,018	5,064
調査費	788	898
委託調査費	4,217	4,154
図書費	11	11
営業雑経費	3,434	4,492
通信費	52	56
印刷費	470	449
協会費	53	58
諸会費	16	18
情報機器関連費	2,726	3,815
その他営業雑経費	114	93
営業費用合計	24,783	27,696
一般管理費		
給料	5,756	5,976
役員報酬	244	214
給料・手当	4,962	4,861
賞与	549	901
退職給付費用	118	170
福利費	535	608
交際費	14	1
旅費交通費	190	13
租税公課	344	315
不動産賃借料	269	276
寄付金	7	3
減価償却費	334	748
業務委託費	864	966
諸経費	750	848
一般管理費合計	9,185	9,929
営業利益	12,589	10,984

（単位：百万円）

	前事業年度	当事業年度

	（自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）	（自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）
営業外収益		
受取利息	15	2
収益分配金	119	101
金銭の信託運用益	－	3,038
投資有価証券売却益	483	1
投資有価証券償還益	316	54
為替差益	273	－
デリバティブ利益	666	－
その他	30	45
営業外収益合計	1,906	3,243
営業外費用		
金銭の信託運用損	1,076	－
投資有価証券売却損	4	0
投資有価証券償還損	19	0
為替差損	－	158
デリバティブ費用	－	3,782
その他	19	5
営業外費用合計	1,118	3,946
経常利益	13,377	10,281
特別損失		
システム統合費用	149	110
特別損失合計	149	110
税引前当期純利益	13,227	10,170
法人税、住民税及び事業税	4,263	3,242
法人税等調整額	△193	△65
法人税等合計	4,070	3,177
当期純利益	9,157	6,993

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2019年4月1日　至　2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
剰余金の配当	230		△2,536	△2,305	△2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	－	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当期変動額				
剰余金の配当				△2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△980	151	△829	△829
当期変動額合計	△980	151	△829	6,022
当期末残高	△587	284	△302	56,464

当事業年度（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
剰余金の配当	194		△3,857	△3,662	△3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	－	3,136	3,330	3,330

当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

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

重要な会計方針

１．有価証券の評価基準及び評価方法
（1）子会社株式
移動平均法による原価法によっております。
（2）その他有価証券
時価のあるもの
決算日の市場価格等に基づく時価法によっております。（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）
時価のないもの
移動平均法による原価法によっております。
２．デリバティブの評価基準及び評価方法
時価法によっております。
３．金銭の信託の評価基準及び評価方法
時価法によっております。
４．固定資産の減価償却の方法
（1）有形固定資産
定額法によっております。
（2）無形固定資産
定額法によっております。
ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。
５．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準
外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。
６．引当金の計上基準
（1）賞与引当金
従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。
（2）退職給付引当金
従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。
７．ヘッジ会計の会計処理
（1）ヘッジ会計の方法
繰延ヘッジ処理によっております。
（2）ヘッジ手段とヘッジ対象
ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。
（3）ヘッジ方針
自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。
（4）ヘッジ有効性評価の方法
ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有

効性を判定しております。

８．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

９．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

注記事項

（貸借対照表関係）

※1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （2020年3月31日）		当事業年度 （2021年3月31日）	
建　　物	77	百万円	106	百万円
器具備品	285	〃	391	〃
そ の 他	4	〃	4	〃
計	367	〃	503	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2019年4月1日　至 2020年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

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

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

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	利益剰余金	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

当事業年度（自 2020年4月1日　至 2021年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

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

2021年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針7.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2020年3月31日）　（単位：百万円）

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

（*1）負債に計上されているものについては、（　　）で示しております。

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

当事業年度（2021年3月31日）　（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
（1）現金及び預金	21,589	21,589	－
（2）金銭の信託	10,857	10,857	－
（3）未収委託者報酬	8,471	8,471	－
（4）未収運用受託報酬	6,151	6,151	－
（5）投資有価証券 その他有価証券	9,950	9,950	－
（6）未払金	(7,572)	(7,572)	－
（7）デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(357)	(357)	－
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)	(73)	－
デリバティブ取引計	(431)	(431)	－

(*1) 負債に計上されているものについては、（　　）で示しております。
(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

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

(1) 現金及び預金
現金及び預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

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

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 投資有価証券 その他有価証券
投資有価証券の時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

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

(7) デリバティブ取引
（デリバティブ取引関係）注記をご参照ください。

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

（単位:百万円）

区分	前事業年度 2020年3月31日	当事業年度 2021年3月31日
非上場株式	0	0

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

（注3） 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2020年3月31日） **（単位:百万円）**

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	24,869	―	―	―
未収委託者報酬	7,284	―	―	―
未収運用受託報酬	5,842	―	―	―
投資有価証券 投資信託	―	9	5,605	―

当事業年度（2021年3月31日） **（単位:百万円）**

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,589	―	―	―
未収委託者報酬	8,471	―	―	―
未収運用受託報酬	6,151	―	―	―

投資有価証券 　投資信託	―	10	5,751	0

（有価証券関係）

１．子会社株式

前事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位:百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

当事業年度（2021年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位:百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

２．その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）　（単位:百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 　その他	891	806	84
小計	891	806	84
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 　その他	7,578	8,509	△931
小計	7,578	8,509	△931
合計	8,469	9,316	△846

当事業年度（2021年3月31日）　（単位: 百万円）

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

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

3．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）　（単位:百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

当事業年度（2021年3月31日）　（単位:百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
109	1	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2020年3月31日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

（注）　1．上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
2．時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち1年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	8,412	－	358	358
合計		8,412	－	358	358

（注）　1．上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
2．時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等（百万円）	契約額等のうち1年超（百万円）	時価（百万円）
原則的処理方法	為替予約取引 売建				
	米ドル	投資有価証券 子会社株式	2,819	－	△44
	英ポンド		2,660	－	△67
	カナダドル		6	－	△0
	スイスフラン		35	－	△0
	香港ドル		71	－	△1
	ユーロ		72	－	△0
合計			5,666	－	△114

（注）　1．時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2021年3月31日）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

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

（注）　1．上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
2．時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（2）株式関連

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

（注）　1．上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
2．時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

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

（注）　1．時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。当社が有する退職一時金制度は簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	前事業年度（自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）	当事業年度（自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）
退職給付債務の期首残高	537	600
退職給付費用	74	77
転籍者受入	－	18
退職給付の支払額	△11	△69
退職給付債務の期末残高	600	626

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

（単位：百万円）

	前事業年度（自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）	当事業年度（自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626
退職給付引当金	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用　前事業年度74百万円　　当事業年度77百万円

3．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度44百万円、当事業年度92百万円であります。

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 （2020年3月31日）		当事業年度 （2021年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	168	百万円	107	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	99	〃	170	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	183	〃	191	〃
税務上の収益認識差額	―	〃	71	〃
有価証券評価差額	259	〃	―	〃
繰延ヘッジ損益	―	〃	28	〃
その他	151	〃	123	〃
繰延税金資産 合計	862	〃	693	〃
繰延税金負債				
有価証券評価差額	―	〃	△349	〃
繰延ヘッジ損益	△125	〃	―	〃
その他	△35	〃	△32	〃
繰延税金負債 合計	△161	〃	△382	〃
繰延税金資産の純額	700	〃	311	〃

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

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

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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

［関連情報］

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2019年4月1日　至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

当事業年度（自 2020年4月1日　至 2021年3月31日）

顧客の名称	営業収益

三井住友信託銀行株式会社	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*1)	6,372百万円

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

該当事項はありません。

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
２．取引条件及び取引条件の決定方針等
① 運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。
② 投信販売代行手数料等
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）

親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,365	未収運用受託報酬	5,402
							投信販売代行手数料等	9,124	未払手数料	1,888

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
２．取引条件及び取引条件の決定方針等
① 運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。
② 投信販売代行手数料等
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
該当事項はありません。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記
（1）親会社情報
前事業年度（2020年3月31日）
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2021年3月31日）
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

	前事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）	当事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）
1株当たり純資産額	18,821,541円72銭	20,274,967円09銭
1株当たり当期純利益金額	3,052,463円23銭	2,331,221円85銭

（注）１．潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
２．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）	当事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）
当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2021年10月12日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第２【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2021年3月末日現在）

③事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2021年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

①名称　　：株式会社日本カストディ銀行
②設立年月日　：2000年6月20日
③資本金の額　：51,000百万円（2021年3月末日現在）
④事業の内容　：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年10月 9日	有価証券届出書
2020年10月 9日	有価証券報告書
2021年 4月 9日	有価証券届出書
2021年 4月 9日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2021年６月２日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	藤　澤　　孝　　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹　内　知　明　　印

監査意見
　当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年４月１日から2021年３月31日までの第35期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

　当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

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

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

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

　監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じ

て、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

利害関係

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

以　上

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

２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年9月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　中島紀子　　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア投資戦略ファンド（切替型ワイド）の2020年7月11日から2021年7月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）の2021年7月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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

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

以　上

（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。