

【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】	2022年2月10日提出
【計算期間】	第9期(自 2021年5月11日至 2021年11月10日)
【ファンド名】	SMT 8資産インデックスバランス・オープン
【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 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グロ ー バ ル (日本を 含む)	ファミリ ー ファン ド ファン ド・ オブ・ファ ンズ	あり () なし	日経225 TOPIX その他 ()	ブル・ベア型 条件付運用型 ロ ン グ・ ショ ー ト型/ 絶対収益追求 型 その他 ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	日本 北米 欧州 アジア オセアニ ア 中南米 アフリカ 中近東 (中東)				
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)資産配 分固定型))	その他 ()					
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

る旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

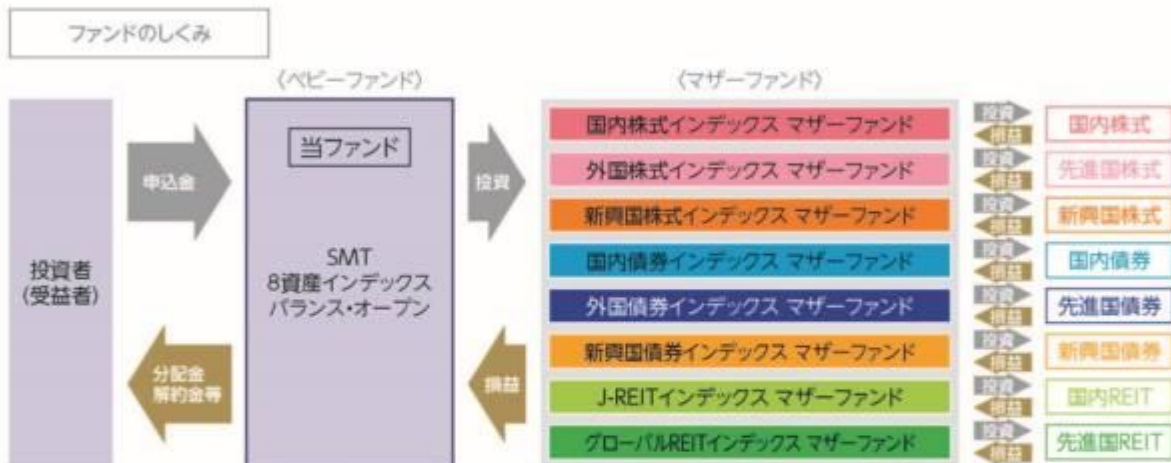
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特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

< ファンドの特色 >

特色1

国内及び海外の株式(DR(預託証券)を含みます。)、債券及び不動産投資信託証券(REIT)に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

- 国内、先進国及び新興国の株式及び債券、並びに国内及び先進国のREITに分散投資を行うことで、リスクの低減に努めます。
- 各マザーファンドは各投資対象市場の代表的な指数(インデックス)への連動を目指す運用を行います。
- 原則として、為替ヘッジは行いません。



? ファミリーファンド方式とは

投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。

? DR(預託証券)とは

ある国の企業の株式を海外でも流通させるために、その会社の株式を銀行等に預託し、その代替として海外で発行する証券のことで、株式と同様に取引所等で取引されます。

? REITとは

REITは Real Estate Investment Trust の略称です。
REITは、投資者から集めた資金で、不動産への投資を行い、そこから得られる賃貸料収入や不動産の売買益を原資として投資者に配当する商品です。

ポートフォリオ構築プロセス

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

ポートフォリオ構築

ファンドマネジャー

●基本配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分

リバランス実施

ファンドマネジャー

●資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

特色2 8つのマザーファンド受益証券への均等配分を基本配分比率とします。

基本配分比率



●配分比率には一定の変動許容幅を設けます。

マザーファンド	インデックス
1 国内株式インデックス マザーファンド	TOPIX(東証株価指数)
2 外国株式インデックス マザーファンド	MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)
3 新興国株式インデックス マザーファンド	MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)
4 国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI 総合
5 外国債券インデックス マザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
6 新興国債券インデックス マザーファンド	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・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円換算ベース)
7 J-REITインデックス マザーファンド	東証REIT指数(配当込み)
8 グローバルREITインデックス マザーファンド	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

各インデックスに関する商標、著作権等の知的財産権、数値の算出、利用などその他一切の権利はそれぞれのインデックスの開発元もしくは公表元に帰属します。

詳しくは下記をご覧ください。

「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。

「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。

「MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)」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。

「NOMURA-BPI総合」とは、野村証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証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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。

「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。

「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円換算ベース)」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。

「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」といいます。)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。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。

「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)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SPDJ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[®]およびS&P[®]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[®]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SPDJ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、SPDJ、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

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。

分配方針

- 年2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

- 株式、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、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 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。
- 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。

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

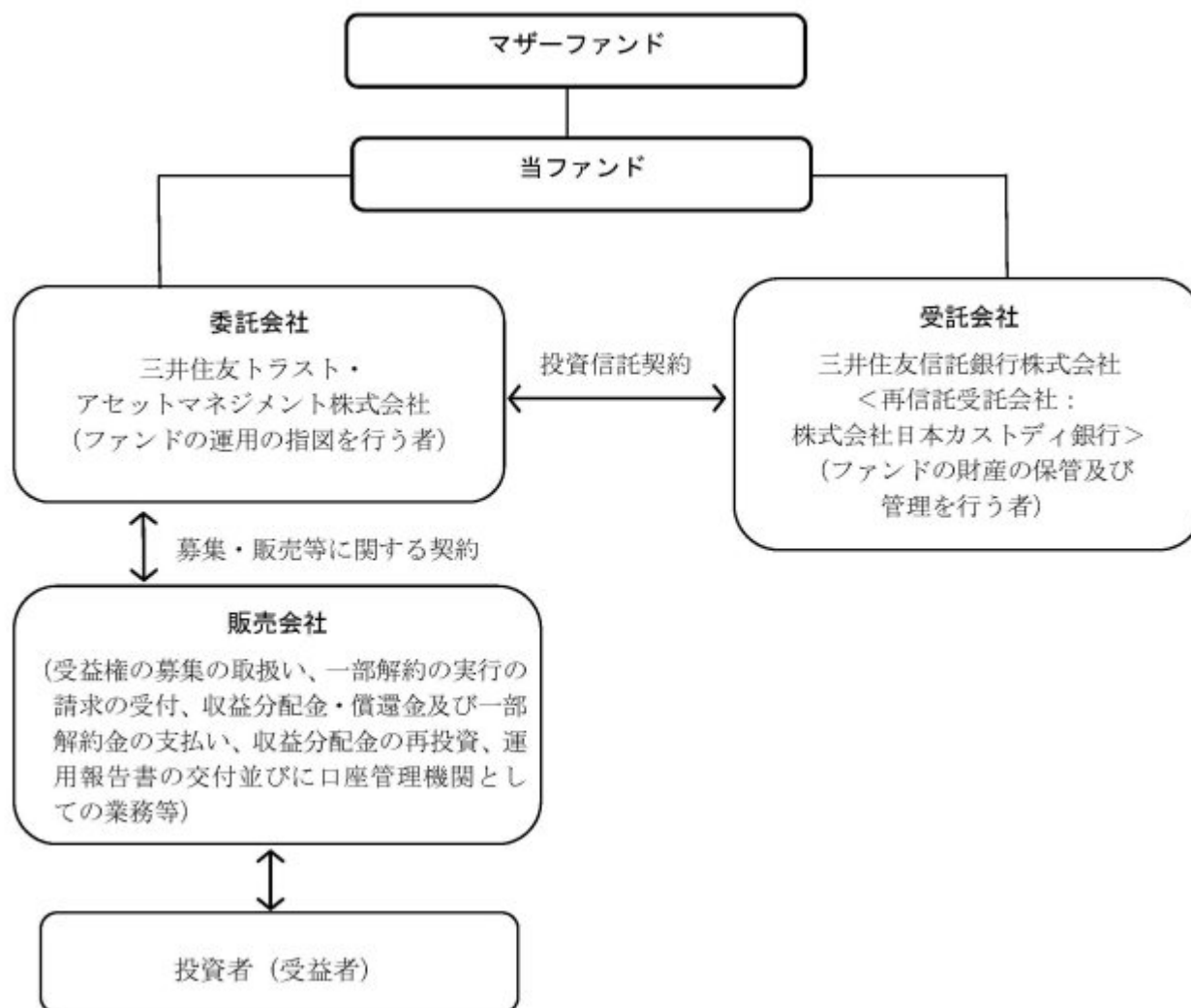
(2) 【ファンドの沿革】

2017年 8月25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】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2021年11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】

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。

投資対象

「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」及び「グローバルREITインデックス マザーファンド」（以下総称して「マザーファンド」ということがあります。）の各受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）及び債券、並びに国内及び先進国の不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減を図ります。
- ロ．各マザーファンド受益証券の基本配分比率は、8分の1ずつの均等配分とします。また、各マザーファンド受益証券の配分比率には一定の変動許容幅を設けます。
- ハ．各マザーファンドは、インデック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。

マザーファンド	インデックス
国内株式インデックス マザーファンド	TOPIX（東証株価指数）
外国株式インデックス マザーファンド	MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）
新興国株式インデックス マザーファンド	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）
国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国債券インデックス マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国債券インデックス マザーファンド	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・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）
J-REITインデックス マザーファンド	東証REIT指数（配当込み）
グローバルREITインデックス マザーファンド	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）

- ニ．実質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。
- ホ．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】

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. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条、第23条及び第24条に定めるものに限りません。）
 3. 金銭債権
 4. 約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

有価証券の指図範囲

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

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

なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の

性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

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

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

ロ．上記 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ．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。

（参考）マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1．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。

2．運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）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。

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。

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。

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。

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。

3．運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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。以下同じ。）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。

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。

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。

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。

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。

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 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。

2. 運用方法

(1)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を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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。

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。

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。

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。

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ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、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。

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。

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。

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。

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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。

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。

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。

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。

「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 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。

2. 運用方法

(1)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。）を主要投資対象とします。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)投資態度

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。

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。

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。

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、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、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ならびに委託会

社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、なら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。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。

3. 運用制限

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。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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。

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。

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。

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 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。

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

NOMURA-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。

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、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。

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。

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ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、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。

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。

3. 運用制限

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投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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。

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。

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）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。

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、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。

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。

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ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、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なら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。

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。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

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投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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。

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。

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 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・マーケット・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。

2. 運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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・マーケット・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。

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。

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、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、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ならびに委託会社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、なら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。

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。

3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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。

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。

「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

1. 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。

2. 運用方法

(1)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を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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。

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。

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。

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。

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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。

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。

外貨建資産への投資は行いません。

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。

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。

「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品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なら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。

2. 運用方法

(1)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なら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を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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。

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。

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。

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。

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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。

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。

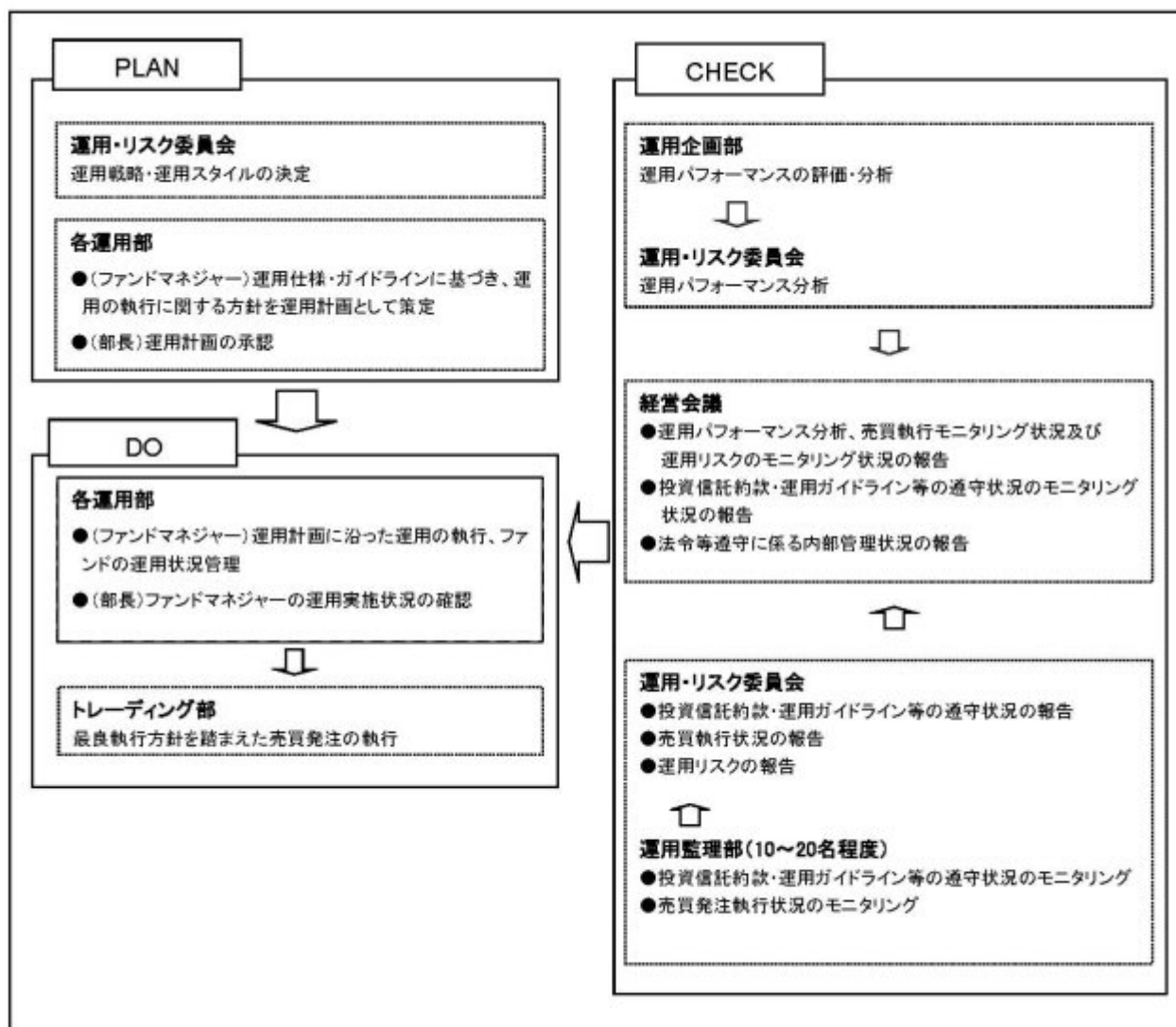
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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、委託会社は、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。

(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2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．株式等への投資割合

株式、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、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

ロ．投資信託証券への投資割合

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。

ハ．外貨建資産への投資割合

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

ニ．投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等（金融商品取引法第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17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

ホ．信用取引の指図範囲

（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、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

（ロ）上記（イ）の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、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、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品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を指

図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとし
ます。(以下同じ。)

- (ロ) 委託会社は、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、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。
- (ハ) 委託会社は、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、わが国の金融商品取引所等における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品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を指図することができます。

ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、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(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことを指図することができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

チ．金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、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、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うことを指図することができます。
- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

リ．有価証券の貸付の指図、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、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ)a.及びb.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

ヌ．公社債の空売りの指図、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、投資信託財産において有しない公社債又は下記ル．の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の売付の指図は、当該売付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)の売付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売付の一部を決済するための指図をするものとします。

ル．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るときは、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。

ヲ．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。

ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

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

カ．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。

ヨ．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。

タ．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、）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。

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

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。

為替変動リスク

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

金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証

券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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。

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。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

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

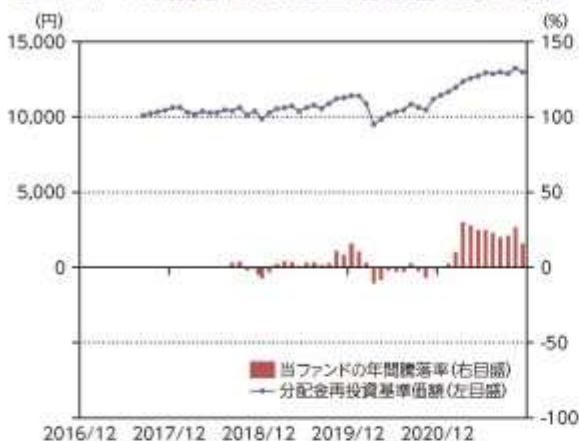
(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*当ファンドについては2018年8月～2021年11月の3年4ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2016年12月～2021年11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部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、数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMJRA-BPI国債	NOMJRA-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。同指数の知財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て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、構築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、錯誤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財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 JPELエマージング・マーケット・インデックス (除く日本、円ベース)	本指数は、信頼性が低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されています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

取得申込受付日の翌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。)。

「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。

上記 及び 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 >

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を信託財産留保額 () として当該基準価額から控除します。また、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.55% (税抜 0.5%) 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 0.22% (税抜 0.2%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.275% (税抜 0.25%)	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

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、毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

(4) 【その他の手数料等】

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

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、先物取引・オプション取引に要する費用（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。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いません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（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ず（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、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）」及び非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたてNISA（つみたてニーサ）」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。つみたてNISAは一定の基準を満たした公募株式投資信託に係る非課税制度で、当ファンドはその適用対象です。

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。なお、同一年中はNISAとつみたてNISAの同時利用はできません。また、ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2021年11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11月30日現在の状況について記載してあります。

【SMT 8資産インデックスバランス・オープン】

(1) 【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	103,707,001	98.98
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,063,643	1.02
合計(純資産総額)		104,770,644	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックスマザーファンド	6,192,045	2.4706	15,298,244	2.4668	15,274,536	14.58
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	3,636,340	4.2327	15,391,894	4.1795	15,198,083	14.51
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	6,904,842	1.9558	13,504,860	1.8779	12,966,602	12.38
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	6,052,564	2.1896	13,252,948	2.1342	12,917,382	12.33
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックスマザーファンド	3,474,406	3.7041	12,869,580	3.5827	12,447,754	11.88
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	3,958,311	3.1277	12,380,561	3.0970	12,258,889	11.70
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	6,846,579	1.7659	12,090,815	1.7071	11,687,795	11.16
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックスマザーファンド	7,759,179	1.4113	10,951,066	1.4120	10,955,960	10.46

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.98
合計	98.98

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2017年11月10日)	3,305,848	3,305,848	10,426	10,426
第2期計算期間末 (2018年 5月10日)	8,441,994	8,441,994	10,414	10,414
第3期計算期間末 (2018年11月12日)	14,205,908	14,205,908	10,346	10,346
第4期計算期間末 (2019年 5月10日)	23,476,764	23,476,764	10,471	10,471
第5期計算期間末 (2019年11月11日)	32,350,523	32,350,523	11,176	11,176
第6期計算期間末 (2020年 5月11日)	38,971,244	38,971,244	9,884	9,884
第7期計算期間末 (2020年11月10日)	58,213,200	58,213,200	11,058	11,058
第8期計算期間末 (2021年 5月10日)	83,447,901	83,447,901	12,622	12,622
第9期計算期間末 (2021年11月10日)	104,137,823	104,137,823	13,229	13,229
2020年11月末日	60,893,010		11,187	
12月末日	64,805,911		11,448	
2021年 1月末日	67,836,156		11,673	
2月末日	73,535,199		11,958	
3月末日	78,921,080		12,365	
4月末日	82,753,531		12,573	
5月末日	86,465,192		12,725	
6月末日	91,266,563		12,935	
7月末日	94,175,465		12,867	
8月末日	98,199,280		12,992	
9月末日	100,137,969		12,878	
10月末日	104,185,252		13,253	
11月末日	104,770,644		12,974	

【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	2017年 8月25日～2017年11月10日	0
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	0

第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	0
第6期計算期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	0
第7期計算期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	0
第8期計算期間	2020年11月11日～2021年 5月10日	0
第9期計算期間	2021年 5月11日～2021年11月10日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	4.3
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0.1
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0.7
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	1.2
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	6.7
第6期計算期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	11.6
第7期計算期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	11.9
第8期計算期間	2020年11月11日～2021年 5月10日	14.1
第9期計算期間	2021年 5月11日～2021年11月10日	4.8

(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	2017年 8月25日～2017年11月10日	3,291,330	120,520	3,170,810
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	6,642,105	1,706,320	8,106,595
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	6,807,776	1,183,554	13,730,817
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	9,998,798	1,308,700	22,420,915
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	10,577,572	4,052,049	28,946,438
第6期計算期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	15,251,653	4,770,851	39,427,240
第7期計算期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	16,057,478	2,841,160	52,643,558
第8期計算期間	2020年11月11日～2021年 5月10日	17,379,718	3,908,644	66,114,632
第9期計算期間	2021年 5月11日～2021年11月10日	18,347,554	5,742,323	78,719,863

(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	468,547,544,500	98.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,621,757,910	1.19
合計(純資産総額)		474,169,302,410	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	6,124,080,000	1.29

(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	8,981,000	1,829.45	16,430,324,107	2,001.00	17,970,981,000	3.79
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,110,700	10,827.29	12,025,872,406	13,825.00	15,355,427,500	3.24
日本	株式	キーエンス	電気機器	160,700	54,228.70	8,714,553,101	70,330.00	11,302,031,000	2.38
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,307,100	5,715.37	7,470,563,519	6,901.00	9,020,297,100	1.90
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,214,800	619.44	6,946,990,415	601.40	6,744,580,720	1.42
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	112,500	48,976.64	5,509,872,421	59,840.00	6,732,000,000	1.42
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,035,000	2,933.01	5,968,684,217	3,125.00	6,359,375,000	1.34
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,043,300	8,196.71	8,551,632,719	6,030.00	6,291,099,000	1.33
日本	株式	HOYA	精密機器	346,000	14,437.24	4,995,285,296	18,020.00	6,234,920,000	1.31
日本	株式	日本電産	電気機器	459,600	12,527.90	5,757,825,443	13,000.00	5,974,800,000	1.26
日本	株式	日立製作所	電気機器	852,800	5,766.75	4,917,885,604	6,688.00	5,703,526,400	1.20
日本	株式	信越化学工業	化学	298,200	18,841.95	5,618,669,703	19,000.00	5,665,800,000	1.19
日本	株式	ダイキン工業	機械	225,900	21,688.73	4,899,485,035	23,150.00	5,229,585,000	1.10
日本	株式	任天堂	その他製品	100,100	67,237.97	6,730,521,727	50,100.00	5,015,010,000	1.06

日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,210,500	3,944.50	4,774,821,628	3,703.00	4,482,481,500	0.95
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,308,600	3,102.78	4,060,306,973	3,391.00	4,437,462,600	0.94
日本	株式	村田製作所	電気機器	521,000	8,297.32	4,322,907,915	8,380.00	4,365,980,000	0.92
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,396,000	3,357.29	4,686,788,885	3,101.00	4,328,996,000	0.91
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,393,600	3,710.74	5,171,295,739	3,031.00	4,224,001,600	0.89
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,268,500	3,705.59	4,700,544,170	3,300.00	4,186,050,000	0.88
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,635,400	1,464.85	3,860,466,892	1,562.50	4,117,812,500	0.87
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,221,400	3,250.05	3,969,612,969	3,260.00	3,981,764,000	0.84
日本	株式	第一三共	医薬品	1,393,300	2,529.67	3,524,589,534	2,824.50	3,935,375,850	0.83
日本	株式	S M C	機械	51,900	65,615.45	3,405,442,037	72,650.00	3,770,535,000	0.80
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	200,200	16,483.72	3,300,041,637	17,840.00	3,571,568,000	0.75
日本	株式	三井物産	卸売業	1,356,100	2,419.72	3,281,390,304	2,557.00	3,467,547,700	0.73
日本	株式	ファナック	電気機器	155,600	26,236.99	4,082,476,192	22,245.00	3,461,322,000	0.73
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	575,900	5,191.77	2,989,943,313	5,708.00	3,287,237,200	0.69
日本	株式	デンソー	輸送用機器	390,400	7,515.28	2,933,967,642	8,331.00	3,252,422,400	0.69
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,236,500	1,667.93	3,730,343,318	1,402.00	3,135,573,000	0.66

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	0.22
		建設業	2.16
		食料品	3.21
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.20
		化学	6.71
		医薬品	4.76
		石油・石炭製品	0.40
		ゴム製品	0.65
		ガラス・土石製品	0.77
		鉄鋼	0.70
		非鉄金属	0.68
		金属製品	0.63
		機械	5.30
		電気機器	19.57
輸送用機器	7.98		
精密機器	2.98		

その他製品	2.16
電気・ガス業	1.07
陸運業	2.95
海運業	0.42
空運業	0.37
倉庫・運輸関連業	0.16
情報・通信業	8.52
卸売業	5.03
小売業	4.14
銀行業	4.60
証券、商品先物取引業	0.72
保険業	1.89
その他金融業	1.11
不動産業	1.86
サービス業	6.34
小計	98.81
合計	98.81

(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	323	円	6,505,204,650	6,124,080,000	1.29

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

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

外国株式インデックス 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	358,839,534,689	68.31
	イギリス	20,636,965,453	3.93
	カナダ	18,145,306,835	3.45
	スイス	16,835,177,908	3.20

	フランス	15,837,155,268	3.01
	ドイツ	13,227,007,675	2.52
	オランダ	10,131,306,712	1.93
	アイルランド	9,494,575,174	1.81
	オーストラリア	9,038,139,626	1.72
	スウェーデン	5,211,930,434	0.99
	デンマーク	4,099,166,169	0.78
	スペイン	3,479,854,047	0.66
	香港	3,285,575,634	0.63
	イタリア	2,723,176,779	0.52
	フィンランド	1,859,587,649	0.35
	ジャージー	1,597,842,018	0.30
	シンガポール	1,398,336,041	0.27
	バミューダ	1,297,274,959	0.25
	ベルギー	1,234,042,661	0.23
	イスラエル	998,807,501	0.19
	ノルウェー	952,234,152	0.18
	ケイマン	930,405,938	0.18
	ニュージーランド	496,047,405	0.09
	ルクセンブルク	430,110,813	0.08
	キュラソー	361,366,047	0.07
	オーストリア	337,259,377	0.06
	ポルトガル	256,411,816	0.05
	リベリア	153,199,341	0.03
	パナマ	145,698,777	0.03
	マン島	131,332,772	0.02
	パプアニューギニア	59,156,153	0.01
	小計	503,623,985,823	95.87
投資信託受益証券	オーストラリア	204,456,863	0.04
	香港	82,715,451	0.02
	小計	287,172,314	0.05
投資証券	アメリカ	9,980,122,201	1.90
	オーストラリア	683,941,513	0.13
	イギリス	338,895,677	0.06
	フランス	217,548,926	0.04
	シンガポール	212,974,582	0.04
	香港	170,897,776	0.03
	カナダ	56,084,987	0.01
	小計	11,660,465,662	2.22
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,771,059,652	1.86
合計(純資産総額)		525,342,683,451	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	6,667,217,802	1.27
	買建	カナダ	501,180,618	0.10
	買建	ドイツ	1,469,541,047	0.28
	買建	イギリス	183,319,398	0.03
	買建	オーストラリア	366,516,287	0.07

(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		311,250,826	0.06
	売建		401,649,009	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	1,328,007	14,176.87	18,826,995,480	18,230.50	24,210,237,988	4.61
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	569,383	28,406.09	16,173,946,792	38,298.39	21,806,455,097	4.15
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	36,106	368,268.93	13,296,718,319	405,199.81	14,630,144,661	2.78
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	65,071	71,903.77	4,678,850,719	129,355.35	8,417,282,130	1.60
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	23,897	268,138.82	6,407,713,490	331,140.09	7,913,254,963	1.51
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	23,138	274,363.18	6,348,215,287	332,467.79	7,692,639,855	1.46

アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	197,988	18,520.61	3,666,860,176	37,971.87	7,517,975,627	1.43
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	190,405	37,399.61	7,121,073,142	38,457.67	7,322,533,247	1.39
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	240,224	18,685.58	4,488,725,923	18,343.13	4,406,461,767	0.84
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	84,310	36,282.39	3,058,968,360	46,283.91	3,902,196,570	0.74
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	74,840	46,864.13	3,507,312,118	51,424.04	3,848,575,154	0.73
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	208,850	19,255.57	4,021,526,317	18,174.75	3,795,798,104	0.72
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	228,377	13,695.54	3,127,746,339	14,802.32	3,380,510,577	0.64
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	105,144	32,929.58	3,462,348,685	32,096.79	3,374,785,140	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	194,019	15,341.88	2,976,617,089	16,954.00	3,289,399,174	0.63
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	611,229	4,822.71	2,947,780,394	5,186.77	3,170,306,869	0.60
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	33,236	70,920.84	2,357,125,138	90,503.36	3,007,969,939	0.57
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	134,076	25,859.92	3,467,194,768	22,331.91	2,994,173,608	0.57
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	37,856	57,406.06	2,173,164,057	78,215.73	2,960,934,951	0.56
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	35,107	57,204.69	2,008,285,182	75,525.07	2,651,458,871	0.50
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	442,966	4,406.31	1,951,846,445	5,961.54	2,640,763,071	0.50
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	76,915	27,019.23	2,078,184,637	33,760.10	2,596,658,845	0.49
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	70,070	41,023.18	2,874,494,685	36,748.84	2,574,991,758	0.49
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	55,594	38,897.70	2,162,478,734	44,061.87	2,449,575,879	0.47
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	143,808	20,325.01	2,922,899,110	16,816.34	2,418,324,755	0.46
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	334,998	6,640.75	2,224,639,610	7,007.09	2,347,362,576	0.45
アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	31,080	53,415.01	1,660,138,666	73,810.56	2,294,032,295	0.44
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	34,970	43,035.77	1,504,961,153	63,128.69	2,207,610,555	0.42
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	362,493	6,523.57	2,364,749,112	5,862.56	2,125,139,898	0.40

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	333,162	6,018.43	2,005,113,175	6,343.81	2,113,518,160	0.40
------	----	---------------	--------------------	---------	----------	---------------	----------	---------------	------

(注1)国ノ地域は、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	3.21
		素材	3.96
		資本財	5.91
		商業・専門サービス	1.27
		運輸	1.90
		自動車・自動車部品	2.55
		耐久消費財・アパレル	1.92
		消費者サービス	1.72
		メディア・娯楽	7.02
		小売	5.74
		食品・生活必需品小売り	1.43
		食品・飲料・タバコ	3.57
		家庭用品・パーソナル用品	1.65
		ヘルスケア機器・サービス	4.49
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.71
		銀行	5.77
		各種金融	4.60
		保険	2.84
		不動産	0.41
		ソフトウェア・サービス	12.40
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.16		
電気通信サービス	1.42		
公益事業	2.74		
半導体・半導体製造装置	5.48		
	小計	95.87	
投資信託受益証券			0.05
投資証券			2.22
合計			98.14

(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	252	アメリカドル	58,006,191.5	6,599,364,407	58,602,600	6,667,217,802	1.27
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	22	カナダドル	5,616,527	501,331,200	5,614,840	501,180,618	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	38	スイスフラン	4,710,506	580,569,865	4,650,820	573,213,565	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	170	ユーロ	7,254,025	931,489,350	6,980,200	896,327,482	0.17
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	25	オーストラリアドル	4,592,700	373,340,583	4,508,750	366,516,287	0.07
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	17	イギリスポンド	1,226,323.75	185,861,628	1,209,550	183,319,398	0.03	

(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	1,720,000.00	195,667,200	195,679,756	0.04
	ユーロ	買建	900,000.00	115,571,700	115,571,070	0.02
	アメリカドル	売建	3,000,000.00	341,280,000	341,294,100	0.06
	ユーロ	売建	470,000.00	60,354,110	60,354,909	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	ケイマン	19,655,783,484	19.40
	台湾	14,277,159,550	14.09
	韓国	11,659,683,435	11.51
	インド	11,474,209,504	11.33
	中国	11,230,733,629	11.09

	ブラジル	3,700,264,620	3.65
	サウジアラビア	3,059,161,913	3.02
	ロシア	2,956,528,595	2.92
	南アフリカ	2,729,450,134	2.69
	メキシコ	1,645,557,277	1.62
	タイ	1,551,933,197	1.53
	インドネシア	1,427,303,633	1.41
	マレーシア	1,212,856,912	1.20
	香港	1,058,793,925	1.05
	アラブ首長国連邦	855,659,573	0.84
	カタール	738,250,761	0.73
	フィリピン	704,558,804	0.70
	ポーランド	608,321,726	0.60
	クウェート	587,173,713	0.58
	バミューダ	557,406,058	0.55
	チリ	395,598,274	0.39
	アメリカ	325,250,125	0.32
	オランダ	248,790,416	0.25
	ハンガリー	240,575,505	0.24
	トルコ	231,557,403	0.23
	ルクセンブルク	230,482,054	0.23
	キプロス	182,681,340	0.18
	ギリシャ	178,842,313	0.18
	コロンビア	158,602,228	0.16
	チェコ	128,385,860	0.13
	ジャージー	90,860,664	0.09
	エジプト	67,941,345	0.07
	マン島	42,154,061	0.04
	英ヴァージン諸島	36,622,126	0.04
	パキスタン	25,735,527	0.03
	シンガポール	19,237,207	0.02
	ペルー	13,482,883	0.01
	アルゼンチン	5,982,287	0.01
	小計	94,313,572,061	93.11
投資信託受益証券	ブラジル	158,558,157	0.16
	メキシコ	32,035,924	0.03
	小計	190,594,081	0.19
投資証券	南アフリカ	42,863,359	0.04
	メキシコ	31,379,290	0.03
	小計	74,242,649	0.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,715,445,703	6.63
合計(純資産総額)		101,293,854,494	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	6,788,243,483	6.70

(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		722,419,755	0.71

(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 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,661,389	2,501.80	6,658,264,597	2,428.09	6,462,112,776	6.38
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	622,900	6,769.76	4,216,883,504	6,746.41	4,202,342,526	4.15
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	517,151	6,753.90	3,492,786,139	6,926.33	3,581,963,657	3.54
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	1,642,688	2,292.08	3,765,187,096	1,896.70	3,115,686,330	3.08
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	436,600	3,945.13	1,722,446,378	3,574.55	1,560,648,530	1.54
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	309,735	3,858.20	1,195,019,887	3,735.49	1,157,013,544	1.14
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	370,852	2,666.02	988,700,703	2,595.41	962,515,029	0.95
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	94,194	8,781.90	827,202,882	10,001.52	942,083,241	0.93
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	187,327	4,500.64	843,092,888	4,152.11	777,803,059	0.77
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	10,385,620	76.15	790,966,742	73.97	768,237,813	0.76
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	165,804	4,004.51	663,965,235	4,217.43	699,268,090	0.69

ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	147,534	4,623.61	682,140,091	4,603.13	679,118,801	0.67
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	655,305	1,118.81	733,164,526	1,028.02	673,670,394	0.67
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	60,303	10,442.19	629,695,986	11,112.79	670,135,178	0.66
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	563,039	1,203.42	677,573,238	1,099.15	618,865,443	0.61
ブラジル	株式	VALE SA	素材	430,378	1,337.82	575,769,884	1,410.05	606,854,822	0.60
ケイマン	株式	MUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	390,000	1,496.93	583,804,260	1,552.37	605,426,640	0.60
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,368,248	442.21	605,062,252	423.79	579,851,325	0.57
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	695,000	819.95	569,870,810	810.47	563,279,778	0.56
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	88,687	6,322.80	560,750,164	6,303.64	559,050,921	0.55
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	285,355	2,284.50	651,893,954	1,914.74	546,383,229	0.54
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	42,826	11,471.42	491,275,423	12,528.35	536,539,220	0.53
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	130,773	4,464.38	583,821,673	4,099.94	536,162,761	0.53
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	98,522	5,363.72	528,444,520	5,358.05	527,886,787	0.52
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	30,081	18,388.64	553,148,833	17,098.49	514,339,777	0.51
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	13,595	39,996.50	543,752,418	37,026.70	503,377,987	0.50
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	44,089	11,473.70	505,864,158	10,059.54	443,515,209	0.44
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	236,442	2,034.79	481,109,818	1,840.42	435,153,059	0.43
韓国	株式	KAKAO CORP	メディア・娯楽	34,497	12,022.89	414,753,981	11,783.40	406,491,950	0.40
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	23,206	17,987.22	417,411,636	17,353.50	402,705,425	0.40

(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	5.22
		素材	7.75
		資本財	2.77
		商業・専門サービス	0.07
		運輸	1.61
		自動車・自動車部品	3.82
		耐久消費財・アパレル	1.57
		消費者サービス	0.94

	メディア・娯楽	7.39
	小売	7.40
	食品・生活必需品小売り	1.13
	食品・飲料・タバコ	3.38
	家庭用品・パーソナル用品	0.83
	ヘルスケア機器・サービス	1.02
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.39
	銀行	13.42
	各種金融	2.19
	保険	2.45
	不動産	1.78
	ソフトウェア・サービス	2.74
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.03
	電気通信サービス	2.70
	公益事業	2.03
	半導体・半導体製造装置	9.46
	小計	93.11
投資信託受益証券		0.19
投資証券		0.07
合計		93.37

(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	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	985	アメリカドル	62,166,534	7,072,686,572	59,666,375	6,788,243,483	6.70

(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	6,350,000.00	722,376,000	722,419,755	0.71

(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。

国内債券インデックス 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	日本	544,282,358,500	83.73
地方債証券	日本	35,064,405,996	5.39
特殊債券	日本	39,714,712,395	6.11
社債券	日本	28,098,734,680	4.32
	フランス	1,200,743,000	0.18
	スペイン	401,216,000	0.06
	オーストラリア	400,460,000	0.06
	小計	30,101,153,680	4.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		846,956,621	0.13
合計(純資産総額)		650,009,587,192	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(%)
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	8,990,000,000	100.55	9,040,155,600	100.50	9,035,129,800	0.005	2026/6/20	1.39
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	7,830,000,000	101.05	7,912,234,600	101.20	7,924,194,900	0.100	2028/3/20	1.22
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	7,410,000,000	100.95	7,480,395,000	100.82	7,470,836,100	0.100	2025/9/20	1.15
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	7,250,000,000	100.74	7,303,650,000	100.63	7,295,820,000	0.100	2024/9/20	1.12
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	6,890,000,000	100.59	6,931,220,300	100.47	6,922,589,700	0.100	2023/12/20	1.06
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	6,760,000,000	100.54	6,796,706,800	100.42	6,788,662,400	0.100	2023/9/20	1.04
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	6,310,000,000	100.91	6,367,421,000	100.78	6,359,470,400	0.100	2025/6/20	0.98
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	6,300,000,000	100.70	6,344,352,000	100.57	6,336,225,000	0.100	2024/6/20	0.97
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	6,250,000,000	101.01	6,313,125,000	101.06	6,316,562,500	0.100	2027/3/20	0.97
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	6,210,000,000	100.98	6,270,858,000	100.96	6,269,926,500	0.100	2026/9/20	0.96
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	5,940,000,000	101.22	6,012,937,800	100.94	5,996,014,200	0.600	2023/3/20	0.92

日本	国債証券	第363回利付国債（10年）	5,790,000,000	100.66	5,828,336,800	100.57	5,823,003,000	0.100	2031/6/20	0.90
日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	5,690,000,000	100.66	5,727,554,000	100.53	5,720,157,000	0.100	2024/3/20	0.88
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	5,340,000,000	101.84	5,438,463,400	101.68	5,430,192,600	0.300	2025/12/20	0.84
日本	国債証券	第142回利付国債（5年）	5,380,000,000	100.80	5,423,201,400	100.68	5,417,068,200	0.100	2024/12/20	0.83
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	5,260,000,000	100.46	5,284,196,000	101.01	5,313,283,800	0.100	2030/9/20	0.82
日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	5,150,000,000	100.95	5,199,383,100	101.32	5,218,392,000	0.100	2029/6/20	0.80
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	5,130,000,000	100.96	5,179,248,000	100.90	5,176,529,100	0.100	2026/3/20	0.80
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	5,110,000,000	101.04	5,163,322,500	101.21	5,172,239,800	0.100	2028/6/20	0.80
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	5,090,000,000	100.95	5,138,452,200	101.32	5,157,238,900	0.100	2029/3/20	0.79
日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	5,090,000,000	101.05	5,143,906,100	101.13	5,147,873,300	0.100	2027/9/20	0.79
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	5,040,000,000	100.90	5,085,360,000	101.29	5,105,217,600	0.100	2029/9/20	0.79
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	4,860,000,000	102.23	4,968,378,000	101.85	4,950,153,000	0.600	2024/6/20	0.76
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	4,830,000,000	102.24	4,938,192,000	101.98	4,925,923,800	0.400	2025/9/20	0.76
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	4,800,000,000	101.87	4,889,760,000	101.49	4,871,568,000	0.600	2023/12/20	0.75
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	4,750,000,000	102.13	4,851,175,000	101.85	4,838,065,000	0.400	2025/6/20	0.74
日本	国債証券	第143回利付国債（5年）	4,800,000,000	100.85	4,841,232,000	100.74	4,835,760,000	0.100	2025/3/20	0.74
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	4,640,000,000	100.33	4,655,754,800	100.85	4,679,857,600	0.100	2030/12/20	0.72
日本	国債証券	第364回利付国債（10年）	4,620,000,000	100.22	4,630,416,400	100.43	4,640,235,600	0.100	2031/9/20	0.71
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	4,560,000,000	102.00	4,651,382,400	101.72	4,638,523,200	0.400	2025/3/20	0.71

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	83.73
地方債証券	5.39
特殊債券	6.11
社債券	4.63
合計	99.87

(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。

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	138,990,725,840	45.70
	フランス	29,347,361,710	9.65
	イタリア	26,721,524,521	8.79
	ドイツ	21,464,216,878	7.06
	イギリス	18,153,445,299	5.97
	スペイン	17,386,564,697	5.72
	ベルギー	6,656,336,456	2.19
	カナダ	5,846,456,003	1.92
	オランダ	5,583,777,566	1.84
	オーストラリア	5,119,507,584	1.68
	オーストリア	4,306,530,923	1.42
	アイルランド	2,317,629,740	0.76
	メキシコ	1,948,203,822	0.64
	フィンランド	1,761,178,950	0.58
	デンマーク	1,485,473,026	0.49
	ポーランド	1,450,360,454	0.48
	イスラエル	1,416,796,813	0.47
	マレーシア	1,408,947,687	0.46
	シンガポール	1,282,836,837	0.42
	スウェーデン	857,868,511	0.28
ノルウェー	708,216,397	0.23	
中国	622,210,880	0.20	
	小計	294,836,170,594	96.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,326,188,158	3.07
合計(純資産総額)		304,162,358,752	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	3,232,260,854	1.06

買建	ドイツ	3,809,585,697	1.25
----	-----	---------------	------

(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		7,063,372,650	2.32

(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	10,490.83	1,673,288,727	10,590.38	1,689,166,753	0.625	2030/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	10,920.14	1,643,481,422	11,035.69	1,660,871,345	1.125	2031/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/51	13,600,000	10,628.64	1,445,495,958	11,358.33	1,544,733,514	1.875	2051/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,533.50	1,485,223,804	10,617.05	1,497,004,333	0.625	2030/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	11,378.77	1,479,241,095	11,281.89	1,466,646,408	0.250	2024/3/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/40	13,000,000	9,906.87	1,287,894,177	10,356.62	1,346,361,291	1.375	2040/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	11,830,000	11,152.41	1,319,331,052	11,161.90	1,320,453,195	0.750	2026/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	11,589.23	1,292,199,174	11,519.21	1,284,392,194	1.625	2031/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.5% 02/28/26	11,500,000	11,252.56	1,294,044,867	11,093.01	1,275,697,229	0.500	2026/2/28	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	11,374.77	1,251,225,576	11,201.45	1,232,160,206	0.750	2026/3/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/15/50	11,300,000	10,029.06	1,133,284,146	10,711.26	1,210,373,260	1.625	2050/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	12,043.62	1,230,858,075	11,835.63	1,209,601,929	2.000	2026/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	10,705.93	1,193,711,732	10,808.15	1,205,108,725	0.875	2030/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	12,097.39	1,227,885,608	11,856.07	1,203,391,958	2.250	2024/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	11,682.97	1,168,297,907	11,565.87	1,156,587,595	2.000	2022/10/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	11,403.22	1,157,426,876	11,367.66	1,153,818,234	0.250	2023/4/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	10,210,000	11,138.31	1,137,221,506	11,168.12	1,140,265,608	1.125	2028/8/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	11,347.22	1,134,722,423	11,269.89	1,126,989,624	0.125	2024/1/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	11,316.69	1,131,669,622	11,258.78	1,125,878,592	0.250	2024/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	11,218.34	1,121,834,421	11,073.46	1,107,346,517	0.250	2025/7/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	10,989.47	1,098,947,093	10,908.58	1,090,858,763	0.625	2027/12/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	12,196.05	1,091,546,935	11,974.73	1,071,738,950	2.250	2027/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,500,000	11,522.28	1,094,617,007	11,276.56	1,071,273,435	1.250	2028/6/30	0.35
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	12,848.89	1,079,307,548	12,679.13	1,065,047,194	3.125	2028/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	9,500,000	10,906.80	1,036,146,948	10,832.14	1,029,054,100	0.375	2027/7/31	0.34

アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	12,184.94	1,041,812,782	11,986.29	1,024,827,940	2.250	2027/8/15	0.34
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000	22,159.71	1,001,619,059	22,512.96	1,017,586,226	4.500	2041/4/25	0.33
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	11,374.15	1,024,811,433	11,275.67	1,015,938,190	0.375	2024/7/15	0.33
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	11,342.41	1,020,817,253	11,248.56	1,012,370,793	0.250	2024/6/15	0.33
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000	15,726.62	1,003,358,964	15,760.78	1,005,538,184	2.500	2030/5/25	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	96.93
合計	96.93

(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	83	アメリカ ドル	10,004,411.97	1,138,201,950	10,065,047.29	1,145,100,430	0.38
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	62	アメリカ ドル	8,016,205.12	912,003,656	8,077,437.5	918,970,064	0.30
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	64	アメリカ ドル	10,171,733.76	1,157,238,150	10,268,000	1,168,190,360	0.38
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	39	ユーロ	4,378,601.9	562,256,270	4,385,160	563,098,395	0.19
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	52	ユーロ	7,015,369.2	900,843,559	7,048,080	905,043,953	0.30
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	106	ユーロ	18,048,642.6	2,317,626,196	18,234,120	2,341,443,349	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。

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	30,310,000.00	3,456,738,278	3,447,156,300	1.13
	カナダドル	買建	3,150,000.00	285,717,257	281,106,000	0.09

ユーロ	買建	22,390,000.00	2,910,494,624	2,875,883,550	0.95
イギリスポンド	買建	3,030,000.00	463,298,047	459,226,800	0.15

(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	8,179,606,783	10.41
	インドネシア	8,121,888,000	10.34
	メキシコ	7,149,806,118	9.10
	タイ	7,114,777,772	9.06
	ブラジル	6,767,185,899	8.62
	マレーシア	6,565,459,316	8.36
	南アフリカ	5,906,205,113	7.52
	ロシア	5,844,950,424	7.44
	ポーランド	5,725,944,655	7.29
	チェコ	3,595,514,124	4.58
	コロンビア	3,184,081,691	4.05
	ハンガリー	2,771,051,360	3.53
	ペルー	1,643,618,557	2.09
	チリ	1,553,901,224	1.98
	トルコ	928,088,605	1.18
	ドミニカ共和国	119,586,649	0.15
	フィリピン	111,434,277	0.14
ウルグアイ	94,702,662	0.12	
	小計	75,377,803,229	95.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,169,271,759	4.03
	合計(純資産総額)	78,547,074,988	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	62,800,000,000	3.24	2,039,546,756	3.20	2,013,547,219	9.850	2027/6/28	2.56
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	92,100,000	1,589.81	1,464,220,900	1,608.41	1,481,347,473	0.000	2024/1/1	1.89
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	60,400,000	1,985.14	1,199,029,688	1,992.28	1,203,342,390	10.000	2023/1/1	1.53
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	70,000,000	1,679.50	1,175,654,748	1,695.36	1,186,756,128	0.000	2023/7/1	1.51
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	132,100,000	781.28	1,032,081,514	773.65	1,021,995,481	10.500	2026/12/21	1.30
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	33,300,000,000	2.65	884,131,346	2.52	840,161,439	7.250	2034/10/18	1.07
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	29,800,000	2,755.81	821,233,413	2,756.59	821,465,465	3.885	2029/8/15	1.05
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	158,800,000	498.82	792,127,171	494.94	785,979,408	5.750	2026/3/5	1.00
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	38,200,000	1,911.08	730,033,119	1,917.15	732,353,571	10.000	2027/1/1	0.93
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000	2,784.30	723,919,684	2,788.73	725,071,622	3.955	2025/9/15	0.92
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	126,100,000	595.59	751,040,315	573.12	722,707,725	8.750	2048/2/28	0.92
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	113,700,000	654.09	743,710,563	634.16	721,041,739	8.000	2030/1/31	0.92
マレーシア	国債証券	MGS 3.733% 06/15/28	25,250,000	2,744.13	692,894,423	2,739.14	691,633,333	3.733	2028/6/15	0.88
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	126,500,000	534.27	675,861,306	526.89	666,525,195	7.500	2027/6/3	0.85
タイ	国債証券	THAIGB 3.3% 06/17/38	178,700,000	372.64	665,922,655	369.60	660,480,561	3.300	2038/6/17	0.84
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	116,900,000	565.26	660,794,281	553.94	647,567,342	8.500	2029/5/31	0.82
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000	2,712.33	653,673,425	2,670.45	643,579,130	2.500	2026/7/25	0.82
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	23,700,000	2,726.77	646,244,680	2,668.25	632,376,571	2.750	2029/10/25	0.81
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000	1,939.45	616,747,894	1,950.85	620,371,742	10.000	2025/1/1	0.79
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	115,400,000	538.26	621,157,421	535.42	617,877,962	8.000	2024/9/5	0.79
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	115,600,000	542.58	627,229,946	529.05	611,589,117	7.750	2031/5/29	0.78
タイ	国債証券	THAIGB 2.125% 12/17/26	170,600,000	354.29	604,427,236	352.76	601,820,878	2.125	2026/12/17	0.77
タイ	国債証券	THAIGB 3.775% 06/25/32	152,500,000	395.29	602,818,775	393.06	599,427,113	3.775	2032/6/25	0.76
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	97,200,000	636.60	618,781,048	614.23	597,032,775	8.250	2032/3/31	0.76
インドネシア	国債証券	INDOGB 7% 09/15/30	68,000,000,000	0.84	573,504,640	0.83	570,971,520	7.000	2030/9/15	0.73
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	105,950,000	537.00	568,956,428	536.72	568,660,734	8.000	2023/12/7	0.72
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	97,700,000	605.18	591,266,820	581.78	568,399,158	8.500	2037/1/31	0.72
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	100,250,000	568.54	569,969,000	564.26	565,677,184	10.000	2024/12/5	0.72
インドネシア	国債証券	INDOGB 6.5% 06/15/25	66,300,000,000	0.84	559,434,096	0.84	560,844,960	6.500	2025/6/15	0.71
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	103,700,000	526.52	546,011,283	527.06	546,561,456	6.500	2022/6/9	0.70

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	95.97
合計	95.97

(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 - R E I T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	104,558,418,350	96.16
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		4,171,678,573	3.84
合計（純資産総額）		108,730,096,923	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	4,141,170,000	3.81

(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	10,801	712,081.93	7,691,196,967	700,000	7,560,700,000	6.95
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	9,531	680,963.12	6,490,259,502	655,000	6,242,805,000	5.74
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	15,100	371,603.07	5,611,206,423	369,500	5,579,450,000	5.13
日本	投資証券	G L P 投資法人	30,868	184,318.41	5,689,540,953	180,300	5,565,500,400	5.12
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	30,821	166,703.28	5,137,961,928	161,400	4,974,509,400	4.58
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	48,088	101,497.16	4,880,795,600	97,800	4,703,006,400	4.33
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	14,311	325,009.56	4,651,211,883	323,500	4,629,608,500	4.26
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	18,990	181,830.99	3,452,970,647	180,500	3,427,695,000	3.15
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	9,529	360,995.24	3,439,923,730	348,500	3,320,856,500	3.05
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	21,456	142,481.71	3,057,087,748	144,600	3,102,537,600	2.85
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	13,531	207,219.03	2,803,880,802	202,800	2,744,086,800	2.52
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,264	415,036.75	2,599,790,231	404,500	2,533,788,000	2.33
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	28,931	85,299.62	2,467,803,530	82,500	2,386,807,500	2.20
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	5,080	454,971.27	2,311,254,087	432,000	2,194,560,000	2.02
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	11,668	190,702.21	2,225,113,408	187,200	2,184,249,600	2.01
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	3,543	588,079.1	2,083,564,276	583,000	2,065,569,000	1.90
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,291	634,058.27	2,086,685,795	620,000	2,040,420,000	1.88
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	2,948	709,050.26	2,090,280,172	689,000	2,031,172,000	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	6,227	331,001.76	2,061,147,982	314,000	1,955,278,000	1.80
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	29,198	66,789.42	1,950,117,654	58,600	1,711,002,800	1.57
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,208	154,604.12	1,732,802,993	152,000	1,703,616,000	1.57
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	11,207	155,600.78	1,743,818,029	150,400	1,685,532,800	1.55
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,341	510,043.89	1,704,056,650	497,000	1,660,477,000	1.53
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	41,949	43,443.53	1,822,412,785	38,050	1,596,159,450	1.47
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	8,891	171,011.69	1,520,464,955	166,700	1,482,129,700	1.36
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,015	732,093.41	1,475,168,226	714,000	1,438,710,000	1.32
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	12,878	113,100.38	1,456,506,799	109,400	1,408,853,200	1.30
日本	投資証券	N T T 都市開発リート投資法人	9,135	152,217.03	1,390,502,622	150,200	1,372,077,000	1.26
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,291	324,513.26	1,392,486,401	319,000	1,368,829,000	1.26
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	6,510	216,301.48	1,408,122,648	206,100	1,341,711,000	1.23

(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	96.16
合計	96.16

(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	2,068	円	4,248,706,000	4,141,170,000	3.81

(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	76,600,183,157	76.01
	オーストラリア	6,767,518,319	6.72
	イギリス	5,465,924,773	5.42
	シンガポール	3,392,411,742	3.37
	カナダ	1,893,041,290	1.88
	フランス	1,716,436,047	1.70
	ベルギー	1,334,912,343	1.32
	香港	1,327,418,626	1.32
	スペイン	401,101,595	0.40
	ニュージーランド	374,814,723	0.37
	ドイツ	294,338,577	0.29
	ガーンジー	261,616,880	0.26
	韓国	159,885,442	0.16
	オランダ	157,642,202	0.16
	アイルランド	112,170,629	0.11
	イスラエル	80,133,922	0.08
イタリア	26,342,894	0.03	
	小計	100,365,893,161	99.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		409,218,523	0.41
合計(純資産総額)		100,775,111,684	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		211,265,883	0.21

(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	406,711	16,892.19	6,870,242,985	17,438.66	7,092,497,125	7.04
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	49,406	90,764.49	4,484,310,403	93,291.39	4,609,154,908	4.57
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	180,980	19,056.47	3,448,840,590	18,196.37	3,293,179,730	3.27
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	83,810	36,975.24	3,098,895,702	37,759.12	3,164,592,291	3.14
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	155,348	17,878.95	2,777,459,979	19,203.23	2,983,184,663	2.96
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	303,677	7,839.21	2,380,590,461	7,941.14	2,411,543,394	2.39
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	232,180	9,714.82	2,255,586,977	9,333.69	2,167,096,330	2.15
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	76,991	27,327.33	2,103,958,902	27,393.54	2,109,056,084	2.09
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	927,343	1,915.05	1,775,916,492	1,995.66	1,850,670,141	1.84
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	187,703	9,745.53	1,829,266,757	9,809.24	1,841,225,540	1.83
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	76,504	23,549.14	1,801,603,857	23,352.43	1,786,554,320	1.77
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	73,849	22,502.30	1,661,772,529	23,100.99	1,705,985,638	1.69
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	63,632	23,044.11	1,466,343,030	23,891.69	1,520,276,654	1.51
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	316,289	4,611.09	1,458,439,607	4,695.28	1,485,067,915	1.47
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	63,578	22,042.93	1,401,445,881	22,384.24	1,423,145,688	1.41
イギリス	投資証券	SEGRE PLC	662,364	2,007.89	1,329,954,959	2,148.36	1,422,998,310	1.41
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	208,999	6,449.89	1,348,022,107	6,763.62	1,413,591,175	1.40
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	35,672	38,754.61	1,382,454,548	39,421.30	1,406,236,792	1.40
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	215,800	6,009.33	1,296,813,716	5,588.38	1,205,972,922	1.20
香港	投資証券	LINK REIT	1,145,400	1,014.00	1,161,441,327	1,002.33	1,148,072,218	1.14
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	295,356	3,865.90	1,141,818,119	3,875.00	1,144,506,331	1.14
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	338,799	3,326.63	1,127,060,544	3,200.35	1,084,275,414	1.08
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	55,087	18,538.82	1,021,248,060	19,210.06	1,058,224,823	1.05
アメリカ	投資証券	UDR INC	153,803	6,282.37	966,248,799	6,538.36	1,005,619,675	1.00
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	77,842	13,369.11	1,040,678,471	12,553.38	977,180,346	0.97
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	94,155	9,610.15	904,843,852	9,649.97	908,593,057	0.90
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	101,146	8,734.12	883,421,595	8,959.38	906,206,208	0.90
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	339,801	2,647.45	899,609,311	2,648.56	899,985,239	0.89
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	157,381	5,413.17	851,931,146	5,331.26	839,039,376	0.83
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	326,707	2,423.30	791,709,399	2,444.91	798,771,596	0.79

(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	99.59
合計	99.59

(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	1,470,000.00	167,227,200	167,234,941	0.17
	カナダドル	売建	150,000.00	13,387,800	13,388,595	0.01
	ユーロ	売建	150,000.00	19,261,950	19,261,845	0.02
	オーストラリアドル	売建	140,000.00	11,365,060	11,380,502	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。

参考情報

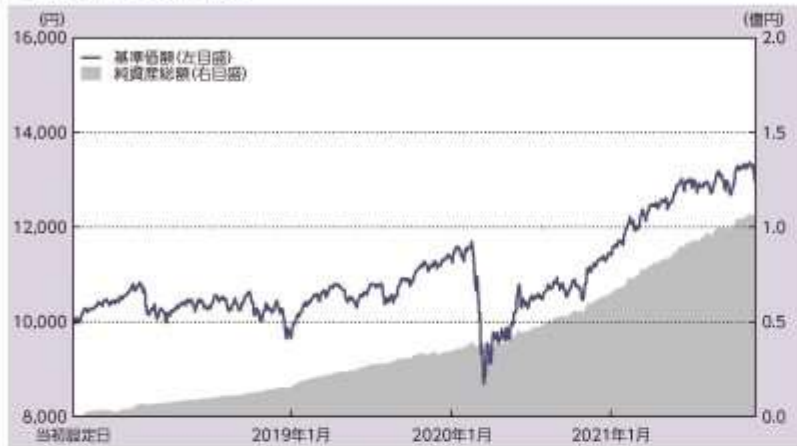
交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2017年 8月25日
作成基準日：2021年11月30日



SMT インデックスシリーズ

基準価額・純資産の推移


基準価額	12,974円
純資産総額	1.05億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年11月	0円
2020年 5月	0円
2020年11月	0円
2021年 5月	0円
2021年11月	0円
設定来 分配金合計額	0円

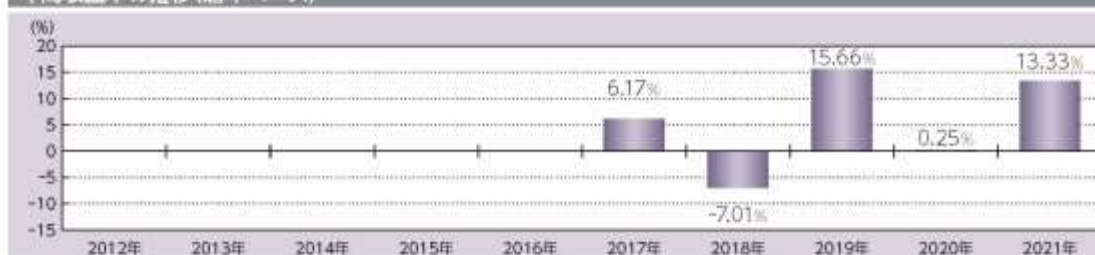
※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位短入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
グローバルREITインデックスマザーファンド	14.6%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	1.0%
		EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.7%
外国株式インデックスマザーファンド	14.5%	APPLE INC	アメリカ	株式	ソフトウェア・ウェアハウェア	-	-	0.7%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.6%
国内株式インデックスマザーファンド	12.4%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.5%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.4%
J-REITインデックスマザーファンド	12.3%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.9%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.7%
新興国株式インデックスマザーファンド	11.9%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.8%
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア・娯楽	-	-	0.5%
外国債券インデックスマザーファンド	11.7%	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.1%
		T 1.125% 02/15/31	アメリカ	国債	-	1.125%	2031/02/15	0.1%
		COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.3%
新興国債券インデックスマザーファンド	11.2%	BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	国債	-	0.000%	2024/01/01	0.2%
		第148回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/06/20	0.1%
国内債券インデックスマザーファンド	10.5%	第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)


※2017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、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、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。

< 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営業日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

< 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6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、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、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（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

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。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

(イ) 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。

(ロ) 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。

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル： 0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。（2017年 8月25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5月11日から11月10日まで及び11月11日から翌年5月10日までとします。

ただし、第1計算期間は2017年8月25日から2017年11月10日までとします。

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

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合は除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社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。

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2021年5月11日から2021年11月10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】

【SMT 8資産インデックスバランス・オープン】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 (2021年 5月10日現在)	第9期 (2021年11月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	847,810	947,570
親投資信託受益証券	82,802,279	103,075,165
未収入金	-	913,984
流動資産合計	83,650,089	104,936,719
資産合計	83,650,089	104,936,719
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,274	533,103
未払受託者報酬	19,313	26,330
未払委託者報酬	173,725	236,895
未払利息	-	2
その他未払費用	1,876	2,566
流動負債合計	202,188	798,896
負債合計	202,188	798,896
純資産の部		
元本等		
元本	66,114,632	78,719,863
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	17,333,269	25,417,960
(分配準備積立金)	11,598,161	15,052,533
元本等合計	83,447,901	104,137,823
純資産合計	83,447,901	104,137,823
負債純資産合計	83,650,089	104,936,719

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期		第9期	
	自	2020年11月11日 至 2021年 5月10日	自	2021年 5月11日 至 2021年11月10日
営業収益				
受取利息		-		1
有価証券売買等損益		9,506,403		4,712,842
営業収益合計		9,506,403		4,712,843
営業費用				
支払利息		50		148
受託者報酬		19,313		26,330
委託者報酬		173,725		236,895
その他費用		1,876		2,566
営業費用合計		194,964		265,939
営業利益又は営業損失（ ）		9,311,439		4,446,904
経常利益又は経常損失（ ）		9,311,439		4,446,904
当期純利益又は当期純損失（ ）		9,311,439		4,446,904
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（ ）		252,997		136,081
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		5,569,642		17,333,269
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,138,622		5,291,130
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,138,622		5,291,130
剰余金減少額又は欠損金増加額		433,437		1,517,262
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		433,437		1,517,262
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		17,333,269		25,417,960

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	第8期 (2021年 5月10日現在)	第9期 (2021年11月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	66,114,632口	78,719,863口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2622円 (12,622円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3229円 (13,229円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自 2020年11月11日 至 2021年 5月10日			第9期 自 2021年 5月11日 至 2021年11月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	864,725円	費用控除後の配当等収益額	A	1,130,937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	8,193,717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	3,179,886円
収益調整金額	C	6,370,691円	収益調整金額	C	10,682,944円
分配準備積立金額	D	2,539,719円	分配準備積立金額	D	10,741,710円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	17,968,852円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	25,735,477円
当ファンドの期末残存口数	F	66,114,632口	当ファンドの期末残存口数	F	78,719,863口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,717円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,269円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第9期 自 2021年 5月11日 至 2021年11月10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9期 (2021年11月10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8期	第9期
	自 2020年11月11日 至 2021年 5月10日	自 2021年 5月11日 至 2021年11月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	52,643,558円	66,114,632円
期中追加設定元本額	17,379,718円	18,347,554円
期中一部解約元本額	3,908,644円	5,742,323円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第8期	第9期
	(2021年 5月10日現在)	(2021年11月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	9,300,751	4,562,061
合計	9,300,751	4,562,061

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	5,899,172	12,916,237
	グローバルREITインデックス マザーファンド	6,057,416	14,961,211
	新興国株式インデックス マザーファンド	3,383,777	12,532,833
	国内株式インデックス マザーファンド	6,733,277	13,168,269
	外国株式インデックス マザーファンド	3,557,168	15,055,002
	国内債券インデックス マザーファンド	7,539,525	10,642,039
	外国債券インデックス マザーファンド	3,850,348	12,044,273
	新興国債券インデックス マザーファンド	6,654,572	11,755,301
合計		43,675,255	103,075,165

(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11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,363,426,305
株式	484,965,890,370
派生商品評価勘定	31,782,000
未収配当金	4,111,927,796
前払金	70,054,900
差入委託証拠金	219,300,000
流動資産合計	491,762,381,371
資産合計	491,762,381,371
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	101,904,550
未払解約金	71,156,267
未払利息	5,253
流動負債合計	173,066,070
負債合計	173,066,070
純資産の部	

	2021年11月10日現在
項目	金額（円）
元本等	
元本	251,362,690,536
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	240,226,624,765
元本等合計	491,589,315,301
純資産合計	491,589,315,301
負債純資産合計	491,762,381,371

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年11月10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11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	251,362,690,536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 1.9557円 (1万口当たり純資産額) (19,557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11月10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11月10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。

	2021年11月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 5月11日
期首元本額	248,363,141,878円
期中追加設定元本額	15,758,988,911円
期中一部解約元本額	12,759,440,253円
期末元本額	251,362,690,536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）	412,453,826円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,898,361,583円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,937,230円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,966,882,031円
世界経済インデックスファンド	3,246,336,748円
日本株式インデックス・オープン	3,407,973,799円
DCマイセレクション25	6,043,130,680円
DCマイセレクション50	17,964,847,745円
DCマイセレクション75	18,058,258,597円
DC日本株式インデックス・オープン	5,985,476,632円

区分	2021年11月10日現在
DCマイセレクションS25	2,985,343,818円
DCマイセレクションS50	8,591,616,955円
DCマイセレクションS75	6,288,213,751円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,917,295,236円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	222,954,159円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	692,620,574円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	494,320,789円
DC世界経済インデックスファンド	3,380,101,262円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,696,047,916円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	7,257,008円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	21,712,749円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	20,260,254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）	190,609,221円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,239,914円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	34,754,887円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	148,169,853円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	26,316,407円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	87,513,343円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,008,809,306円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	449,748,923円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,947,677,334円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	100,887,417円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	27,116,588円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	523,166,540円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	290,980,566円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	372,414,747円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	37,370,650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）	595,292,191円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,528,653,872円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,908,233,949円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,370,121,973円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,782,035,999円
分散投資コア戦略ファンドA	1,322,664,148円
分散投資コア戦略ファンドS	5,718,049,945円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	434,751,983円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	400,750,822円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,001,144,658円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	213,142,210円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,620,124円
SMT インデックスバランス・オープン	59,503,174円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	25,867,962,641円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	546,578,818円
SMT 世界経済インデックス・オープン	39,271,066円

区分	2021年11月10日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	138,357,190円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	25,870,776円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,733,277円
グローバル経済コア	217,558,036円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	24,322,277円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	79,049,276円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	19,858,349円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,226,885,412円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	157,096,979円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	5,135,154円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	3,561,085円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	1,755,515円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	2,147,224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)	41,992,296,798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)	1,074,242,823円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	235,182,961円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	36,102,836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)	47,686,777,614円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	4,685,065円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	61,115,278円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	20,787,486,800
合計	20,787,486,800

(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11月10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	6,781,784,900	-	6,711,730,000	70,054,900
合計		6,781,784,900	-	6,711,730,000	70,054,900

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	8,400	3,050.00	25,620,000	
日本水産	239,400	618.00	147,949,200	
マルハニチロ	37,500	2,452.00	91,950,000	
雪国まいたけ	17,500	1,373.00	24,027,500	
カネコ種苗	7,200	1,454.00	10,468,800	
サカタのタネ	28,500	3,365.00	95,902,500	
ホクト	20,100	1,960.00	39,396,000	
ホクリヨウ	3,200	752.00	2,406,400	
住石ホールディングス	41,900	139.00	5,824,100	
日鉄鉱業	5,500	6,340.00	34,870,000	
三井松島ホールディングス	10,000	1,409.00	14,090,000	
I N P E X	960,400	969.00	930,627,600	
石油資源開発	28,200	2,371.00	66,862,200	
K & O エナジーグループ	11,600	1,544.00	17,910,400	
ヒノキヤグループ	5,200	2,266.00	11,783,200	
ショーボンドホールディングス	34,200	4,825.00	165,015,000	
ミライト・ホールディングス	77,100	2,122.00	163,606,200	
タマホーム	14,500	2,302.00	33,379,000	
サンヨーホームズ	2,800	728.00	2,038,400	
日本アクア	9,500	645.00	6,127,500	
ファーストコーポレーション	7,300	770.00	5,621,000	
ベステラ	4,800	1,401.00	6,724,800	
Robot Home	39,900	269.00	10,733,100	
キャンディル	4,100	513.00	2,103,300	
スペースバリューホールディングス	26,500	982.00	26,023,000	
ダイセキ環境ソリューション	4,600	1,837.00	8,450,200	
第一カッター興業	5,900	1,385.00	8,171,500	
安藤・間	131,600	742.00	97,647,200	
東急建設	70,100	685.00	48,018,500	
コムシスホールディングス	77,200	2,831.00	218,553,200	

ビーアールホールディングス	32,600	426.00	13,887,600	
高松コンストラクショングループ	14,900	1,991.00	29,665,900	
東建コーポレーション	7,400	9,380.00	69,412,000	
ソネック	2,500	1,088.00	2,720,000	
ヤマウラ	11,500	925.00	10,637,500	
オリエンタル白石	80,500	269.00	21,654,500	
大成建設	159,800	3,645.00	582,471,000	
大林組	552,800	923.00	510,234,400	
清水建設	517,900	776.00	401,890,400	
飛鳥建設	14,800	1,048.00	15,510,400	
長谷工コーポレーション	164,600	1,473.00	242,455,800	
松井建設	21,800	737.00	16,066,600	
銭高組	2,400	4,000.00	9,600,000	
鹿島建設	405,100	1,400.00	567,140,000	
不動テトラ	11,700	1,767.00	20,673,900	
大末建設	5,800	1,186.00	6,878,800	
鉄建建設	12,000	1,800.00	21,600,000	
西松建設	33,500	3,415.00	114,402,500	
三井住友建設	124,600	416.00	51,833,600	
大豊建設	8,100	3,730.00	30,213,000	
佐田建設	12,200	486.00	5,929,200	
ナカノフドー建設	13,200	339.00	4,474,800	
奥村組	32,600	2,962.00	96,561,200	
東鉄工業	25,700	2,351.00	60,420,700	
イチケン	4,000	1,896.00	7,584,000	
富士ピー・エス	7,100	521.00	3,699,100	
浅沼組	6,200	4,550.00	28,210,000	
戸田建設	229,600	716.00	164,393,600	
熊谷組	28,200	2,756.00	77,719,200	
北野建設	3,400	2,167.00	7,367,800	
植木組	4,900	1,489.00	7,296,100	
矢作建設工業	24,400	706.00	17,226,400	
ピーエス三菱	18,200	628.00	11,429,600	
日本ハウスホールディングス	37,700	379.00	14,288,300	
大東建託	56,600	13,440.00	760,704,000	
新日本建設	23,500	838.00	19,693,000	
N I P P O	45,700	4,120.00	188,284,000	
東亜道路工業	2,900	5,070.00	14,703,000	
日本道路	5,300	8,080.00	42,824,000	
東亜建設工業	13,500	2,547.00	34,384,500	
日本国土開発	53,800	578.00	31,096,400	
若築建設	9,200	2,003.00	18,427,600	

東洋建設	62,000	556.00	34,472,000
五洋建設	219,100	758.00	166,077,800
世紀東急工業	26,500	791.00	20,961,500
福田組	5,900	4,565.00	26,933,500
住友林業	141,400	2,326.00	328,896,400
日本基礎技術	15,200	480.00	7,296,000
巴コーポレーション	24,500	456.00	11,172,000
大和ハウス工業	510,500	3,463.00	1,767,861,500
ライト工業	34,800	1,949.00	67,825,200
積水ハウス	599,600	2,381.50	1,427,947,400
日特建設	11,400	691.00	7,877,400
北陸電気工事	9,600	1,039.00	9,974,400
ユアテック	31,600	643.00	20,318,800
日本リーテック	11,600	1,525.00	17,690,000
四電工	6,000	1,583.00	9,498,000
中電工	25,500	2,157.00	55,003,500
関電工	89,900	862.00	77,493,800
きんでん	123,500	1,822.00	225,017,000
東京エネシス	18,400	1,076.00	19,798,400
トーエネック	5,600	3,270.00	18,312,000
住友電設	13,900	2,058.00	28,606,200
日本電設工業	30,300	1,705.00	51,661,500
エクシオグループ	83,800	2,665.00	223,327,000
新日本空調	14,600	2,259.00	32,981,400
九電工	42,700	3,500.00	149,450,000
三機工業	35,900	1,450.00	52,055,000
日揮ホールディングス	170,300	1,089.00	185,456,700
中外炉工業	5,500	1,702.00	9,361,000
ヤマト	16,200	761.00	12,328,200
太平電業	12,200	2,616.00	31,915,200
高砂熱学工業	50,000	2,094.00	104,700,000
三晃金属工業	2,200	2,407.00	5,295,400
朝日工業社	3,700	3,340.00	12,358,000
明星工業	35,800	649.00	23,234,200
大気社	26,900	3,285.00	88,366,500
ダイダン	12,300	2,240.00	27,552,000
日比谷総合設備	17,800	1,935.00	34,443,000
フィル・カンパニー	3,200	2,716.00	8,691,200
テスホールディングス	10,100	2,412.00	24,361,200
インフロニア・ホールディングス	235,700	923.00	217,551,100
東洋エンジニアリング	23,200	824.00	19,116,800
レイズネクスト	26,700	1,230.00	32,841,000

ニッポン	51,800	1,611.00	83,449,800
日清製粉グループ本社	199,900	1,720.00	343,828,000
日東富士製粉	2,600	3,405.00	8,853,000
昭和産業	16,700	2,783.00	46,476,100
鳥越製粉	15,700	756.00	11,869,200
中部飼料	19,900	1,049.00	20,875,100
フィード・ワン	23,800	801.00	19,063,800
東洋精糖	3,000	1,173.00	3,519,000
日本甜菜製糖	9,200	1,646.00	15,143,200
D M三井製糖ホールディングス	16,100	1,975.00	31,797,500
塩水港精糖	21,100	218.00	4,599,800
日新製糖	8,400	1,699.00	14,271,600
森永製菓	41,500	3,870.00	160,605,000
中村屋	4,300	3,705.00	15,931,500
江崎グリコ	48,700	3,935.00	191,634,500
名糖産業	7,800	1,712.00	13,353,600
井村屋グループ	10,000	2,282.00	22,820,000
不二家	9,900	2,311.00	22,878,900
山崎製パン	132,600	1,665.00	220,779,000
第一屋製パン	3,400	691.00	2,349,400
モロゾフ	2,800	5,450.00	15,260,000
亀田製菓	10,100	4,435.00	44,793,500
寿スピリッツ	17,000	6,920.00	117,640,000
カルビー	80,600	2,837.00	228,662,200
森永乳業	32,700	6,390.00	208,953,000
六甲バター	12,900	1,611.00	20,781,900
ヤクルト本社	131,100	5,890.00	772,179,000
明治ホールディングス	117,000	7,160.00	837,720,000
雪印メグミルク	42,600	2,076.00	88,437,600
プリマハム	22,100	2,530.00	55,913,000
日本ハム	67,600	4,110.00	277,836,000
林兼産業	5,400	579.00	3,126,600
丸大食品	17,400	1,670.00	29,058,000
S Foods	15,900	3,385.00	53,821,500
柿安本店	6,100	2,634.00	16,067,400
伊藤ハム米久ホールディングス	113,900	683.00	77,793,700
サッポロホールディングス	60,400	2,311.00	139,584,400
アサヒグループホールディングス	416,200	4,919.00	2,047,287,800
キリンホールディングス	650,300	1,880.50	1,222,889,150
宝ホールディングス	120,200	1,425.00	171,285,000
オエノンホールディングス	50,300	375.00	18,862,500
養命酒製造	5,400	1,807.00	9,757,800

コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	124,200	1,541.00	191,392,200	
サントリー食品インターナショナル	118,400	4,370.00	517,408,000	
ダイドーグループホールディングス	9,100	5,420.00	49,322,000	
伊藤園	53,700	7,480.00	401,676,000	
キーコーヒー	17,400	2,193.00	38,158,200	
ユニカフェ	5,300	1,093.00	5,792,900	
ジャパンフーズ	2,500	1,218.00	3,045,000	
日清オイリオグループ	22,100	2,990.00	66,079,000	
不二製油グループ本社	38,300	2,588.00	99,120,400	
かどや製油	1,900	4,070.00	7,733,000	
J - オイルミルズ	16,500	1,758.00	29,007,000	
キッコーマン	127,300	9,250.00	1,177,525,000	
味の素	390,700	3,500.00	1,367,450,000	
ブルドックソース	7,400	2,114.00	15,643,600	
キューピー	92,900	2,498.00	232,064,200	
ハウス食品グループ本社	66,200	3,080.00	203,896,000	
カゴメ	67,100	2,961.00	198,683,100	
焼津水産化学工業	8,600	986.00	8,479,600	
アリアケジャパン	16,200	6,820.00	110,484,000	
ピエトロ	2,300	1,785.00	4,105,500	
エバラ食品工業	3,900	2,457.00	9,582,300	
やまみ	1,900	2,061.00	3,915,900	
ニチレイ	84,300	2,634.00	222,046,200	
東洋水産	85,000	4,865.00	413,525,000	
イトアンドホールディングス	6,700	2,159.00	14,465,300	
大冷	2,000	1,920.00	3,840,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,100	771.00	7,016,100	
日清食品ホールディングス	69,400	8,860.00	614,884,000	
永谷園ホールディングス	7,900	2,036.00	16,084,400	
一正蒲鉾	6,900	913.00	6,299,700	
フジッコ	19,200	1,895.00	36,384,000	
ロック・フィールド	19,100	1,726.00	32,966,600	
日本たばこ産業	948,600	2,326.00	2,206,443,600	
ケンコーマヨネーズ	9,900	1,489.00	14,741,100	
わらべや日洋ホールディングス	11,600	2,101.00	24,371,600	
なとり	9,900	1,954.00	19,344,600	
イフジ産業	3,100	943.00	2,923,300	
ピクルスコーポレーション	8,400	1,778.00	14,935,200	
ファーマフーズ	16,700	2,572.00	42,952,400	
ユーグレナ	90,100	844.00	76,044,400	
紀文食品	10,300	1,134.00	11,680,200	
ミヨシ油脂	6,800	1,309.00	8,901,200	

理研ビタミン	18,400	1,776.00	32,678,400
片倉工業	19,500	2,255.00	43,972,500
グンゼ	11,700	4,135.00	48,379,500
東洋紡	68,600	1,322.00	90,689,200
ユニチカ	48,700	316.00	15,389,200
富士紡ホールディングス	7,800	4,045.00	31,551,000
倉敷紡績	15,000	1,939.00	29,085,000
シキボウ	9,000	925.00	8,325,000
日本毛織	52,600	901.00	47,392,600
トーア紡コーポレーション	6,400	435.00	2,784,000
帝国繊維	19,700	2,073.00	40,838,100
帝人	162,800	1,451.00	236,222,800
東レ	1,250,700	699.90	875,364,930
住江織物	3,800	1,746.00	6,634,800
日本フェルト	10,800	446.00	4,816,800
イチカワ	2,600	1,384.00	3,598,400
日東製網	1,900	1,467.00	2,787,300
アツギ	13,600	655.00	8,908,000
ダイニック	6,500	753.00	4,894,500
セーレン	35,600	2,285.00	81,346,000
ソトー	6,500	841.00	5,466,500
東海染工	2,200	1,115.00	2,453,000
小松マテーレ	28,600	1,096.00	31,345,600
ワコールホールディングス	43,200	2,185.00	94,392,000
ホギメディカル	23,300	3,065.00	71,414,500
T S Iホールディングス	58,300	374.00	21,804,200
マツオカコーポレーション	5,700	1,367.00	7,791,900
ワールド	22,700	1,523.00	34,572,100
三陽商会	8,300	912.00	7,569,600
ナイガイ	6,600	318.00	2,098,800
オンワードホールディングス	104,300	359.00	37,443,700
ルックホールディングス	5,600	1,413.00	7,912,800
ゴールドウイン	31,200	7,200.00	224,640,000
デサント	33,700	4,425.00	149,122,500
キング	8,800	543.00	4,778,400
ヤマトインターナショナル	15,800	309.00	4,882,200
特種東海製紙	10,600	4,300.00	45,580,000
王子ホールディングス	721,700	581.00	419,307,700
日本製紙	82,700	1,175.00	97,172,500
三菱製紙	24,500	352.00	8,624,000
北越コーポレーション	113,200	732.00	82,862,400
中越パルプ工業	6,600	1,152.00	7,603,200

巴川製紙所	5,300	808.00	4,282,400
大王製紙	83,200	2,021.00	168,147,200
阿波製紙	4,500	379.00	1,705,500
レンゴー	163,200	822.00	134,150,400
トーモク	10,600	1,869.00	19,811,400
ザ・パック	13,100	2,819.00	36,928,900
北の達人コーポレーション	61,800	418.00	25,832,400
クラレ	252,500	1,052.00	265,630,000
旭化成	1,144,300	1,148.00	1,313,656,400
共和レザー	10,700	661.00	7,072,700
昭和電工	149,700	2,728.00	408,381,600
住友化学	1,268,400	572.00	725,524,800
住友精化	7,600	3,245.00	24,662,000
日産化学	93,900	6,490.00	609,411,000
ラサ工業	6,100	1,888.00	11,516,800
クレハ	13,700	8,280.00	113,436,000
多木化学	6,700	6,000.00	40,200,000
テイカ	12,700	1,306.00	16,586,200
石原産業	28,700	1,292.00	37,080,400
片倉コープアグリ	4,200	1,167.00	4,901,400
日本曹達	22,100	3,320.00	73,372,000
東ソー	249,100	1,761.00	438,665,100
トクヤマ	55,200	1,983.00	109,461,600
セントラル硝子	28,200	2,064.00	58,204,800
東亜合成	98,300	1,240.00	121,892,000
大阪ソーダ	16,100	2,686.00	43,244,600
関東電化工業	37,800	1,050.00	39,690,000
デンカ	63,000	3,550.00	223,650,000
信越化学工業	296,400	19,870.00	5,889,468,000
日本カーバイド工業	6,000	1,326.00	7,956,000
堺化学工業	12,100	2,190.00	26,499,000
第一稀元素化学工業	16,000	1,449.00	23,184,000
エア・ウォーター	163,500	1,803.00	294,790,500
日本酸素ホールディングス	165,900	2,720.00	451,248,000
日本化学工業	5,400	2,895.00	15,633,000
東邦アセチレン	2,900	1,230.00	3,567,000
日本パーカライズिंग	87,100	1,127.00	98,161,700
高圧ガス工業	27,400	761.00	20,851,400
チタン工業	2,000	1,800.00	3,600,000
四国化成工業	22,500	1,420.00	31,950,000
戸田工業	3,700	3,365.00	12,450,500
ステラ ケミファ	8,700	2,668.00	23,211,600

保土谷化学工業	5,500	5,130.00	28,215,000
日本触媒	29,000	5,540.00	160,660,000
大日精化工業	14,300	2,599.00	37,165,700
カネカ	44,700	4,170.00	186,399,000
三菱瓦斯化学	160,600	2,076.00	333,405,600
三井化学	156,800	3,350.00	525,280,000
J S R	160,900	4,090.00	658,081,000
東京応化工業	29,600	7,380.00	218,448,000
大阪有機化学工業	14,700	3,765.00	55,345,500
三菱ケミカルホールディングス	1,154,100	932.70	1,076,429,070
K Hネオケム	28,500	3,195.00	91,057,500
ダイセル	248,700	821.00	204,182,700
住友ベークライト	27,100	5,330.00	144,443,000
積水化学工業	361,300	1,886.00	681,411,800
日本ゼオン	155,700	1,314.00	204,589,800
アイカ工業	48,100	3,375.00	162,337,500
宇部興産	81,400	2,071.00	168,579,400
積水樹脂	26,100	2,114.00	55,175,400
タキロンシーアイ	37,400	561.00	20,981,400
旭有機材	9,800	1,450.00	14,210,000
ニチバン	10,200	1,857.00	18,941,400
リケンテクノス	42,100	529.00	22,270,900
大倉工業	8,800	2,132.00	18,761,600
積水化成品工業	23,100	527.00	12,173,700
群栄化学工業	3,900	3,190.00	12,441,000
タイガースポリマー	9,100	423.00	3,849,300
ミライアル	5,500	1,598.00	8,789,000
ダイキアクシス	6,700	874.00	5,855,800
ダイキョーニシカワ	36,400	670.00	24,388,000
竹本容器	6,200	863.00	5,350,600
森六ホールディングス	9,300	1,843.00	17,139,900
恵和	4,300	5,010.00	21,543,000
日本化薬	136,000	1,214.00	165,104,000
カーリットホールディングス	17,100	765.00	13,081,500
日本精化	13,900	2,024.00	28,133,600
扶桑化学工業	15,500	4,900.00	75,950,000
トリケミカル研究所	17,800	3,435.00	61,143,000
A D E K A	79,500	2,558.00	203,361,000
日油	58,900	5,970.00	351,633,000
新日本理化	28,600	297.00	8,494,200
ハリマ化成グループ	12,800	850.00	10,880,000
花王	389,900	6,287.00	2,451,301,300

第一工業製薬	6,400	3,365.00	21,536,000
石原ケミカル	8,700	1,412.00	12,284,400
日華化学	5,800	887.00	5,144,600
ニイタカ	3,600	2,413.00	8,686,800
三洋化成工業	10,300	5,400.00	55,620,000
有機合成薬品工業	12,000	297.00	3,564,000
大日本塗料	21,100	845.00	17,829,500
日本ペイントホールディングス	648,700	1,175.00	762,222,500
関西ペイント	179,000	2,715.00	485,985,000
神東塗料	13,600	189.00	2,570,400
中国塗料	40,700	819.00	33,333,300
日本特殊塗料	12,900	1,002.00	12,925,800
藤倉化成	21,800	526.00	11,466,800
太陽ホールディングス	25,400	3,140.00	79,756,000
D I C	72,900	3,000.00	218,700,000
サカタインクス	34,300	1,072.00	36,769,600
東洋インキＳＣホールディングス	36,500	1,986.00	72,489,000
T & K T O K A	13,900	802.00	11,147,800
富士フィルムホールディングス	309,800	9,118.00	2,824,756,400
資生堂	328,400	7,589.00	2,492,227,600
ライオン	212,800	1,827.00	388,785,600
高砂香料工業	12,100	2,795.00	33,819,500
マンダム	37,000	1,646.00	60,902,000
ミルボン	21,700	6,930.00	150,381,000
ファンケル	71,300	3,470.00	247,411,000
コーセー	33,200	13,940.00	462,808,000
コタ	11,200	1,569.00	17,572,800
シーボン	2,300	1,804.00	4,149,200
ポーラ・オルビスホールディングス	75,200	2,265.00	170,328,000
ノエビアホールディングス	15,000	5,780.00	86,700,000
アジュバンホールディングス	3,900	1,237.00	4,824,300
新日本製薬	4,800	1,637.00	7,857,600
エステー	11,300	1,587.00	17,933,100
アグロ カネショウ	5,900	1,327.00	7,829,300
コニシ	29,000	1,733.00	50,257,000
長谷川香料	30,400	2,810.00	85,424,000
星光P M C	10,000	761.00	7,610,000
小林製薬	49,400	9,360.00	462,384,000
荒川化学工業	14,700	1,186.00	17,434,200
メック	13,200	3,405.00	44,946,000
日本高純度化学	4,800	2,797.00	13,425,600
タカラバイオ	46,100	2,761.00	127,282,100

J C U	19,800	4,635.00	91,773,000
新田ゼラチン	11,100	619.00	6,870,900
O A Tアグリオ	3,600	1,959.00	7,052,400
デクセリアルズ	45,800	3,310.00	151,598,000
アース製薬	14,500	6,510.00	94,395,000
北興化学工業	16,400	964.00	15,809,600
大成ラミック	5,400	2,828.00	15,271,200
クミアイ化学工業	65,600	872.00	57,203,200
日本農薬	31,400	546.00	17,144,400
アキレス	11,300	1,308.00	14,780,400
有沢製作所	25,700	945.00	24,286,500
日東電工	106,500	8,550.00	910,575,000
レック	23,000	989.00	22,747,000
三光合成	18,500	413.00	7,640,500
きもと	27,000	227.00	6,129,000
藤森工業	15,800	4,740.00	74,892,000
前澤化成工業	11,200	1,312.00	14,694,400
未来工業	6,300	1,656.00	10,432,800
ウェーブロックホールディングス	6,700	710.00	4,757,000
J S P	10,300	1,560.00	16,068,000
エフピコ	32,400	3,865.00	125,226,000
天馬	14,700	2,570.00	37,779,000
信越ポリマー	31,700	1,029.00	32,619,300
東リ	43,900	234.00	10,272,600
ニフコ	58,800	3,625.00	213,150,000
バルカー	14,300	2,414.00	34,520,200
ユニ・チャーム	339,800	4,564.00	1,550,847,200
ショーエイコーポレーション	4,700	793.00	3,727,100
協和キリン	206,900	3,670.00	759,323,000
武田薬品工業	1,385,500	3,232.00	4,477,936,000
アステラス製薬	1,528,400	1,971.50	3,013,240,600
大日本住友製薬	108,900	1,535.00	167,161,500
塩野義製薬	221,700	7,191.00	1,594,244,700
わかもと製薬	21,000	320.00	6,720,000
日本新薬	46,100	8,950.00	412,595,000
中外製薬	551,400	4,076.00	2,247,506,400
科研製薬	27,700	4,295.00	118,971,500
エーザイ	211,000	8,168.00	1,723,448,000
ロート製薬	90,500	3,420.00	309,510,000
小野薬品工業	404,800	2,411.50	976,175,200
久光製薬	46,600	3,860.00	179,876,000
持田製薬	22,200	3,375.00	74,925,000

参天製薬	328,700	1,548.00	508,827,600
扶桑薬品工業	6,200	2,482.00	15,388,400
日本ケミファ	2,100	2,144.00	4,502,400
ツムラ	54,600	3,575.00	195,195,000
日医工	54,700	888.00	48,573,600
キッセイ薬品工業	31,200	2,339.00	72,976,800
生化学工業	31,100	995.00	30,944,500
栄研化学	31,000	1,890.00	58,590,000
日水製薬	6,500	963.00	6,259,500
鳥居薬品	9,500	2,974.00	28,253,000
JCRファーマ	49,700	2,839.00	141,098,300
東和薬品	25,400	2,941.00	74,701,400
富士製薬工業	10,800	1,135.00	12,258,000
ゼリア新薬工業	32,000	2,035.00	65,120,000
第一三共	1,385,300	2,761.50	3,825,505,950
キョーリン製薬ホールディングス	35,400	1,789.00	63,330,600
大幸薬品	26,600	844.00	22,450,400
ダイト	11,300	3,075.00	34,747,500
大塚ホールディングス	366,400	4,443.00	1,627,915,200
大正製薬ホールディングス	41,900	5,980.00	250,562,000
ペプチドリーム	92,500	2,541.00	235,042,500
あすか製薬ホールディングス	20,100	1,002.00	20,140,200
サワイグループホールディングス	38,600	5,020.00	193,772,000
日本コークス工業	148,900	132.00	19,654,800
ニチレキ	22,500	1,292.00	29,070,000
ユシロ化学工業	9,100	1,154.00	10,501,400
ビーピー・カストロール	6,300	1,405.00	8,851,500
富士石油	47,100	266.00	12,528,600
MORESCO	5,800	1,155.00	6,699,000
出光興産	195,600	3,115.00	609,294,000
ENEOSホールディングス	2,651,900	464.30	1,231,277,170
コスモエネルギーホールディングス	51,000	2,401.00	122,451,000
横浜ゴム	102,100	1,858.00	189,701,800
TOYO TIRE	92,800	1,871.00	173,628,800
ブリヂストン	507,800	4,904.00	2,490,251,200
住友ゴム工業	158,400	1,249.00	197,841,600
藤倉コンポジット	14,100	727.00	10,250,700
オカモト	10,500	4,010.00	42,105,000
フコク	7,700	997.00	7,676,900
ニッタ	18,200	2,658.00	48,375,600
住友理工	34,200	615.00	21,033,000
三ツ星ベルト	21,400	1,934.00	41,387,600

バンドー化学	28,400	913.00	25,929,200
日東紡績	26,300	3,345.00	87,973,500
A G C	161,800	5,700.00	922,260,000
日本板硝子	84,600	570.00	48,222,000
石塚硝子	3,000	2,078.00	6,234,000
日本山村硝子	6,900	833.00	5,747,700
日本電気硝子	70,800	2,616.00	185,212,800
オハラ	7,000	1,475.00	10,325,000
住友大阪セメント	32,600	3,325.00	108,395,000
太平洋セメント	100,200	2,374.00	237,874,800
日本ヒューム	17,800	736.00	13,100,800
日本コンクリート工業	35,100	281.00	9,863,100
三谷セキサン	8,200	7,490.00	61,418,000
アジアパイルホールディングス	27,300	456.00	12,448,800
東海カーボン	147,800	1,295.00	191,401,000
日本カーボン	9,100	4,275.00	38,902,500
東洋炭素	11,500	3,140.00	36,110,000
ノリタケカンパニーリミテド	9,800	4,670.00	45,766,000
T O T O	125,900	5,340.00	672,306,000
日本碍子	191,000	1,953.00	373,023,000
日本特殊陶業	134,100	1,950.00	261,495,000
M A R U W A	6,100	13,220.00	80,642,000
品川リフラクトリーズ	4,200	3,630.00	15,246,000
黒崎播磨	3,000	4,120.00	12,360,000
ヨータイ	11,300	1,248.00	14,102,400
イソライト工業	7,900	859.00	6,786,100
東京窯業	22,700	319.00	7,241,300
ニッカトー	8,100	743.00	6,018,300
フジミインコーポレーテッド	14,200	7,430.00	105,506,000
クニミネ工業	5,600	1,094.00	6,126,400
エーアンドエーマテリアル	3,100	946.00	2,932,600
ニチアス	40,900	2,640.00	107,976,000
ニチハ	24,500	3,065.00	75,092,500
日本製鉄	780,200	1,891.50	1,475,748,300
神戸製鋼所	325,500	595.00	193,672,500
中山製鋼所	27,800	448.00	12,454,400
合同製鐵	9,400	1,422.00	13,366,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	470,800	1,464.00	689,251,200
東京製鐵	59,500	1,213.00	72,173,500
共英製鋼	19,700	1,325.00	26,102,500
大和工業	33,400	3,535.00	118,069,000
東京鐵鋼	7,700	1,439.00	11,080,300

大阪製鐵	9,300	1,064.00	9,895,200
淀川製鋼所	22,900	2,415.00	55,303,500
丸一鋼管	61,800	2,560.00	158,208,000
モリ工業	5,200	2,598.00	13,509,600
大同特殊鋼	28,600	4,115.00	117,689,000
日本高周波鋼業	6,600	388.00	2,560,800
日本冶金工業	12,700	2,228.00	28,295,600
山陽特殊製鋼	17,900	1,995.00	35,710,500
愛知製鋼	9,800	2,605.00	25,529,000
日立金属	187,800	2,150.00	403,770,000
日本金属	4,400	1,000.00	4,400,000
大平洋金属	10,800	2,030.00	21,924,000
新日本電工	112,700	313.00	35,275,100
栗本鐵工所	7,900	1,543.00	12,189,700
虹技	2,500	1,066.00	2,665,000
三菱製鋼	11,200	1,017.00	11,390,400
日亜鋼業	22,900	284.00	6,503,600
日本精線	2,900	4,500.00	13,050,000
エンビプロ・ホールディングス	7,400	2,185.00	16,169,000
シンニッタン	21,400	226.00	4,836,400
新家工業	4,300	1,654.00	7,112,200
大紀アルミニウム工業所	26,300	1,538.00	40,449,400
日本軽金属ホールディングス	44,200	1,756.00	77,615,200
三井金属鉱業	47,100	3,055.00	143,890,500
東邦亜鉛	9,700	2,483.00	24,085,100
三菱マテリアル	115,200	2,013.00	231,897,600
住友金属鉱山	222,800	4,353.00	969,848,400
D O W Aホールディングス	47,500	4,670.00	221,825,000
古河機械金属	28,900	1,241.00	35,864,900
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,300	878.00	17,823,400
東邦チタニウム	31,300	1,102.00	34,492,600
U A C J	26,500	2,621.00	69,456,500
C Kサンエツ	3,700	3,260.00	12,062,000
古河電気工業	54,200	2,458.00	133,223,600
住友電気工業	651,800	1,525.50	994,320,900
フジクラ	194,500	571.00	111,059,500
昭和電線ホールディングス	15,200	1,874.00	28,484,800
東京特殊電線	2,600	2,791.00	7,256,600
タツタ電線	30,900	488.00	15,079,200
カナレ電気	2,700	1,724.00	4,654,800
平河ヒューテック	9,700	1,192.00	11,562,400
リョービ	21,500	1,116.00	23,994,000

アーレスティ	18,800	380.00	7,144,000
アサヒホールディングス	69,800	2,047.00	142,880,600
稲葉製作所	9,800	1,343.00	13,161,400
宮地エンジニアリンググループ	5,300	2,586.00	13,705,800
トーカロ	45,000	1,331.00	59,895,000
アルファC o	6,700	1,227.00	8,220,900
SUMCO	268,300	2,365.00	634,529,500
川田テクノロジーズ	3,600	3,835.00	13,806,000
RS Technologies	5,700	6,640.00	37,848,000
ジェイテックコーポレーション	1,900	2,143.00	4,071,700
信和	10,800	775.00	8,370,000
東洋製罐グループホールディングス	111,000	1,446.00	160,506,000
ホッカンホールディングス	9,600	1,484.00	14,246,400
コロナ	9,600	900.00	8,640,000
横河ブリッジホールディングス	29,900	2,183.00	65,271,700
駒井ハルテック	3,300	1,618.00	5,339,400
高田機工	1,600	2,725.00	4,360,000
三和ホールディングス	164,400	1,275.00	209,610,000
文化シャッター	55,300	1,055.00	58,341,500
三協立山	22,500	747.00	16,807,500
アルインコ	12,700	963.00	12,230,100
東洋シャッター	3,800	654.00	2,485,200
LIXIL	274,400	2,925.00	802,620,000
日本フィルコン	12,100	544.00	6,582,400
ノーリツ	33,400	1,831.00	61,155,400
長府製作所	17,700	2,046.00	36,214,200
リンナイ	32,900	12,430.00	408,947,000
ダイニチ工業	8,300	783.00	6,498,900
日東精工	21,900	643.00	14,081,700
三洋工業	2,100	1,860.00	3,906,000
岡部	35,300	670.00	23,651,000
ジーテクト	21,600	1,400.00	30,240,000
東プレ	32,500	1,311.00	42,607,500
高周波熱錬	31,200	579.00	18,064,800
東京製綱	10,700	841.00	8,998,700
サンコール	14,900	476.00	7,092,400
モリテック スチール	13,600	415.00	5,644,000
パイオラックス	25,800	1,641.00	42,337,800
エイチワン	17,100	681.00	11,645,100
日本発條	160,300	855.00	137,056,500
中央発條	8,400	895.00	7,518,000
アドバネクス	2,400	1,055.00	2,532,000

立川ブラインド工業	7,700	1,203.00	9,263,100
三益半導体工業	13,600	2,501.00	34,013,600
日本ドライケミカル	4,400	1,960.00	8,624,000
日本製鋼所	53,000	3,315.00	175,695,000
三浦工業	75,500	4,300.00	324,650,000
タクマ	59,300	1,446.00	85,747,800
ツガミ	42,400	1,489.00	63,133,600
オークマ	20,400	5,340.00	108,936,000
芝浦機械	19,800	2,994.00	59,281,200
アマダ	275,500	1,131.00	311,590,500
アイダエンジニアリング	46,000	986.00	45,356,000
滝澤鉄工所	5,100	1,128.00	5,752,800
F U J I	80,400	2,484.00	199,713,600
牧野フライス製作所	19,200	3,805.00	73,056,000
オーエスジー	80,800	1,863.00	150,530,400
ダイジェット工業	2,300	1,106.00	2,543,800
旭ダイヤモンド工業	46,300	684.00	31,669,200
D M G 森精機	103,600	1,943.00	201,294,800
ソディック	38,700	869.00	33,630,300
ディスコ	25,700	32,900.00	845,530,000
日東工器	9,600	1,878.00	18,028,800
日進工具	13,800	1,572.00	21,693,600
パンチ工業	14,700	564.00	8,290,800
富士ダイス	8,900	643.00	5,722,700
豊和工業	9,400	811.00	7,623,400
O K K	6,700	374.00	2,505,800
東洋機械金属	11,600	557.00	6,461,200
津田駒工業	3,400	802.00	2,726,800
エンシュウ	4,400	710.00	3,124,000
島精機製作所	25,700	2,159.00	55,486,300
オプトラン	21,900	2,147.00	47,019,300
N C ホールディングス	5,000	1,607.00	8,035,000
イワキポンプ	11,200	1,060.00	11,872,000
フリー	15,600	1,592.00	24,835,200
ヤマシンフィルタ	35,300	632.00	22,309,600
日阪製作所	21,600	848.00	18,316,800
やまびこ	33,900	1,247.00	42,273,300
野村マイクロ・サイエンス	4,600	4,940.00	22,724,000
平田機工	8,300	6,880.00	57,104,000
ペガサスミシン製造	17,900	511.00	9,146,900
マルマエ	7,200	2,340.00	16,848,000
タツモ	8,200	1,735.00	14,227,000

ナブテスコ	99,500	3,710.00	369,145,000
三井海洋開発	18,600	1,581.00	29,406,600
レオン自動機	18,700	1,401.00	26,198,700
S M C	51,600	70,200.00	3,622,320,000
ホソカワミクロン	12,300	3,090.00	38,007,000
ユニオンツール	6,500	3,915.00	25,447,500
オイレス工業	24,500	1,673.00	40,988,500
日精エー・エス・ビー機械	5,900	3,840.00	22,656,000
サトーホールディングス	23,000	2,606.00	59,938,000
技研製作所	15,400	4,440.00	68,376,000
日本エアーテック	8,100	1,255.00	10,165,500
カワタ	5,600	967.00	5,415,200
日精樹脂工業	12,500	1,098.00	13,725,000
オカダアイヨン	5,600	1,265.00	7,084,000
ワイエイシイホールディングス	6,900	926.00	6,389,400
小松製作所	799,000	3,026.00	2,417,774,000
住友重機械工業	101,000	2,851.00	287,951,000
日立建機	70,700	3,645.00	257,701,500
日工	24,700	659.00	16,277,300
巴工業	7,000	2,240.00	15,680,000
井関農機	16,600	1,653.00	27,439,800
T O W A	15,100	2,912.00	43,971,200
丸山製作所	3,800	1,480.00	5,624,000
北川鉄工所	8,200	1,560.00	12,792,000
ローツェ	8,700	11,900.00	103,530,000
タカキタ	6,300	655.00	4,126,500
クボタ	860,000	2,301.00	1,978,860,000
荏原実業	8,200	2,611.00	21,410,200
三菱化工機	5,800	2,463.00	14,285,400
月島機械	32,800	1,157.00	37,949,600
帝国電機製作所	12,400	1,390.00	17,236,000
新東工業	39,300	723.00	28,413,900
澁谷工業	15,500	2,988.00	46,314,000
アイチ コーポレーション	26,200	797.00	20,881,400
小森コーポレーション	45,200	750.00	33,900,000
鶴見製作所	13,800	1,766.00	24,370,800
住友精密工業	2,700	2,298.00	6,204,600
日本ギア工業	6,700	288.00	1,929,600
酒井重工業	3,300	2,550.00	8,415,000
荏原製作所	73,200	6,280.00	459,696,000
石井鐵工所	2,600	2,966.00	7,711,600
西島製作所	16,400	915.00	15,006,000

北越工業	16,900	995.00	16,815,500
ダイキン工業	224,600	25,150.00	5,648,690,000
オルガノ	5,100	6,890.00	35,139,000
トーヨーカネツ	6,800	2,569.00	17,469,200
栗田工業	95,500	5,770.00	551,035,000
椿本チエイン	23,200	3,135.00	72,732,000
大同工業	8,200	990.00	8,118,000
木村化工機	15,200	755.00	11,476,000
アネスト岩田	27,500	917.00	25,217,500
ダイフク	97,000	9,820.00	952,540,000
サムコ	4,400	2,807.00	12,350,800
加藤製作所	8,800	825.00	7,260,000
油研工業	3,200	1,760.00	5,632,000
タダノ	92,400	1,152.00	106,444,800
フジテック	65,400	2,526.00	165,200,400
C K D	52,100	2,365.00	123,216,500
キトー	15,000	1,721.00	25,815,000
平和	49,200	2,124.00	104,500,800
理想科学工業	14,800	1,998.00	29,570,400
S A N K Y O	38,100	3,015.00	114,871,500
日本金銭機械	18,000	772.00	13,896,000
マースグループホールディングス	11,300	1,634.00	18,464,200
フクシマガリレイ	12,100	4,545.00	54,994,500
オーイズミ	6,500	382.00	2,483,000
ダイコク電機	8,200	1,245.00	10,209,000
竹内製作所	26,900	2,930.00	78,817,000
アマノ	46,200	2,708.00	125,109,600
J U K I	24,500	771.00	18,889,500
ジャノメ	15,100	683.00	10,313,300
マックス	23,500	1,856.00	43,616,000
グローリー	45,300	2,321.00	105,141,300
新晃工業	16,400	1,930.00	31,652,000
大和冷機工業	25,600	1,282.00	32,819,200
セガサミーホールディングス	174,900	1,863.00	325,838,700
日本ピストンリング	6,500	1,299.00	8,443,500
リケン	7,600	2,715.00	20,634,000
T P R	23,800	1,452.00	34,557,600
ツバキ・ナカシマ	38,700	1,592.00	61,610,400
ホシザキ	51,500	9,110.00	469,165,000
大豊工業	14,500	776.00	11,252,000
日本精工	332,000	757.00	251,324,000
N T N	378,800	227.00	85,987,600

ジェイテクト	169,200	1,003.00	169,707,600
不二越	15,000	4,245.00	63,675,000
日本トムソン	48,500	596.00	28,906,000
T H K	102,600	2,400.00	246,240,000
ユーシン精機	13,800	762.00	10,515,600
前澤給装工業	13,300	1,059.00	14,084,700
イーグル工業	21,900	1,216.00	26,630,400
前澤工業	10,700	661.00	7,072,700
日本ピラー工業	17,900	2,853.00	51,068,700
キッツ	59,500	769.00	45,755,500
マキタ	214,600	5,188.00	1,113,344,800
三井E & Sホールディングス	63,700	430.00	27,391,000
日立造船	149,500	838.00	125,281,000
三菱重工業	277,100	2,829.00	783,915,900
I H I	110,200	2,563.00	282,442,600
スター精密	27,200	1,492.00	40,582,400
日清紡ホールディングス	107,800	889.00	95,834,200
イビデン	92,700	6,880.00	637,776,000
コニカミノルタ	387,100	506.00	195,872,600
ブラザー工業	215,800	2,157.00	465,480,600
ミネベアミツミ	304,200	3,105.00	944,541,000
日立製作所	847,800	7,014.00	5,946,469,200
東芝	308,100	4,903.00	1,510,614,300
三菱電機	1,762,700	1,525.50	2,688,998,850
富士電機	106,200	5,670.00	602,154,000
東洋電機製造	6,900	1,017.00	7,017,300
安川電機	189,700	5,040.00	956,088,000
シンフォニアテクノロジー	21,200	1,342.00	28,450,400
明電舎	29,900	2,669.00	79,803,100
オリジン	4,500	1,336.00	6,012,000
山洋電気	8,000	6,160.00	49,280,000
デンヨー	15,000	1,961.00	29,415,000
東芝テック	18,900	4,525.00	85,522,500
芝浦メカトロニクス	3,300	7,730.00	25,509,000
マブチモーター	41,600	3,775.00	157,040,000
日本電産	457,000	12,805.00	5,851,885,000
トレックス・セミコンダクター	9,300	2,682.00	24,942,600
東光高岳	10,600	1,410.00	14,946,000
ダイヘン	19,300	4,555.00	87,911,500
ヤーマン	29,700	1,423.00	42,263,100
J V C ケンウッド	149,100	179.00	26,688,900
ミマキエンジニアリング	17,000	996.00	16,932,000

I - P E X	8,800	2,035.00	17,908,000
日新電機	41,300	1,437.00	59,348,100
大崎電気工業	32,400	506.00	16,394,400
オムロン	146,700	11,125.00	1,632,037,500
日東工業	23,500	1,587.00	37,294,500
I D E C	21,800	2,537.00	55,306,600
正興電機製作所	6,400	1,225.00	7,840,000
不二電機工業	4,200	1,268.00	5,325,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	59,300	2,167.00	128,503,100
サクサホールディングス	4,100	1,422.00	5,830,200
メルコホールディングス	5,100	4,275.00	21,802,500
テクノメディカ	4,700	1,694.00	7,961,800
日本電気	224,000	5,530.00	1,238,720,000
富士通	158,600	20,485.00	3,248,921,000
沖電気工業	71,600	958.00	68,592,800
岩崎通信機	7,400	878.00	6,497,200
電気興業	9,300	2,545.00	23,668,500
サンケン電気	16,500	5,540.00	91,410,000
ナカヨ	3,300	1,314.00	4,336,200
アイホン	10,000	2,286.00	22,860,000
ルネサスエレクトロニクス	955,000	1,453.00	1,387,615,000
セイコーエプソン	218,700	1,941.00	424,496,700
ワコム	138,200	804.00	111,112,800
アルバック	32,400	6,600.00	213,840,000
アクセル	9,000	758.00	6,822,000
E I Z O	13,700	4,195.00	57,471,500
日本信号	44,900	925.00	41,532,500
京三製作所	37,800	482.00	18,219,600
能美防災	23,800	2,023.00	48,147,400
ホーチキ	13,700	1,284.00	17,590,800
星和電機	10,200	536.00	5,467,200
エレコム	41,000	1,507.00	61,787,000
パナソニック	1,880,200	1,380.00	2,594,676,000
シャープ	200,900	1,316.00	264,384,400
アンリツ	113,500	1,946.00	220,871,000
富士通ゼネラル	47,900	2,728.00	130,671,200
ソニーグループ	1,104,300	13,725.00	15,156,517,500
T D K	255,600	4,470.00	1,142,532,000
帝国通信工業	8,600	1,331.00	11,446,600
タムラ製作所	67,900	733.00	49,770,700
アルプスアルパイン	156,900	1,085.00	170,236,500
池上通信機	5,300	768.00	4,070,400

鈴木	9,100	981.00	8,927,100
メイコー	14,700	4,105.00	60,343,500
日本トリム	3,600	3,440.00	12,384,000
ローランド ディー・ジー・	10,800	2,999.00	32,389,200
フォスター電機	17,800	779.00	13,866,200
S M K	4,100	2,399.00	9,835,900
ヨコオ	13,500	2,458.00	33,183,000
ホシデン	43,500	1,280.00	55,680,000
ヒロセ電機	27,200	18,770.00	510,544,000
日本航空電子工業	40,400	1,831.00	73,972,400
T O A	19,300	813.00	15,690,900
マクセル	35,800	1,338.00	47,900,400
古野電気	21,900	1,212.00	26,542,800
ユニデンホールディングス	3,900	3,300.00	12,870,000
スミダコーポレーション	17,400	1,285.00	22,359,000
アイコム	6,700	2,415.00	16,180,500
リオン	7,200	2,307.00	16,610,400
本多通信工業	16,100	455.00	7,325,500
横河電機	176,400	2,290.00	403,956,000
新電元工業	6,800	3,660.00	24,888,000
アズビル	103,300	4,990.00	515,467,000
東亜ディーケーケー	10,000	840.00	8,400,000
日本光電工業	73,100	3,375.00	246,712,500
チノー	5,600	1,438.00	8,052,800
共和電業	16,900	400.00	6,760,000
日本電子材料	8,600	2,196.00	18,885,600
堀場製作所	32,600	7,700.00	251,020,000
アドバンテスト	131,000	9,890.00	1,295,590,000
小野測器	9,500	505.00	4,797,500
エスペック	14,800	2,314.00	34,247,200
キーエンス	159,700	70,660.00	11,284,402,000
日置電機	8,600	8,430.00	72,498,000
シスメックス	149,100	13,660.00	2,036,706,000
日本マイクロニクス	31,400	1,635.00	51,339,000
メガチップス	16,700	4,270.00	71,309,000
O B A R A G R O U P	8,300	3,685.00	30,585,500
澤藤電機	2,700	1,935.00	5,224,500
原田工業	9,400	968.00	9,099,200
コーセル	22,700	925.00	20,997,500
イリソ電子工業	15,000	5,040.00	75,600,000
オブテックスグループ	29,700	1,500.00	44,550,000
千代田インテグレ	7,900	2,137.00	16,882,300

アイ・オー・データ機器	7,700	894.00	6,883,800
レーザーテック	77,400	26,565.00	2,056,131,000
スタンレー電気	123,700	3,060.00	378,522,000
岩崎電気	7,000	2,125.00	14,875,000
ウシオ電機	90,900	2,245.00	204,070,500
岡谷電機産業	15,900	345.00	5,485,500
ハリオス テクノ ホールディング	18,700	303.00	5,666,100
エノモト	5,500	1,880.00	10,340,000
日本セラミック	16,800	2,884.00	48,451,200
遠藤照明	9,100	1,104.00	10,046,400
古河電池	13,300	1,496.00	19,896,800
双信電機	9,100	651.00	5,924,100
山一電機	13,400	2,050.00	27,470,000
図研	11,700	4,280.00	50,076,000
日本電子	36,800	9,010.00	331,568,000
カシオ計算機	127,600	1,568.00	200,076,800
ファナック	154,700	22,200.00	3,434,340,000
日本シイエムケイ	37,200	524.00	19,492,800
エンプラス	4,700	2,780.00	13,066,000
大真空	24,800	1,181.00	29,288,800
ローム	79,000	11,120.00	878,480,000
浜松ホトニクス	126,600	6,800.00	860,880,000
三井ハイテック	17,400	9,420.00	163,908,000
新光電気工業	52,000	4,885.00	254,020,000
京セラ	248,200	6,922.00	1,718,040,400
太陽誘電	85,700	6,090.00	521,913,000
村田製作所	517,900	8,425.00	4,363,307,500
双葉電子工業	31,600	810.00	25,596,000
北陸電気工業	7,700	1,060.00	8,162,000
ニチコン	56,500	1,134.00	64,071,000
日本ケミコン	16,700	2,006.00	33,500,200
K O A	27,300	1,616.00	44,116,800
市光工業	23,100	563.00	13,005,300
小糸製作所	97,000	6,450.00	625,650,000
ミツバ	32,400	601.00	19,472,400
S C R E E Nホールディングス	30,600	11,040.00	337,824,000
キャノン電子	16,900	1,579.00	26,685,100
キャノン	875,900	2,566.00	2,247,559,400
リコー	489,200	1,094.00	535,184,800
象印マホービン	48,400	1,631.00	78,940,400
M U T O Hホールディングス	2,900	1,621.00	4,700,900
東京エレクトロン	111,900	56,000.00	6,266,400,000

トヨタ紡織	71,900	2,237.00	160,840,300
芦森工業	3,300	984.00	3,247,200
ユニプレス	26,300	878.00	23,091,400
豊田自動織機	142,700	9,800.00	1,398,460,000
モリタホールディングス	28,200	1,401.00	39,508,200
三櫻工業	24,400	983.00	23,985,200
デンソー	388,100	8,241.00	3,198,332,100
東海理化電機製作所	46,400	1,592.00	73,868,800
川崎重工業	128,700	2,073.00	266,795,100
名村造船所	52,900	215.00	11,373,500
日本車輛製造	6,400	2,078.00	13,299,200
三菱ロジスネクスト	23,300	1,043.00	24,301,900
近畿車輛	2,700	1,066.00	2,878,200
日産自動車	2,079,000	634.00	1,318,086,000
いすゞ自動車	553,100	1,575.00	871,132,500
トヨタ自動車	8,929,000	2,005.50	17,907,109,500
日野自動車	220,100	1,079.00	237,487,900
三菱自動車工業	652,500	377.00	245,992,500
エフテック	12,300	543.00	6,678,900
レシップホールディングス	7,000	574.00	4,018,000
G M B	3,200	761.00	2,435,200
ファルテック	3,100	710.00	2,201,000
武蔵精密工業	39,300	1,829.00	71,879,700
日産車体	25,800	742.00	19,143,600
新明和工業	49,800	912.00	45,417,600
極東開発工業	32,700	1,524.00	49,834,800
トピー工業	14,500	1,112.00	16,124,000
ティラド	5,000	2,851.00	14,255,000
曙ブレーキ工業	96,800	236.00	22,844,800
タチエス	30,900	1,383.00	42,734,700
N O K	85,300	1,323.00	112,851,900
フタバ産業	44,100	419.00	18,477,900
K Y B	18,300	3,075.00	56,272,500
大同メタル工業	33,800	598.00	20,212,400
プレス工業	87,400	410.00	35,834,000
ミクニ	22,400	319.00	7,145,600
太平洋工業	36,900	1,158.00	42,730,200
河西工業	21,600	325.00	7,020,000
アイシン	129,000	4,070.00	525,030,000
マツダ	553,200	1,034.00	572,008,800
今仙電機製作所	12,100	618.00	7,477,800
本田技研工業	1,387,900	3,260.00	4,524,554,000

スズキ	403,200	5,273.00	2,126,073,600
S U B A R U	505,200	2,163.50	1,093,000,200
安永	8,500	1,057.00	8,984,500
ヤマハ発動機	230,000	3,145.00	723,350,000
T B K	20,000	415.00	8,300,000
エクセディ	26,600	1,697.00	45,140,200
豊田合成	56,900	2,308.00	131,325,200
愛三工業	27,600	789.00	21,776,400
盟和産業	2,600	1,025.00	2,665,000
日本プラスト	13,800	609.00	8,404,200
ヨロズ	16,500	1,193.00	19,684,500
エフ・シー・シー	28,800	1,535.00	44,208,000
シマノ	71,000	31,320.00	2,223,720,000
テイ・エス テック	74,400	1,377.00	102,448,800
ジャムコ	10,300	985.00	10,145,500
テルモ	498,800	4,753.00	2,370,796,400
クリエートメディック	5,300	980.00	5,194,000
日機装	52,900	1,000.00	52,900,000
日本エム・ディ・エム	10,200	2,140.00	21,828,000
島津製作所	226,900	4,665.00	1,058,488,500
J M S	14,900	635.00	9,461,500
長野計器	12,800	1,399.00	17,907,200
ブイ・テクノロジー	7,700	3,765.00	28,990,500
東京計器	11,200	1,001.00	11,211,200
愛知時計電機	2,500	4,490.00	11,225,000
インターアクション	8,800	2,419.00	21,287,200
オーバル	15,900	256.00	4,070,400
東京精密	29,800	5,230.00	155,854,000
マニー	70,200	1,887.00	132,467,400
ニコン	269,200	1,160.00	312,272,000
トプコン	82,900	1,952.00	161,820,800
オリンパス	924,400	2,570.00	2,375,708,000
理研計器	14,300	3,065.00	43,829,500
タムロン	13,700	2,509.00	34,373,300
H O Y A	344,000	17,530.00	6,030,320,000
シード	8,300	613.00	5,087,900
ノーリツ鋼機	15,900	2,474.00	39,336,600
エー・アンド・デイ	16,100	1,326.00	21,348,600
朝日インテック	193,300	2,840.00	548,972,000
シチズン時計	206,500	465.00	96,022,500
リズム	5,500	1,355.00	7,452,500
大研医器	14,000	562.00	7,868,000

メニコン	58,400	4,265.00	249,076,000
シンシア	1,900	580.00	1,102,000
松風	7,400	2,318.00	17,153,200
セイコーホールディングス	24,900	2,211.00	55,053,900
ニプロ	131,400	1,133.00	148,876,200
中本パックス	4,900	1,700.00	8,330,000
スノーピーク	11,500	6,230.00	71,645,000
パラマウントベッドホールディングス	33,800	2,009.00	67,904,200
トランザクション	9,600	1,126.00	10,809,600
粧美堂	5,100	405.00	2,065,500
ニホンフラッシュ	15,100	1,094.00	16,519,400
前田工織	19,400	3,500.00	67,900,000
永大産業	23,000	294.00	6,762,000
アートネイチャー	15,100	685.00	10,343,500
バンダイナムコホールディングス	157,900	9,274.00	1,464,364,600
アイフィスジャパン	4,500	678.00	3,051,000
共立印刷	29,500	154.00	4,543,000
SHOEI	16,500	5,030.00	82,995,000
フランスベッドホールディングス	22,700	899.00	20,407,300
パイロットコーポレーション	29,700	4,170.00	123,849,000
萩原工業	11,400	1,482.00	16,894,800
トッパン・フォームズ	25,200	1,022.00	25,754,400
フジシールインターナショナル	42,800	2,465.00	105,502,000
タカラトミー	73,800	1,056.00	77,932,800
広済堂ホールディングス	10,900	916.00	9,984,400
エステールホールディングス	4,500	642.00	2,889,000
タカノ	6,000	717.00	4,302,000
プロネクサス	13,700	1,049.00	14,371,300
ホクシン	12,400	175.00	2,170,000
ウッドワン	5,400	1,007.00	5,437,800
大建工業	10,400	2,434.00	25,313,600
凸版印刷	267,900	1,787.00	478,737,300
大日本印刷	208,300	2,822.00	587,822,600
共同印刷	5,400	2,740.00	14,796,000
N I S S H A	36,200	1,855.00	67,151,000
光村印刷	1,500	1,530.00	2,295,000
TAKARA & COMPANY	8,600	1,807.00	15,540,200
アシックス	155,900	2,891.00	450,706,900
ツツミ	4,400	2,236.00	9,838,400
ローランド	12,200	4,935.00	60,207,000
小松ウオール工業	5,400	1,942.00	10,486,800
ヤマハ	104,800	6,350.00	665,480,000

河合楽器製作所	4,900	3,470.00	17,003,000
クリナップ	16,400	519.00	8,511,600
ピジョン	106,500	2,454.00	261,351,000
兼松サステック	1,100	1,799.00	1,978,900
キングジム	14,200	893.00	12,680,600
リンテック	37,800	2,513.00	94,991,400
イトーキ	32,500	366.00	11,895,000
任天堂	99,500	49,740.00	4,949,130,000
三菱鉛筆	29,000	1,272.00	36,888,000
タカラスタANDARD	36,400	1,438.00	52,343,200
コクヨ	84,600	1,727.00	146,104,200
ナカバヤシ	16,000	550.00	8,800,000
グローブライド	15,800	3,460.00	54,668,000
オカムラ	60,600	1,375.00	83,325,000
美津濃	17,500	2,673.00	46,777,500
東京電力ホールディングス	1,319,300	306.00	403,705,800
中部電力	539,300	1,141.00	615,341,300
関西電力	667,900	1,051.00	701,962,900
中国電力	275,500	868.00	239,134,000
北陸電力	161,200	532.00	85,758,400
東北電力	412,800	741.00	305,884,800
四国電力	158,700	698.00	110,772,600
九州電力	363,300	811.00	294,636,300
北海道電力	153,200	454.00	69,552,800
沖縄電力	37,400	1,394.00	52,135,600
電源開発	150,300	1,442.00	216,732,600
エフオン	10,700	786.00	8,410,200
イーレックス	25,900	2,380.00	61,642,000
レノバ	34,400	5,280.00	181,632,000
東京瓦斯	337,900	1,986.00	671,069,400
大阪瓦斯	319,300	1,827.00	583,361,100
東邦瓦斯	80,900	3,220.00	260,498,000
北海道瓦斯	8,700	1,516.00	13,189,200
広島ガス	33,800	367.00	12,404,600
西部ガスホールディングス	19,800	2,184.00	43,243,200
静岡ガス	45,900	1,132.00	51,958,800
メタウォーター	19,800	2,026.00	40,114,800
SBSホールディングス	13,000	3,660.00	47,580,000
東武鉄道	172,200	2,776.00	478,027,200
相鉄ホールディングス	56,400	2,127.00	119,962,800
東急	444,600	1,682.00	747,817,200
京浜急行電鉄	226,400	1,272.00	287,980,800

小田急電鉄	262,200	2,293.00	601,224,600
京王電鉄	91,500	5,350.00	489,525,000
京成電鉄	122,700	3,540.00	434,358,000
富士急行	21,000	4,940.00	103,740,000
新京成電鉄	4,100	2,034.00	8,339,400
東日本旅客鉄道	310,300	7,103.00	2,204,060,900
西日本旅客鉄道	213,700	5,381.00	1,149,919,700
東海旅客鉄道	146,600	16,925.00	2,481,205,000
西武ホールディングス	230,100	1,300.00	299,130,000
鴻池運輸	28,100	1,211.00	34,029,100
西日本鉄道	48,900	2,764.00	135,159,600
ハマキョウレックス	12,500	3,065.00	38,312,500
サカイ引越センター	8,100	4,585.00	37,138,500
近鉄グループホールディングス	167,000	3,560.00	594,520,000
阪急阪神ホールディングス	208,700	3,570.00	745,059,000
南海電気鉄道	74,500	2,203.00	164,123,500
京阪ホールディングス	74,300	2,980.00	221,414,000
神戸電鉄	4,000	3,435.00	13,740,000
名古屋鉄道	137,300	1,946.00	267,185,800
山陽電気鉄道	12,800	2,007.00	25,689,600
アルプス物流	11,600	1,042.00	12,087,200
日本通運	57,800	7,000.00	404,600,000
ヤマトホールディングス	233,900	2,756.00	644,628,400
山九	46,400	4,750.00	220,400,000
丸運	9,500	263.00	2,498,500
丸全昭和運輸	13,500	3,445.00	46,507,500
センコーグループホールディングス	83,700	985.00	82,444,500
トナミホールディングス	4,000	4,215.00	16,860,000
ニッコンホールディングス	56,000	2,124.00	118,944,000
日本石油輸送	1,800	2,696.00	4,852,800
福山通運	27,500	4,545.00	124,987,500
セイノーホールディングス	113,700	1,348.00	153,267,600
エスライン	5,000	916.00	4,580,000
神奈川中央交通	4,100	3,425.00	14,042,500
日立物流	32,200	4,470.00	143,934,000
丸和運輸機関	35,300	1,480.00	52,244,000
C & F ロジホールディングス	16,900	1,635.00	27,631,500
九州旅客鉄道	129,100	2,641.00	340,953,100
S Gホールディングス	315,400	2,663.00	839,910,200
日本郵船	140,000	7,600.00	1,064,000,000
商船三井	92,900	6,780.00	629,862,000
川崎汽船	51,400	5,220.00	268,308,000

N Sユニテッド海運	10,000	3,315.00	33,150,000
飯野海運	83,400	507.00	42,283,800
共栄タンカー	6,100	900.00	5,490,000
乾汽船	11,400	2,028.00	23,119,200
日本航空	382,800	2,527.00	967,335,600
A N Aホールディングス	424,100	2,766.00	1,173,060,600
パスコ	3,200	1,421.00	4,547,200
ランコム	4,700	8,540.00	40,138,000
日新	13,300	1,745.00	23,208,500
三菱倉庫	53,000	3,010.00	159,530,000
三井倉庫ホールディングス	17,700	2,362.00	41,807,400
住友倉庫	59,000	1,891.00	111,569,000
澁澤倉庫	10,000	2,196.00	21,960,000
東陽倉庫	28,000	327.00	9,156,000
日本トランスシティ	36,700	604.00	22,166,800
ケイヒン	3,000	1,413.00	4,239,000
中央倉庫	10,200	966.00	9,853,200
川西倉庫	3,100	1,201.00	3,723,100
安田倉庫	13,700	955.00	13,083,500
ファイズホールディングス	3,600	700.00	2,520,000
東洋埠頭	5,100	1,438.00	7,333,800
宇徳	11,900	520.00	6,188,000
上組	91,800	2,261.00	207,559,800
サンリツ	4,600	834.00	3,836,400
キムラユニティー	4,500	1,301.00	5,854,500
キューソー流通システム	4,200	2,012.00	8,450,400
近鉄エクスプレス	31,500	2,639.00	83,128,500
東海運	9,500	307.00	2,916,500
エーアイティー	10,500	1,138.00	11,949,000
内外トランスライン	6,400	1,946.00	12,454,400
日本コンセプト	5,300	1,678.00	8,893,400
N E C ネットエスアイ	57,300	1,895.00	108,583,500
クロスキャット	4,700	1,242.00	5,837,400
システナ	61,800	2,035.00	125,763,000
デジタルアーツ	9,300	9,890.00	91,977,000
日鉄ソリューションズ	25,100	3,530.00	88,603,000
キューブシステム	8,900	981.00	8,730,900
W O W W O R L D	2,600	1,610.00	4,186,000
コア	7,400	1,679.00	12,424,600
ラクーンホールディングス	12,400	1,623.00	20,125,200
ソリトンシステムズ	8,800	1,309.00	11,519,200
ソフトクリエイティブホールディングス	7,600	4,175.00	31,730,000

T I S	165,000	3,260.00	537,900,000
J N S ホールディングス	8,000	486.00	3,888,000
グリー	106,300	985.00	104,705,500
G M O ペパボ	1,900	2,968.00	5,639,200
コーエーテクモホールディングス	55,200	5,200.00	287,040,000
三菱総合研究所	7,500	3,965.00	29,737,500
電算	2,000	2,311.00	4,622,000
A G S	9,000	878.00	7,902,000
ファインデックス	14,800	948.00	14,030,400
ブレインパッド	4,500	5,700.00	25,650,000
K L a b	31,700	654.00	20,731,800
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	25,200	1,015.00	25,578,000
イーブックイニシアティブジャパン	3,200	4,740.00	15,168,000
ネクソン	389,800	2,383.00	928,893,400
アイスタイル	53,200	339.00	18,034,800
エムアップホールディングス	5,000	3,990.00	19,950,000
エイチーム	12,000	1,830.00	21,960,000
エニグモ	18,900	1,112.00	21,016,800
テクノスジャパン	13,700	577.00	7,904,900
コロプラ	57,100	766.00	43,738,600
ブロードリーフ	86,100	566.00	48,732,600
クロス・マーケティンググループ	6,800	864.00	5,875,200
デジタルハーツホールディングス	8,000	2,269.00	18,152,000
システム情報	13,200	953.00	12,579,600
メディアドゥ	6,100	4,910.00	29,951,000
じげん	49,400	418.00	20,649,200
ブイキューブ	17,600	1,240.00	21,824,000
エンカレッジ・テクノロジー	4,100	655.00	2,685,500
サイバーリンクス	5,900	1,203.00	7,097,700
フィックスターズ	18,700	733.00	13,707,100
C A R T A H O L D I N G S	7,000	2,556.00	17,892,000
オブティム	12,200	1,723.00	21,020,600
セレス	6,400	2,858.00	18,291,200
S H I F T	8,700	27,620.00	240,294,000
ティーガイア	15,400	1,794.00	27,627,600
セック	2,600	2,485.00	6,461,000
テクマトリックス	29,300	1,804.00	52,857,200
プロシップ	5,800	1,605.00	9,309,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	47,000	2,245.00	105,515,000
G M O ペイメントゲートウェイ	33,500	14,720.00	493,120,000
ザッパラス	7,100	541.00	3,841,100
システムリサーチ	5,100	1,900.00	9,690,000

インターネットイニシアティブ	46,100	4,575.00	210,907,500
さくらインターネット	18,900	575.00	10,867,500
ヴィンクス	5,000	1,008.00	5,040,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,900	4,555.00	17,764,500
SRAホールディングス	8,400	2,920.00	24,528,000
システムインテグレータ	5,800	612.00	3,549,600
朝日ネット	16,000	695.00	11,120,000
eBASE	20,900	704.00	14,713,600
アバント	18,600	1,360.00	25,296,000
アドソル日進	6,300	1,927.00	12,140,100
ODKソリューションズ	3,900	680.00	2,652,000
フリービット	10,400	1,309.00	13,613,600
コムチュア	19,500	3,355.00	65,422,500
サイバーコム	2,800	1,226.00	3,432,800
アステリア	12,700	711.00	9,029,700
アイル	9,700	1,650.00	16,005,000
マークラインズ	8,700	3,215.00	27,970,500
メディカル・データ・ビジョン	22,000	1,452.00	31,944,000
gumi	24,200	888.00	21,489,600
ショーケース	4,100	555.00	2,275,500
モバイルファクトリー	4,100	1,046.00	4,288,600
テラスカイ	6,400	2,473.00	15,827,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,800	1,564.00	12,199,200
PCIホールディングス	7,900	1,037.00	8,192,300
パイプドHD	3,200	2,900.00	9,280,000
アイビーシー	3,000	894.00	2,682,000
ネオジャパン	5,000	1,304.00	6,520,000
PR TIMES	3,700	3,535.00	13,079,500
ラクス	59,600	3,590.00	213,964,000
ランドコンピュータ	4,200	817.00	3,431,400
ダブルスタンダード	5,300	3,640.00	19,292,000
オープンドア	10,300	2,828.00	29,128,400
マイネット	6,200	651.00	4,036,200
アカツキ	7,800	3,220.00	25,116,000
ベネフィットジャパン	1,400	2,715.00	3,801,000
Ubicomホールディングス	4,600	2,838.00	13,054,800
カナミックネットワーク	18,800	596.00	11,204,800
ノムラシステムコーポレーション	9,500	285.00	2,707,500
チェンジ	31,900	1,886.00	60,163,400
シンクロ・フード	9,300	358.00	3,329,400
オークネット	9,300	1,865.00	17,344,500
キャピタル・アセット・プランニング	3,700	844.00	3,122,800

セグエグループ	4,700	777.00	3,651,900
エイトレッド	2,500	2,387.00	5,967,500
マクロミル	35,600	912.00	32,467,200
ビーグリー	4,200	1,644.00	6,904,800
オロ	5,500	3,820.00	21,010,000
ユーザーローカル	5,300	1,866.00	9,889,800
テモナ	4,000	702.00	2,808,000
ニーズウェル	4,200	693.00	2,910,600
マネーフォワード	26,300	7,820.00	205,666,000
サインポスト	5,500	1,802.00	9,911,000
電算システムホールディングス	7,200	2,609.00	18,784,800
ソルクシーズ	15,000	500.00	7,500,000
フェイス	5,200	649.00	3,374,800
プロトコーポレーション	18,500	1,373.00	25,400,500
ハイマックス	4,800	1,167.00	5,601,600
野村総合研究所	334,300	4,635.00	1,549,480,500
サイバネットシステム	12,600	701.00	8,832,600
C Eホールディングス	9,500	489.00	4,645,500
日本システム技術	3,500	2,217.00	7,759,500
インテージホールディングス	21,700	1,929.00	41,859,300
東邦システムサイエンス	4,700	1,003.00	4,714,100
ソースネクスト	75,500	193.00	14,571,500
インフォコム	19,000	2,199.00	41,781,000
シンプレクス・ホールディングス	18,000	2,940.00	52,920,000
HEROZ	5,000	1,691.00	8,455,000
ラクスル	18,900	6,830.00	129,087,000
I P S	4,900	1,716.00	8,408,400
F I G	19,400	322.00	6,246,800
システムサポート	5,300	1,365.00	7,234,500
イーソル	10,800	781.00	8,434,800
アルテリア・ネットワークス	22,000	1,632.00	35,904,000
E d u L a b	1,600	1,541.00	2,465,600
東海ソフト	2,900	1,153.00	3,343,700
ウイングアーク1 s t	9,900	2,202.00	21,799,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,000	2,532.00	10,128,000
サーバーワークス	3,000	4,345.00	13,035,000
東名	1,800	1,265.00	2,277,000
ヴィッツ	1,700	1,581.00	2,687,700
トピラシステムズ	3,600	1,009.00	3,632,400
S a n s a n	15,400	13,490.00	207,746,000
L i n k - U	3,200	1,188.00	3,801,600
ギフトィ	15,100	3,825.00	57,757,500

ベース	3,000	5,070.00	15,210,000
フォーカスシステムズ	11,800	1,038.00	12,248,400
クレスコ	12,700	2,109.00	26,784,300
フジ・メディア・ホールディングス	166,800	1,275.00	212,670,000
オービック	54,500	20,580.00	1,121,610,000
ジャストシステム	24,600	5,780.00	142,188,000
TDCソフト	15,300	1,236.00	18,910,800
Zホールディングス	2,514,400	798.30	2,007,245,520
トレンドマイクロ	92,500	6,510.00	602,175,000
IDホールディングス	11,100	906.00	10,056,600
日本オラクル	35,100	10,360.00	363,636,000
アルファシステムズ	4,700	4,415.00	20,750,500
フューチャー	18,300	3,930.00	71,919,000
CAC Holdings	10,200	1,644.00	16,768,800
SBテクノロジー	7,500	3,010.00	22,575,000
トーセ	4,900	790.00	3,871,000
オービックビジネスコンサルタント	16,500	5,350.00	88,275,000
伊藤忠テクノソリューションズ	78,900	3,725.00	293,902,500
アイティフォー	21,200	878.00	18,613,600
東計電算	2,100	4,830.00	10,143,000
エクスネット	2,900	1,000.00	2,900,000
大塚商会	93,600	5,260.00	492,336,000
サイボウズ	23,200	2,666.00	61,851,200
電通国際情報サービス	25,000	3,965.00	99,125,000
ACCESS	19,700	867.00	17,079,900
デジタルガレージ	28,600	5,430.00	155,298,000
EMシステムズ	28,800	748.00	21,542,400
ウェザーニューズ	5,200	8,680.00	45,136,000
CIJ	11,400	851.00	9,701,400
ビジネスエンジニアリング	2,000	3,460.00	6,920,000
日本エンタープライズ	18,500	195.00	3,607,500
WOWOW	8,400	2,230.00	18,732,000
スカラ	15,700	710.00	11,147,000
インテリジェント ウェイブ	10,400	548.00	5,699,200
IMAGICA GROUP	15,000	657.00	9,855,000
ネットワンシステムズ	65,900	3,825.00	252,067,500
システムソフト	38,200	134.00	5,118,800
アルゴグラフィックス	13,500	3,070.00	41,445,000
マーベラス	27,500	768.00	21,120,000
エイベックス	30,000	1,763.00	52,890,000
日本ユニシス	54,100	3,410.00	184,481,000
兼松エレクトロニクス	9,500	3,695.00	35,102,500

都築電気	8,900	1,848.00	16,447,200
TBSホールディングス	105,300	1,875.00	197,437,500
日本テレビホールディングス	144,500	1,286.00	185,827,000
朝日放送グループホールディングス	17,400	716.00	12,458,400
テレビ朝日ホールディングス	41,700	1,778.00	74,142,600
スカパーJSATホールディングス	146,900	432.00	63,460,800
テレビ東京ホールディングス	12,500	2,211.00	27,637,500
日本BS放送	6,000	1,111.00	6,666,000
ビジョン	29,700	1,402.00	41,639,400
スマートバリュー	4,800	571.00	2,740,800
USEN-NEXT HOLDINGS	16,500	3,480.00	57,420,000
ワイヤレスゲート	7,600	355.00	2,698,000
コネクシオ	12,400	1,450.00	17,980,000
クロップス	3,400	989.00	3,362,600
日本電信電話	2,023,200	3,225.00	6,524,820,000
KDDI	1,261,100	3,415.00	4,306,656,500
ソフトバンク	2,620,100	1,513.00	3,964,211,300
光通信	20,400	18,280.00	372,912,000
エムティーアイ	17,000	654.00	11,118,000
GMOインターネット	61,300	3,200.00	196,160,000
ファイバーゲート	5,700	1,327.00	7,563,900
アйдママーケティングコミュニケーション	4,200	371.00	1,558,200
KADOKAWA	50,500	6,560.00	331,280,000
学研ホールディングス	24,600	1,094.00	26,912,400
ゼンリン	28,400	1,031.00	29,280,400
昭文社ホールディングス	7,400	498.00	3,685,200
インプレスホールディングス	14,300	244.00	3,489,200
アイネット	9,000	1,390.00	12,510,000
松竹	11,500	12,260.00	140,990,000
東宝	102,100	5,600.00	571,760,000
東映	5,700	23,500.00	133,950,000
エヌ・ティ・ティ・データ	460,600	2,419.00	1,114,191,400
ピー・シー・エー	10,200	1,595.00	16,269,000
ビジネスブレイン太田昭和	6,000	1,896.00	11,376,000
DTS	33,200	2,434.00	80,808,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	80,500	6,470.00	520,835,000
シーイーシー	18,700	1,356.00	25,357,200
カブコン	163,100	3,170.00	517,027,000
アイ・エス・ビー	8,200	1,125.00	9,225,000
ジャステック	10,200	1,302.00	13,280,400
SCSK	119,800	2,157.00	258,408,600
日本システムウエア	6,600	2,364.00	15,602,400

アイネス	15,800	1,444.00	22,815,200
T K C	29,300	3,350.00	98,155,000
富士ソフト	18,500	5,800.00	107,300,000
N S D	55,700	2,173.00	121,036,100
コナミホールディングス	62,900	6,330.00	398,157,000
福井コンピュータホールディングス	8,000	3,975.00	31,800,000
J B C Cホールディングス	11,800	1,720.00	20,296,000
ミロク情報サービス	15,300	1,841.00	28,167,300
ソフトバンクグループ	1,037,300	6,554.00	6,798,464,200
ハウスイ	1,400	925.00	1,295,000
高千穂交易	6,700	1,246.00	8,348,200
オルバヘルスケアホールディングス	2,800	1,554.00	4,351,200
伊藤忠食品	4,200	5,120.00	21,504,000
エレマテック	13,900	1,086.00	15,095,400
J A L U X	4,900	2,553.00	12,509,700
あらた	13,800	4,075.00	56,235,000
トーメンデバイス	2,600	6,110.00	15,886,000
東京エレクトロン デバイス	5,200	7,240.00	37,648,000
フィールズ	15,200	524.00	7,964,800
双日	191,800	1,676.00	321,456,800
アルフレッサ ホールディングス	193,000	1,644.00	317,292,000
横浜冷凍	48,700	873.00	42,515,100
ラサ商事	9,200	916.00	8,427,200
アルコニックス	18,500	1,598.00	29,563,000
神戸物産	134,800	4,225.00	569,530,000
ハイパー	4,400	556.00	2,446,400
あい ホールディングス	24,800	2,175.00	53,940,000
ディーブイエックス	5,900	1,100.00	6,490,000
ダイワボウホールディングス	84,400	1,852.00	156,308,800
マクニカ・富士エレホールディングス	41,400	2,601.00	107,681,400
ラクト・ジャパン	6,000	2,591.00	15,546,000
グリムス	7,700	2,624.00	20,204,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30,200	780.00	23,556,000
八洲電機	12,600	928.00	11,692,800
メディアスホールディングス	9,900	947.00	9,375,300
レスターホールディングス	16,500	1,887.00	31,135,500
ジュテックホールディングス	4,000	1,121.00	4,484,000
大光	6,700	719.00	4,817,300
O C H Iホールディングス	5,100	1,263.00	6,441,300
T O K A Iホールディングス	84,100	866.00	72,830,600
黒谷	4,800	645.00	3,096,000
C o m i n i x	3,100	730.00	2,263,000

三洋貿易	17,500	1,015.00	17,762,500
ビューティガレージ	2,800	4,050.00	11,340,000
ウイン・パートナーズ	12,600	928.00	11,692,800
ミタチ産業	4,800	932.00	4,473,600
シップヘルスケアホールディングス	55,700	2,773.00	154,456,100
明治電機工業	5,600	1,313.00	7,352,800
デリカフーズホールディングス	6,800	620.00	4,216,000
スターティアホールディングス	4,000	1,350.00	5,400,000
コメダホールディングス	37,900	2,033.00	77,050,700
ピーバンドットコム	2,400	675.00	1,620,000
アセンテック	6,000	1,348.00	8,088,000
富士興産	4,300	1,078.00	4,635,400
協栄産業	1,800	1,498.00	2,696,400
フルサト・マルカホールディングス	16,700	2,035.00	33,984,500
ヤマエグループホールディングス	11,700	1,126.00	13,174,200
小野建	16,800	1,625.00	27,300,000
南陽	3,500	1,996.00	6,986,000
佐島電機	10,800	1,085.00	11,718,000
エコートレーディング	3,700	638.00	2,360,600
伯東	10,600	2,200.00	23,320,000
コンドーテック	13,400	1,010.00	13,534,000
中山福	9,200	383.00	3,523,600
ナガイレーベン	23,000	2,381.00	54,763,000
三菱食品	16,700	2,873.00	47,979,100
松田産業	12,700	3,310.00	42,037,000
第一興商	33,000	4,175.00	137,775,000
メディバルホールディングス	187,400	2,041.00	382,483,400
S P K	6,900	1,364.00	9,411,600
萩原電気ホールディングス	6,400	2,205.00	14,112,000
アズワン	12,500	14,880.00	186,000,000
スズデン	6,000	1,696.00	10,176,000
尾家産業	4,900	1,052.00	5,154,800
シモジマ	10,700	1,128.00	12,069,600
ドウシシャ	16,400	1,637.00	26,846,800
小津産業	3,800	1,908.00	7,250,400
高速	10,400	1,523.00	15,839,200
たけびし	6,500	1,458.00	9,477,000
リックス	3,900	1,512.00	5,896,800
丸文	15,400	841.00	12,951,400
ハピネット	14,500	1,545.00	22,402,500
橋本総業ホールディングス	3,500	2,087.00	7,304,500
日本ライフライン	51,500	1,173.00	60,409,500

タカショー	13,200	821.00	10,837,200
I D O M	52,700	771.00	40,631,700
進和	10,300	2,111.00	21,743,300
エスケイジャパン	4,300	485.00	2,085,500
ダイترون	7,300	2,108.00	15,388,400
シークス	24,900	1,276.00	31,772,400
田中商事	5,400	669.00	3,612,600
オーハシテクニカ	9,700	1,490.00	14,453,000
白銅	5,600	2,880.00	16,128,000
ダイコー通産	2,100	1,175.00	2,467,500
伊藤忠商事	1,214,400	3,314.00	4,024,521,600
丸紅	1,712,600	1,000.50	1,713,456,300
高島	2,700	2,217.00	5,985,900
長瀬産業	95,300	1,752.00	166,965,600
蝶理	9,700	1,826.00	17,712,200
豊田通商	174,400	5,170.00	901,648,000
三共生興	23,100	551.00	12,728,100
兼松	64,700	1,286.00	83,204,200
ツカモトコーポレーション	2,900	1,340.00	3,886,000
三井物産	1,348,300	2,457.50	3,313,447,250
日本紙パルプ商事	9,100	3,810.00	34,671,000
カメイ	20,600	1,111.00	22,886,600
東都水産	900	4,505.00	4,054,500
O U Gホールディングス	2,500	2,680.00	6,700,000
スターゼン	12,800	2,064.00	26,419,200
山善	73,100	1,030.00	75,293,000
椿本興業	3,600	3,735.00	13,446,000
住友商事	1,095,800	1,622.00	1,777,387,600
内田洋行	7,400	4,820.00	35,668,000
三菱商事	1,301,000	3,355.00	4,364,855,000
第一実業	7,900	5,060.00	39,974,000
キャノンマーケティングジャパン	43,100	2,286.00	98,526,600
西華産業	9,100	1,632.00	14,851,200
佐藤商事	14,400	1,176.00	16,934,400
菱洋エレクトロ	10,300	2,341.00	24,112,300
東京産業	15,800	745.00	11,771,000
ユアサ商事	16,500	2,952.00	48,708,000
神鋼商事	3,900	3,340.00	13,026,000
トルク	9,400	220.00	2,068,000
阪和興業	34,800	3,355.00	116,754,000
正栄食品工業	11,200	4,035.00	45,192,000
カナデン	14,100	1,046.00	14,748,600

菱電商事	13,800	1,741.00	24,025,800
岩谷産業	41,700	6,500.00	271,050,000
ナイス	6,000	1,771.00	10,626,000
ニチモウ	2,600	2,099.00	5,457,400
極東貿易	5,000	2,465.00	12,325,000
アステナホールディングス	24,500	567.00	13,891,500
三愛石油	42,800	1,348.00	57,694,400
稲畑産業	38,300	1,602.00	61,356,600
G S I クレオス	8,300	862.00	7,154,600
明和産業	16,100	813.00	13,089,300
クワザワホールディングス	6,900	670.00	4,623,000
ワキタ	37,100	1,026.00	38,064,600
東邦ホールディングス	55,700	1,782.00	99,257,400
サンゲツ	46,300	1,566.00	72,505,800
ミツウロコグループホールディングス	25,600	1,289.00	32,998,400
シナネンホールディングス	6,400	3,400.00	21,760,000
伊藤忠エネクス	38,400	996.00	38,246,400
サンリオ	53,600	2,726.00	146,113,600
サンワテクノス	10,600	1,528.00	16,196,800
リョーサン	19,200	2,390.00	45,888,000
新光商事	26,000	865.00	22,490,000
トーホー	7,900	1,525.00	12,047,500
三信電気	8,000	1,557.00	12,456,000
東陽テクニカ	17,200	1,121.00	19,281,200
モスフードサービス	22,800	3,115.00	71,022,000
加賀電子	15,700	2,930.00	46,001,000
ソーダニッカ	18,000	618.00	11,124,000
立花エレテック	13,900	1,603.00	22,281,700
フォーバル	7,600	1,167.00	8,869,200
P A L T A C	24,400	4,870.00	118,828,000
三谷産業	20,400	342.00	6,976,800
西本W i s m e t t a cホールディングス	3,900	3,970.00	15,483,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,600	2,006.00	3,209,600
コア商事ホールディングス	13,100	670.00	8,777,000
国際紙パルプ商事	37,100	399.00	14,802,900
ヤマタネ	8,100	1,588.00	12,862,800
丸紅建材リース	1,600	1,861.00	2,977,600
日鉄物産	12,400	4,800.00	59,520,000
泉州電業	4,900	4,595.00	22,515,500
トラスコ中山	36,100	2,673.00	96,495,300
オートバックスセブン	58,400	1,408.00	82,227,200
モリト	12,700	688.00	8,737,600

加藤産業	25,100	3,155.00	79,190,500
北恵	4,400	989.00	4,351,600
イノテック	10,500	1,395.00	14,647,500
イエローハット	30,100	1,720.00	51,772,000
J Kホールディングス	14,000	964.00	13,496,000
日伝	14,400	2,242.00	32,284,800
北沢産業	11,900	246.00	2,927,400
杉本商事	8,100	2,260.00	18,306,000
因幡電機産業	46,300	2,627.00	121,630,100
東テク	5,800	2,593.00	15,039,400
ミスミグループ本社	217,800	4,790.00	1,043,262,000
アルテック	11,800	310.00	3,658,000
タキヒヨー	5,200	1,744.00	9,068,800
蔵王産業	3,400	1,862.00	6,330,800
スズケン	67,900	3,070.00	208,453,000
ジェコス	12,000	820.00	9,840,000
グローセル	20,300	405.00	8,221,500
ローソン	38,500	5,910.00	227,535,000
サンエー	13,200	4,210.00	55,572,000
カワチ薬品	13,600	2,281.00	31,021,600
エービーシー・マート	27,200	5,510.00	149,872,000
ハードオフコーポレーション	8,200	768.00	6,297,600
アスクル	28,300	1,554.00	43,978,200
ゲオホールディングス	23,600	1,213.00	28,626,800
アダストリア	18,900	2,098.00	39,652,200
くら寿司	18,200	3,710.00	67,522,000
キャンドゥ	8,400	2,557.00	21,478,800
アイケイ	5,800	499.00	2,894,200
パルグループホールディングス	15,500	1,666.00	25,823,000
エディオン	80,100	1,080.00	86,508,000
サーラコーポレーション	35,900	625.00	22,437,500
ワッツ	9,000	761.00	6,849,000
ハローズ	8,100	2,760.00	22,356,000
フジオフードグループ本社	14,600	1,389.00	20,279,400
あみやき亭	4,300	2,993.00	12,869,900
大黒天物産	5,600	6,590.00	36,904,000
ハニーズホールディングス	14,100	1,102.00	15,538,200
ファーマライズホールディングス	4,700	807.00	3,792,900
アルペン	13,400	2,401.00	32,173,400
ハブ	6,200	730.00	4,526,000
クオールホールディングス	21,500	1,622.00	34,873,000
ジーンズホールディングス	11,900	7,400.00	88,060,000

ビックカメラ	103,400	1,011.00	104,537,400
D C Mホールディングス	107,500	1,119.00	120,292,500
M o n o t a R O	219,600	2,461.00	540,435,600
東京一番フーズ	5,100	594.00	3,029,400
きちりホールディングス	4,600	525.00	2,415,000
アークランドサービスホールディングス	12,900	2,286.00	29,489,400
J . フロント リテイリング	207,700	1,041.00	216,215,700
ドトール・日レスホールディングス	30,200	1,637.00	49,437,400
マツキヨココカラ&カンパニー	106,900	4,925.00	526,482,500
ブロンコビリー	10,100	2,428.00	24,522,800
Z O Z O	119,500	3,595.00	429,602,500
トレジャー・ファクトリー	5,500	998.00	5,489,000
物語コーポレーション	9,300	6,940.00	64,542,000
三越伊勢丹ホールディングス	304,400	836.00	254,478,400
H a m e e	4,800	1,239.00	5,947,200
マーケットエンタープライズ	1,700	700.00	1,190,000
ウエルシアホールディングス	91,900	4,330.00	397,927,000
クリエイトSDホールディングス	25,700	3,445.00	88,536,500
丸善C H Iホールディングス	20,300	374.00	7,592,200
ミサワ	4,100	677.00	2,775,700
ティーライフ	2,600	1,440.00	3,744,000
チムニー	5,300	1,433.00	7,594,900
シュッピン	14,800	1,206.00	17,848,800
オイシックス・ラ・大地	25,100	4,545.00	114,079,500
ネクステージ	35,300	2,270.00	80,131,000
ジョイフル本田	51,100	1,574.00	80,431,400
鳥貴族ホールディングス	6,600	1,941.00	12,810,600
ホットランド	13,300	1,360.00	18,088,000
すかいらーくホールディングス	224,400	1,518.00	340,639,200
S F Pホールディングス	8,500	1,448.00	12,308,000
綿半ホールディングス	13,400	1,234.00	16,535,600
ヨシックスホールディングス	3,600	2,071.00	7,455,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	50,800	1,026.00	52,120,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,300	1,272.00	11,829,600
B E E N O S	8,900	2,477.00	22,045,300
あさひ	14,700	1,370.00	20,139,000
日本調剤	10,800	1,468.00	15,854,400
コスモス薬品	17,500	18,660.00	326,550,000
トーエル	8,900	785.00	6,986,500
セブン&アイ・ホールディングス	679,200	5,022.00	3,410,942,400
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	82,900	734.00	60,848,600

ツルハホールディングス	37,900	14,440.00	547,276,000
サンマルクホールディングス	14,000	1,534.00	21,476,000
フェリシモ	4,100	1,404.00	5,756,400
トリドールホールディングス	43,300	2,850.00	123,405,000
TOKYO BASE	16,500	764.00	12,606,000
ウイルプラスホールディングス	3,100	1,006.00	3,118,600
JMホールディングス	11,900	1,868.00	22,229,200
サツドラホールディングス	2,800	2,230.00	6,244,000
アレンザホールディングス	13,600	1,165.00	15,844,000
串カツ田中ホールディングス	4,800	2,297.00	11,025,600
パロックジャパンリミテッド	12,500	889.00	11,112,500
クスリのアオキホールディングス	17,300	7,740.00	133,902,000
力の源ホールディングス	8,900	618.00	5,500,200
FOOD & LIFE COMPANIES	101,700	4,600.00	467,820,000
メディカルシステムネットワーク	17,400	706.00	12,284,400
はるやまホールディングス	8,800	583.00	5,130,400
ノジマ	28,200	2,385.00	67,257,000
カッパ・クリエイト	24,300	1,417.00	34,433,100
ライトオン	13,000	699.00	9,087,000
良品計画	200,000	2,104.00	420,800,000
三城ホールディングス	23,100	258.00	5,959,800
アドヴァングループ	18,100	967.00	17,502,700
アルビス	5,800	2,304.00	13,363,200
コナカ	20,500	330.00	6,765,000
ハウス オブ ローゼ	2,400	1,665.00	3,996,000
G-7ホールディングス	19,500	1,834.00	35,763,000
イオン北海道	30,700	1,357.00	41,659,900
コジマ	30,600	576.00	17,625,600
ヒマラヤ	6,500	1,014.00	6,591,000
コーナン商事	24,800	3,555.00	88,164,000
エコス	6,600	1,853.00	12,229,800
ワタミ	21,000	971.00	20,391,000
マルシェ	4,200	473.00	1,986,600
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	347,200	2,399.00	832,932,800
西松屋チェーン	38,400	1,513.00	58,099,200
ゼンショーホールディングス	84,900	2,670.00	226,683,000
幸楽苑ホールディングス	11,000	1,499.00	16,489,000
ハークスレイ	8,100	473.00	3,831,300
サイゼリヤ	25,900	3,035.00	78,606,500
VTホールディングス	66,200	510.00	33,762,000
魚力	5,100	2,006.00	10,230,600

フジ・コーポレーション	9,500	1,211.00	11,504,500
ユナイテッドアローズ	18,400	2,102.00	38,676,800
ハイデイ日高	25,300	1,651.00	41,770,300
YU-WA Creation Holdings	12,000	223.00	2,676,000
コロワイド	71,300	1,626.00	115,933,800
ピーシーデポコーポレーション	21,100	463.00	9,769,300
壱番屋	12,300	4,630.00	56,949,000
PLANT	5,000	725.00	3,625,000
スギホールディングス	34,700	8,240.00	285,928,000
薬王堂ホールディングス	8,800	2,418.00	21,278,400
スクロール	27,200	902.00	24,534,400
ヨンドシーホールディングス	16,200	1,704.00	27,604,800
木曽路	23,000	2,178.00	50,094,000
SRSホールディングス	24,000	778.00	18,672,000
リテールパートナーズ	21,400	1,231.00	26,343,400
ケーヨー	32,300	824.00	26,615,200
上新電機	20,100	2,236.00	44,943,600
日本瓦斯	84,700	1,471.00	124,593,700
ロイヤルホールディングス	29,800	2,063.00	61,477,400
いなげや	21,600	1,399.00	30,218,400
チヨダ	17,500	768.00	13,440,000
ライフコーポレーション	16,300	3,610.00	58,843,000
リンガーハット	21,400	2,225.00	47,615,000
MrMaxHD	22,400	589.00	13,193,600
AOKIホールディングス	34,200	676.00	23,119,200
オークワ	27,400	1,091.00	29,893,400
コメリ	27,000	2,653.00	71,631,000
青山商事	36,400	753.00	27,409,200
しまむら	20,200	9,740.00	196,748,000
はせがわ	10,800	260.00	2,808,000
高島屋	126,700	1,121.00	142,030,700
松屋	35,200	962.00	33,862,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	82,400	864.00	71,193,600
近鉄百貨店	6,800	2,596.00	17,652,800
丸井グループ	147,000	2,220.00	326,340,000
アクシアル リテイリング	13,600	3,400.00	46,240,000
イオン	668,100	2,706.00	1,807,878,600
イズミ	31,400	3,470.00	108,958,000
平和堂	32,100	1,956.00	62,787,600
フジ	21,100	1,998.00	42,157,800
ヤオコー	19,700	6,780.00	133,566,000
ゼビオホールディングス	24,000	1,048.00	25,152,000

ケーズホールディングス	160,400	1,185.00	190,074,000
Olympicグループ	9,500	713.00	6,773,500
日産東京販売ホールディングス	27,200	235.00	6,392,000
シルバーライフ	3,800	1,413.00	5,369,400
Genky DrugStores	7,700	5,230.00	40,271,000
ナルミヤ・インターナショナル	4,200	1,195.00	5,019,000
ブックオフグループホールディングス	10,100	995.00	10,049,500
ギフト	2,900	3,095.00	8,975,500
アインホールディングス	25,300	6,300.00	159,390,000
元気寿司	5,000	2,664.00	13,320,000
ヤマダホールディングス	635,800	433.00	275,301,400
アークランドサカモト	27,400	1,727.00	47,319,800
ニトリホールディングス	68,900	21,210.00	1,461,369,000
グルメ杵屋	14,200	987.00	14,015,400
愛眼	12,700	200.00	2,540,000
ケーユーホールディングス	9,400	1,059.00	9,954,600
吉野家ホールディングス	60,800	2,367.00	143,913,600
松屋フーズホールディングス	8,500	3,640.00	30,940,000
サガミホールディングス	26,900	1,048.00	28,191,200
関西スーパーマーケット	13,300	1,433.00	19,058,900
王将フードサービス	11,500	6,030.00	69,345,000
プレナス	19,600	1,966.00	38,533,600
ミニストップ	13,000	1,423.00	18,499,000
アークス	33,300	2,207.00	73,493,100
パローホールディングス	38,600	2,414.00	93,180,400
ベルク	7,800	5,430.00	42,354,000
大庄	9,700	1,010.00	9,797,000
ファーストリテイリング	23,200	75,720.00	1,756,704,000
サンドラッグ	65,400	3,310.00	216,474,000
サクスパー ホールディングス	17,100	597.00	10,208,700
ヤマザワ	4,300	1,719.00	7,391,700
やまや	3,600	2,405.00	8,658,000
ベルーナ	37,800	765.00	28,917,000
島根銀行	5,800	569.00	3,300,200
じもとホールディングス	12,400	636.00	7,886,400
めぶきフィナンシャルグループ	903,400	238.00	215,009,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,800	1,474.00	32,133,200
九州フィナンシャルグループ	355,000	398.00	141,290,000
ゆうちょ銀行	410,400	862.00	353,764,800
富山第一銀行	41,400	283.00	11,716,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	993,000	446.00	442,878,000
西日本フィナンシャルホールディングス	113,500	778.00	88,303,000

三十三フィナンシャルグループ	16,100	1,391.00	22,395,100
第四北越フィナンシャルグループ	28,300	2,583.00	73,098,900
ひろぎんホールディングス	256,400	651.00	166,916,400
おきなわフィナンシャルグループ	15,700	2,434.00	38,213,800
十六フィナンシャルグループ	23,300	2,047.00	47,695,100
北國フィナンシャルホールディングス	16,200	2,005.00	32,481,000
新生銀行	113,400	1,790.00	202,986,000
あおぞら銀行	97,100	2,633.00	255,664,300
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,149,900	630.00	7,024,437,000
りそなホールディングス	1,990,000	445.10	885,749,000
三井住友トラスト・ホールディングス	328,600	3,873.00	1,272,667,800
三井住友フィナンシャルグループ	1,203,500	3,790.00	4,561,265,000
千葉銀行	580,200	712.00	413,102,400
群馬銀行	334,000	347.00	115,898,000
武蔵野銀行	25,900	1,709.00	44,263,100
千葉興業銀行	40,900	265.00	10,838,500
筑波銀行	67,800	169.00	11,458,200
七十七銀行	54,500	1,193.00	65,018,500
青森銀行	13,500	1,944.00	26,244,000
秋田銀行	11,100	1,445.00	16,039,500
山形銀行	19,500	799.00	15,580,500
岩手銀行	11,400	1,630.00	18,582,000
東邦銀行	145,100	201.00	29,165,100
東北銀行	8,300	999.00	8,291,700
みちのく銀行	11,200	873.00	9,777,600
ふくおかフィナンシャルグループ	146,500	2,085.00	305,452,500
静岡銀行	423,400	897.00	379,789,800
スルガ銀行	152,500	469.00	71,522,500
八十二銀行	391,600	369.00	144,500,400
山梨中央銀行	18,800	813.00	15,284,400
大垣共立銀行	34,300	1,901.00	65,204,300
福井銀行	14,900	1,489.00	22,186,100
清水銀行	7,200	1,530.00	11,016,000
富山銀行	3,100	1,881.00	5,831,100
滋賀銀行	32,700	1,869.00	61,116,300
南都銀行	27,100	1,948.00	52,790,800
百五銀行	166,900	333.00	55,577,700
京都銀行	62,300	5,100.00	317,730,000
紀陽銀行	61,600	1,464.00	90,182,400
ほくほくフィナンシャルグループ	108,500	848.00	92,008,000
山陰合同銀行	103,100	572.00	58,973,200
中国銀行	138,900	844.00	117,231,600

鳥取銀行	5,500	1,101.00	6,055,500	
伊予銀行	230,400	564.00	129,945,600	
百十四銀行	18,500	1,438.00	26,603,000	
四国銀行	26,400	742.00	19,588,800	
阿波銀行	26,600	2,073.00	55,141,800	
大分銀行	10,000	1,815.00	18,150,000	
宮崎銀行	10,900	2,003.00	21,832,700	
佐賀銀行	9,800	1,403.00	13,749,400	
琉球銀行	37,700	754.00	28,425,800	
セブン銀行	516,300	234.00	120,814,200	
みずほフィナンシャルグループ	2,223,500	1,523.50	3,387,502,250	
高知銀行	6,300	756.00	4,762,800	
山口フィナンシャルグループ	202,500	634.00	128,385,000	
長野銀行	5,700	1,076.00	6,133,200	
名古屋銀行	13,000	2,360.00	30,680,000	
北洋銀行	262,100	236.00	61,855,600	
愛知銀行	6,300	3,485.00	21,955,500	
中京銀行	6,300	1,311.00	8,259,300	
大光銀行	6,000	1,331.00	7,986,000	
愛媛銀行	24,300	776.00	18,856,800	
トマト銀行	6,300	1,038.00	6,539,400	
京葉銀行	74,100	441.00	32,678,100	
栃木銀行	84,000	180.00	15,120,000	
北日本銀行	5,400	1,510.00	8,154,000	
東和銀行	30,500	505.00	15,402,500	
福島銀行	19,900	226.00	4,497,400	
大東銀行	8,300	680.00	5,644,000	
トモニホールディングス	134,400	298.00	40,051,200	
フィデアホールディングス	15,900	1,154.00	18,348,600	
池田泉州ホールディングス	199,900	158.00	31,584,200	
F P G	58,800	608.00	35,750,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	13,600	1,288.00	17,516,800	
マーキュリアホールディングス	6,100	731.00	4,459,100	
S B Iホールディングス	214,500	2,785.00	597,382,500	
ジャフコ グループ	22,200	7,290.00	161,838,000	
大和証券グループ本社	1,302,400	635.20	827,284,480	
野村ホールディングス	2,654,900	502.00	1,332,759,800	
岡三証券グループ	137,300	379.00	52,036,700	
丸三証券	52,000	565.00	29,380,000	
東洋証券	58,700	150.00	8,805,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	200,200	379.00	75,875,800	
光世証券	4,000	541.00	2,164,000	

水戸証券	47,100	287.00	13,517,700
いちよし証券	32,800	637.00	20,893,600
松井証券	85,400	816.00	69,686,400
マネックスグループ	142,000	928.00	131,776,000
極東証券	23,600	754.00	17,794,400
岩井コスモホールディングス	16,600	1,313.00	21,795,800
アイザワ証券グループ	28,800	1,029.00	29,635,200
マネーパートナーズグループ	19,400	248.00	4,811,200
スパークス・グループ	81,000	309.00	25,029,000
かんぽ生命保険	175,000	1,791.00	313,425,000
S O M P Oホールディングス	306,500	4,821.00	1,477,636,500
アニコム ホールディングス	53,400	884.00	47,205,600
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	389,900	3,652.00	1,423,914,800
第一生命ホールディングス	855,800	2,396.50	2,050,924,700
東京海上ホールディングス	572,600	5,916.00	3,387,501,600
T & Dホールディングス	451,300	1,396.00	630,014,800
アドバンスクリエイト	8,300	1,033.00	8,573,900
全国保証	41,600	5,200.00	216,320,000
あんしん保証	6,900	298.00	2,056,200
イントラスト	8,000	816.00	6,528,000
日本モーゲージサービス	10,200	1,087.00	11,087,400
C a s a	6,700	910.00	6,097,000
アルヒ	26,100	1,297.00	33,851,700
プレミアグループ	8,900	3,795.00	33,775,500
クレディセゾン	112,000	1,268.00	142,016,000
芙蓉総合リース	18,300	7,440.00	136,152,000
みずほリース	27,000	3,210.00	86,670,000
東京センチュリー	33,700	6,090.00	205,233,000
日本証券金融	68,900	826.00	56,911,400
アイフル	293,200	362.00	106,138,400
リコーリース	15,500	3,645.00	56,497,500
イオンフィナンシャルサービス	94,900	1,390.00	131,911,000
アコム	344,400	365.00	125,706,000
ジャックス	19,400	3,005.00	58,297,000
オリエントコーポレーション	473,800	142.00	67,279,600
オリックス	1,055,700	2,274.00	2,400,661,800
三菱H C キャピタル	643,200	565.00	363,408,000
九州リースサービス	9,400	597.00	5,611,800
日本取引所グループ	440,500	2,566.50	1,130,543,250
イー・ギャランティ	25,700	2,577.00	66,228,900
アサックス	9,800	706.00	6,918,800
N E C キャピタルソリューション	7,300	1,989.00	14,519,700

いちご	201,200	323.00	64,987,600
日本駐車場開発	208,400	144.00	30,009,600
スター・マイカ・ホールディングス	11,100	1,428.00	15,850,800
S R E ホールディングス	4,600	8,900.00	40,940,000
A Dワークスグループ	34,700	162.00	5,621,400
ヒューリック	417,600	1,114.00	465,206,400
三栄建築設計	8,400	1,716.00	14,414,400
野村不動産ホールディングス	90,800	2,640.00	239,712,000
三重交通グループホールディングス	40,400	481.00	19,432,400
サムティ	29,000	2,548.00	73,892,000
ディア・ライフ	26,800	556.00	14,900,800
日本商業開発	12,500	1,776.00	22,200,000
プレサンスコーポレーション	24,000	1,927.00	46,248,000
ハウスコム	5,000	1,252.00	6,260,000
日本管理センター	10,600	1,085.00	11,501,000
サンセイランディック	8,200	827.00	6,781,400
フージャースホールディングス	23,300	683.00	15,913,900
オープンハウス	55,600	6,900.00	383,640,000
東急不動産ホールディングス	516,000	630.00	325,080,000
飯田グループホールディングス	145,900	2,608.00	380,507,200
イーランド	4,400	1,684.00	7,409,600
ムゲンエステート	15,900	481.00	7,647,900
ハウズドゥ	8,600	959.00	8,247,400
シーアールイー	6,200	1,739.00	10,781,800
グッドコムアセット	9,500	1,303.00	12,378,500
ジェイ・エス・ビー	4,400	2,849.00	12,535,600
テンポイノベーション	7,600	913.00	6,938,800
フェイスネットワーク	3,600	1,288.00	4,636,800
パーク24	94,800	1,857.00	176,043,600
パラカ	6,100	1,605.00	9,790,500
三井不動産	793,600	2,556.00	2,028,441,600
三菱地所	1,143,800	1,690.00	1,933,022,000
平和不動産	30,500	3,335.00	101,717,500
東京建物	173,200	1,629.00	282,142,800
ダイビル	45,700	1,485.00	67,864,500
京阪神ビルディング	29,700	1,384.00	41,104,800
住友不動産	365,400	3,964.00	1,448,445,600
テーオーシー	35,400	614.00	21,735,600
東京楽天地	3,500	4,100.00	14,350,000
スターツコーポレーション	24,600	2,582.00	63,517,200
フジ住宅	23,900	693.00	16,562,700
空港施設	22,100	536.00	11,845,600

明和地所	12,400	611.00	7,576,400
ゴールドクレスト	15,300	1,512.00	23,133,600
エスリード	8,300	1,687.00	14,002,100
日神グループホールディングス	33,300	492.00	16,383,600
日本エスコン	32,400	820.00	26,568,000
タカラレーベン	72,800	293.00	21,330,400
A V A N T I A	12,000	857.00	10,284,000
イオンモール	88,700	1,690.00	149,903,000
毎日コムネット	9,200	777.00	7,148,400
ファースト住建	8,600	1,221.00	10,500,600
カチタス	43,700	4,150.00	181,355,000
トーセイ	26,300	1,078.00	28,351,400
穴吹興産	5,000	2,061.00	10,305,000
サンフロンティア不動産	26,400	1,005.00	26,532,000
F Jネクストホールディングス	19,600	1,045.00	20,482,000
インテリックス	3,900	714.00	2,784,600
ランドビジネス	7,300	275.00	2,007,500
サンネクスタグループ	8,000	1,012.00	8,096,000
グランディハウス	17,100	503.00	8,601,300
日本空港ビルデング	66,700	5,940.00	396,198,000
明豊ファシリティワークス	8,100	890.00	7,209,000
日本工営	10,000	3,510.00	35,100,000
L I F U L L	52,500	357.00	18,742,500
ミクシィ	38,700	2,233.00	86,417,100
ジェイエイシーリクルートメント	13,800	2,211.00	30,511,800
日本M & Aセンターホールディングス	276,400	3,575.00	988,130,000
メンバーズ	5,100	2,619.00	13,356,900
中広	3,600	401.00	1,443,600
UTグループ	24,400	4,195.00	102,358,000
アイティメディア	8,100	2,218.00	17,965,800
E・Jホールディングス	9,100	1,272.00	11,575,200
夢真ビーネックスグループ	45,100	1,606.00	72,430,600
コシダカホールディングス	45,600	726.00	33,105,600
アルトナー	4,500	875.00	3,937,500
パソナグループ	18,400	3,525.00	64,860,000
C D S	4,400	1,593.00	7,009,200
リンクアンドモチベーション	37,100	1,110.00	41,181,000
エス・エム・エス	57,300	4,570.00	261,861,000
サニーサイドアップグループ	6,300	804.00	5,065,200
パーソルホールディングス	168,500	3,025.00	509,712,500
リニカル	9,900	848.00	8,395,200
クックパッド	54,500	247.00	13,461,500

アイ・ケイ・ケイホールディングス	8,700	659.00	5,733,300
学情	7,100	1,246.00	8,846,600
スタジオアリス	7,700	2,200.00	16,940,000
シミックホールディングス	9,600	1,596.00	15,321,600
エプコ	4,000	833.00	3,332,000
N J S	3,900	2,010.00	7,839,000
総合警備保障	67,100	4,540.00	304,634,000
カカクコム	124,500	3,450.00	429,525,000
アイロムグループ	6,100	1,872.00	11,419,200
セントケア・ホールディング	11,300	846.00	9,559,800
サイネックス	3,400	676.00	2,298,400
ルネサンス	12,000	1,451.00	17,412,000
ディップ	29,700	4,225.00	125,482,500
デジタルホールディングス	11,900	1,720.00	20,468,000
新日本科学	20,800	1,776.00	36,940,800
キャリアデザインセンター	4,600	1,175.00	5,405,000
ベネフィット・ワン	61,300	5,840.00	357,992,000
エムスリー	297,300	6,348.00	1,887,260,400
ツカダ・グローバルホールディング	10,700	332.00	3,552,400
アウトソーシング	96,700	1,539.00	148,821,300
ウェルネット	17,700	506.00	8,956,200
ワールドホールディングス	6,900	2,920.00	20,148,000
ディー・エヌ・エー	64,300	1,830.00	117,669,000
博報堂D Yホールディングス	234,700	1,901.00	446,164,700
ぐるなび	28,300	614.00	17,376,200
タカミヤ	21,200	446.00	9,455,200
ジャパンベストレスキューシステム	11,400	920.00	10,488,000
ファンコミュニケーションズ	42,900	423.00	18,146,700
ライク	4,700	1,847.00	8,680,900
ビジネス・ブレークスルー	7,100	443.00	3,145,300
エスプール	47,900	1,208.00	57,863,200
W D Bホールディングス	7,800	3,655.00	28,509,000
手間いらず	2,200	5,740.00	12,628,000
ティア	10,600	481.00	5,098,600
C D G	2,000	1,499.00	2,998,000
アドウェイズ	25,500	871.00	22,210,500
バリューコマース	13,300	4,980.00	66,234,000
インフォマート	184,900	1,237.00	228,721,300
J Pホールディングス	44,700	247.00	11,040,900
エコナックホールディングス	34,300	96.00	3,292,800
レッグス	3,800	1,603.00	6,091,400
プレステージ・インターナショナル	63,600	739.00	47,000,400

アミューズ	9,300	2,261.00	21,027,300
ドリームインキュベータ	5,000	777.00	3,885,000
クイック	11,800	1,432.00	16,897,600
T A C	10,700	241.00	2,578,700
電通グループ	173,700	4,265.00	740,830,500
イオンファンタジー	6,700	2,012.00	13,480,400
シーティーエス	19,500	824.00	16,068,000
ネクシィーズグループ	6,300	881.00	5,550,300
H . U . グループホールディングス	44,100	2,667.00	117,614,700
アルプス技研	15,100	2,070.00	31,257,000
ダイオーズ	3,700	1,026.00	3,796,200
日本空調サービス	18,100	796.00	14,407,600
オリエンタルランド	199,100	18,905.00	3,763,985,500
ダスキン	39,200	2,695.00	105,644,000
明光ネットワークジャパン	20,400	561.00	11,444,400
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	47,300	1,542.00	72,936,600
リゾートトラスト	77,400	2,057.00	159,211,800
ビー・エム・エル	21,800	3,880.00	84,584,000
りらいあコミュニケーションズ	25,900	1,119.00	28,982,100
リソー教育	77,700	441.00	34,265,700
早稲田アカデミー	9,700	1,035.00	10,039,500
ユー・エス・エス	188,800	1,818.00	343,238,400
東京個別指導学院	15,400	669.00	10,302,600
サイバーエージェント	415,300	1,973.00	819,386,900
楽天グループ	865,200	1,207.00	1,044,296,400
クリーク・アンド・リバー社	9,000	1,984.00	17,856,000
モーニングスター	30,200	526.00	15,885,200
テー・オー・ダブリュー	30,600	349.00	10,679,400
山田コンサルティンググループ	9,000	1,169.00	10,521,000
セントラルスポーツ	6,400	2,599.00	16,633,600
フルキャストホールディングス	14,500	2,792.00	40,484,000
エン・ジャパン	27,300	4,590.00	125,307,000
リソルホールディングス	1,900	4,130.00	7,847,000
テクノプロ・ホールディングス	101,000	3,390.00	342,390,000
アトラグループ	3,700	311.00	1,150,700
インターワークス	5,700	404.00	2,302,800
アイ・アールジャパンホールディングス	7,800	8,250.00	64,350,000
K e e P e r 技研	10,900	3,240.00	35,316,000
ファーストロジック	3,700	778.00	2,878,600
三機サービス	3,600	1,039.00	3,740,400
G u n o s y	11,100	603.00	6,693,300

デザインワン・ジャパン	5,700	223.00	1,271,100
イー・ガーディアン	7,000	3,295.00	23,065,000
リブセンス	10,800	236.00	2,548,800
ジャパンマテリアル	52,000	1,552.00	80,704,000
ベクトル	23,900	1,342.00	32,073,800
ウチヤマホールディングス	9,300	374.00	3,478,200
チャーム・ケア・コーポレーション	12,700	1,423.00	18,072,100
キャリアリンク	6,400	1,421.00	9,094,400
I B J	14,100	1,111.00	15,665,100
アサンテ	7,600	1,713.00	13,018,800
バリューHR	6,900	2,012.00	13,882,800
M&Aキャピタルパートナーズ	13,900	5,730.00	79,647,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,800	1,449.00	9,853,200
E R Iホールディングス	4,900	1,549.00	7,590,100
アビスト	2,700	2,877.00	7,767,900
シグマクシス・ホールディングス	10,300	3,090.00	31,827,000
ウィルグループ	12,700	1,596.00	20,269,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	24,300	195.00	4,738,500
メドピア	13,100	3,045.00	39,889,500
レアジョブ	3,500	1,225.00	4,287,500
リクルートホールディングス	1,299,500	7,809.00	10,147,795,500
エラン	23,500	1,206.00	28,341,000
土木管理総合試験所	8,800	350.00	3,080,000
ネットマーケティング	8,900	551.00	4,903,900
日本郵政	2,200,000	842.00	1,852,400,000
ベルシステム24ホールディングス	24,400	1,390.00	33,916,000
鎌倉新書	19,600	957.00	18,757,200
S M N	4,100	659.00	2,701,900
グローバルキッズCOMPANY	3,500	907.00	3,174,500
エアトリ	11,000	4,165.00	45,815,000
アトラエ	11,900	2,463.00	29,309,700
ストライク	6,400	5,650.00	36,160,000
ソラスト	41,600	1,326.00	55,161,600
セラク	5,500	2,064.00	11,352,000
インソース	16,500	2,494.00	41,151,000
ベイカレント・コンサルティング	11,900	50,300.00	598,570,000
Orchestra Holdings	3,300	5,040.00	16,632,000
アイモバイル	5,000	1,451.00	7,255,000
キャリアインデックス	6,100	1,023.00	6,240,300
MS - Japan	7,200	997.00	7,178,400
船場	3,800	781.00	2,967,800
グレイステクノロジー	22,100	700.00	15,470,000

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	53,600	2,355.00	126,228,000
フルテック	2,600	1,456.00	3,785,600
GameWith	5,700	538.00	3,066,600
ソウルドアウト	4,300	1,335.00	5,740,500
MS&Consulting	3,000	774.00	2,322,000
ウェルビー	11,300	1,617.00	18,272,100
エル・ティー・エス	2,300	3,180.00	7,314,000
ミダックホールディングス	7,400	5,440.00	40,256,000
日総工産	13,700	755.00	10,343,500
キュービーネットホールディングス	7,900	1,966.00	15,531,400
RPAホールディングス	24,500	420.00	10,290,000
スプリックス	5,100	1,232.00	6,283,200
マネジメントソリューションズ	8,300	3,280.00	27,224,000
プロレド・パートナーズ	4,000	1,230.00	4,920,000
テノ・ホールディングス	2,500	788.00	1,970,000
フロンティア・マネジメント	4,800	915.00	4,392,000
ピアラ	3,200	719.00	2,300,800
コプロ・ホールディングス	3,600	1,247.00	4,489,200
ギークス	3,100	1,508.00	4,674,800
カーブスホールディングス	46,700	917.00	42,823,900
フォーラムエンジニアリング	12,100	846.00	10,236,600
ダイレクトマーケティングミックス	9,100	4,230.00	38,493,000
ポピンズホールディングス	4,000	3,815.00	15,260,000
LITALICO	13,700	3,770.00	51,649,000
アドバンテッジリスクマネジメント	8,900	813.00	7,235,700
リログループ	92,200	2,188.00	201,733,600
東祥	12,800	2,186.00	27,980,800
TREホールディングス	23,200	1,650.00	38,280,000
人・夢・技術グループ	6,900	1,924.00	13,275,600
エイチ・アイ・エス	37,600	2,635.00	99,076,000
ラックランド	4,900	2,940.00	14,406,000
共立メンテナンス	30,100	4,285.00	128,978,500
イチネンホールディングス	17,500	1,425.00	24,937,500
建設技術研究所	10,200	2,726.00	27,805,200
スペース	12,400	984.00	12,201,600
燦ホールディングス	7,600	1,436.00	10,913,600
スバル興業	1,100	8,270.00	9,097,000
東京テアトル	6,600	1,241.00	8,190,600
タナベ経営	7,000	732.00	5,124,000
ナガワ	5,400	10,850.00	58,590,000
東京都競馬	12,700	4,535.00	57,594,500
カナモト	29,800	2,419.00	72,086,200

西尾レントオール	15,700	2,746.00	43,112,200
トランス・コスモス	21,500	3,210.00	69,015,000
乃村工藝社	72,500	1,082.00	78,445,000
藤田観光	7,300	2,552.00	18,629,600
KNT-CTホールディングス	10,500	1,713.00	17,986,500
日本管財	18,200	2,756.00	50,159,200
トーカイ	15,000	2,133.00	31,995,000
セコム	166,000	7,673.00	1,273,718,000
セントラル警備保障	8,200	2,631.00	21,574,200
丹青社	34,900	919.00	32,073,100
メイテック	20,400	6,970.00	142,188,000
応用地質	19,200	1,842.00	35,366,400
船井総研ホールディングス	34,600	2,710.00	93,766,000
進学会ホールディングス	6,700	395.00	2,646,500
オオバ	12,300	813.00	9,999,900
いであ	4,700	1,920.00	9,024,000
学究社	5,700	1,402.00	7,991,400
ベネッセホールディングス	56,300	2,387.00	134,388,100
イオンディライト	20,900	3,565.00	74,508,500
ナック	8,400	965.00	8,106,000
ダイセキ	31,100	5,330.00	165,763,000
ステップ	6,400	1,817.00	11,628,800
合 計	191,559,700		484,965,890,370

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	

	2021年11月10日現在
項目	金額（円）
流動資産	
預金	2,909,881,517
コール・ローン	499,412,891
株式	517,030,486,552
投資信託受益証券	288,946,693
投資証券	11,753,086,958
派生商品評価勘定	545,689,542
未収入金	125,559,840
未収配当金	356,061,219
差入委託証拠金	4,309,375,929
流動資産合計	537,818,501,141
資産合計	537,818,501,141
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	221,076
前受金	545,467,038
未払解約金	410,239,011
未払利息	1,110
流動負債合計	955,928,235
負債合計	955,928,235
純資産の部	
元本等	
元本	126,848,172,131
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	410,014,400,775
元本等合計	536,862,572,906
純資産合計	536,862,572,906
負債純資産合計	537,818,501,141

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p>

2021年11月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p> <p>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。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2021年11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	126,848,172,131口

		2021年11月10日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4,2323円 (42,323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11月10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。		
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。		

2. 金融商品の時価等に関する事項

		2021年11月10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。		

	2021年11月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 5月11日
期首元本額	137,665,256,872円
期中追加設定元本額	7,335,518,644円
期中一部解約元本額	18,152,603,385円
期末元本額	126,848,172,131円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,931,661,003円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,957,688円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	29,034,810,940円
世界経済インデックスファンド	9,274,913,315円
外国株式インデックス・オープン	824,864,717円
D C マイセレクション 2 5	838,317,022円

区分	2021年11月10日現在
D Cマイセレクション50	3,915,013,000円
D Cマイセレクション75	4,461,281,152円
D C外国株式インデックス・オープン	11,460,210,433円
D CマイセレクションS25	403,322,698円
D CマイセレクションS50	1,836,359,078円
D CマイセレクションS75	1,527,792,774円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	52,281,065円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	163,693,176円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	116,832,209円
D C世界経済インデックスファンド	9,813,690,420円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,692,071,138円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	4,866,954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）	30,833,020円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	17,534,296円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	72,287,258円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	12,319,933円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	40,952,858円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	336,648,416円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	195,308,733円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,439,569,450円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	235,746,247円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	38,020,046円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	191,012,544円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	63,754,612円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,153,399,892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）	1,265,313,113円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,184,412,486円
コア投資戦略ファンド（安定型）	761,067,560円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,614,408,687円
分散投資コア戦略ファンドA	1,517,087,653円
分散投資コア戦略ファンドS	8,381,677,425円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,240,489,715円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,098,337,195円
コア投資戦略ファンド（切替型）	678,849,198円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	624,299,380円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,464,831円
SMT インデックスバランス・オープン	165,725,457円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	625,342,457円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	18,545,505,385円
SMT 世界経済インデックス・オープン	170,216,106円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	604,474,014円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	116,922,347円

区分	2021年11月10日現在
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,557,168円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	135,096,828円
グローバル経済コア	655,202,542円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	12,197,850円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	4,697,143円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	492,176,711円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	61,288,677円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	14,529,777円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	10,053,108円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	4,915,022円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	6,143,942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)	363,412,870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)	847,860,282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)	1,533,398,095円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,036,508,633円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	160,560,072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)	55,608,951円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	20,817,741円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	23,336,869円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	269,423,198円
SMTAM海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	274,199,214円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	266,246,764円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	264,646,323円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	259,631,356円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	255,658,802円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	46,838,387,668
投資信託受益証券	14,750,101
投資証券	1,092,478,324
合計	47,945,616,093

(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11月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,145,626,720	-	7,691,093,758	545,467,038
合計		7,145,626,720	-	7,691,093,758	545,467,038

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2021年11月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	23,698,122	-	23,699,550	1,428
	アメリカドル	23,698,122	-	23,699,550	1,428
合計		23,698,122	-	23,699,550	1,428

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	57,980	25.28	1,465,734.40	
	CHENIERE ENERGY INC	19,034	106.92	2,035,115.28	
	CHEVRON CORP	155,065	116.00	17,987,540.00	
	CONOCOPHILLIPS	107,649	75.75	8,154,411.75	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	21.36	1,367,040.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	51,677	43.99	2,273,271.23	

EOG RESOURCES INC	46,119	97.11	4,478,616.09
EXXON MOBIL	340,008	66.36	22,562,930.88
HALLIBURTON CO	68,269	25.08	1,712,186.52
HESS CORP	22,781	86.30	1,966,000.30
KINDER MORGAN INC	169,739	16.82	2,855,009.98
MARATHON PETROLEUM CORP	54,237	67.13	3,640,929.81
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	79,106	33.74	2,669,036.44
ONEOK INC	37,709	64.67	2,438,641.03
PHILLIPS 66	35,503	79.17	2,810,772.51
PIONEER NATURAL RESOURCES	18,224	187.34	3,414,084.16
SCHLUMBERGER	116,716	34.14	3,984,684.24
VALERO ENERGY CORP	34,683	78.25	2,713,944.75
WILLIAMS COS	98,553	28.53	2,811,717.09
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,541	313.84	5,505,067.44
ALBEMARLE CORP	9,440	274.57	2,591,940.80
AMCOR PLC	132,975	12.31	1,636,922.25
AVERY DENNISON CORP	6,638	227.13	1,507,688.94
BALL CORP	25,605	91.28	2,337,224.40
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	172.91	1,483,913.62
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	63.22	1,205,668.62
CORTEVA INC	58,500	47.85	2,799,225.00
CROWN HOLDINGS INC	11,212	106.79	1,197,329.48
DOW INC	60,946	58.79	3,583,015.34
DUPONT DE NEMOURS INC	43,310	81.02	3,508,976.20
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	112.34	1,244,165.50
ECOLAB INC	21,075	230.95	4,867,271.25
FMC CORP	10,507	106.99	1,124,143.93
FREEMPORT-MCMORAN INC	119,724	39.20	4,693,180.80
INT'L PAPER CO	30,800	49.28	1,517,824.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,494	153.12	2,984,921.28
LINDE PLC	41,677	338.62	14,112,665.74
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,673	92.81	2,104,281.13
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,321	421.97	2,245,302.37
MOSAIC CO/THE	31,911	37.51	1,196,981.61
NEWMONT CORPORATION	65,375	56.75	3,710,031.25
NUCOR CORP	23,355	113.40	2,648,457.00
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	134.19	1,031,518.53
PPG INDUSTRIES INC	19,278	161.45	3,112,433.10
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	90.41	945,326.96
SEALED AIR CORP	11,690	64.62	755,407.80
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	20,217	324.05	6,551,318.85
STEEL DYNAMICS INC	18,273	65.73	1,201,084.29

VULCAN MATERIALS CO	10,247	205.78	2,108,627.66
WESTROCK CO	21,356	48.42	1,034,057.52
3 M COMPANY	46,302	181.33	8,395,941.66
ALLEGION PLC	7,601	132.97	1,010,704.97
AMETEK INC	18,006	139.36	2,509,316.16
BOEING CO	44,447	220.79	9,813,453.13
CARRIER GLOBAL CORP	67,383	54.81	3,693,262.23
CATERPILLAR	43,764	209.81	9,182,124.84
CUMMINS INC	12,028	236.20	2,841,013.60
DEERE&CO	23,783	355.81	8,462,229.23
DOVER CORP	12,202	175.39	2,140,108.78
EATON CORP	31,624	174.66	5,523,447.84
EMERSON ELECTRIC CO	49,115	97.50	4,788,712.50
FASTENAL CO	44,846	58.82	2,637,841.72
FORTIVE CORP	25,722	78.63	2,022,520.86
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	104.62	1,078,632.20
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	439.80	2,291,797.80
GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	202.88	3,848,633.60
GENERAL ELECTRIC CO	87,737	111.29	9,764,250.73
GRAINGER (WW) INC	3,846	482.13	1,854,271.98
HEICO CORP	3,640	149.80	545,272.00
HEICO CORP-CLASS A	6,449	139.01	896,475.49
HONEYWELL INTL INC	55,630	227.75	12,669,732.50
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	33.09	1,045,445.46
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	194.75	685,909.50
IDEX CORP	5,916	235.86	1,395,347.76
ILLINOIS TOOL WORKS	25,097	234.82	5,893,277.54
INGERSOLL-RAND INC	31,562	59.50	1,877,939.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	59.31	1,049,787.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	56,689	76.41	4,331,606.49
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	16,974	224.72	3,814,397.28
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,062	309.58	947,933.96
LOCKHEED MARTIN CORP	19,938	338.17	6,742,433.46
MASCO CORP	19,462	65.72	1,279,042.64
NORDSON CORP	4,121	262.95	1,083,616.95
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,113	364.52	4,415,430.76
OTIS WORLDWIDE CORP	33,153	83.54	2,769,601.62
OWENS CORNING	8,642	97.70	844,323.40
PACCAR INC	28,106	88.02	2,473,890.12
PARKER HANNIFIN CORP	10,508	329.57	3,463,121.56
PENTAIR PLC	14,533	74.57	1,083,725.81
PLUG POWER INC	41,884	40.72	1,705,516.48

RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	121,255	90.99	11,032,992.45
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,098	335.64	3,053,652.72
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,314	489.38	4,068,705.32
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	58.76	812,533.28
SMITH (A.O.) CORP	12,146	78.71	956,011.66
SNAP-ON INC	4,000	214.85	859,400.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	188.02	2,368,675.96
SUNRUN INC	13,917	55.99	779,212.83
TEXTRON	18,893	76.43	1,443,991.99
TRANE TECHNOLOGIES PLC	19,522	189.54	3,700,199.88
TRANSDIGM GROUP INC	4,075	685.00	2,791,375.00
UNITED RENTALS INC	6,103	391.50	2,389,324.50
WABTEC CORP	15,024	96.52	1,450,116.48
XYLEM INC	15,209	133.51	2,030,553.59
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	87.82	997,986.48
CINTAS CORP	7,423	436.95	3,243,479.85
CLARIVATE PLC	27,357	23.22	635,229.54
COPART INC	16,617	154.40	2,565,664.80
COSTAR GROUP INC	32,116	83.25	2,673,657.00
EQUIFAX INC	9,509	288.34	2,741,825.06
IHS MARKIT LTD	30,929	126.53	3,913,446.37
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,661	144.51	1,540,621.11
LEIDOS HOLDINGS	11,220	94.38	1,058,943.60
REPUBLIC SERVICES INC	18,483	133.14	2,460,826.62
ROBERT HALF INTL INC	9,566	117.44	1,123,431.04
ROLLINS INC	17,468	35.45	619,240.60
TRANSUNION	15,741	114.91	1,808,798.31
VERISK ANALYTICS INC	12,503	216.29	2,704,273.87
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	133.94	2,849,573.50
WASTE MANAGEMENT INC	34,610	159.58	5,523,063.80
AMERCO	734	745.26	547,020.84
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,292	94.18	1,063,480.56
CSX CORP	186,396	35.54	6,624,513.84
DELTA AIR LINES INC	14,609	44.53	650,538.77
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	125.29	1,788,138.88
FEDEX CORP	20,644	249.48	5,150,265.12
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	195.28	1,377,114.56
KANSAS CITY SOUTHERN	7,340	311.40	2,285,676.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	59.38	635,366.00
LYFT INC-A	21,288	56.26	1,197,662.88
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,853	284.60	5,650,163.80
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	351.94	2,816,575.82

SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	50.91	688,965.03
UBER TECHNOLOGIES INC	99,588	45.51	4,532,249.88
UNION PACIFIC CORP	53,166	241.00	12,813,006.00
UNITED PARCEL SERVICE B	57,890	209.96	12,154,584.40
APTIV PLC	22,055	172.47	3,803,825.85
AUTOLIV INC	6,776	103.14	698,876.64
BORGWARNER INC	19,781	46.50	919,816.50
FORD MOTOR COMPANY	320,829	20.12	6,455,079.48
GENERAL MOTORS CO	103,796	58.62	6,084,521.52
LEAR CORP	5,287	180.16	952,505.92
TESLA INC	65,911	1,023.50	67,459,908.50
DR HORTON INC	27,764	97.52	2,707,545.28
GARMIN LTD	12,854	144.94	1,863,058.76
HASBRO INC	10,572	97.64	1,032,250.08
LENNAR CORP-CL A	22,762	107.66	2,450,556.92
LULULEMON ATHLETICA INC	9,788	470.24	4,602,709.12
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	173.22	876,839.64
NEWELL BRANDS INC	31,461	24.47	769,850.67
NIKE B	102,256	173.82	17,774,137.92
NVR INC	297	5,200.27	1,544,480.19
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	50.13	1,089,625.68
PULTE GROUP INC	21,609	51.91	1,121,723.19
VF CORP	25,718	75.18	1,933,479.24
WHIRLPOOL CORP	5,220	221.06	1,153,933.20
AIRBNB INC-CLASS A	10,665	194.68	2,076,262.20
ARAMARK	20,955	38.57	808,234.35
BOOKING HOLDINGS INC	3,268	2,648.20	8,654,317.60
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	103.07	1,809,909.20
CARNIVAL CORPORATION	70,520	24.17	1,704,468.40
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,304	1,814.90	4,181,529.60
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	155.61	1,666,894.32
DOMINO'S PIZZA INC	3,251	498.49	1,620,590.99
DRAFTKINGS INC - CL A	27,674	43.05	1,191,365.70
EXPEDIA GROUP INC	11,638	188.00	2,187,944.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,878	148.46	3,248,007.88
LAS VEGAS SANDS CORP	29,370	41.08	1,206,519.60
MARRIOTT INTL A	23,009	164.77	3,791,192.93
MCDONALD'S CORP	59,837	252.65	15,117,818.05
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	11.45	202,229.90
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,064	47.33	1,564,919.12
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,267	91.35	1,760,040.45
STARBUCKS CORP	94,298	114.13	10,762,230.74

VAIL RESORTS INC	3,014	359.46	1,083,412.44
WYNN RESORTS LTD	9,302	94.12	875,504.24
YUM BRANDS INC	24,252	126.19	3,060,359.88
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,643	67.10	4,136,245.30
ALPHABET INC-CL A	24,227	2,978.37	72,156,969.99
ALPHABET INC-CL C	23,448	2,984.97	69,991,576.56
ALTICE USA INC- A	22,505	17.54	394,737.70
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	38,290	39.93	1,528,919.70
CABLE ONE INC	445	1,800.69	801,307.05
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	10,540	696.31	7,339,107.40
COMCAST CORP-CL A	368,233	53.75	19,792,523.75
DISCOVERY INC - A	12,804	26.65	341,226.60
DISCOVERY INC-C	28,190	25.74	725,610.60
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	36.86	742,065.52
ELECTRONIC ARTS INC	23,411	139.79	3,272,623.69
FACEBOOK INC-A	192,925	335.37	64,701,257.25
FOX CORP - CLASS A	27,658	40.54	1,121,255.32
FOX CORP- CLASS B	15,092	37.70	568,968.40
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	140.93	947,190.53
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	36.03	1,219,039.02
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	167.64	432,343.56
LIBERTY BROADBAND-C	12,312	170.82	2,103,135.84
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	57.84	889,521.36
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	54.53	740,735.52
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	54.99	351,056.16
LIVE NATION ENTERTAINMENT	13,908	116.61	1,621,811.88
MATCH GROUP INC	20,191	155.59	3,141,517.69
NETFLIX INC	35,617	655.99	23,364,395.83
NEWS CORP-CLASS A	33,479	23.73	794,456.67
OMNICOM GROUP	18,031	68.99	1,243,958.69
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	46.64	2,134,572.88
ROKU INC	9,122	279.77	2,552,061.94
SEA LTD-ADR	5,838	340.91	1,990,232.58
SIRIUS XM HOLDINGS INC	99,548	6.43	640,093.64
SNAP INC - A	75,611	54.82	4,144,995.02
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,738	186.81	1,819,155.78
THE WALT DISNEY CO	146,028	175.11	25,570,963.08
TWITTER INC	63,066	53.70	3,386,644.20
VIACOMCBS INC-CLASS B	48,586	35.50	1,724,803.00
ZILLOW GROUP INC-A	5,497	66.62	366,210.14
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	66.40	891,552.80
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	232.39	1,237,244.36

AMAZON.COM	36,596	3,576.23	130,875,713.08
AUTOZONE INC	1,779	1,866.38	3,320,290.02
BATH & BODY WORKS INC	19,806	75.25	1,490,401.50
BEST BUY COMPANY INC	18,175	132.94	2,416,184.50
BURLINGTON STORES INC	5,108	299.25	1,528,569.00
CARMAX INC	13,891	154.85	2,151,021.35
CARVANA CO	5,700	295.85	1,686,345.00
CHEWY INC - CLASS A	6,878	76.62	526,992.36
DOLLAR GENERAL CORP	18,686	220.18	4,114,283.48
DOLLAR TREE INC	17,931	111.15	1,993,030.65
DOORDASH INC - A	6,300	192.01	1,209,663.00
EBAY	53,823	73.96	3,980,749.08
ETSY INC	10,294	258.67	2,662,748.98
GENUINE PARTS CO	12,119	134.73	1,632,792.87
HOME DEPOT	85,480	370.65	31,683,162.00
LKQ CORP	22,779	57.34	1,306,147.86
LOWES COMPANIES	56,608	233.91	13,241,177.28
MERCADOLIBRE INC	3,567	1,709.98	6,099,498.66
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,694	643.45	3,663,804.30
POOL CORP	3,304	526.31	1,738,928.24
ROSS STORES INC	28,076	119.27	3,348,624.52
TARGET (DAYTON HUDSON)	39,551	255.16	10,091,833.16
TJX COMPANIES INC	96,126	69.68	6,698,059.68
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	220.86	1,970,512.92
ULTA BEAUTY INC	3,990	395.11	1,576,488.90
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	250.61	1,503,660.00
COSTCO WHOLESALE CORP	35,500	508.71	18,059,205.00
KROGER CO	56,126	41.93	2,353,363.18
SYSCO CORP	40,288	79.60	3,206,924.80
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	49.10	2,934,559.70
WALMART INC	124,190	149.79	18,602,420.10
ALTRIA GROUP INC	147,613	44.79	6,611,586.27
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45,402	64.43	2,925,250.86
BOSTON BEER COMPANY INC-A	744	484.97	360,817.68
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26,220	72.50	1,900,950.00
BUNGE LIMITED	11,604	92.89	1,077,895.56
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	41.28	655,072.32
COCA-COLA CO	328,753	56.49	18,571,256.97
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	57.80	889,773.20
CONAGRA BRANDS INC	41,157	32.54	1,339,248.78
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,180	221.64	3,142,855.20
GENERAL MILLS INC	49,646	63.17	3,136,137.82

HERSHEY FOODS CORPORATION	11,352	176.18	1,999,995.36
HORMEL FOODS CORP	23,338	43.25	1,009,368.50
JM SMUCKER CO	9,145	128.58	1,175,864.10
KELLOGG CO	21,630	62.94	1,361,392.20
KEURIG DR PEPPER INC	59,596	35.78	2,132,344.88
KRAFT HEINZ CO/THE	52,188	37.35	1,949,221.80
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	58.78	759,672.72
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,088	80.98	1,707,706.24
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	45.69	670,226.61
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	111,937	62.24	6,966,958.88
MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	91.76	2,960,819.92
PEPSICO INC	110,876	163.51	18,129,334.76
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	124,866	93.67	11,696,198.22
TYSON FOODS INC	25,074	81.52	2,044,032.48
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,055	89.66	1,887,791.30
CLOROX COMPANY	9,570	166.15	1,590,055.50
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,788	78.05	4,978,653.40
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,438	347.07	6,399,276.66
KIMBERLY-CLARK CORP	27,550	132.46	3,649,273.00
PROCTER & GAMBLE CO	196,819	145.39	28,615,514.41
ABBOTT LABORATORIES	142,590	126.43	18,027,653.70
ABIOMED INC	3,781	371.35	1,404,074.35
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	711.02	4,225,591.86
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	124.67	1,607,744.32
ANTHEM INC	19,533	430.12	8,401,533.96
BAXTER INTERNATIONAL	40,994	77.70	3,185,233.80
BECTON DICKINSON & CO	23,131	243.66	5,636,099.46
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,802	42.79	4,826,797.58
CARDINAL HEALTH	24,692	49.32	1,217,809.44
CENTENE CORP	48,540	74.77	3,629,335.80
CERNER CORP	25,323	74.16	1,877,953.68
CIGNA CORP	27,283	216.20	5,898,584.60
CVS HEALTH CORP	105,249	92.76	9,762,897.24
DANAHER CORP	51,501	299.19	15,408,584.19
DAVITA INC	5,784	106.81	617,789.04
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	55.77	991,255.98
DEXCOM INC	7,647	637.05	4,871,521.35
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	51,036	120.04	6,126,361.44
HCA HEALTHCARE INC	21,426	246.14	5,273,795.64
HENRY SCHEIN INC	11,747	78.15	918,028.05
HOLOGIC INC	21,687	71.26	1,545,415.62
HUMANA INC	10,553	450.40	4,753,071.20

IDEXX LABORATORIES INC	6,751	629.26	4,248,134.26
INSULET CORP	5,311	318.29	1,690,438.19
INTUITIVE SURGICAL INC	28,389	364.15	10,337,854.35
LABORATORY CRP OF AMER	7,595	276.55	2,100,397.25
MASIMO CORP	4,147	287.79	1,193,465.13
MCKESSON CORP	12,843	219.46	2,818,524.78
MEDTRONIC PLC	108,067	122.29	13,215,513.43
MOLINA HEALTHCARE INC	4,940	305.38	1,508,577.20
NOVOCURE LTD	7,933	106.11	841,770.63
OAK STREET HEALTH INC	7,613	37.14	282,746.82
QUEST DIAGNOSTICS	10,005	142.03	1,421,010.15
RESMED INC	11,440	261.65	2,993,276.00
STERIS PLC	8,018	228.99	1,836,041.82
STRYKER CORP	27,043	275.17	7,441,422.31
TELADOC HEALTH INC	11,375	143.06	1,627,307.50
TELEFLEX INC	3,934	342.32	1,346,686.88
THE COOPER COS INC	4,134	433.63	1,792,626.42
UNITEDHEALTH GROUP INC	75,880	464.35	35,234,878.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	128.43	783,679.86
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	320.09	3,602,612.95
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	414.11	2,388,172.37
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,300	134.38	2,324,774.00
10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	168.19	951,114.45
ABBVIE INC	141,675	115.61	16,379,046.75
AGILENT TECHNOLOGIES	24,927	159.81	3,983,583.87
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	183.92	1,773,540.56
AMGEN	45,952	211.71	9,728,497.92
AVANTOR INC	42,980	39.10	1,680,518.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	732.08	1,356,544.24
BIO-TECHNE CORP	3,245	502.14	1,629,444.30
BIOGEN INC	11,860	270.03	3,202,555.80
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	82.76	1,223,441.08
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	178,823	59.46	10,632,815.58
CATALENT INC	13,739	125.04	1,717,924.56
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	383.45	1,612,023.80
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	33.10	1,193,619.10
EXACT SCIENCES CORP	14,756	99.38	1,466,451.28
GILEAD SCIENCES INC	100,025	66.15	6,616,653.75
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	107.63	1,929,375.38
ILLUMINA INC	11,968	395.36	4,731,668.48
INCYTE CORP	15,212	66.53	1,012,054.36
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	251.80	3,808,726.80

JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	132.00	656,172.00
JOHNSON & JOHNSON	211,820	162.51	34,422,868.20
LILLY (ELI) & CO	65,377	262.02	17,130,081.54
MERCK & CO	203,094	82.72	16,799,935.68
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,917	1,557.51	2,985,746.67
MODERNA INC	27,309	236.85	6,468,136.65
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	92.07	780,201.18
NOVAVAX INC	5,754	169.30	974,152.20
PERKINELMER INC	9,372	174.55	1,635,882.60
PFIZER	449,496	47.30	21,261,160.80
PPD INC	11,027	47.23	520,805.21
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,586	616.31	5,291,637.66
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	15,534	39.60	615,146.40
SEAGEN INC	11,471	185.86	2,132,000.06
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	9.30	747,729.30
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,550	618.58	19,516,199.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,153	191.09	4,042,126.77
VIATRIS INC	103,541	14.57	1,508,592.37
WATERS CORP	5,228	350.15	1,830,584.20
ZOETIS INC	37,880	220.22	8,341,933.60
BANK OF AMERICA CORP	619,949	46.88	29,063,209.12
CITIGROUP	165,561	67.99	11,256,492.39
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,041	47.83	1,723,841.03
FIFTH THIRD BANCORP	57,022	44.09	2,514,099.98
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,787	219.32	3,023,764.84
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	15.87	1,810,957.44
JPMORGAN CHASE & CO	243,564	167.78	40,865,167.92
KEY CORP	83,212	23.71	1,972,956.52
M & T BANK CORP	10,537	154.61	1,629,125.57
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	33,857	207.04	7,009,753.28
REGIONS FINL CORP	81,824	24.34	1,991,596.16
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	750.47	3,410,886.15
TRUIST FINANCIAL CORP	107,118	64.74	6,934,819.32
US BANCORP	112,812	60.07	6,776,616.84
WELLS FARGO & CO	331,600	49.89	16,543,524.00
ALLY FINANCIAL INC	31,445	49.08	1,543,320.60
AMERICAN EXPRESS	54,596	179.86	9,819,636.56
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,404	305.20	2,870,100.80
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,153	76.29	1,156,022.37
BANK NEW YORK CO	67,972	58.58	3,981,799.76
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	106,664	286.35	30,543,236.40
BLACKROCK INC	12,198	966.75	11,792,416.50

BLACKSTONE INC	54,507	146.39	7,979,279.73
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	37,066	155.42	5,760,797.72
CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	59.45	748,772.75
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	131.22	1,164,577.50
CME GROUP INC	28,556	221.73	6,331,721.88
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	24,840	116.81	2,901,560.40
EQUITABLE HOLDINGS INC	32,815	34.51	1,132,445.65
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	445.78	1,403,315.44
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	35.72	931,220.40
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	54.76	236,344.16
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,184	405.35	11,019,034.40
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,703	135.48	6,056,362.44
INVESCO LTD	26,420	26.01	687,184.20
KKR & CO INC	43,643	79.65	3,476,164.95
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	387.19	1,241,718.33
MOODY'S CORP	13,365	392.30	5,243,089.50
MORGAN STANLEY	111,716	99.71	11,139,202.36
MSCI INC	6,518	652.82	4,255,080.76
NASDAQ INC	9,657	210.81	2,035,792.17
NORTHERN TRUST CORP	15,902	121.89	1,938,294.78
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	219.66	3,933,451.62
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	99.90	1,547,051.40
S&P GLOBAL INC	19,238	461.98	8,887,571.24
SCHWAB (CHARLES) CORP	115,518	80.78	9,331,544.04
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	64.29	613,969.50
STATE STREET CORP	29,894	96.03	2,870,720.82
SYNCHRONY FINANCIAL	45,369	49.31	2,237,145.39
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	95.55	865,778.55
VOYA FINANCIAL INC	10,050	65.94	662,697.00
AFLAC	50,591	56.28	2,847,261.48
ALLEGHANY CORP	1,276	692.08	883,094.08
ALLSTATE CORP	24,717	115.19	2,847,151.23
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	144.77	914,801.63
AMERICAN INT'L GROUP	71,038	58.76	4,174,192.88
AON PLC	18,508	297.53	5,506,685.24
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,031	42.02	1,429,982.62
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	161.56	2,642,960.04
ASSURANT INC	4,726	160.43	758,192.18
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	10,207	86.44	882,293.08
BROWN & BROWN INC	19,873	63.01	1,252,197.73
CHUBB LTD	35,817	193.52	6,931,305.84
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	124.16	1,588,130.56

ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	225.92	489,342.72
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	272.44	895,782.72
FNF GROUP	20,461	50.72	1,037,781.92
GLOBE LIFE INC	8,106	92.34	748,508.04
HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,721	72.17	2,000,624.57
LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	72.21	973,679.64
LOEWS CORP	18,851	57.66	1,086,948.66
MARKEL CORP	1,156	1,304.39	1,507,874.84
MARSH & MCLENNAN COS	40,497	164.92	6,678,765.24
METLIFE INC	60,762	62.97	3,826,183.14
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,072	68.31	1,576,048.32
PROGRESSIVE CORP	47,880	95.45	4,570,146.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,037	109.16	3,387,998.92
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,733	155.98	582,273.34
TRAVELERS COS INC/THE	19,772	157.40	3,112,112.80
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,061	233.38	2,348,036.18
WR BERKLEY CORP	11,715	81.32	952,663.80
CBRE GROUP INC-A	27,882	106.02	2,956,049.64
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	5.70	562,590.00
WEYERHAEUSER CO	58,295	37.55	2,188,977.25
ACCENTURE PLC-CL A	50,998	367.47	18,740,235.06
ADOBE INC	38,396	667.92	25,645,456.32
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	109.32	1,494,732.36
ANSYS INC	6,794	405.97	2,758,160.18
AUTODESK INC	17,467	329.40	5,753,629.80
AUTOMATIC DATA PROCESS	33,910	229.20	7,772,172.00
AVALARA INC	6,847	162.80	1,114,691.60
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	60.26	843,398.96
BLACK KNIGHT INC	11,543	77.61	895,852.23
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	178.36	1,737,583.12
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,922	182.37	3,997,915.14
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	121.47	1,295,841.96
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	118.36	961,556.64
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	90.35	943,615.40
CLOUDFLARE INC - CLASS A	17,902	204.60	3,662,749.20
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	42,997	80.51	3,461,688.47
COUPA SOFTWARE INC	6,059	241.52	1,463,369.68
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,466	293.18	4,534,321.88
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	198.81	616,311.00
DATADOG INC - CLASS A	15,147	196.56	2,977,294.32
DOCUSIGN INC	15,919	275.17	4,380,431.23
DROPBOX INC-CLASS A	28,845	28.53	822,947.85

DYNATRACE INC	14,790	76.04	1,124,631.60
EPAM SYSTEMS INC	4,403	717.08	3,157,303.24
FAIR ISAAC CORP	2,125	403.74	857,947.50
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	50,915	115.47	5,879,155.05
FISERV INC	49,211	99.62	4,902,399.82
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,523	244.08	1,592,133.84
FORTINET INC	11,565	349.06	4,036,878.90
GARTNER INC	6,968	339.34	2,364,521.12
GLOBAL PAYMENTS INC	24,126	132.82	3,204,415.32
GODADDY INC - CLASS A	13,798	71.71	989,454.58
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	127.83	807,629.94
HUBSPOT INC	3,646	850.32	3,100,266.72
INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,479	120.85	8,638,237.15
INTUIT INC	21,881	612.78	13,408,239.18
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	159.04	1,000,520.64
MASTERCARD INC-CLASS A	71,090	344.65	24,501,168.50
MICROSOFT CORP	576,923	335.95	193,817,281.85
MONGODB INC	4,623	576.77	2,666,407.71
NORTONLIFELOCK INC	50,376	25.11	1,264,941.36
OKTA INC	10,230	268.28	2,744,504.40
ORACLE CORP	150,256	94.59	14,212,715.04
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	24.25	3,037,167.00
PALO ALTO NETWORKS INC	7,957	512.32	4,076,530.24
PAYCHEX INC	25,433	122.97	3,127,496.01
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	507.33	2,148,542.55
PAYPAL HOLDINGS INC	89,664	205.42	18,418,778.88
PTC INC	8,304	122.37	1,016,160.48
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	233.64	1,493,660.52
SALESFORCE.COM INC	78,035	309.71	24,168,219.85
SERVICENOW INC	15,788	691.27	10,913,770.76
SNOWFLAKE INC-CLASS A	15,775	376.70	5,942,442.50
SPLUNK INC	13,355	173.31	2,314,555.05
SQUARE INC - A	31,267	230.78	7,215,798.26
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	79.18	1,530,945.30
SYNOPSYS INC	12,038	348.26	4,192,353.88
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	35,780	97.09	3,473,880.20
TWILIO INC - A	12,842	310.60	3,988,725.20
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	541.77	1,808,970.03
UNITY SOFTWARE INC	4,329	171.63	742,986.27
VERISIGN INC	7,790	233.58	1,819,588.20
VISA INC-CLASS A SHARES	136,046	213.39	29,030,855.94
VMWARE INC-CLASS A	16,717	128.95	2,155,657.15

WESTERN UNION CO	29,297	18.05	528,810.85
WIX.COM LTD	5,010	200.90	1,006,509.00
WORKDAY INC-CLASS A	15,505	293.48	4,550,407.40
ZENDESK INC	10,500	100.35	1,053,675.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,545	258.40	4,533,628.00
ZSCALER INC	6,234	352.61	2,198,170.74
AMPHENOL CORPORATION	48,807	82.29	4,016,328.03
APPLE INC	1,345,437	150.81	202,905,353.97
ARISTA NETWORKS INC	4,720	531.36	2,508,019.20
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	119.98	731,878.00
CDW CORP/DE	10,882	187.02	2,035,151.64
CISCO SYSTEMS	338,342	57.44	19,434,364.48
COGNEX CORP	14,352	83.20	1,194,086.40
CORNING	64,989	38.22	2,483,879.58
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	56.08	1,260,734.48
F5 NETWORKS INC	5,350	225.56	1,206,746.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	109,149	15.53	1,695,083.97
HP INC	98,163	31.77	3,118,638.51
IPG PHOTONICS CORP	3,207	168.52	540,443.64
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	31.42	795,585.82
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	185.86	2,785,855.54
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,091	249.43	3,514,718.13
NETAPP INC	18,303	91.80	1,680,215.40
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	17,940	99.29	1,781,262.60
TE CONNECTIVITY LTD	26,068	161.06	4,198,512.08
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	438.99	1,711,622.01
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	88.40	1,871,958.40
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	56.25	1,450,687.50
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	595.72	2,479,386.64
AT&T INC	572,789	24.71	14,153,616.19
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	28.52	442,516.32
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	28.44	781,730.28
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	14.00	1,032,766.00
T-MOBILE US INC	49,657	119.86	5,951,888.02
VERIZON COMMUNICATIONS	332,338	52.24	17,361,337.12
AES CORP	54,375	23.89	1,299,018.75
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	55.43	1,151,724.54
AMEREN CORPORATION	20,898	83.04	1,735,369.92
AMERICAN ELECTRIC POWER	41,494	83.04	3,445,661.76
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,174	169.52	2,402,776.48
ATMOS ENERGY CORP	11,419	93.14	1,063,565.66
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	26.52	1,277,256.24

CMS ENERGY CORP	23,697	60.07	1,423,478.79
CONSOLIDATED EDISON INC	28,745	77.83	2,237,223.35
DOMINION ENERGY INC	66,075	74.58	4,927,873.50
DTE ENERGY COMPANY	16,240	112.50	1,827,000.00
DUKE ENERGY CORP	63,155	101.96	6,439,283.80
EDISON INTL	32,117	64.60	2,074,758.20
ENERGY CORP	16,926	102.32	1,731,868.32
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	47.25	984,406.50
EVERGY INC	18,475	64.12	1,184,617.00
EVERSOURCE ENERGY	26,753	83.32	2,229,059.96
EXELON CORP	77,196	54.09	4,175,531.64
FIRSTENERGY CORP	45,787	38.30	1,753,642.10
NEXTERA ENERGY INC	157,142	84.94	13,347,641.48
NISOURCE INC	35,781	25.03	895,598.43
NRG ENERGY INC	19,068	34.89	665,282.52
PG&E CORP	118,132	12.18	1,438,847.76
PINNACLE WEST CAPITAL	8,632	63.36	546,923.52
PPL CORPORATION	63,429	28.75	1,823,583.75
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	62.16	2,453,330.88
SEMPRA ENERGY	25,825	125.06	3,229,674.50
SOUTHERN CO	84,113	63.35	5,328,558.55
UGI CORP	18,019	44.60	803,647.40
VISTRA CORP	37,797	19.34	730,993.98
WEC ENERGY GROUP INC	24,561	89.79	2,205,332.19
XCEL ENERGY INC	43,741	63.60	2,781,927.60
ADVANCED MICRO DEVICES	97,184	148.92	14,472,641.28
ANALOG DEVICES	42,907	185.00	7,937,795.00
APPLIED MATERIALS	73,379	156.29	11,468,403.91
BROADCOM INC	32,757	557.80	18,271,854.60
ENPHASE ENERGY INC	10,113	239.39	2,420,951.07
INTEL CORP	324,092	51.20	16,593,510.40
KLA CORP	12,119	417.11	5,054,956.09
LAM RESEARCH CORP	11,353	621.91	7,060,544.23
MARVELL TECHNOLOGY INC	66,930	72.94	4,881,874.20
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,808	82.92	3,715,479.36
MICRON TECHNOLOGY	89,326	75.59	6,752,152.34
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	553.47	1,954,302.57
NVIDIA CORP	200,518	306.57	61,472,803.26
NXP SEMICONDUCTORS NV	21,843	221.05	4,828,395.15
ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	58.20	2,094,967.20
QORVO INC	9,678	157.64	1,525,639.92
QUALCOMM	90,340	166.74	15,063,291.60

	SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	164.16	2,195,147.52
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,600	351.14	1,615,244.00
	TERADYNE INC	14,398	145.42	2,093,757.16
	TEXAS INSTRUMENTS	74,049	190.79	14,127,808.71
	XILINX INC	19,302	205.00	3,956,910.00
	アメリカドル 小計	25,534,686		3,355,148,974.40 (378,662,113,250)
カナダドル	CAMECO CORP	26,880	34.47	926,553.60
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,194	54.24	5,054,842.56
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	16.36	1,581,455.76
	ENBRIDGE	163,399	52.62	8,598,055.38
	IMPERIAL OIL	24,763	43.33	1,072,980.79
	KEYERA CORP	18,607	30.62	569,746.34
	PARKLAND CORP	14,075	35.97	506,277.75
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	42.89	1,958,614.74
	SUNCOR ENERGY	116,208	32.67	3,796,515.36
	TC ENERGY CORP	77,328	62.83	4,858,518.24
	AGNICO EAGLE MINES	20,293	69.06	1,401,434.58
	B2GOLD CORP	90,243	5.47	493,629.21
	BARRICK GOLD CORP	139,009	24.41	3,393,209.69
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	70.46	925,773.94
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	27.63	1,188,090.00
	FRANCO-NEVADA CORP	15,363	181.23	2,784,236.49
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	9.76	506,026.72
	KINROSS GOLD CORP	108,451	7.77	842,664.27
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,428	54.33	1,272,843.24
	LUNDIN MINING CORP	62,243	10.78	670,979.54
	NUTRIEN LTD	44,786	85.24	3,817,558.64
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	33.34	613,822.74
	TECK RESOURCES LTD-CL B	40,561	33.96	1,377,451.56
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	103.69	808,782.00
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,238	52.44	1,795,440.72
	YAMANA GOLD INC	81,672	5.31	433,678.32
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	19,724	21.03	414,795.72
	CAE INC	25,999	42.36	1,101,317.64
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,705	112.59	867,505.95
	WSP GLOBAL INC	8,602	172.53	1,484,103.06
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	48.30	652,291.50
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	87.91	900,637.95
	THOMSON REUTERS CORP	13,293	150.04	1,994,481.72
	AIR CANADA	13,805	26.41	364,590.05
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	57,324	164.28	9,417,186.72

CP RAILWAY LIMITED	52,569	96.91	5,094,461.79
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	104.51	2,433,201.82
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	52.21	891,694.59
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	72.29	1,667,947.17
QUEBECOR INC -CL B	15,200	30.26	459,952.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	36.70	1,299,987.40
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	185.44	1,003,044.96
DOLLARAMA INC	22,000	58.19	1,280,180.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	66,914	50.35	3,369,119.90
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	39.07	595,934.71
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	96.98	1,252,302.74
METRO INC	18,840	65.29	1,230,063.60
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	137.66	947,513.78
SAPUTO INC	14,489	31.57	457,417.73
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	34.30	953,540.00
CANOPY GROWTH CORP	20,989	17.38	364,788.82
BANK MONTREAL	51,389	139.40	7,163,626.60
BANK NOVA SCOTIA	96,500	82.84	7,994,060.00
CANADIAN IMPERIAL BANK	36,854	148.43	5,470,239.22
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	104.47	2,850,881.83
ROYAL BANK OF CANADA	114,053	132.23	15,081,228.19
TORONTO-DOMINION BANK	145,443	91.65	13,329,850.95
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	102,035	76.40	7,795,474.00
IGM FINANCIAL INC	7,685	51.14	393,010.90
ONEX CORP	6,603	94.42	623,455.26
TMX GROUP LTD	4,685	134.38	629,570.30
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	526.56	1,123,152.48
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	38.59	917,978.92
IA FINANCIAL CORP INC	10,099	74.13	748,638.87
INTACT FINANCIAL CORP	13,312	166.19	2,212,321.28
MANULIFE FINANCIAL CORP	163,056	24.82	4,047,049.92
POWER CORP OF CANADA	43,577	42.75	1,862,916.75
SUN LIFE FINANCIAL INC	45,702	71.18	3,253,068.36
FIRSTSERVICE CORP	3,690	244.28	901,393.20
BLACKBERRY LIMITED	39,400	13.91	548,054.00
CGI INC - CL A	18,428	114.77	2,114,981.56
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,661	2,189.05	3,636,012.05
LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	88.68	735,689.28
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	139.66	600,677.66
OPEN TEXT CORP	20,463	64.95	1,329,071.85
SHOPIFY INC - CLASS A	9,030	1,935.30	17,475,759.00
BCE INC	6,203	63.86	396,123.58

	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,584	60.90	1,862,565.60
	TELUS CORP	32,908	29.23	961,900.84
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	17.77	920,805.86
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	25.14	613,290.30
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	41.04	215,090.64
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	50.16	566,557.20
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	34.96	360,927.04
	EMERA INC	18,723	58.34	1,092,299.82
	FORTIS INC	36,823	56.43	2,077,921.89
	HYDRO ONE LTD	23,269	30.43	708,075.67
	NORTHLAND POWER INC	17,854	39.03	696,841.62
	カナダドル 小計	3,288,496		205,057,805.99 (18,598,743,003)
ユーロ	ENI	197,669	12.62	2,494,582.78
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	8.89	437,433.04
	NESTE OIL OYJ	32,126	48.39	1,554,577.14
	OMV AG	12,549	53.60	672,626.40
	REPSOL SA	111,112	10.80	1,200,676.27
	TENARIS SA	40,648	10.85	441,030.80
	TOTALENERGIES SE	199,789	43.53	8,697,814.11
	VOPAK	6,360	33.51	213,123.60
	AIR LIQUIDE	38,463	150.90	5,804,066.70
	AKZO NOBEL	15,301	101.80	1,557,641.80
	ARCELORMITTAL	55,231	27.74	1,532,384.09
	ARKEMA	4,369	117.45	513,139.05
	BASF SE	74,374	61.71	4,589,619.54
	COVESTRO AG	14,454	55.28	799,017.12
	CRH PLC	64,773	43.78	2,835,761.94
	EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	27.65	546,198.10
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	41.50	239,123.00
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	64.68	843,491.88
	KONINKLIJKE DSM NV	13,707	190.20	2,607,071.40
	LANXESS	7,293	54.92	400,531.56
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	45.59	889,187.36
	SOLVAY SA	5,356	103.80	555,952.80
	STORA ENSO OYJ R	42,169	14.47	610,396.27
	SYMRISE AG	9,776	123.45	1,206,847.20
	UMICORE	17,605	49.87	877,961.35
	UPM KYMMENE OYJ	45,603	30.88	1,408,220.64
	VOESTALPINE AG	7,152	33.46	239,305.92
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,729	23.21	481,120.09
	AIRBUS SE	47,862	116.32	5,567,307.84

ALSTOM	24,388	31.90	777,977.20
BOUYGUES ORD	16,606	33.38	554,308.28
BRENTAG SE	12,514	79.10	989,857.40
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	15.03	1,218,225.91
DASSAULT AVIATION SA	2,130	95.55	203,521.50
EIFFAGE	5,924	92.16	545,955.84
FERROVIAL SA	41,438	26.87	1,113,439.06
FERROVIAL SA-RTS	41,438	0.31	12,887.21
GEA GROUP AG	13,382	44.13	590,547.66
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	100.95	1,251,578.10
KION GROUP AG	5,887	96.84	570,097.08
KNORR-BREMSE AG	6,822	94.36	643,723.92
KONE OYJ-B	26,311	58.82	1,547,613.02
LEGRAND SA	21,768	94.54	2,057,946.72
MTU AERO ENGINES AG	4,753	203.70	968,186.10
PRYSMIAN SPA	21,155	33.58	710,384.90
RATIONAL AG	483	894.80	432,188.40
SAFRAN SA	28,410	120.62	3,426,814.20
SAINT-GOBAIN	40,093	60.64	2,431,239.52
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,968	154.28	6,629,103.04
SIEMENS	61,210	145.70	8,918,297.00
SIEMENS ENERGY AG	36,181	24.58	889,328.98
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	20.60	462,161.00
THALES SA	9,665	83.60	807,994.00
VINCI S.A.	43,434	94.44	4,101,906.96
WARTSILA OYJ	41,917	12.52	525,010.42
BUREAU VERITAS SA	25,073	29.10	729,624.30
RANDSTAD NV	11,218	62.46	700,676.28
TELEPERFORMANCE	4,734	357.60	1,692,878.40
WOLTERS KLUWER	20,839	94.54	1,970,119.06
ADP	2,382	122.95	292,866.90
AENA SME SA	6,542	149.80	979,991.60
ATLANTIA SPA	35,937	17.09	614,163.33
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	7.00	162,973.81
DEUTSCHE POST AG-REG	78,714	56.31	4,432,385.34
GETLINK	29,362	13.83	406,223.27
INPOST SA	12,480	14.32	178,738.56
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	90.66	2,366,860.62
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	77.00	384,307.00
CONTINENTAL AG	8,168	105.50	861,724.00
DAIMLER AG	69,397	87.42	6,066,685.74
FAURECIA	10,948	46.48	508,863.04

FERRARI NV	10,170	221.70	2,254,689.00
MICHELIN	13,839	135.40	1,873,800.60
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	85.82	1,007,955.90
RENAULT SA	17,362	33.65	584,318.11
STELLANTIS NV	159,744	17.44	2,785,935.36
VALEO SA	21,538	27.62	594,879.56
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,167	185.72	2,816,815.24
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	285.20	709,007.20
ADIDAS AG	15,395	295.50	4,549,222.50
ESSILORLUXOTTICA	23,442	184.64	4,328,330.88
HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,440.50	3,657,429.50
KERING	5,855	681.90	3,992,524.50
LVMH	22,273	707.30	15,753,692.90
MONCLER SPA	14,361	66.02	948,113.22
PUMA SE	9,220	111.50	1,028,030.00
SEB SA	2,282	134.80	307,613.60
ACCOR	14,436	33.16	478,697.76
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,048	145.65	1,900,441.20
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	45.37	367,859.96
SODEXO	8,135	83.82	681,875.70
BOLLORE	83,646	5.11	427,431.06
PUBLICIS GROUPE	17,077	57.54	982,610.58
SCOUT24 SE	7,492	63.46	475,442.32
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	47.00	332,337.00
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	61,243	26.46	1,620,489.78
VIVENDI SE	61,243	10.97	671,835.71
DELIVERY HERO SE	13,414	109.75	1,472,186.50
HELLOFRESH SE	13,805	85.68	1,182,812.40
INDITEX	87,326	31.89	2,784,826.14
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	63.05	981,814.60
PROSUS	75,024	72.66	5,451,243.84
ZALANDO SE	17,664	76.44	1,350,236.16
CARREFOUR	52,544	15.79	829,932.48
COLRUYT SA	5,424	42.54	230,736.96
JERONIMO MARTINS	24,901	20.65	514,205.65
KESKO OYJ-B SHS	20,083	29.18	586,021.94
KONINKLIJKE AHOLD NV	87,400	28.53	2,493,522.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,098	51.81	3,113,677.38
DANONE (GROUPE)	51,543	57.26	2,951,352.18
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	12.78	627,204.06
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	80.25	742,392.75
HEINEKEN NV	20,157	96.14	1,937,893.98

JDE PEET'S BV	7,000	25.70	179,900.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	115.35	1,505,317.50
PERNOD-RICARD	16,970	205.30	3,483,941.00
REMY COINTREAU	2,382	178.90	426,139.80
BEIERSDORF AG	7,430	92.96	690,692.80
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	72.25	634,355.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	77.42	1,117,867.38
LOREAL	20,148	414.55	8,352,353.40
AMPLIFON SPA	11,650	46.54	542,191.00
BIOMERIEUX	4,175	106.90	446,307.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	182.30	625,289.00
DIASORIN SPA	2,070	182.80	378,396.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,472	58.34	1,019,316.48
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	37.77	1,272,433.53
KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	41.51	2,978,550.05
ORPEA	4,336	91.22	395,529.92
SARTORIUS AG-VORZUG	2,224	557.60	1,240,102.40
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	59.52	1,283,667.84
ARGENX SE	3,428	278.50	954,698.00
BAYER	79,047	50.75	4,011,635.25
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	102.76	1,050,207.20
GRIFOLS SA	27,685	18.43	510,372.97
IPSEN	3,532	85.14	300,714.48
MERCK KGAA	10,555	208.20	2,197,551.00
ORION OYJ-CLASS B	9,854	38.22	376,619.88
QIAGEN N.V.	17,038	46.26	788,177.88
RECORDATI SPA	9,859	56.00	552,104.00
SANOFI	90,684	88.61	8,035,509.24
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,419	469.30	1,135,236.70
UCB (GROUPE)	9,389	104.90	984,906.10
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	12.73	508,513.69
BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	5.97	3,194,754.61
BANCO SANTANDER SA	1,404,532	3.19	4,482,563.87
BNP PARIBAS	89,478	58.87	5,267,569.86
CAIXABANK	380,168	2.48	945,477.81
COMMERZBANK AG	94,388	6.70	632,399.60
CREDIT AGRICOLE SA	89,515	13.10	1,172,646.50
ERSTE GROUP BANK AG	23,905	41.31	987,515.55
FINECOBANK SPA	53,120	16.96	901,180.80
ING GROEP NV-CVA	320,768	13.15	4,220,665.34
INTESA SANPAOLO	1,346,514	2.47	3,326,562.83
KBC GROEP NV	21,052	85.06	1,790,683.12

MEDIOBANCA	53,990	10.71	578,502.85
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	28.50	355,965.00
SOCIETE GENERALE	67,846	29.51	2,002,474.69
UNICREDIT SPA	168,352	11.38	1,916,855.87
AMUNDI SA	4,626	78.30	362,215.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	160,613	10.99	1,765,458.09
DEUTSCHE BOERSE	14,999	149.45	2,241,600.55
EURAZEO SA	3,357	77.55	260,335.35
EXOR NV	7,825	83.74	655,265.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	103.45	880,876.75
SOFINA	1,238	396.00	490,248.00
WENDEL	2,023	115.60	233,858.80
AEGON	166,267	4.26	709,461.28
AGEAS	16,065	42.40	681,156.00
ALLIANZ SE-REG	32,896	203.30	6,687,756.80
ASSICURAZIONI GENERALI	85,637	18.98	1,625,818.44
AXA SA	155,519	25.35	3,943,184.24
CNP ASSURANCES	16,287	21.67	352,939.29
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	162.20	702,812.60
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,376	253.95	2,888,935.20
NN GROUP NV	22,611	46.43	1,049,828.73
POSTE ITALIANE SPA	46,035	12.44	572,675.40
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	44.82	1,732,517.10
SCOR SE	13,354	28.00	373,912.00
AROUNDTOWN SA	94,068	6.21	584,914.82
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	130.65	689,178.75
VONOVIA SE	45,080	52.12	2,349,569.60
ADYEN NV	1,566	2,606.00	4,080,996.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	64.24	2,285,916.16
ATOS SE	9,750	42.80	417,300.00
BECHTLE AG	7,659	69.14	529,543.26
CAPGEMINI SA	12,715	212.20	2,698,123.00
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	54.82	2,892,686.94
EDENRED	18,664	44.52	830,921.28
NEMETSCHEK SE	5,455	114.15	622,688.25
NEXI SPA	31,458	14.50	456,141.00
SAP SE	83,616	128.32	10,729,605.12
TEAMVIEWER AG	14,174	14.53	206,019.09
WORLDLINE SA	20,332	50.05	1,017,616.60
NOKIA OYJ	450,608	5.05	2,275,570.40
CELLNEX TELECOM SA	41,435	53.58	2,220,087.30
DEUTSCHE TELEKOM	269,906	16.53	4,463,705.42

ELISA A	10,227	53.84	550,621.68	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.74	296,095.50	
KPN (KON.)	282,927	2.61	739,571.17	
ORANGE	153,815	9.65	1,484,776.19	
PROXIMUS	13,141	16.68	219,257.58	
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.32	280,489.60	
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.34	161,871.61	
TELEFONICA	402,460	3.81	1,536,391.05	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.44	241,358.17	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	34.44	327,627.72	
E.ON SE	185,377	11.01	2,042,113.03	
EDP RENOVAVEIS SA	21,466	22.40	480,838.40	
ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	12.91	510,216.11	
ELIA GROUP SA/NV	2,925	101.90	298,057.50	
ENAGAS	15,690	19.80	310,662.00	
ENDESA	25,972	19.54	507,492.88	
ENEL	651,071	7.09	4,618,697.67	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.75	1,072,326.75	
ENGIE	141,564	12.71	1,800,410.95	
FORTUM OYJ	32,550	25.93	844,021.50	
IBERDROLA SA	487,356	10.10	4,922,295.60	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,310	23.12	538,927.20	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	17.93	710,601.76	
RWE STAMM	49,680	32.07	1,593,237.60	
SNAM SPA	147,559	5.01	739,565.70	
SUEZ	32,549	19.71	641,703.53	
TERNA SPA	102,810	6.63	682,041.54	
UNIPER SE	7,335	38.91	285,404.85	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,427	29.58	1,284,570.66	
VERBUND AG	6,430	87.40	561,982.00	
ASM INTERNATIONAL NV	3,483	418.80	1,458,680.40	
ASML HOLDING NV	33,716	731.70	24,669,997.20	
INFINEON TECHNOLOGIES	105,296	41.73	4,394,528.56	
STMICROELECTRONICS	55,076	44.27	2,438,214.52	
ユーロ 小計	15,511,770		407,487,525.00 (53,311,592,895)	
イギリスポンド				
BP PLC	1,615,015	3.44	5,562,919.16	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	327,167	16.77	5,486,590.59	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	295,308	16.82	4,968,261.79	
ANGLO AMERICAN PLC	102,156	27.29	2,788,348.02	
ANTOFAGASTA PLC	35,856	13.95	500,370.48	
BHP GROUP PLC	167,196	18.94	3,167,361.02	

CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	96.12	1,050,014.88
EVRAZ PLC	43,000	6.11	262,816.00
GLENCORE PLC	823,141	3.55	2,925,854.68
JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	27.26	459,276.48
MONDI PLC	36,710	18.25	669,957.50
RIO TINTO PLC REG	91,370	44.40	4,057,284.85
ASHTED GROUP PLC	37,034	62.60	2,318,328.40
BAE SYSTEMS PLC	260,104	5.67	1,476,870.51
BUNZL PLC	24,880	27.21	676,984.80
DCC PLC	9,127	60.42	551,453.34
FERGUSON PLC	17,761	114.30	2,030,082.30
MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	1.65	528,431.49
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	1.46	933,895.95
SMITHS GROUP PLC	37,146	14.03	521,344.11
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	163.50	901,539.00
EXPERIAN PLC	74,115	34.49	2,556,226.35
INTERTEK GROUP PLC	13,890	51.58	716,446.20
RELX PLC	158,847	23.38	3,713,842.86
RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	6.08	854,399.36
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	6.50	475,813.00
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	10,924	42.31	462,194.44
BURBERRY GROUP PLC	29,776	19.87	591,649.12
PERSIMMON PLC	25,686	26.50	680,679.00
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.54	406,720.16
COMPASS GROUP PLC	142,427	15.80	2,251,058.73
ENTAIN PLC	49,630	19.72	978,703.60
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	52.20	837,340.20
WHITBREAD PLC	17,434	33.15	577,937.10
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.07	440,134.18
INFORMA PLC	110,598	5.31	587,496.57
PEARSON	66,305	6.12	406,317.04
WPP PLC	95,821	10.95	1,049,239.95
JD SPORTS FASHION PLC	41,365	11.16	461,840.22
KINGFISHER PLC	153,717	3.30	508,188.40
NEXT PLC	11,468	80.16	919,274.88
OCADO GROUP PLC	35,862	17.41	624,536.73
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.89	429,726.49
TESCO PLC	601,050	2.78	1,673,924.25
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	20.07	516,601.80
BRITISH AMERICAN TOBACCO	173,638	25.45	4,419,955.29
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	25.70	461,572.00
DIAGEO	186,926	37.41	6,992,901.66

	IMPERIAL BRANDS PLC	80,986	15.30	1,239,490.73	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	57,728	61.25	3,535,840.00	
	UNILEVER PLC	209,797	39.07	8,197,817.77	
	SMITH & NEPHEW PLC	68,595	13.30	912,656.47	
	ASTRAZENECA	124,228	92.89	11,539,538.92	
	GLAXOSMITHKLINE	401,546	15.59	6,263,314.50	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	23.92	393,579.68	
	BARCLAYS	1,339,545	1.90	2,545,135.50	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,632,150	4.29	7,013,348.55	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,838,937	0.48	2,824,877.72	
	NATWEST GROUP PLC	443,701	2.14	949,520.14	
	STANDARD CHARTERED PLC	212,446	4.48	952,607.86	
	3I GROUP PLC	74,757	13.49	1,008,471.93	
	ABRDN PLC	153,430	2.57	395,082.25	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	15.05	497,838.95	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	27,592	70.46	1,944,132.32	
	M&G PLC	229,107	1.96	449,507.93	
	SCHRODERS PLC	11,794	36.32	428,358.08	
	ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	15.85	648,803.90	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	29.01	471,557.55	
	AVIVA PIC	332,730	3.95	1,314,948.96	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.76	313,853.40	
	LEGAL & GENERAL GROUP	460,759	2.88	1,331,132.75	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.48	330,894.48	
	PRUDENTIAL	210,968	14.80	3,122,326.40	
	AVEVA GROUP PLC	10,917	35.10	383,186.70	
	SAGE GROUP PLC	95,210	7.35	699,983.92	
	HALMA PLC	31,069	30.21	938,594.49	
	BT GROUP PLC	769,485	1.62	1,251,567.35	
	VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	1.11	2,464,465.07	
	NATIONAL GRID PLC	286,046	9.42	2,696,269.59	
	SEVERN TRENT PLC	22,468	27.25	612,253.00	
	SSE PLC	81,663	16.15	1,318,857.45	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.47	613,625.50	
	イギリスボンド 小計	23,412,164		146,036,144.74 (22,339,149,060)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	19.26	335,085.48	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	914.00	524,636.00	
	GIVAUDAN-REG	748	4,399.00	3,290,452.00	
	HOLCIM LTD	40,627	47.32	1,922,469.64	
	SIKA AG-BR	11,766	322.10	3,789,828.60	
	ABB LTD	141,281	31.89	4,505,451.09	

	GEBERIT AG-REG	2,964	723.20	2,143,564.80
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,375	243.60	334,950.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	248.40	768,052.80
	ADECCO GROUP AG-REG	14,573	46.22	673,564.06
	SGS SA	506	2,806.00	1,419,836.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	300.90	1,377,219.30
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,341	123.50	5,105,613.50
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	265.70	659,733.10
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	51.20	201,625.60
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,158.00	604,240.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	117,400.00	939,200.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	11,700.00	959,400.00
	NESTLE SA - REGISTERED	231,607	122.96	28,478,396.72
	ALCON INC	39,333	78.34	3,081,347.22
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,677	398.30	1,862,849.10
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	854	2,050.00	1,750,700.00
	LONZA GROUP AG-REG	5,895	726.00	4,279,770.00
	NOVARTIS	178,061	75.88	13,511,268.68
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,799	405.20	1,134,154.80
	ROCHE HOLDING GENUSS	56,424	367.15	20,716,071.60
	VIFOR PHARMA AG	4,486	119.40	535,628.40
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,854	71.40	203,775.60
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	9.34	1,994,330.36
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	65.56	1,238,887.32
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	1,640.00	3,006,120.00
	UBS GROUP AG	298,295	16.74	4,994,949.77
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,362	144.30	629,436.60
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	513.40	1,241,914.60
	SWISS RE LTD	24,674	90.30	2,228,062.20
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,260	408.70	5,010,662.00
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	93.90	533,258.10
	TEMENOS AG - REG	5,150	139.70	719,455.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	72.80	1,069,140.80
	SWISSCOM	2,187	506.80	1,108,371.60
	スイスフラン 小計	1,418,388		128,883,472.44 (15,962,218,061)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	365.20	6,289,474.40
	BOLIDEN AB	23,903	294.60	7,041,823.80
	SCA SV CELLULOSA B	43,887	134.20	5,889,635.40
	ALFA LAVAL AB	27,268	376.90	10,277,309.20
	ASSA ABLOY AB-B	78,158	259.60	20,289,816.80
	ATLAS COPCO A	55,390	556.60	30,830,074.00

ATLAS COPCO B	31,902	473.00	15,089,646.00	
EPIROC AB-A	58,039	222.60	12,919,481.40	
EPIROC AB-B	37,972	189.10	7,180,505.20	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	329.30	4,610,858.60	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	107,624	134.25	14,448,522.00	
SANDVIK AB	87,644	222.50	19,500,790.00	
SKANSKA B	25,507	220.00	5,611,540.00	
SKF AB-B	35,405	209.80	7,427,969.00	
VOLVO AB-A SHS	13,514	208.40	2,816,317.60	
VOLVO B	111,799	205.05	22,924,384.95	
SECURITAS B	29,533	139.75	4,127,236.75	
ELECTROLUX AB-SER B	21,269	196.75	4,184,675.75	
HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	125.50	4,858,356.00	
EVOLUTION AB	14,096	1,391.00	19,607,536.00	
EMBRACER GROUP AB	37,510	87.02	3,264,120.20	
HENNES & MAURITZ B	55,229	165.74	9,153,654.46	
ICA GRUPPEN AB	9,493	480.70	4,563,285.10	
SWEDISH MATCH AB	127,270	67.58	8,600,906.60	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	285.00	14,100,090.00	
NORDEA BANK ABP	253,851	108.18	27,461,601.18	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,470	139.50	19,316,565.00	
SVENSKA HANDELSBK A	110,736	100.45	11,123,431.20	
SWEDBANK AB-A	72,526	190.18	13,792,994.68	
EQT AB	20,102	490.70	9,864,051.40	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	286.00	3,379,948.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	281.60	3,144,908.80	
INVESTOR AB-B SHS	142,777	206.05	29,419,200.85	
KINNEVIK AB - B	18,792	345.55	6,493,575.60	
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	509.40	3,708,432.00	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	9,450	650.00	6,142,500.00	
SINCH AB	44,150	121.40	5,359,810.00	
ERICSSON (LM) B	225,508	95.89	21,623,962.12	
HEXAGON AB-B SHS	153,838	142.85	21,975,758.30	
TELE2 AB-B SHS	32,829	123.45	4,052,740.05	
TELIA CO AB	230,643	34.43	7,942,191.70	
スウェーデンクローナ 小計	2,635,760		460,409,680.09 (6,058,991,389)	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	76,370	225.30	17,206,161.00
	NORSK HYDRO	96,800	60.72	5,877,696.00
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	461.40	5,766,577.20
	ADEVINTA ASA	19,117	149.80	2,863,726.60
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	385.60	3,576,054.40

	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	444.20	3,145,824.40	
	MOWI ASA	31,968	237.70	7,598,793.60	
	ORKLA	69,804	85.32	5,955,677.28	
	DNB BANK ASA	71,795	214.30	15,385,668.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	213.70	3,969,263.80	
	TELENOR ASA	51,193	135.75	6,949,449.75	
	ノルウェークローネ 小計	464,475		78,294,892.53 (1,038,973,223)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	523.40	4,440,002.20	
	NOVOZYMES A/S	17,111	494.10	8,454,545.10	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	755	3,070.00	2,317,850.00	
	VESTAS WIND SYSSEMS A/S	81,654	223.10	18,217,007.40	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	19,150.00	4,193,850.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	20,130.00	8,736,420.00	
	DSV A/S	16,380	1,574.50	25,790,310.00	
	PANDORA A/S	8,163	920.00	7,509,960.00	
	CARLSBERG AS-B	8,646	1,100.00	9,510,600.00	
	AMBU A/S-B	13,555	185.60	2,515,808.00	
	COLOPLAST-B	9,208	1,115.50	10,271,524.00	
	DEMANT A/S	8,512	335.20	2,853,222.40	
	GN STORE NORD A/S	9,226	406.80	3,753,136.80	
	GENMAB A/S	5,250	2,924.00	15,351,000.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	134,949	734.60	99,133,535.40	
	DANSKE BANK A/S	56,132	110.50	6,202,586.00	
TRYG A/S	29,772	156.40	4,656,340.80		
ORSTED A/S	15,439	872.40	13,468,983.60		
	デンマーククローネ 小計	423,888		247,376,681.70 (4,351,355,831)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	31.20	643,624.80	
	OIL SEARCH LTD	186,117	4.28	796,580.76	
	SANTOS	156,437	6.95	1,087,237.15	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	31.90	408,734.70	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,404	22.98	1,709,803.92	
	BHP GROUP LTD	234,548	36.73	8,614,948.04	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	21.24	738,514.80	
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	3.93	480,065.22	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,483	14.59	2,020,466.97	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	53.94	1,992,975.12	
	NEWCREST MINING LIMITED	61,178	24.96	1,527,002.88	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	10.13	1,029,491.64	
	ORICA LTD	38,288	15.33	586,955.04	
RIO TINTO LTD	28,818	88.98	2,564,225.64		

SOUTH32 LTD	341,133	3.54	1,207,610.82
REECE LTD	16,814	21.18	356,120.52
BRAMBLES LTD	108,007	10.42	1,125,432.94
AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.42	409,001.22
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.84	496,400.00
TRANSURBAN GROUP	233,493	13.68	3,194,184.24
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	47.58	2,198,671.80
CROWN RESORTS LTD	30,328	9.78	296,607.84
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	117.55	416,244.55
TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	5.16	939,187.08
REA GROUP LTD	3,586	168.97	605,926.42
SEEK LTD	31,593	34.34	1,084,903.62
WESFARMERS LTD	92,850	59.85	5,557,072.50
COLES GROUP LTD	115,478	17.68	2,041,651.04
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	7.07	777,000.07
WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	39.22	3,918,117.22
TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	11.56	815,419.28
COCHLEAR LIMITED	4,783	230.60	1,102,959.80
RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	72.98	1,185,779.04
SONIC HEALTHCARE LTD	40,076	39.53	1,584,204.28
CSL LIMITED	36,928	314.88	11,627,888.64
AUST AND NZ BANKING GROUP	225,511	27.91	6,294,012.01
COMMONWEALTH BANK OF AUST	141,979	108.81	15,448,734.99
NATIONAL AUSTRALIA BANK	262,008	28.89	7,569,411.12
WESTPAC BANKING	302,673	22.52	6,816,195.96
ASX LTD	14,549	93.69	1,363,095.81
MACQUARIE GROUP LIMITED	27,074	200.00	5,414,800.00
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	35.26	384,757.12
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	229,407	4.58	1,050,684.06
MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	3.42	922,921.20
QBE INSURANCE GROUP	111,591	11.67	1,302,266.97
SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	11.23	1,065,322.72
AFTERPAY LTD	16,621	119.52	1,986,541.92
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	19.02	844,031.52
WISETECH GLOBAL LTD	13,801	53.71	741,251.71
XERO LTD	11,340	148.00	1,678,320.00
TELSTRA CORP	308,467	3.92	1,209,190.64
AGL ENERGY LTD	64,235	5.36	344,299.60
AUSNET SERVICES	187,145	2.58	482,834.10
ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	4.99	826,319.05
オーストラリアドル 小計	5,537,235		120,886,000.10 (10,058,924,068)

ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	8.17	963,006.07	
	A2 MILK CO LTD	66,854	6.55	437,893.70	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	32.29	1,290,954.20	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	14.70	533,859.90	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.54	785,955.72	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.06	391,554.78	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.92	543,876.48	
ニュージーランドドル 小計		609,297		4,947,100.85	(397,845,850)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	229,496	52.70	12,094,439.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	161.20	17,248,400.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	20.50	3,526,000.00	
	MTR CORP	125,000	43.15	5,393,750.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	26.00	3,120,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	44.05	7,664,700.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	18.10	3,583,800.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	5.85	772,200.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	6.99	984,192.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	16.56	2,851,632.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	20.65	3,012,835.00	
	WH GROUP LTD	809,301	5.33	4,313,574.33	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	24.40	6,868,600.00	
	HANG SENG BANK	59,400	145.70	8,654,580.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,800	465.00	44,547,000.00	
	AIA GROUP LTD	968,400	85.60	82,895,040.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	48.00	7,895,808.00	
	ESR CAYMAN LTD	157,000	25.80	4,050,600.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	17.62	3,048,260.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	33.35	4,176,353.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	33.75	4,602,656.25	
	SINO LAND CO	315,400	9.96	3,141,384.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	98.85	10,675,800.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	49.35	1,998,675.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	20.65	1,986,530.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	44.25	5,265,750.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	46.75	3,155,625.00	
CLP HOLDINGS	137,500	76.05	10,456,875.00		
HONG KONG & CHINA GAS	904,657	11.88	10,747,325.16		
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	47.40	5,308,800.00		
香港ドル 小計		6,587,653		284,041,184.74	(4,115,756,766)
	KEPPEL CORP LTD	137,300	5.31	729,063.00	

シンガポールドル	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.81	561,594.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.48	593,659.36	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.81	501,225.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.38	782,268.00	
	DBS GROUP	141,500	32.30	4,570,450.00	
	OCBC BANK	257,100	11.88	3,054,348.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	27.90	2,619,810.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	9.55	747,765.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.45	771,075.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	7.24	309,872.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.12	338,200.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	18.41	473,137.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	584,543	2.57	1,502,275.51	
シンガポールドル 小計		2,681,475		17,554,741.87 (1,470,911,821)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	27.50	1,863,290.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	484.50	1,039,737.00	
	BANK HAPOLIM BM	98,310	30.81	3,028,931.10	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	30.45	3,314,908.80	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	19.00	1,890,500.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	113.00	1,412,839.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	309.20	1,336,671.60	
	NICE LTD	4,991	879.10	4,387,588.10	
イスラエルシェケル 小計		398,393		18,274,465.60 (663,911,335)	
合 計		88,503,680		517,030,486,552 (517,030,486,552)	

(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	82,693	719,429.10	
		LENDLEASE GROUP	64,786	707,463.12	
		SYDNEY AIRPORT	124,551	1,046,228.40	
	オーストラリアドル 小計		272,030	2,473,120.62 (205,788,366)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,726,515.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,012,500.00	
	香港ドル 小計		595,500	5,739,015.00 (83,158,327)	
	投資信託受益証券合計			867,530	288,946,693 (288,946,693)

投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	743,398.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,971	2,270,448.45	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	36,371	10,180,970.32	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,080,318.74	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,721,153.16	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	1,323,045.09	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	1,262,699.55	
		CROWN CASTLE INTL CORP	34,399	6,221,059.15	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	22,174	3,484,644.10	
		DUKE REALTY CORP	31,540	1,786,741.00	
		EQUINIX INC	7,120	5,680,264.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	1,190,182.30	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,400	2,518,404.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,510	1,876,926.40	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	2,148,712.28	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,538,104.70	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,040,649.09	
		INVITATION HOMES INC	46,840	1,898,425.20	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,109,851.08	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	1,065,766.80	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,603	1,945,087.65	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	597,709.76	
		PROLOGIS INC	59,030	8,763,003.50	
		PUBLIC STORAGE	12,441	4,043,325.00	
		REALTY INCOME CORP	41,563	2,949,310.48	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	922,060.70	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,999,415.18	
		SIMON PROPERTY GROUP	26,818	4,491,746.82	
		SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,756,343.75	
		UDR INC	24,265	1,339,913.30	
		VENTAS INC	31,565	1,667,263.30	
		VICI PROPERTIES INC	43,921	1,284,250.04	
		VORNADO REALTY TRUST	15,390	696,551.40	
		WELLTOWER INC	32,739	2,795,583.21	
WP CAREY INC	14,258	1,094,586.66			
	アメリカドル 小計	989,349	88,487,915.16 (9,986,746,104)		
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	540,773.95		
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	354,411.20		
	カナダドル 小計	24,377	895,185.15 (81,193,293)		
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	375,027.96		

	GECINA SA	3,139	384,841.40
	KLEPIERRE	17,225	381,878.25
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	722,754.15
	ユーロ 小計	35,781	1,864,501.76 (243,932,765)
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	401,834.84
	LAND SECURITIES GROUP PLC	66,349	462,452.53
	SEGRO PLC	93,383	1,236,857.83
	イギリスポンド 小計	239,146	2,101,145.20 (321,412,181)
オーストラ リアドル	DEXUS	94,090	1,055,689.80
	GOODMAN GROUP	139,848	3,293,420.40
	GPT GROUP	167,884	864,602.60
	MIRVAC GROUP	266,683	762,713.38
	SCENTRE GROUP	382,183	1,196,232.79
	STOCKLAND	207,412	937,502.24
	VICINITY CENTERS	365,149	646,313.73
	オーストラリアドル 小計	1,623,249	8,756,474.94 (728,626,279)
香港ドル	LINK REIT	170,500	11,849,750.00
	香港ドル 小計	170,500	11,849,750.00 (171,702,877)
シンガポ ールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	880,827.80
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	340,429	731,922.35
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	468,600.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	273,085	537,977.45
	シンガポールドル 小計	1,117,652	2,619,327.60 (219,473,459)
	投資証券合計	4,200,054	11,753,086,958 (11,753,086,958)
	合計		12,042,033,651 (12,042,033,651)

(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	599銘柄	97.4%			71.6%
	投資証券	35銘柄			2.6%	1.9%
カナダドル	株式	88銘柄	99.6%			3.5%
	投資証券	2銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式	231銘柄	99.5%			10.1%
	投資証券	4銘柄			0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式	82銘柄	98.6%			4.2%
	投資証券	3銘柄			1.4%	0.1%
スイスフラン	株式	40銘柄	100.0%			3.0%
スウェーデンクローナ	株式	41銘柄	100.0%			1.1%
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	91.5%			1.9%
	投資信託受益証券	3銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券	7銘柄			6.6%	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	94.2%			0.8%
	投資信託受益証券	2銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券	1銘柄			3.9%	0.0%
シンガポールドル	株式	14銘柄	87.0%			0.3%
	投資証券	4銘柄			13.0%	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。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,045,443,059

項目	2021年11月10日現在
	金額（円）
コール・ローン	96,875,450
株式	97,437,385,523
新株予約権証券	197,712
投資信託受益証券	200,991,203
投資証券	83,695,030
派生商品評価勘定	23,123,220
未収入金	1,075,981
未収配当金	82,978,857
前払金	85,163,027
差入委託証拠金	1,204,454,410
流動資産合計	104,261,383,472
資産合計	104,261,383,472
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	108,516,687
未払金	111,431
未払解約金	20,307,222
未払利息	215
流動負債合計	128,935,555
負債合計	128,935,555
純資産の部	
元本等	
元本	28,114,813,263
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	76,017,634,654
元本等合計	104,132,447,917
純資産合計	104,132,447,917
負債純資産合計	104,261,383,472

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資信託受益証券</p>

	2021年11月10日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2021年11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		28,114,813,263口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.7038円 (37,038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11月10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。
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11月10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

	2021年11月10日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2021年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 5月11日
期首元本額	25,738,059,714円
期中追加設定元本額	2,812,659,699円
期中一部解約元本額	435,906,150円
期末元本額	28,114,813,263円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国株式インデックス・オープン	7,711,696,092円

区分	2021年11月10日現在
世界経済インデックスファンド	4,855,658,021円
D C新興国株式インデックス・オープン	5,108,045,604円
D C世界経済インデックスファンド	4,989,360,031円
新興国株式インデックス・オープン(S M A 専用)	209,811,818円
分散投資コア戦略ファンドA	223,488,884円
分散投資コア戦略ファンドS	1,291,777,359円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	665,946,316円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	571,010,419円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	324,344,522円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	15,903,844円
S M T インデックスバランス・オープン	82,918,447円
S M T 世界経済インデックス・オープン	131,975,703円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	474,869,833円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	86,295,499円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	3,383,777円
グローバル経済コア	352,275,605円
i - S M T 新興国株式インデックス(ノーロード)	35,900,151円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	8,003,862円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	5,548,514円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	2,718,279円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	3,378,675円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	817,704,272円
F O F s 用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	123,078,811円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	16,877,329円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	2,841,596円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	6,026,645,887
新株予約権証券	82,328
投資信託受益証券	1,450,524
投資証券	6,547,671
合計	6,034,561,754

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「新興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

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,529,017,587	-	6,443,854,560	85,163,027
合計		6,529,017,587	-	6,443,854,560	85,163,027

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2021年11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	110,830,080	-	110,599,640	230,440
	アメリカドル	110,830,080	-	110,599,640	230,440
合計		110,830,080	-	110,599,640	230,440

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	655,305	9.83	6,444,269.37	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	44,089	100.85	4,446,375.65	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	10,590	250.70	2,654,913.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	134,073	8.87	1,190,300.09	

SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	123,206	4.79	590,156.74
TATNEFT-SPONSORED ADR	29,910	45.61	1,364,195.10
YPF S.A.-SPONSORED ADR	15,511	4.56	70,730.16
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	7.47	126,467.10
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	72,204	31.13	2,247,710.52
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	19,598	31.92	625,568.16
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,818	25.12	673,668.16
POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,938	103.40	820,789.20
SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	23.68	918,144.64
SOUTHERN COPPER CORP	9,585	59.82	573,374.70
51JOB INC-ADR	2,701	54.03	145,935.03
DIDI GLOBAL INC	34,321	8.12	278,686.52
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	44,721	27.83	1,244,585.43
LI AUTO INC - ADR	60,121	29.98	1,802,427.58
NIO INC - ADR	147,534	40.64	5,995,781.76
XPENG INC - ADR	40,797	44.30	1,807,307.10
GAOTU TECHEDU INC	16,359	2.89	47,277.51
HUAZHU GROUP LTD-ADR	19,163	46.03	882,072.89
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	156,180	2.04	318,607.20
TAL EDUCATION GROUP- ADR	41,058	3.85	158,073.30
TRIP.COM GROUP LTD	55,661	30.41	1,692,651.01
YUM CHINA HOLDINGS INC	45,333	55.19	2,501,928.27
AUTOHOME INC-ADR	6,571	37.81	248,449.51
BAIDU INC - SPON ADR	30,081	161.63	4,861,992.03
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	18,268	77.43	1,414,491.24
HELLO GROUP INC -SPN ADR	15,529	12.88	200,013.52
HUYA INC-ADR	8,211	8.95	73,488.45
IQIYI INC-ADR	28,984	8.20	237,668.80
JOYY INC	6,185	48.89	302,384.65
MAIL.RU GROUP-GDR REGS	19,368	19.82	383,873.76
NETEASE INC-ADR	42,826	100.83	4,318,145.58
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	64,895	7.95	515,915.25
WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	43.44	228,016.56
YANDEX NV-A	30,372	84.63	2,570,382.36
BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	16.73	58,688.84
DADA NEXUS LTD-ADR	7,696	20.97	161,385.12
JD.COM INC-ADR	94,194	77.19	7,270,834.86
OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	44.56	335,224.88
PINDUODUO INC-ADR	46,519	83.24	3,872,241.56
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	52,765	11.60	612,074.00
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	39,926	18.85	752,605.10
ADECOAGRO SA	17,629	9.40	165,712.60

	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	68,136	4.16	283,445.76
	BEIGENE LTD-ADR	4,929	369.65	1,822,004.85
	BURNING ROCK BIOTECH LTD-ADR	5,009	14.17	70,977.53
	HUTCHMED CHINA-ADR	7,243	30.29	219,390.47
	I-MAB-SPONSORED ADR	2,944	57.46	169,162.24
	ZAI LAB LTD-ADR	7,677	86.69	665,519.13
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	189,281	3.30	625,573.70
	CREDICORP LTD	7,637	124.75	952,715.75
	SBERBANK-SPONSORED ADR	285,355	20.08	5,729,928.40
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	112.65	1,582,056.60
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	378,037	1.41	535,300.39
	360 DIGITECH INC	8,061	22.63	182,420.43
	LUFAX HOLDING LTD	12,385	6.36	78,768.60
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	43.07	87,044.47
	UP FINTECH HOLDING LTD - ADR	10,604	6.80	72,107.20
	KE HOLDINGS INC	35,590	19.79	704,326.10
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	0.87	47,736.86
	AGORA INC-ADR	4,630	23.25	107,647.50
	CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	12,493	9.33	116,559.69
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	9,050	59.03	534,221.50
	GLOBANT SA	4,495	354.44	1,593,207.80
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	5,558	21.42	119,052.36
	ONECONNECT FINANCIAL TECHNO	10,976	2.90	31,830.40
	VNET GROUP INC-ADR	7,475	16.64	124,384.00
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT-SP ADR	39,854	9.16	365,062.64
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	4,948	66.74	330,229.52
	アメリカドル 小計	3,607,642		85,356,258.75 (9,633,307,362)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,545,161	13.63	21,060,544.43
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	323,292	88.23	28,524,053.16
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	269.83	3,912,535.00
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	54.12	5,241,630.24
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	71.55	2,683,125.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	427.04	9,952,167.20
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	43,680	285.23	12,458,846.40
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	157.23	6,711,362.55
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	288,490	42.61	12,292,558.90
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	59.30	1,862,020.00
	WALMART DE MEXICO-SER V	567,680	74.54	42,314,867.20
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	126.27	6,373,478.25
	BEACLE SAB DE CV	48,100	48.29	2,322,749.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	207,440	165.64	34,360,361.60

	GRUMA S.A.B. -B	25,960	248.74	6,457,290.40
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	62.82	11,420,676.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	32.23	5,859,414.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	282,600	134.33	37,961,658.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	252,500	21.42	5,408,550.00
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,658,740	18.63	68,162,326.20
	TELESITES SAB DE CV	74,800	18.59	1,390,532.00
	メキシコペソ 小計	7,978,760		326,730,745.53 (1,814,303,156)
ブラジルリアル	COSAN SA	118,300	21.02	2,486,666.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	375,100	27.55	10,334,005.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	544,440	26.64	14,503,881.60
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	13.02	984,312.00
	BRADSPAR SA -PREF	27,107	45.80	1,241,500.60
	BRASKEM SA-PREF A	19,300	56.30	1,086,590.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	21.31	1,342,530.00
	GERDAU SA-PREF	105,000	23.99	2,518,950.00
	SUZANO SA	90,079	49.00	4,413,871.00
	VALE SA	430,378	65.94	28,379,125.32
	WEG SA	171,144	36.79	6,296,387.76
	CCR SA	125,600	11.62	1,459,472.00
	LOCALIZA RENT A CAR	61,952	49.60	3,072,819.20
	RUMO SA	159,700	16.93	2,703,721.00
	ALPARGATAS SA - PREF	28,600	41.25	1,179,750.00
	AMERICANAS SA	39,740	35.18	1,398,053.20
	LOJAS RENNER S.A.	115,947	32.32	3,747,407.04
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	13.13	4,011,215.00
	VIA S/A	135,900	7.54	1,024,686.00
	VIBRA ENERGIA SA	134,600	22.88	3,079,648.00
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	17.53	727,495.00
	RAIA DROGASIL SA	122,500	24.38	2,986,550.00
	AMBEV SA	534,900	17.89	9,569,361.00
	BRF SA	52,500	23.54	1,235,850.00
	JBS SA	110,000	37.74	4,151,400.00
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	40.74	4,086,547.92
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	100,500	13.28	1,334,640.00
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	54,400	73.79	4,014,176.00
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	45,600	57.93	2,641,608.00
	HYPERA SA	35,300	29.52	1,042,056.00
	BANCO BRADESCO S.A.	161,367	16.74	2,701,283.58
	BANCO BRADESCO SA-PREF	531,802	19.30	10,263,778.60
	BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	29.44	2,599,552.00

	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	523,681	22.53	11,798,532.93	
	ITAUSA SA	503,167	10.04	5,051,796.68	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	637,309	12.64	8,055,585.76	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	23.44	1,617,360.00	
	TOTVS SA	57,900	35.11	2,032,869.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	49.79	2,604,017.00	
	TIM SA	96,100	12.81	1,231,041.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	34.55	1,278,350.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,600	34.94	1,173,984.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	113,867	13.47	1,533,788.49	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	79,000	6.20	489,800.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	34,700	36.22	1,256,834.00	
	CPFL ENERGIA SA	43,700	26.97	1,178,589.00	
	ENGIE BRASIL SA	29,250	39.68	1,160,640.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	80,900	23.27	1,882,543.00	
	ブラジルリアル 小計	7,497,438		184,964,619.68 (3,804,888,694)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	6,450.00	288,508,500.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,549.00	210,609,785.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	12,523	52,300.00	654,952,900.00	
	FALABELLA SA	70,837	2,800.00	198,343,600.00	
	CENCOSUD SA	137,988	1,236.10	170,566,966.80	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	7,400.00	54,649,000.00	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	75.54	367,323,825.60	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,718	29,449.00	168,389,382.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	38.90	244,285,036.90	
	CENCOSUD SHOPPING SA	41,600	820.01	34,112,416.00	
	COLBUN SA	1,215,680	57.10	69,415,328.00	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	99.40	347,036,711.00	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	34.47	88,287,252.66	
	チリペソ 小計	18,867,480		2,896,480,703.96 (412,551,539)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,937.00	1,436,131,323.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	32,880.00	965,882,880.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	33,200.00	2,043,958,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	21,400.00	445,548,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	22,600.00	1,141,548,600.00	
	コロンビアペソ 小計	651,251		6,033,068,803.00 (175,857,922)	
ユーロ	OPAP SA	18,496	13.10	242,297.60	
	JUMBO SA	19,341	12.96	250,659.36	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	1.11	294,780.82	

	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	282,775	0.96	271,972.99
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	15.25	399,656.75
	ユーロ 小計	610,487		1,459,367.52 (190,929,052)
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	44,689	14.07	628,774.23
	イギリスポンド 小計	44,689		628,774.23 (96,183,593)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	153.00	1,775,259.00
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	19.63	2,291,900.65
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	17.20	1,712,535.20
	KOC HOLDING AS	89,884	26.24	2,358,556.16
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	9.29	2,775,368.92
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	204.30	1,328,154.30
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	65.65	2,811,395.60
	AKBANK T.A.S.	276,321	6.30	1,740,822.30
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	10.58	2,539,115.36
	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	6.22	1,076,134.64
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	16.66	2,383,896.06
	トルコリラ 小計	1,498,297		22,793,138.19 (264,357,096)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	955.00	7,127,165.00
	MONETA MONEY BANK AS	62,031	88.95	5,517,657.45
	CEZ AS	18,145	751.00	13,626,895.00
	チェココルナ 小計	87,639		26,271,717.45 (136,119,022)
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	42,355	2,724.00	115,375,020.00
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	8,645.00	131,213,810.00
	OTP BANK NYRT	25,606	18,460.00	472,686,760.00
	ハンガリーフォリント 小計	83,139		719,275,590.00 (260,840,977)
ポーランドズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	88.04	2,703,972.52
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	200,051	6.21	1,243,517.01
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	152.10	1,997,377.20
	LPP SA	124	14,440.00	1,790,560.00
	CD PROJEKT SA	6,704	181.70	1,218,116.80
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	35.30	1,274,259.40
	ALLEGRO.EU SA	39,203	42.34	1,659,855.02
	DINO POLSKA SA	5,945	347.00	2,062,915.00
	BANK PEKAO SA	23,647	127.40	3,012,627.80
	PKO BANK POLSKI SA	93,312	47.62	4,443,517.44
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	372.80	1,347,672.00
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	62,044	40.32	2,501,614.08

	ORANGE POLSKA SA	55,658	7.76	432,184.37
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	10.20	647,976.68
	ポーランドズロチ 小計	633,742		26,336,165.32 (750,069,790)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	7.12	1,367,040.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,915,400	3.78	11,020,212.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	331,000	16.20	5,362,200.00
	PETROCHINA CO LTD-H	2,148,000	3.51	7,539,480.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	11.84	1,681,280.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	4.15	1,411,000.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	144,500	37.40	5,404,300.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	219,000	7.25	1,587,750.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	468,000	4.61	2,157,480.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	8.93	3,679,160.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	6.09	1,753,920.00
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	26,200	150.90	3,953,580.00
	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	101,000	14.44	1,458,440.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	13.48	1,118,840.00
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	5.81	964,460.00
	MMG LIMITED	304,000	3.13	951,520.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	9.53	1,229,370.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	50,750	14.54	737,905.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	6.08	550,240.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	10.60	7,727,400.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	5.39	1,482,250.00
	BOC AVIATION LTD	23,800	69.20	1,646,960.00
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.89	762,440.00
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	37.75	6,021,125.00
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	11.42	1,461,760.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	474,000	3.69	1,749,060.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	7.72	1,312,400.00
	CITIC LTD	617,000	7.19	4,436,230.00
	FOSUN INTERNATIONAL	288,000	8.88	2,557,440.00
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	21.65	1,688,700.00
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	8.18	1,308,800.00
	SINOTRUK HONG KONG LTD	54,500	10.62	578,790.00
	WEICHAJ POWER CO LTD-H	211,800	13.68	2,897,424.00
	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	141,216	18.02	2,544,712.32
	ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	46.20	2,878,260.00
	ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	5.25	610,050.00
	CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	5.13	1,975,429.62
	AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.71	1,221,940.00

BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	5.25	1,302,000.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	12.18	2,016,362.46
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.83	850,080.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	11.52	5,967,936.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	6.13	1,537,244.62
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	156,000	7.25	1,131,000.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	8.93	1,142,343.46
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	6.90	607,200.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	7.30	2,686,400.00
BYD CO LTD-H	88,500	310.60	27,488,100.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	7.26	1,931,160.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	44.10	2,575,440.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	630,000	26.05	16,411,500.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	32.95	11,623,112.50
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	7.49	2,683,996.56
MINTH GROUP LTD	64,000	32.00	2,048,000.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	108,000	13.54	1,462,320.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	121,000	128.20	15,512,200.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	5.76	2,522,880.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	244,600	27.45	6,714,270.00
LI NING CO LTD	237,500	92.75	22,028,125.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	84,800	162.40	13,771,520.00
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	45,000	6.68	300,600.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	70,000	12.68	887,600.00
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	96,000	3.18	305,280.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	116,000	20.85	2,418,600.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	57,000	17.60	1,003,200.00
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	68,400	17.58	1,202,472.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	0.87	1,261,500.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	53.80	2,776,080.00
KINGSOFT CORP LTD	92,000	32.60	2,999,200.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	26,500	92.05	2,439,325.00
TENCENT HOLDINGS LTD	622,900	464.00	289,025,600.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,642,688	157.10	258,066,284.80
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	54,000	39.60	2,138,400.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,206,958	0.73	881,079.34
HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	268,000	2.15	576,200.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	47,300	74.75	3,535,675.00
MEITUAN-CLASS B	436,600	270.40	118,056,640.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	9.17	1,045,380.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	68,000	68.95	4,688,600.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	259,000	3.22	833,980.00

ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	101.00	1,535,200.00
CHINA FEIHE LTD	346,000	11.58	4,006,680.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	329,000	48.85	16,071,650.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	148,000	61.90	9,161,200.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	4.18	1,028,280.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	56,800	40.40	2,294,720.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	33.55	6,542,250.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	15.18	3,461,040.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	68,000	65.35	4,443,800.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	6.27	501,600.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	6.16	3,449,600.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	45.00	2,160,000.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	52,500	38.95	2,044,875.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	21.70	542,500.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	422,000	9.23	3,895,060.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	124,000	10.64	1,319,360.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	35.15	2,319,900.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	31.00	1,664,700.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	11.92	2,908,480.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	13.62	1,748,808.00
SINOPHARM GROUP CO-H	125,200	17.72	2,218,544.00
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	20,500	35.35	724,675.00
3SBIO INC	119,000	7.03	836,570.00
AKESO INC	25,000	40.10	1,002,500.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	10,000	159.10	1,591,000.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	13.00	1,300,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	956,160	8.01	7,658,841.60
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	3.52	554,400.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	3.53	585,980.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	29.30	3,867,600.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	135.80	692,580.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	17.24	2,103,280.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	139,000	76.50	10,633,500.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	22,300	158.80	3,541,240.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	36.65	2,675,450.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,113,000	5.47	6,088,110.00
SSY GROUP LTD	114,000	3.53	402,420.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	42,288	154.20	6,520,809.60
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	390,000	102.60	40,014,000.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,825,000	2.62	7,401,500.00
BANK OF CHINA LTD-H	8,801,200	2.75	24,203,300.00

BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	4.79	5,261,695.25
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	366,500	2.64	967,560.00
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.40	3,234,080.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	10,385,620	5.22	54,212,936.40
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.72	1,020,000.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	429,923	62.75	26,977,668.25
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	3.05	2,056,920.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	151,000	2.74	413,740.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,265,515	4.23	26,503,128.45
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,059,000	5.62	5,951,580.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.27	1,056,640.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	134,000	8.46	1,133,640.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.35	2,101,050.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	1.02	945,540.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	18.62	2,457,840.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	248,500	18.92	4,701,620.00
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	7.34	1,761,600.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	12.74	1,128,764.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	6.78	2,421,816.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	135,600	11.40	1,545,840.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	918,000	13.66	12,539,880.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	296,600	23.90	7,088,740.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	11.40	2,097,873.60
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	21.75	2,096,700.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.34	2,197,260.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	6.99	4,818,123.12
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	695,000	56.20	39,059,000.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	27.00	1,233,900.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	41,500	21.20	879,800.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	5.23	742,660.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	126,000	2.10	264,600.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	2.23	1,288,940.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	415,540	16.68	6,931,207.20
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	80,000	6.51	520,800.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	367,111	29.00	10,646,219.00
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	67,600	39.95	2,700,620.00
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	18.10	3,229,040.00
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	64,000	12.88	824,320.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	564,000	3.95	2,227,800.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	800,964	6.71	5,374,468.44
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	164,000	55.40	9,085,600.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	10.82	784,450.00

GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	7.20	1,296,000.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	135,200	4.15	561,080.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	66,000	18.14	1,197,240.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	1.01	157,560.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	152,500	6.18	942,450.00
LOGAN GROUP CO LTD	150,000	7.16	1,074,000.00
LONGFOR PROPERTIES	197,000	34.20	6,737,400.00
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD-H	8,000	40.55	324,400.00
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	178,000	4.82	857,960.00
SEAZEN GROUP LTD	204,000	5.58	1,138,320.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	1.83	614,880.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	8.98	1,189,850.00
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	75,000	10.40	780,000.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	327,000	13.82	4,519,140.00
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	64,000	13.92	890,880.00
WHARF HOLDINGS	154,000	27.00	4,158,000.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	115,600	6.74	779,144.00
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	131,000	3.57	467,670.00
CHINA YOUZAN LTD	1,456,000	0.91	1,324,960.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	12.66	3,494,160.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	311,000	25.50	7,930,500.00
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	32,000	22.85	731,200.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	14.02	1,107,580.00
WEIMOB INC	149,000	9.89	1,473,610.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	32.00	2,288,000.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	60,500	26.05	1,576,025.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	34.05	2,281,350.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	12.20	841,800.00
LENOVO GROUP LTD	732,000	7.98	5,841,360.00
SUNNY OPTICAL TECH	76,800	202.00	15,513,600.00
XIAOMI CORP-CLASS B	1,405,800	20.35	28,608,030.00
ZTE CORP-H	82,908	22.15	1,836,412.20
CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	1.01	4,611,660.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	27.90	1,660,050.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	2.82	1,720,200.00
CGN POWER CO LTD-H	791,000	2.11	1,669,010.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	305,600	18.36	5,610,816.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	339,000	17.10	5,796,900.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	4.12	2,743,920.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,000	39.65	4,202,900.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	19.44	3,409,776.00
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	83,300	131.40	10,945,620.00

	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	320,000	10.34	3,308,800.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	3.70	1,369,000.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	360,000	6.88	2,476,800.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	37.05	2,371,200.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	46.65	2,099,250.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	531,987	14.28	7,596,774.36	
	香港ドル 小計	94,837,976		1,559,573,135.15 (22,598,214,728)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.90	1,199,637.20	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	20.30	509,530.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	8.29	2,237,471.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	288,600	5.31	1,532,466.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	7.77	296,814.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.22	746,688.12	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	6.42	684,333.48	
	MISC BHD	125,040	6.98	872,779.20	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	4.27	298,900.00	
	GENTING BHD	188,500	5.14	968,890.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	3.20	1,183,040.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	5,800	26.92	156,136.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.81	1,029,995.40	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	35,146	20.70	727,522.20	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	134.00	964,800.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	17.78	1,306,474.40	
	QL RESOURCES BHD	124,800	4.85	605,280.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.03	995,595.38	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	181,300	5.69	1,031,597.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	6.45	1,478,985.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	128,200	2.20	282,040.00	
	SUPERMAX CORP BHD	161,715	1.71	276,532.65	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	2.33	1,176,417.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	3.22	968,254.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	650,575	5.02	3,265,886.50	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	18.10	1,109,385.20	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	17.46	290,412.18	
	MALAYAN BANKING BHD	411,105	7.99	3,284,728.95	
	PUBLIC BANK BERHAD	1,675,000	4.03	6,750,250.00	
	RHB BANK BHD	210,820	5.38	1,134,211.60	
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	3.88	1,106,921.32	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.24	1,321,608.00	
	MAXIS BHD	267,900	4.59	1,229,661.00	

	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	5.55	391,563.60	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	16.38	1,236,690.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	305,275	9.61	2,933,692.75	
	マレーシアリングット 小計	8,843,216		45,585,189.13 (1,239,488,643)	
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	134,400	119.50	16,060,800.00	
	PTT PCL-NVDR	1,197,400	38.25	45,800,550.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	55.00	6,605,500.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	43.25	8,926,800.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	62.00	13,945,908.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	100,600	63.50	6,388,100.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	81,000	396.00	32,076,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	527,000	67.00	35,309,000.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	9.10	7,434,700.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	9.70	7,852,150.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	4.70	3,808,410.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	34.00	12,333,092.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	36.25	6,604,750.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	471,035	15.20	7,159,732.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	289,000	26.00	7,514,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	34.75	6,171,600.00	
	CP ALL PCL-NVDR	691,700	65.25	45,133,425.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	123.50	5,718,050.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	25.00	13,910,000.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	33.25	2,194,500.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	184,900	20.30	3,753,470.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,176,900	24.00	28,245,600.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	154.50	12,777,150.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	73,600	27.75	2,042,400.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	11.80	5,176,070.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	88,700	133.50	11,841,450.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	18.60	3,070,860.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	59.00	5,988,500.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	63.25	5,679,850.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	64.00	4,883,200.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	59.25	13,408,275.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	8.50	7,412,000.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	38,900	382.00	14,859,800.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	194.00	23,221,800.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	76.50	9,321,525.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	3.78	3,634,126.02	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	41.25	2,202,750.00	

	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	16,900	175.00	2,957,500.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	129,400	65.00	8,411,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	75.25	5,132,050.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	288,200	42.00	12,104,400.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	44.25	2,402,775.00	
	タイパーツ 小計	13,300,316		479,473,618.02 (1,649,389,245)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	51.10	12,158,734.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	899.00	25,423,720.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	585.00	4,011,930.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	303,513	61.40	18,635,698.20	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	984.00	22,440,120.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	96,110	196.00	18,837,560.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	259.80	15,850,398.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	134.90	12,891,044.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	212,515	95.80	20,358,937.00	
	BDO UNIBANK INC	219,911	132.00	29,028,252.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	52.10	8,403,052.70	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	4.02	9,469,914.00	
	AYALA LAND INC	794,100	38.00	30,175,800.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,003,150	36.00	36,113,400.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	3,422.00	16,049,180.00	
	PLDT INC	10,460	1,640.00	17,154,400.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	297.00	8,645,670.00	
	フィリピンペソ 小計	5,642,999		305,647,809.90 (688,349,432)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,705.00	2,454,006,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	23,050.00	4,630,745,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	2,340.00	2,306,772,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	970.00	2,796,025,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	8,650.00	2,112,330,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	12,675.00	2,408,250,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,542,100	3,250.00	5,011,825,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	9,650.00	3,335,040,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,218,400	5,850.00	12,977,640,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	792,300	6,150.00	4,872,645,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	32,850.00	1,957,860,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	8,925.00	1,436,925,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,350.00	2,724,785,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	4,430.00	3,306,552,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,620.00	4,464,558,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	5,772,500	7,675.00	44,303,937,500.00	

	BANK MANDIRI	2,163,796	6,875.00	14,876,097,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	7,050.00	5,711,910,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	6,804,702	4,250.00	28,919,983,500.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	1,190.00	3,380,314,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,601,300	3,710.00	20,780,823,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,076,100	2,790.00	3,002,319,000.00	
	インドネシアルピア 小計	40,062,298		177,771,343,000.00 (1,422,170,744)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	6,593	44,050.00	290,421,650.00	
	S-OIL CORPORATION	4,447	100,000.00	444,700,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,586	232,500.00	1,298,745,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	12,381	36,500.00	451,906,500.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	41,450.00	463,784,050.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	501,000.00	392,283,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	169,000.00	320,762,000.00	
	LG CHEM LTD	4,869	769,000.00	3,744,261,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	350,500.00	307,388,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	217,000.00	418,810,000.00	
	POSCO	8,093	285,000.00	2,306,505,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	3,350	144,500.00	484,075,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	1,122	158,500.00	177,837,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	1,500	151,000.00	226,500,000.00	
	SKC CO LTD	1,734	179,000.00	310,386,000.00	
	CJ CORP	1,230	97,300.00	119,679,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	44,250.00	190,629,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	28,815	26,400.00	760,716,000.00	
	ECOPRO BM CO LTD	1,170	557,500.00	652,275,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	41,900.00	283,244,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	50,900.00	497,191,200.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	5,180	61,400.00	318,052,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,139	30,100.00	214,883,900.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	101,000.00	439,754,000.00	
	LG CORP	9,026	94,000.00	848,444,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	8,727	116,000.00	1,012,332,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	23,600.00	436,977,600.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	59,306	5,950.00	352,870,700.00	
	SK INC	3,592	241,500.00	867,468,000.00	
	S-1 CORPORATION	840	83,200.00	69,888,000.00	
	CJ LOGISTICS	862	141,000.00	121,542,000.00	
	HMM CO LTD	25,309	26,700.00	675,750,300.00	
	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,586	159,000.00	252,174,000.00	
	KOREAN AIR LINES CO LTD	23,739	30,850.00	732,348,150.00	

STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	5,680.00	168,900,480.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	7,066	42,900.00	303,131,400.00
HANON SYSTEMS	19,000	14,400.00	273,600,000.00
HYUNDAI MOBIS	7,116	248,500.00	1,768,326,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	14,897	213,000.00	3,173,061,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,051	100,500.00	306,625,500.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	99,100.00	341,795,900.00
KIA CORP	29,259	87,000.00	2,545,533,000.00
COWAY CO LTD	5,058	80,900.00	409,192,200.00
FILA HOLDINGS CORPORATION	4,080	38,450.00	156,876,000.00
HLB INC	10,012	40,350.00	403,984,200.00
LG ELECTRONICS INC	11,019	123,000.00	1,355,337,000.00
KANGWON LAND INC	7,703	26,950.00	207,595,850.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	23,150.00	117,370,500.00
HYBE CO LTD	1,547	389,000.00	601,783,000.00
KAKAO CORP	34,497	125,500.00	4,329,373,500.00
NAVER CORP	13,595	417,500.00	5,675,912,500.00
NCSOFT CORPORATION	1,643	627,000.00	1,030,161,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	131,500.00	324,147,500.00
PEARL ABYSS CORP	4,605	114,300.00	526,351,500.00
CJ ENM CO LTD	830	171,900.00	142,677,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	82,700.00	252,317,700.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	104,000.00	107,536,000.00
SHINSEGAE CO LTD	881	240,000.00	211,440,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	167,000.00	91,683,000.00
EMART	1,864	164,500.00	306,628,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	374,500.00	290,237,500.00
KT&G CORP	13,223	86,200.00	1,139,822,600.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	114,500.00	359,759,000.00
AMOREPACIFIC CORP	3,762	186,500.00	701,613,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	956	1,219,000.00	1,165,364,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	389	630,000.00	245,070,000.00
PACIFIC CORP	3,393	49,750.00	168,801,750.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,678	83,000.00	720,274,000.00
ALTEOGEN INC	2,841	78,100.00	221,882,100.00
CELLTRION INC	10,677	205,500.00	2,194,123,500.00
CELLTRION PHARM INC	1,911	115,600.00	220,911,600.00
GREEN CROSS CORP	564	243,500.00	137,334,000.00
HANMI PHARM CO LTD	499	278,000.00	138,722,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,870	826,000.00	1,544,620,000.00
SEEGENE INC	3,838	50,400.00	193,435,200.00
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	3,049	46,100.00	140,558,900.00

	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	96,400.00	308,190,800.00	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	222,000.00	466,200,000.00	
	YUHAN CORPORATION	5,817	60,300.00	350,765,100.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	33,962	44,200.00	1,501,120,400.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	11,150.00	315,879,500.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	42,887	55,800.00	2,393,094,600.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	50,883	37,450.00	1,905,568,350.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	13,250.00	787,129,500.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	87,400.00	402,214,800.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	4,720.00	226,106,880.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	8,970.00	278,204,550.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	12,950.00	156,785,650.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	48,100.00	277,825,600.00	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	58,400.00	245,805,600.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	223,000.00	693,084,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	67,700.00	502,130,900.00	
	DOUZONE BIZON CO LTD	1,451	78,800.00	114,338,800.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	157,000.00	584,825,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	24,071	20,500.00	493,455,500.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	213,500.00	302,102,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	6,845	161,000.00	1,102,045,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	517,151	70,500.00	36,459,145,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	88,687	66,000.00	5,853,342,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	5,892	748,000.00	4,407,216,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	14,350.00	317,493,750.00	
	SK TELECOM	3,161	309,500.00	978,329,500.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,459	23,400.00	619,140,600.00	
	SK HYNIX INC	60,303	109,000.00	6,573,027,000.00	
	韓国ウォン 小計	1,673,228		123,813,019,810.00 (11,861,287,297)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	101.50	11,392,360.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	44.80	10,491,084.80	
	CHINA STEEL	1,266,261	34.50	43,686,004.50	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	420,061	80.60	33,856,916.60	
	FORMOSA PLASTICS CORP	441,824	107.50	47,496,080.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	561,752	85.80	48,198,321.60	
	TAIWAN CEMENT	486,511	48.80	23,741,736.80	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,557	767.00	9,631,219.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	29.90	10,406,037.20	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	23,207	290.00	6,730,030.00	
	EVERGREEN MARINE	266,039	122.00	32,456,758.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	150,000	29.35	4,402,500.00	

WAN HAI LINES LIMITED	64,900	183.50	11,909,150.00
YANG MING MARINE TRANSPORT	180,000	116.00	20,880,000.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	35.20	6,232,547.20
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	635.00	12,659,995.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	43,448	228.00	9,906,144.00
GIANT MANUFACTURING	34,464	302.00	10,408,128.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	384.00	6,144,000.00
POU CHEN	273,780	34.90	9,554,922.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	30,000	628.00	18,840,000.00
MOMO.COM INC	5,000	1,735.00	8,675,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,544	290.50	17,297,532.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	494,395	67.30	33,272,783.50
ONENESS BIOTECH CO LTD	20,000	254.00	5,080,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	587,664	16.70	9,813,988.80
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,011,237	23.55	47,364,631.35
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,397,452	27.00	37,731,204.00
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,248,238	23.05	28,771,885.90
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,059,344	20.45	21,663,584.80
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,211,339	33.70	40,822,124.30
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	14.15	16,369,979.35
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,009,432	18.30	18,472,605.60
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,078,434	23.00	24,803,982.00
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	451,861	44.95	20,311,151.95
CHAILEASE HOLDING CO LTD	144,167	260.50	37,555,503.50
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,056,159	24.20	25,559,047.80
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	888,123	58.50	51,955,195.50
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,624,780	14.30	23,234,354.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	339,308	29.00	9,839,932.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	810,435	73.10	59,242,798.50
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,262,866	9.88	12,477,116.08
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	206,724	67.50	13,953,870.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	290.00	13,920,000.00
ACER INC	255,803	26.80	6,855,520.40
ADVANTECH CO LTD	43,336	389.00	16,857,704.00
ASUSTEK COMPUTER INC	72,092	375.50	27,070,546.00
AU OPTRONICS CORP	945,090	20.55	19,421,599.50
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	69,700	165.00	11,500,500.00
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	1,049,000	18.00	18,882,000.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	24.35	10,513,356.00
DELTA ELECTRONICS INC	217,903	266.00	57,962,198.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	69.60	6,462,360.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,368,248	108.00	147,770,784.00

	INVENTEC CO LTD	280,511	26.30	7,377,439.30	
	LARGAN PRECISION CO LTD	11,040	2,060.00	22,742,400.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	61.60	13,887,843.20	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	159.50	9,570,000.00	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	542.00	11,382,000.00	
	PEGATRON CORP	200,474	69.00	13,832,706.00	
	QUANTA COMPUTER INC	286,270	81.10	23,216,497.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	57.80	7,404,180.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	118,000	192.50	22,715,000.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	159.00	4,293,000.00	
	WISTRON CORP	242,695	28.85	7,001,750.75	
	WIWYNN CORP	8,000	941.00	7,528,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	143,692	52.30	7,515,091.60	
	YAGEO CORPORATION	38,764	429.00	16,629,756.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	59,922	103.00	6,171,966.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	410,315	111.50	45,750,122.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	63.00	9,891,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	192,200	98.80	18,989,360.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	359,315	105.00	37,728,075.00	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	3,000	1,705.00	5,115,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	779.00	18,696,000.00	
	MEDIATEK INC	165,804	978.00	162,156,312.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	115,000	68.70	7,900,500.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,045	461.00	26,758,745.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	22,599	386.00	8,723,214.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	69,770	97.90	6,830,483.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50,944	511.00	26,032,384.00	
	SILERGY CORP	8,000	4,820.00	38,560,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,661,389	611.00	1,626,108,679.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,316,000	63.10	83,039,600.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	155.50	13,839,500.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	349.00	11,168,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	28.15	9,824,350.00	
	新台湾ドル 小計	35,813,720		3,628,887,727.88 (14,755,420,390)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	96,221	430.50	41,423,140.50	
	COAL INDIA LTD	180,326	170.50	30,745,583.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	344.55	20,474,883.75	
	INDIAN OIL CORP LTD	193,765	139.70	27,068,970.50	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	156.65	39,586,864.85	
	PETRONET LNG LTD	83,779	235.60	19,738,332.40	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	309,735	2,521.70	781,058,749.50	

ACC LTD	5,315	2,538.30	13,491,064.50
AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	431.25	31,711,106.25
ASIAN PAINTS LTD	42,204	3,145.15	132,737,910.60
BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	774.95	22,821,502.55
GRASIM INDUSTRIES LTD	31,529	1,863.85	58,765,326.65
HINDALCO INDUSTRIES LTD	180,501	464.60	83,860,764.60
JSW STEEL LTD	80,284	676.65	54,324,168.60
PI INDUSTRIES LTD	8,147	2,785.95	22,697,134.65
PIDILITE INDUSTRIES LTD	18,199	2,392.10	43,533,827.90
SHREE CEMENT LTD	901	29,229.65	26,335,914.65
TATA STEEL LTD	77,326	1,335.95	103,303,669.70
ULTRATECH CEMENT LTD	11,556	8,166.00	94,366,296.00
UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	746.35	40,455,155.40
VEDANTA LTD	147,245	318.60	46,912,257.00
ADANI ENTERPRISES LTD	26,979	1,635.45	44,122,805.55
BHARAT ELECTRONICS LTD	116,287	220.80	25,676,169.60
HAVELLS INDIA LTD	23,476	1,326.90	31,150,304.40
LARSEN & TOUBRO LTD	71,836	1,943.60	139,620,449.60
SIEMENS INDIA LTD	5,926	2,408.50	14,272,771.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	64,743	737.35	47,738,251.05
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	701.45	18,556,859.75
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	2,155.20	18,017,472.00
BAJAJ AUTO LTD	5,820	3,794.45	22,083,699.00
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,496.95	22,050,565.45
BHARAT FORGE LTD	30,322	834.05	25,290,064.10
EICHER MOTORS LTD	14,685	2,724.25	40,005,611.25
HERO MOTOCORP LTD	12,238	2,714.35	33,218,215.30
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	101,669	892.15	90,703,998.35
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	13,994	7,577.55	106,040,234.70
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	124,426	238.65	29,694,264.90
MRF LTD	133	78,508.70	10,441,657.10
TATA MOTORS LTD	190,082	509.65	96,875,291.30
PAGE INDUSTRIES LTD	601	39,769.35	23,901,379.35
TITAN INDUSTRIES LTD	40,781	2,512.10	102,445,950.10
JUBILANT FOODWORKS LTD	8,786	3,904.10	34,301,422.60
INFO EDGE INDIA LTD	7,855	6,219.15	48,851,423.25
TRENT LTD	19,255	1,127.40	21,708,087.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	17,524	4,757.15	83,364,296.60
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	11,474	3,621.60	41,554,238.40
ITC LTD	289,062	228.75	66,122,932.50
NESTLE INDIA LIMITED	3,906	18,940.75	73,982,569.50
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	61,013	835.65	50,985,513.45

UNITED SPIRITS LTD	32,483	1,004.50	32,629,173.50
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	9,566	1,539.25	14,724,465.50
DABUR INDIA LTD	58,111	603.20	35,052,555.20
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	38,464	960.30	36,936,979.20
HINDUSTAN UNILEVER LTD	89,298	2,431.15	217,096,832.70
MARICO LTD	42,465	564.25	23,960,876.25
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	10,114	4,532.90	45,845,750.60
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	677.00	23,975,955.00
BIOCON LTD	58,256	347.00	20,214,832.00
CIPLA LTD	49,816	914.15	45,539,296.40
DIVI'S LABORATORIES LTD	14,782	4,951.30	73,190,116.60
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	4,792.35	60,594,473.40
IPCA LABORATORIES LTD	9,167	2,182.25	20,004,685.75
LUPIN LTD	26,552	937.35	24,888,517.20
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	97,015	801.35	77,742,970.25
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	6,110	2,847.35	17,397,308.50
AXIS BANK LTD	247,821	745.05	184,639,036.05
BANDHAN BANK LTD	74,811	306.90	22,959,495.90
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	187,327	2,941.60	551,041,103.20
ICICI BANK LTD	563,039	786.55	442,858,325.45
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	56,150	2,097.20	117,757,780.00
STATE BANK OF INDIA	187,504	529.15	99,217,741.60
YES BANK LTD	1,020,164	13.10	13,364,148.40
BAJAJ FINANCE LTD	30,037	7,577.50	227,605,367.50
BAJAJ FINSERV LTD	3,888	18,172.50	70,654,680.00
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	38,543	640.00	24,667,520.00
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,095	2,672.90	10,945,525.50
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,629.05	20,237,688.15
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	2,772.80	32,502,761.60
REC LTD	142,172	152.75	21,716,773.00
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	31,013	1,083.05	33,588,629.65
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	21,216	1,616.05	34,286,116.80
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	94,500	706.45	66,759,525.00
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	23,540	1,508.90	35,519,506.00
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	651.30	20,667,051.60
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	53,770	1,207.25	64,913,832.50
DLF LTD	56,420	437.40	24,678,108.00
HCL TECHNOLOGIES LTD	123,161	1,172.80	144,443,220.80
INFOSYS LTD	370,852	1,742.50	646,209,610.00
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	5,756	6,839.65	39,369,025.40
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	98,522	3,505.70	345,388,575.40
TECH MAHINDRA LTD	72,109	1,559.20	112,432,352.80

	WIPRO LTD	144,908	658.45	95,414,672.60	
	BHARTI AIRTEL LTD	266,977	713.20	190,407,996.40	
	INDUS TOWERS LTD	90,578	290.75	26,335,553.50	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	1,230.80	52,407,464.00	
	ADANI TOTAL GAS LTD	26,949	1,575.10	42,447,369.90	
	ADANI TRANSMISSION LTD	27,228	1,859.80	50,638,634.40	
	GAIL INDIA LTD	174,768	150.65	26,328,799.20	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	494.00	13,201,656.00	
	NTPC LTD	513,123	138.50	71,067,535.50	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	327,337	186.55	61,064,717.35	
	インドルピー 小計	9,036,589		7,905,721,807.90 (12,095,754,366)	
パキスタンル ピー	LUCKY CEMENT	31,357	768.17	24,087,506.69	
	HABIB BANK LTD	66,500	125.32	8,333,780.00	
	MCB BANK LTD	53,300	156.82	8,358,506.00	
	パキスタンルピー 小計	151,157		40,779,792.69 (26,914,663)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	60,443	18.69	1,129,679.67	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	296,777	3.29	976,396.33	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.36	1,047,663.00	
	INDUSTRIES QATAR	196,788	15.76	3,101,378.88	
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	6.50	1,325,935.00	
	MASRAF AL RAYAN	406,540	4.95	2,015,218.78	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	9.73	959,668.98	
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	18.27	2,086,982.10	
	QATAR NATIONAL BANK	484,445	21.00	10,173,345.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.24	672,267.60	
	OOREDOO QSC	72,800	7.00	509,600.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	62,421	17.00	1,061,157.00	
	カタールリアル 小計	2,648,408		25,059,292.34 (774,833,319)	
南アフリカラン ド	EXXARO RESOURCES LTD	22,520	160.28	3,609,505.60	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	199.00	2,919,330.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	6,119	1,532.00	9,374,308.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	39,424	285.66	11,261,859.84	
	GOLD FIELDS LTD	97,102	142.91	13,876,846.82	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	56,301	54.40	3,062,774.40	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	91,758	189.99	17,433,102.42	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	411.33	2,209,664.76	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	33,950	205.73	6,984,533.50	
	SASOL LTD	57,207	270.41	15,469,344.87	
	SIBANYE STILLWATER LTD	313,727	51.75	16,235,372.25	

	BIDVEST GROUP LTD	27,702	189.76	5,256,731.52
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	118.98	4,822,140.42
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	202.80	5,781,828.00
	NASPERS LTD-N SHS	23,206	2,551.38	59,207,324.28
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	56.86	6,282,745.70
	BID CORP LTD	35,017	324.10	11,349,009.70
	CLICKS GROUP LTD	26,921	280.00	7,537,880.00
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	60,003	188.26	11,296,164.78
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	196.19	4,566,126.06
	TIGER BRANDS LTD	13,023	192.00	2,500,416.00
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,244	223.38	8,319,564.72
	ABSA GROUP LTD	73,296	140.53	10,300,286.88
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	8,544	1,838.99	15,712,330.56
	NEDBANK GROUP LTD	44,497	167.92	7,471,936.24
	STANDARD BANK GROUP LTD	150,257	134.75	20,247,130.75
	FIRSTSTRAND LTD	560,323	58.87	32,986,215.01
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	271.85	4,672,285.95
	REMGRO LTD	55,441	134.76	7,471,229.16
	DISCOVERY LIMITED	48,488	141.64	6,867,840.32
	OLD MUTUAL LTD	489,612	14.24	6,972,074.88
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	101,268	42.83	4,337,308.44
	SANLAM LTD	214,053	61.59	13,183,524.27
	NEPI ROCKCASTLE PLC	60,556	102.90	6,231,212.40
	MTN GROUP LTD	194,516	169.06	32,884,874.96
	VODACOM GROUP	62,331	136.93	8,534,983.83
	南アフリカランド 小計	3,244,443		407,229,807.29 (3,050,151,256)
アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	271,405	4.30	1,167,041.50
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	327,038	8.21	2,684,981.98
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	5.90	1,096,107.90
	DUBAI ISLAMIC BANK	215,945	5.36	1,157,465.20
	EMIRATES NBD PJSC	265,296	14.15	3,753,938.40
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	486,542	19.00	9,244,298.00
	ALDAR PROPERTIES PJSC	367,539	4.19	1,539,988.41
	EMAAR PROPERTIES PJSC	385,040	4.89	1,882,845.60
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	174,383	27.00	4,708,341.00
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	2,678,969		27,235,007.99 (838,293,545)
クウェートディ ナル	AGILITY	142,931	1.01	144,360.31
	BOUBYAN BANK K.S.C	130,019	0.80	104,925.33
	KUWAIT FINANCE HOUSE	514,294	0.84	433,549.84
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	722,881	1.02	737,338.62

	MABANEE CO KPSC	67,003	0.83	56,014.50
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	215,000	0.59	128,355.00
	クウェートディナール 小計	1,792,128		1,604,543.60 (601,431,077)
香港・オフショア 人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	109,080	4.12	449,409.60
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20,000	19.45	389,000.00
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	4.85	485,000.00
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	11.78	451,174.00
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	11.45	1,005,310.00
	YANZHOU COAL MINING CO-A	61,200	22.91	1,402,092.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	5.47	898,721.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	37.89	1,115,481.60
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	6.31	244,197.00
	CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	78,847	17.02	1,341,975.94
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	50.24	1,044,992.00
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	8,000	173.50	1,388,000.00
	GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	5,000	29.88	149,400.00
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	12,413	153.21	1,901,795.73
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	21.13	783,923.00
	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	16.34	163,400.00
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	2.60	1,198,600.00
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.90	294,000.00
	JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	21.95	489,485.00
	JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	38,570	5.48	211,363.60
	KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	30,400	12.65	384,560.00
	LB GROUP CO LTD-A	15,300	27.04	413,712.00
	NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	14.39	1,139,688.00
	PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	3.72	818,772.00
	RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	15.81	765,994.50
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	20.07	145,547.64
	SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	27.80	498,732.00
	SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	4.16	1,192,256.00
	SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	5,600	194.00	1,086,400.00
	SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	7.16	983,784.00
	SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	20.67	1,019,031.00
	SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	6,000	132.00	792,000.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	4,100	11.46	46,986.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	19.77	193,746.00	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	8.07	744,054.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	96.66	1,691,550.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	76.73	707,450.60	
YINTAI GOLD CO LTD-A	111,300	9.39	1,045,107.00	

YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	10,400	270.31	2,811,224.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	5,700	124.11	707,427.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	12.88	303,968.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	8.55	290,700.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	62.30	710,220.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	26.76	224,784.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	21.12	1,166,140.80
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	4.57	963,813.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	13,400	663.28	8,887,952.00
CRRC CORP LTD-A	185,800	5.99	1,112,942.00
EVE ENERGY CO LTD-A	7,573	134.62	1,019,477.26
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	10.42	237,576.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	59.85	347,130.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	144.43	909,909.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	13,600	40.74	554,064.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	18,800	76.50	1,438,200.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	83.03	951,191.68
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.78	1,250,802.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	58,320	38.15	2,224,908.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	7.08	1,155,456.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	22.19	929,761.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	10,650	71.14	757,641.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	154,700	11.39	1,762,033.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	160.21	1,602,100.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	5.65	127,690.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	1,600	706.10	1,129,760.00
TBEA CO LTD-A	22,519	24.84	559,371.96
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	15.68	677,376.00
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	3,800	243.66	925,908.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	6.14	1,224,316.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	19.59	393,974.49
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	28,280	34.45	974,246.00
YUTONG BUS CO LTD-A	44,300	11.56	512,108.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	56.62	1,789,192.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	71.01	586,542.60
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	47,190	24.53	1,157,570.70
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	7.03	563,103.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	7.10	572,260.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	62.93	692,230.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	8.97	232,323.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	106,700	4.52	482,284.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.86	194,400.00

S F HOLDING CO LTD-A	20,300	60.28	1,223,684.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	49.93	265,577.67
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	4.63	205,572.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	58.48	485,384.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	17.05	372,372.00
BYD CO LTD -A	9,700	320.69	3,110,693.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	33,348	20.85	695,305.80
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	47.17	872,645.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	26.74	917,182.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	19.64	575,452.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	22.16	944,016.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	41.70	1,636,891.80
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	1,031	909.80	938,003.80
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	183.84	514,752.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	29.47	818,087.20
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	6,102	65.08	397,118.16
NAVINFO CO LTD-A	33,200	12.87	427,284.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	121.30	934,010.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	25.61	665,860.00
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	3,000	17.31	51,930.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	102,000	6.23	635,460.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	55.46	443,680.00
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	97,400	9.29	904,846.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	55.90	1,464,580.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	6.00	475,800.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	14.49	485,125.20
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	9.95	533,320.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	7.49	1,044,106.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	43.96	716,548.00
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	16,500	7.25	119,625.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	18.36	418,608.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	24,500	24.96	611,520.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	7.23	444,645.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	12,200	227.62	2,776,964.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	19.14	325,380.00
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	4.42	202,436.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	15,480	38.93	602,636.40
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	8,600	45.73	393,278.00
SHANGHAI BAILIAN GROUP CO-A	60,340	14.34	865,275.60
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	10,140	49.00	496,860.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	4.05	164,025.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	55.88	597,916.00

ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	240.26	384,416.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	63.30	139,260.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	10.46	622,370.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	34.31	353,393.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	56.00	560,000.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	154.19	1,218,101.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	4,600	33.96	156,216.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	18,408	119.90	2,207,119.20
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	3,000	189.61	568,830.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	23.53	644,722.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	65.62	1,115,540.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	30.78	36,936.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	42.23	1,448,573.46
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	54.34	940,082.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	179.20	1,630,720.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	27,700	10.68	295,836.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	210.40	1,178,240.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	37.19	427,685.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	69.18	484,260.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	7,600	1,790.01	13,604,076.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	226.97	2,224,306.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	56.97	1,911,799.26
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	15.57	417,276.00
QIANHE CONDIMENT AND FOOD-A	16,800	25.83	433,944.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	302.01	2,832,853.80
TONGWEI CO LTD-A	31,600	50.48	1,595,168.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	16.77	639,943.20
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	21,200	208.77	4,425,924.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	65.62	662,762.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	25.27	133,931.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	23.70	703,890.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	23,226	48.23	1,120,189.98
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	6,500	55.38	359,970.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	33,700	30.34	1,022,458.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	109.88	311,839.44
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	35.18	341,949.60
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	7,875	53.43	420,761.25
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	48.99	605,026.50
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	18,000	35.15	632,700.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	13.47	140,088.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	21.47	317,756.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	7.73	192,013.20

OVCTEK CHINA INC-A	7,209	63.01	454,239.09
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	8,400	370.30	3,110,520.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	220.65	441,300.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	37,830	13.94	527,350.20
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	381.21	76,242.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	23,400	29.01	678,834.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	5,167	210.93	1,089,875.31
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	80.13	1,290,093.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	88.70	487,850.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	273.07	600,754.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	24.00	244,800.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	128.56	1,272,744.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	40.46	897,928.78
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	29.12	465,920.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	141.37	1,130,960.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	29.62	558,337.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	569.10	1,183,728.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	38,102	49.81	1,897,860.62
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	21,294	39.64	844,094.16
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	6.52	417,932.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,800	107.49	730,932.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	29.77	208,390.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	59,640	15.96	951,854.40
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	18.24	204,871.68
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,500	11.78	229,710.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	48.56	825,520.00
WUXI APPTTEC CO LTD-A	16,464	126.98	2,090,598.72
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	26,100	17.05	445,005.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	7,100	88.27	626,717.00
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	3,900	423.00	1,649,700.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	21.24	191,584.80
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	29,040	28.98	841,579.20
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	54.95	533,015.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	2.92	1,032,512.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.40	255,200.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	4.63	457,907.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	75,140	6.18	464,365.20
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	9.41	475,205.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	24,000	36.81	883,440.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	7.24	329,420.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	5.84	729,416.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	3.32	427,948.00

CHINA MERCHANTS BANK-A	104,900	51.06	5,356,194.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.87	1,058,832.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	308,600	3.41	1,052,326.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.52	659,088.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	4.64	1,211,968.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	18.31	1,743,112.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	17.53	2,093,082.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.34	755,610.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	8.54	1,181,082.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.89	476,525.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	13.11	1,040,934.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	44,100	10.18	448,938.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	7.21	143,479.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	10.61	495,487.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	17.05	488,653.00
CITIC SECURITIES CO-A	43,200	25.58	1,105,056.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	28.60	689,260.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	41,880	33.49	1,402,561.20
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	14.83	53,388.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	7.14	429,828.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	7.82	647,496.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	19.98	1,210,788.00
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	127,170	8.02	1,019,903.40
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	17.10	1,236,330.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	7.43	1,129,731.50
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	114.40	617,760.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	56,420	5.07	286,049.40
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	15.57	490,455.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	8.56	752,424.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	42,700	9.66	412,482.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	13.34	422,878.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	69,616	8.29	577,116.64
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	5.62	1,164,464.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	4.77	543,780.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	94,600	3.97	375,562.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	12.66	553,242.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	27.74	504,868.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	49.69	3,319,292.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	18,200	3.42	62,244.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	9.42	515,274.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	18.22	978,414.00
GEMDALE CORP-A	45,500	9.77	444,535.00

GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	123,480	4.01	495,154.80
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	70,360	3.69	259,628.40
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	12.55	1,026,590.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	30.77	393,856.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	14.89	126,565.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	12.40	333,560.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	289.49	1,396,210.27
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	18,900	25.11	474,579.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	14.19	408,672.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	6,700	55.52	371,984.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	78,400	13.60	1,066,240.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	7.14	397,698.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	12,740	61.08	778,159.20
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	58.85	635,580.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	220.23	660,690.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	6,110	73.99	452,078.90
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	139.76	768,680.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	32.60	429,342.00
ADDSINO CO LTD -A	5,800	16.48	95,584.00
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	40.50	1,534,950.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	5.01	574,146.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	41.64	1,165,920.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	13.81	480,588.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	17.62	366,496.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	11.59	522,709.00
GOERTEK INC -A	26,900	47.69	1,282,861.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	6.56	328,000.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	77.61	543,270.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	31.63	623,490.56
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	21.59	362,712.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	39.90	1,853,355.00
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,080	308.50	333,180.00
NINESTAR CORP-A	18,543	38.37	711,494.91
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	8.19	256,347.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	23.42	569,106.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	109.81	522,695.60
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	23,500	16.08	377,880.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	13,400	24.86	333,124.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	25.85	736,725.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	12.32	579,040.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	27.37	501,965.80
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	2,800	14.68	41,104.00

	WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	116.87	490,854.00
	WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	29,512	23.33	688,514.96
	WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	23,360	87.05	2,033,488.00
	YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	75.20	846,000.00
	ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	24.54	743,562.00
	ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	34.89	303,543.00
	ZTE CORP-A	12,600	31.49	396,774.00
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	6.63	1,152,294.00
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	134,000	20.34	2,725,560.00
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	10.05	679,380.00
	SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	6.15	922,500.00
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	158.20	1,122,745.40
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	4.09	337,425.00
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	6,272	164.30	1,030,489.60
	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	10,800	130.80	1,412,640.00
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	64.97	487,275.00
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	17,450	91.14	1,590,393.00
	JCET GROUP CO LTD-A	29,800	32.08	955,984.00
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	33,600	93.13	3,129,168.00
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	404.20	1,253,020.00
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	40,600	35.90	1,457,540.00
	SG MICRO CORP-A	2,100	347.95	730,695.00
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2,600	109.51	284,726.00
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	29,500	48.43	1,428,685.00
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	13.98	457,845.00
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	20.87	468,865.42
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	4,900	224.42	1,099,658.00
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	5,400	280.00	1,512,000.00
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	77.63	1,321,417.86
	香港・オフショア人民元 小計	14,129,241		282,069,945.20 (4,982,624,546)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	27.20	640,804.80
	SAUDI ARABIAN OIL CO	238,091	37.30	8,880,794.30
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,804	72.00	705,888.00
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	24.30	775,850.40
	NATIONAL PETROCHEMICAL CO	13,666	43.10	589,004.60
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	24,254	174.20	4,225,046.80
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	43.85	1,415,609.55
	SAUDI ARABIAN MINING CO	44,984	79.00	3,553,736.00
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	97,353	127.60	12,422,242.80
	SAUDI CEMENT	7,489	59.60	446,344.40
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	21,059	34.50	726,535.50

SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	66,114	19.18	1,268,066.52	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	72.60	1,927,965.60	
JARIR MARKETING CO	7,199	203.00	1,461,397.00	
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	3,725	116.40	433,590.00	
ALMARAI CO	30,130	52.20	1,572,786.00	
SAVOLA	25,336	35.70	904,495.20	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	6,923	170.00	1,176,910.00	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	4,029	166.20	669,619.80	
AL RAJHI BANK	130,773	147.00	19,223,631.00	
ALINMA BANK	109,956	24.96	2,744,501.76	
ARAB NATIONAL BANK	57,638	23.10	1,331,437.80	
BANK AL-JAZIRA	35,813	18.98	679,730.74	
BANK ALBILAD	45,859	46.00	2,109,514.00	
BANQUE SAUDI FRANSI	67,536	47.75	3,224,844.00	
RIYAD BANK	138,943	29.25	4,064,082.75	
SAUDI BRITISH BANK	94,400	33.05	3,119,920.00	
THE SAUDI NATIONAL BANK	236,442	67.00	15,841,614.00	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	139.80	847,607.40	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,613	83.40	551,524.20	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	47,092	9.25	435,601.00	
EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	11.88	548,701.56	
ETIHAD ETISALAT CO	34,414	29.85	1,027,257.90	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	26,891	13.32	358,188.12	
SAUDI TELECOM CO	66,310	115.00	7,625,650.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	26.15	2,411,579.15	
サウジアラビアリアル 小計	1,957,633		109,942,072.65 (3,313,654,069)	
合 計	277,372,885		97,437,385,523 (97,437,385,523)	

(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
新株予約権 証券	タイバーツ	BTS GROUP HOLDINGS PCL-CW22	40,475.00	57,474.50	
		タイバーツ 小計	40,475.00	57,474.50 (197,712)	
新株予約権証券合計				197,712 (197,712)	
投資信託受 益証券	メキシコペ ソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	58,400	6,450,280.00	
		メキシコペソ 小計	58,400	6,450,280.00 (35,817,759)	

	ブラジルレアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	131,500	3,016,610.00	
		BANCO INTER SA-UNITS	31,500	1,349,145.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,549,125.00	
		ENERGISA SA-UNITS	16,500	673,365.00	
		KLABIN SA-UNIT	64,600	1,441,226.00	
ブラジルレアル 小計			290,000	8,029,471.00 (165,173,444)	
投資信託受益証券合計			348,400	200,991,203 (200,991,203)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	6,451,728.00	
		メキシコペソ 小計	308,400	6,451,728.00 (35,825,800)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	6,391,085.55	
		南アフリカランド 小計	478,733	6,391,085.55 (47,869,230)	
投資証券合計			787,133	83,695,030 (83,695,030)	
合計				284,883,945 (284,883,945)	

有価証券明細表注記

1. 券面総額欄の数値は、証券数又は口数を表示しております。
2. 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。
3. 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。
4. 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。
5. 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	組入新株予約権 証券 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 72銘柄	100.0%				9.9%
メキシコペソ	株式 21銘柄	96.2%				1.9%
	投資信託受益証券 1銘柄			1.9%		0.0%
	投資証券 1銘柄				1.9%	0.0%
ブラジルレアル	株式 48銘柄	95.8%				3.9%
	投資信託受益証券 5銘柄			4.2%		0.2%
チリペソ	株式 13銘柄	100.0%				0.4%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	100.0%				0.2%
ユーロ	株式 5銘柄	100.0%				0.2%

イギリスポンド	株式	1銘柄	100.0%				0.1%
トルコリラ	株式	11銘柄	100.0%				0.3%
チェココルナ	株式	3銘柄	100.0%				0.1%
ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%				0.3%
ポーランドズロチ	株式	14銘柄	100.0%				0.8%
香港ドル	株式	213銘柄	100.0%				23.1%
マレーシアリンギット	株式	36銘柄	100.0%				1.3%
タイバーツ	株式	42銘柄	100.0%				1.7%
	新株予約権証券	1銘柄		0.0%			0.0%
フィリピンペソ	株式	17銘柄	100.0%				0.7%
インドネシアルピア	株式	22銘柄	100.0%				1.5%
韓国ウォン	株式	104銘柄	100.0%				12.1%
新台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%				15.1%
インドルピー	株式	101銘柄	100.0%				12.4%
パキスタンルピー	株式	3銘柄	100.0%				0.0%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%				0.8%
南アフリカランド	株式	36銘柄	98.5%				3.1%
	投資証券	1銘柄				1.5%	0.0%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式	9銘柄	100.0%				0.9%
クウェートディナール	株式	6銘柄	100.0%				0.6%
香港・オフショア人民元	株式	319銘柄	100.0%				5.1%
サウジアラビアリアル	株式	36銘柄	100.0%				3.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	335,805,389
国債証券	541,644,438,250
地方債証券	35,257,830,442
特殊債券	40,727,666,151
社債券	29,302,542,560
未収入金	451,491,300
未収利息	1,077,134,618
前払費用	30,520,583
流動資産合計	648,827,429,293
資産合計	648,827,429,293
負債の部	
流動負債	
未払金	200,000,000
未払解約金	229,448,943
未払利息	746
流動負債合計	429,449,689
負債合計	429,449,689
純資産の部	
元本等	
元本	459,359,027,915
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	189,038,951,689
元本等合計	648,397,979,604
純資産合計	648,397,979,604
負債純資産合計	648,827,429,293

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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。</p>

	2021年11月10日現在
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11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	459,359,027,915口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 101,246,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.4115円 (1万口当たり純資産額) (14,115円)

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

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2021年11月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年11月10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11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 5月11日
期首元本額	443,635,763,178円
期中追加設定元本額	41,037,418,722円
期中一部解約元本額	25,314,153,985円
期末元本額	459,359,027,915円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円

区分	2021年11月10日現在
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,845,211,962円
S B I 資産設計オープン（分配型）	17,032,122円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,892,679,816円
世界経済インデックスファンド	3,059,512,291円
D C マイセレクション 2 5	24,926,805,607円
D C マイセレクション 5 0	28,306,848,761円
D C マイセレクション 7 5	8,230,136,134円
D C 日本債券インデックス・オープン	443,638,092円
D C 日本債券インデックス・オープン S	93,182,370,103円
D C 日本債券インデックス・オープン P	68,740,136,194円
D C マイセレクション S 2 5	11,972,934,092円
D C マイセレクション S 5 0	13,398,274,946円
D C マイセレクション S 7 5	2,821,411,138円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	883,217,507円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	2,059,146,401円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	749,168,846円
D C 世界経済インデックスファンド	3,113,620,735円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	8,515,469円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	3,229,247円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	36,130,719円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	9,005,829円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	1,065,314円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	102,687,358円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	167,870,693円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	34,930,870円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	33,874,240円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	3,242,737,533円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	787,140,774円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,339,016,534円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	167,336,042円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	82,459,266円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,080,289,727円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,201,928,427円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,513,641,833円
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	146,170,033円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	5,819,118,506円
日本債券ファンド・シリーズ 1	14,801,412,240円
分散投資コア戦略ファンド A	25,782,175,370円
分散投資コア戦略ファンド S	32,758,547,405円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	141,331,727円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,283,192,625円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	61,302,700円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	34,957,308円

区分	2021年11月10日現在
S M T インデックスバランス・オープン	57,950,323円
S M T 世界経済インデックス・オープン	29,947,689円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	55,964,619円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	91,267,563円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	7,539,525円
グローバル経済コア	229,462,339円
S B I資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	25,256,878円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	14,337,053円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	8,263,967円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	3,708,382円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	1,185,839円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	875,887円
F O F s用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	79,394,668,196円
F O F s用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	60,527,480円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	4,383,436円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	89,248,963円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	581,291,950
地方債証券	14,335,836
特殊債券	29,613,545
社債券	34,324,400
合計	590,916,931

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「国内債券インデックス 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	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第419回利付国債(2年)	570,000,000	571,293,900	
	第420回利付国債(2年)	500,000,000	501,255,000	
	第421回利付国債(2年)	590,000,000	591,587,100	
	第422回利付国債(2年)	80,000,000	80,228,800	
	第423回利付国債(2年)	1,310,000,000	1,312,266,300	
	第424回利付国債(2年)	570,000,000	571,043,100	
	第425回利付国債(2年)	2,870,000,000	2,875,567,800	
	第426回利付国債(2年)	620,000,000	621,264,800	
	第427回利付国債(2年)	3,870,000,000	3,878,320,500	
	第428回利付国債(2年)	230,000,000	230,519,800	
	第429回利付国債(2年)	950,000,000	952,242,000	
	第430回利付国債(2年)	100,000,000	100,247,000	
	第134回利付国債(5年)	5,700,000,000	5,713,224,000	
	第135回利付国債(5年)	4,080,000,000	4,091,872,800	
	第136回利付国債(5年)	4,400,000,000	4,415,180,000	
	第137回利付国債(5年)	6,760,000,000	6,787,648,400	
	第138回利付国債(5年)	6,800,000,000	6,831,552,000	
	第139回利付国債(5年)	5,690,000,000	5,719,531,100	
	第140回利付国債(5年)	6,300,000,000	6,335,343,000	
	第141回利付国債(5年)	7,250,000,000	7,295,675,000	
	第142回利付国債(5年)	5,380,000,000	5,416,906,800	
	第143回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,835,520,000	
	第144回利付国債(5年)	6,310,000,000	6,359,091,800	
	第145回利付国債(5年)	7,410,000,000	7,471,725,300	
	第146回利付国債(5年)	3,150,000,000	3,177,279,000	
	第147回利付国債(5年)	4,420,000,000	4,441,260,200	
	第148回利付国債(5年)	7,020,000,000	7,054,047,000	
	第149回利付国債(5年)	670,000,000	673,269,600	
	第1回利付国債(40年)	400,000,000	574,292,000	
	第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,571,434,500	
	第3回利付国債(40年)	550,000,000	768,823,000	
	第4回利付国債(40年)	1,200,000,000	1,691,856,000	
	第5回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,460,261,100	
	第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,696,728,600	
第7回利付国債(40年)	1,440,000,000	1,866,628,800		
第8回利付国債(40年)	1,230,000,000	1,493,084,700		
第9回利付国債(40年)	1,950,000,000	1,780,584,000		
第10回利付国債(40年)	2,100,000,000	2,241,246,000		

第11回利付国債(40年)	1,790,000,000	1,852,596,300	
第12回利付国債(40年)	1,450,000,000	1,358,084,500	
第13回利付国債(40年)	2,040,000,000	1,905,115,200	
第14回利付国債(40年)	1,060,000,000	1,058,357,000	
第326回利付国債(10年)	3,120,000,000	3,147,986,400	
第327回利付国債(10年)	5,190,000,000	5,242,315,200	
第328回利付国債(10年)	5,940,000,000	5,997,142,800	
第329回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,322,323,800	
第330回利付国債(10年)	1,900,000,000	1,932,357,000	
第331回利付国債(10年)	900,000,000	911,970,000	
第332回利付国債(10年)	4,800,000,000	4,872,960,000	
第333回利付国債(10年)	3,030,000,000	3,081,116,100	
第334回利付国債(10年)	4,860,000,000	4,950,784,800	
第335回利付国債(10年)	2,160,000,000	2,198,383,200	
第336回利付国債(10年)	1,050,000,000	1,070,128,500	
第337回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,836,652,000	
第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	4,639,024,800	
第339回利付国債(10年)	4,750,000,000	4,838,540,000	
第340回利付国債(10年)	5,230,000,000	5,335,384,500	
第341回利付国債(10年)	5,340,000,000	5,431,420,800	
第342回利付国債(10年)	5,130,000,000	5,175,964,800	
第343回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,695,311,600	
第344回利付国債(10年)	6,640,000,000	6,706,400,000	
第345回利付国債(10年)	3,740,000,000	3,778,372,400	
第346回利付国債(10年)	6,350,000,000	6,418,326,000	
第347回利付国債(10年)	3,880,000,000	3,923,727,600	
第348回利付国債(10年)	5,090,000,000	5,149,960,200	
第349回利付国債(10年)	4,130,000,000	4,180,716,400	
第350回利付国債(10年)	7,830,000,000	7,927,561,800	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,610,000,000	4,668,178,200	
第352回利付国債(10年)	4,510,000,000	4,567,547,600	
第353回利付国債(10年)	3,450,000,000	3,495,609,000	
第354回利付国債(10年)	5,090,000,000	5,155,813,700	
第355回利付国債(10年)	5,150,000,000	5,214,941,500	
第356回利付国債(10年)	5,040,000,000	5,101,639,200	
第357回利付国債(10年)	2,500,000,000	2,529,475,000	
第358回利付国債(10年)	3,290,000,000	3,327,209,900	
第359回利付国債(10年)	3,230,000,000	3,263,398,200	
第360回利付国債(10年)	5,260,000,000	5,308,918,000	
第361回利付国債(10年)	4,920,000,000	4,960,245,600	
第362回利付国債(10年)	3,950,000,000	3,977,610,500	
第363回利付国債(10年)	5,990,000,000	6,024,382,600	

第364回利付国債(10年)	1,810,000,000	1,817,982,100	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	134,677,400	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	192,419,200	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	143,822,400	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	138,788,100	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	60,300,000	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	431,609,500	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	221,688,000	
第8回利付国債(30年)	350,000,000	414,911,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	274,120,800	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	177,561,600	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	306,844,200	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	233,707,600	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	488,572,000	
第14回利付国債(30年)	800,000,000	1,018,312,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	438,304,200	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	258,796,000	
第17回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,478,796,500	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	440,371,800	
第19回利付国債(30年)	530,000,000	678,315,200	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	629,284,800	
第21回利付国債(30年)	500,000,000	643,615,000	
第22回利付国債(30年)	420,000,000	553,623,000	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	568,331,000	
第24回利付国債(30年)	380,000,000	503,560,800	
第25回利付国債(30年)	350,000,000	454,776,000	
第26回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,502,394,600	
第27回利付国債(30年)	1,920,000,000	2,573,030,400	
第28回利付国債(30年)	2,140,000,000	2,880,632,600	
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,230,936,300	
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,346,170,400	
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,444,443,000	
第32回利付国債(30年)	1,560,000,000	2,082,802,800	
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,338,809,200	
第34回利付国債(30年)	1,795,000,000	2,379,649,450	
第35回利付国債(30年)	2,300,000,000	2,974,245,000	
第36回利付国債(30年)	2,210,000,000	2,867,408,700	
第37回利付国債(30年)	2,240,000,000	2,873,001,600	
第38回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,900,050,000	
第39回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,444,038,400	
第40回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,828,670,400	
第41回利付国債(30年)	1,040,000,000	1,301,383,200	

第42回利付国債(30年)	1,400,000,000	1,753,640,000	
第43回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,742,921,000	
第44回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,631,708,000	
第45回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,747,324,800	
第46回利付国債(30年)	1,850,000,000	2,246,251,500	
第47回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,831,455,600	
第48回利付国債(30年)	1,780,000,000	2,123,718,000	
第49回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,718,812,800	
第50回利付国債(30年)	1,790,000,000	1,892,191,100	
第51回利付国債(30年)	1,660,000,000	1,561,595,200	
第52回利付国債(30年)	1,740,000,000	1,713,465,000	
第53回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,268,290,800	
第54回利付国債(30年)	1,910,000,000	2,009,530,100	
第55回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,514,001,600	
第56回利付国債(30年)	1,680,000,000	1,763,092,800	
第57回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,688,390,900	
第58回利付国債(30年)	2,600,000,000	2,721,420,000	
第59回利付国債(30年)	1,000,000,000	1,020,600,000	
第60回利付国債(30年)	1,530,000,000	1,634,269,500	
第61回利付国債(30年)	1,550,000,000	1,576,939,000	
第62回利付国債(30年)	120,000,000	115,819,200	
第63回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,180,733,400	
第64回利付国債(30年)	2,510,000,000	2,348,130,100	
第65回利付国債(30年)	1,590,000,000	1,484,932,800	
第66回利付国債(30年)	1,030,000,000	961,443,200	
第67回利付国債(30年)	1,530,000,000	1,504,280,700	
第68回利付国債(30年)	1,640,000,000	1,614,186,400	
第69回利付国債(30年)	1,050,000,000	1,061,550,000	
第70回利付国債(30年)	1,920,000,000	1,938,873,600	
第71回利付国債(30年)	1,430,000,000	1,444,157,000	
第72回利付国債(30年)	380,000,000	383,309,800	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	204,010,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	355,855,500	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	243,609,600	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	324,681,600	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	206,142,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	332,000,000	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	229,361,000	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	343,345,200	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	136,164,600	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	200,355,000	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	410,334,600	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	426,288,000	

第71回利付国債(20年)	200,000,000	212,098,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	670,005,000	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	383,738,400	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	213,812,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	139,692,800	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	288,314,100	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	310,645,100	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	182,367,500	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	290,619,900	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	237,597,800	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	421,878,600	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	651,366,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	316,439,300	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	510,908,800	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	317,964,700	
第86回利付国債(20年)	510,000,000	563,641,800	
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	2,014,464,000	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	466,746,000	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	387,334,500	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	700,723,800	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	502,713,000	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	979,369,600	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	456,338,200	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	682,224,000	
第95回利付国債(20年)	610,000,000	692,520,800	
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,787,175,900	
第97回利付国債(20年)	400,000,000	454,072,000	
第98回利付国債(20年)	440,000,000	496,887,600	
第99回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,463,917,800	
第100回利付国債(20年)	480,000,000	550,238,400	
第101回利付国債(20年)	715,000,000	828,763,650	
第102回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,467,988,200	
第103回利付国債(20年)	400,000,000	463,372,000	
第104回利付国債(20年)	160,000,000	183,222,400	
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,357,365,800	
第106回利付国債(20年)	380,000,000	439,739,800	
第107回利付国債(20年)	260,000,000	300,510,600	
第108回利付国債(20年)	660,000,000	753,403,200	
第109回利付国債(20年)	520,000,000	595,717,200	
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,276,429,000	
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,137,489,900	
第112回利付国債(20年)	790,000,000	920,373,700	

第113回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,363,521,200
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,736,631,600
第115回利付国債(20年)	700,000,000	827,862,000
第116回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,768,987,600
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,273,168,800
第118回利付国債(20年)	660,000,000	774,925,800
第119回利付国債(20年)	530,000,000	613,146,400
第120回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,789,234,800
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,753,215,000
第122回利付国債(20年)	940,000,000	1,090,343,600
第123回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,225,580,500
第124回利付国債(20年)	610,000,000	720,446,600
第125回利付国債(20年)	1,820,000,000	2,190,406,400
第126回利付国債(20年)	730,000,000	864,940,500
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,199,020,200
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,143,183,800
第129回利付国債(20年)	890,000,000	1,040,374,400
第130回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,505,583,100
第131回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,161,850,000
第132回利付国債(20年)	1,160,000,000	1,350,425,600
第133回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,444,266,000
第134回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,330,258,600
第135回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,201,948,200
第136回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,677,171,500
第137回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,275,016,600
第138回利付国債(20年)	620,000,000	712,206,400
第139回利付国債(20年)	730,000,000	846,237,900
第140回利付国債(20年)	2,520,000,000	2,954,649,600
第141回利付国債(20年)	1,740,000,000	2,044,691,400
第142回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,209,811,800
第143回利付国債(20年)	1,800,000,000	2,099,556,000
第144回利付国債(20年)	970,000,000	1,120,553,700
第145回利付国債(20年)	3,155,000,000	3,723,436,350
第146回利付国債(20年)	2,810,000,000	3,323,218,400
第147回利付国債(20年)	2,310,000,000	2,709,884,100
第148回利付国債(20年)	1,990,000,000	2,314,429,700
第149回利付国債(20年)	2,880,000,000	3,354,768,000
第150回利付国債(20年)	2,660,000,000	3,069,719,800
第151回利付国債(20年)	2,395,000,000	2,707,787,000
第152回利付国債(20年)	3,290,000,000	3,722,733,700
第153回利付国債(20年)	2,530,000,000	2,898,595,700
第154回利付国債(20年)	2,600,000,000	2,946,606,000
第155回利付国債(20年)	2,860,000,000	3,165,219,200

第156回利付国債(20年)	2,310,000,000	2,361,282,000	
第157回利付国債(20年)	2,980,000,000	2,956,905,000	
第158回利付国債(20年)	2,530,000,000	2,616,854,900	
第159回利付国債(20年)	2,910,000,000	3,049,359,900	
第160回利付国債(20年)	2,300,000,000	2,443,980,000	
第161回利付国債(20年)	2,190,000,000	2,293,061,400	
第162回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,119,434,000	
第163回利付国債(20年)	2,060,000,000	2,153,297,400	
第164回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,706,430,200	
第165回利付国債(20年)	2,180,000,000	2,238,336,800	
第166回利付国債(20年)	1,330,000,000	1,407,459,200	
第167回利付国債(20年)	2,340,000,000	2,396,651,400	
第168回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,458,279,500	
第169回利付国債(20年)	1,690,000,000	1,667,675,100	
第170回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,324,529,200	
第171回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,268,211,900	
第172回利付国債(20年)	2,520,000,000	2,517,832,800	
第173回利付国債(20年)	3,080,000,000	3,071,992,000	
第174回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,469,162,400	
第175回利付国債(20年)	1,560,000,000	1,579,266,000	
第176回利付国債(20年)	2,810,000,000	2,840,067,000	
第177回利付国債(20年)	2,620,000,000	2,596,393,800	
第178回利付国債(20年)	920,000,000	928,381,200	
国債証券合計	507,890,000,000	541,644,438,250	
地方債証券			
第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,309,000	
第5回東京都公募公債(東京グリーンbond(30年))	100,000,000	100,621,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	106,689,000	
第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	132,255,000	
第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	130,787,000	
第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	127,004,000	
第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	126,312,000	
第16回東京都公募公債(20年)	300,000,000	341,769,000	
第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,490,000	
第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,806,000	
第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	100,140,000	
第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	233,060,000	
第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	232,668,000	
第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	200,040,000	
第717回東京都公募公債	100,000,000	100,848,000	
第720回東京都公募公債	100,000,000	101,391,000	
第726回東京都公募公債	200,000,000	203,060,000	

第728回東京都公募公債	100,000,000	101,361,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	101,498,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	101,043,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	100,867,000	
第781回東京都公募公債	300,000,000	302,571,000	
第800回東京都公募公債	200,000,000	200,242,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,028,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,901,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,334,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,135,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	201,988,000	
第29回1号宮城県公募公債（10年）	100,000,000	101,321,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	200,000,000	270,202,000	
第11回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	115,593,000	
第15回神奈川県公募公債（20年）	200,000,000	233,036,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	116,175,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	114,290,000	
第78回神奈川県公募公債（5年）	200,000,000	200,000,000	
第201回神奈川県公募公債	200,250,000	202,853,250	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	202,774,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	101,764,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,780,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,962,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,867,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	200,160,000	
第6回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	233,028,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	233,230,000	
第10回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	116,416,000	
第371回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,830,000	
第375回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,485,000	
第377回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,416,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,543,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	153,221,210	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,970,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,954,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	156,555,360	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	199,914,000	
第439回大阪府公募公債（10年）	500,000,000	504,895,000	
第440回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,042,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	116,752,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	116,221,000	

平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	101,477,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	101,976,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	100,024,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	104,104,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	140,879,350	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	113,733,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	101,903,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	400,000,000	435,160,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	107,631,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	107,737,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	400,000,000	469,756,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,499,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	102,923,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	302,082,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	120,665,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	103,404,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	116,422,000	
第18回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	115,150,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	100,916,000	
平成26年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	101,714,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,923,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,035,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	101,138,000	
平成29年度第14回静岡県公募公債（5年）	100,000,000	100,047,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	313,189,900	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	116,943,000	
平成25年度第2回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,832,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,629,000	
平成26年度第5回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	203,334,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,579,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,301,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	202,248,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債（20年）	300,000,000	310,947,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,999,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	102,185,000	

令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	200,410,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,559,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	200,160,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	115,819,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	232,554,000	
平成25年度第4回広島県公募公債	100,000,000	101,361,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	127,613,126	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,829,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	113,400,000	
第5回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	114,697,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	230,540,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	107,322,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	234,062,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	201,568,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	233,036,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	200,206,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	101,543,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	101,913,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,390,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,236,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,925,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	100,303,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	100,270,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	113,602,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	114,207,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	106,711,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	117,899,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	107,498,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	131,217,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	112,772,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	101,892,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	102,185,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	103,839,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	302,052,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	100,425,000	

令和3年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	99,696,000	
第5回千葉県公募公債(20年)	200,000,000	230,540,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	116,424,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	116,422,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	101,495,000	
平成25年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	101,475,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,396,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	101,921,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,389,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	121,029,600	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	300,369,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	100,519,000	
令和3年度第1回長野県公募公債(10年)	300,000,000	302,238,000	
平成30年度第3回茨城県公募公債	350,000,000	350,154,000	
第1回群馬県公募公債(20年)	200,000,000	231,130,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	101,102,000	
第117回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,594,000	
第119回共同発行市場公募地方債	400,000,000	404,104,000	
第121回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,822,000	
第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,916,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,321,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,335,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,334,000	
第131回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,499,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,659,000	
第134回共同発行市場公募地方債	112,000,000	113,898,400	
第135回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,714,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,638,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,561,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,040,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,770,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,870,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	127,945,620	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,983,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,415,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,333,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,600,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,422,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	401,052,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,226,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,858,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,216,000	

第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,798,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,722,276	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,159,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,898,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,145,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	234,426,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	99,738,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	301,305,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	104,622,000	
平成25年度第8回大阪市公募公債	100,000,000	101,695,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	201,036,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	129,376,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	134,205,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	114,349,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	125,365,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,127,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	302,052,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	101,040,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	201,718,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	134,008,800	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	230,672,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	117,721,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	116,722,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	98,788,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	99,958,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	107,813,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	348,627,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,831,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	101,227,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	101,059,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	203,584,000	
第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	228,258,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	302,046,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,471,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	107,764,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,321,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	115,556,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,739,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	100,167,000	

	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,376,000	
	平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,944,000	
	平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	100,309,000	
	平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	116,349,000	
	平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	115,356,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	203,164,000	
	平成30年度第5回福岡市公募公債（5年）	200,000,000	200,088,000	
	平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	101,801,000	
	平成30年度第10回福岡市公募公債（5年）	100,000,000	100,031,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	152,283,000	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,408,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,805,350	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	172,135,200	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	552,266,000	
	令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	200,000,000	200,118,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	200,246,000	
	平成25年度第4回福井県公募公債	100,000,000	101,706,000	
	平成24年度第1回徳島県公募公債	100,000,000	100,923,000	
	平成24年度第2回岡山県公募公債（10年）	150,000,000	151,398,000	
	平成24年度第1回岡山市公募公債（10年）	200,000,000	202,054,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	202,094,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	113,474,000	
	地方債券合計	33,529,680,000	35,257,830,442	
特殊債券	第2回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	103,488,180	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	410,000,000	413,759,700	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	300,000,000	310,668,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,356,000	
	第119回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,961,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	96,363,000	
	第14回道路債券	100,000,000	102,108,000	
	第17回道路債券	100,000,000	101,697,000	
	第21回道路債券	100,000,000	128,492,000	
	第27回道路債券	400,000,000	422,612,000	
	第28回道路債券	200,000,000	260,648,000	
	第33回道路債券	200,000,000	264,540,000	

第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,660,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	150,122,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,417,000	
第42回道路債券	100,000,000	107,385,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,232,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	142,348,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	232,458,000	
第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	234,772,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,642,000	
第102回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	605,334,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	900,000,000	908,604,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,394,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	130,853,000	
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,050,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,354,000	
第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,581,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,302,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,187,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,417,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	131,903,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	224,212,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,541,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,274,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,039,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,240,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,840,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	619,608,000	

第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	302,000,000	304,455,260	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	628,000,000	634,047,640	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,934,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	150,276,240	
第202回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,408,000	
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	265,800,000	269,425,512	
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,934,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,858,000	
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	422,000,000	428,967,220	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,524,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	230,126,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	103,670,760	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,681,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,621,000	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	228,742,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,587,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,426,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,997,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,568,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	224,722,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,616,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,580,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	94,780,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,945,430	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	206,068,050	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,699,000	
	200,000,000	201,366,000	

第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,834,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	121,396,800	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,766,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,920,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	217,038,800	
第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,809,000	
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,690,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	375,678,000	
第3回公営企業債券（20年）	210,000,000	212,914,800	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	107,895,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	391,593,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	105,171,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	262,470,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	42,115,600	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	129,272,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	233,440,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	228,792,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	194,264,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	233,252,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	116,055,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	581,075,000	
第44回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,026,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,896,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,055,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,840,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,802,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,937,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,495,000	
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	106,408,050	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,972,000	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,499,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,733,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,668,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,536,000	

第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,544,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,836,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,455,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,507,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,043,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,317,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,356,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	252,701,780	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,296,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,830,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,822,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,273,800	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,620,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	158,043,600	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,412,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,573,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,778,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,014,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,910,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,586,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,848,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	107,178,000	
第22回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,958,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	116,511,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	118,948,000	
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	202,140,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,054,180	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,833,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	210,984,900	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,479,620	
第87回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,910,000	
第88回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,962,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	212,208,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	171,672,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	94,082,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	201,872,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	106,801,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	102,038,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,340,400	
第59回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,989,000	

第6 2回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	100,682,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,955,000	11,125,240	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,266,000	11,481,518	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,484,000	11,743,997	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	149,934,000	149,857,533	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	107,458,000	107,482,715	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,302,000	11,534,821	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,278,000	12,605,945	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	193,626,000	193,180,660	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	20,332,000	20,481,440	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,149,000	12,462,930	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	214,152,000	213,447,439	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	76,478,000	76,443,584	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	10,652,000	10,809,223	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,627,000	13,001,516	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	251,502,000	251,388,824	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	10,804,000	10,964,223	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	174,042,000	174,076,808	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,754,000	13,155,751	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,538,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,790,000	17,755,592	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,032,000	18,066,694	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,944,000	20,224,235	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,782,000	22,078,796	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,030,000	24,617,918	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,429,000	24,999,914	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,856,000	53,073,207	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,102,000	11,256,872	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,458,000	23,720,588	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,267,000	11,467,214	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,878,000	11,067,821	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,191,000	24,487,376	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,114,000	10,189,652	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,877,000	24,191,741	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,627,000	22,806,104	

第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,212,000	12,603,150	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,846,000	48,074,115	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,250,000	25,472,200	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,889,000	12,203,701	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,688,000	36,561,152	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,150,000	34,910,596	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,457,000	35,266,019	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,986,000	77,862,866	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,388,000	85,127,778	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,781,000	43,661,145	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,092,000	44,340,975	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,258,000	44,570,357	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,894,000	38,749,768	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,371,000	37,932,407	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,929,000	44,256,898	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	177,246,000	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	110,802,000	115,546,541	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	149,504,000	155,926,691	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,670,000	44,439,524	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,039,000	45,898,326	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,985,000	46,760,108	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,625,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,651,000	147,206,552	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,643,000	50,356,206	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	102,508,000	105,449,979	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,836,000	58,662,140	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,635,000	62,417,669	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,226,000	62,297,172	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,747,000	193,933,024	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	125,462,000	130,158,042	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,789,000	62,936,067	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,885,000	68,270,037	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,066,000	72,459,480	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,491,000	78,097,754	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,276,000	77,718,018	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,630,000	78,425,707	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,008,000	79,150,817	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,734,000	79,769,352	

第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,266,000	81,300,628	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,888,000	82,025,285	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,705,000	81,622,615	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,958,000	81,876,063	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,475,000	82,444,552	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,934,000	166,547,054	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,620,000	82,535,776	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,368,000	168,645,577	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,880,000	83,821,516	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,078,000	167,707,225	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,892,000	84,855,919	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,702,000	170,318,165	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,898,000	171,510,332	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	129,470,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,163,000	87,450,275	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,920,000	87,384,936	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,953,000	86,722,279	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,612,000	177,463,269	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,443,000	88,788,812	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,072,000	88,542,304	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,776,000	178,490,659	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,022,000	89,749,233	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	272,265,000	270,092,325	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,552,000	181,071,503	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,512,000	93,087,424	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,299,000	93,589,159	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,916,000	192,502,511	

第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,352,000	97,034,172	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,244,000	194,583,180	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,146,000	195,151,676	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,114,000	97,861,777	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,724,000	197,019,795	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,900,000	198,099,957	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,450,000	99,464,035	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,134,000	99,472,046	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	298,311,000	299,301,392	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,829,000	100,308,179	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	97,482,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,948,000	
第62回日本学生支援債券	100,000,000	99,988,000	
第64回日本学生支援債券	300,000,000	299,949,000	
第65回日本学生支援債券	200,000,000	199,962,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	107,283,000	
い第823号商工債	200,000,000	200,552,000	
い第829号商工債	200,000,000	200,472,000	
い第832号商工債	200,000,000	200,056,000	
い第833号商工債	100,000,000	100,000,000	
い第843号商工債	200,000,000	200,454,000	
い第847号商工債	100,000,000	100,123,000	
い第850号商工債	200,000,000	200,174,000	
第337回信金中金債（5年）	100,000,000	100,101,000	
第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,103,000	
第339回信金中金債（5年）	200,000,000	200,220,000	
第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,130,000	
第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,110,000	
第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,878,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	100,065,000	
第254号商工債（3年）	300,000,000	300,069,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	101,877,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	117,093,000	
第48回東日本高速道路株式会社社債	600,000,000	600,462,000	
第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,159,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,546,000	

	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	502,770,000	
	第83回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,028,000	
	第60回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,895,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,255,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,190,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	200,048,000	
	第141回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	199,978,000	
	特殊債券合計	39,119,123,000	40,727,666,151	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	100,206,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	300,000,000	299,445,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	100,146,000	
	第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	100,488,000	
	第3回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	100,107,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,116,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,162,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,966,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,083,000	
	第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	400,000,000	400,456,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,967,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,578,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,500,000	
	第15回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	200,000,000	199,550,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	300,252,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,459,000	
	第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,349,000	
	第9回明治ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,716,000	
	第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,384,000	
	第13回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,772,000	
	第10回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,665,000	
	第19回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,668,000	

第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,143,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	101,003,000	
第10回J・フロントリテリング株式会社無担保社債	100,000,000	100,344,000	
第18回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,864,000	
第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,130,000	
第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	200,000,000	200,556,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	100,017,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,414,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	100,862,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	101,019,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	200,408,000	
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	200,628,000	
第40回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,084,000	
第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,195,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,778,000	
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,712,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,283,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	202,932,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,278,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,142,000	
第42回D I C株式会社無担保社債	100,000,000	100,041,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	99,437,000	
第14回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,890,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,316,000	
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,760,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,560,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,389,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	101,127,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,130,000	
第28回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,038,000	
第34回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,633,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,956,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	108,034,000	

第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	100,122,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	100,105,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,212,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,538,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,370,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,974,000	
第20回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,967,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,238,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,790,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,689,000	
第19回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,610,000	
第29回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,491,000	
第35回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,392,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,172,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,098,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	201,180,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	199,074,000	
第12回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,890,000	
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,130,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,208,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	101,544,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	97,678,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,765,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,833,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,545,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	200,980,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,784,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,408,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債(劣後特)	100,000,000	100,109,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	117,088,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	111,578,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,895,000	
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	100,000,000	101,212,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,329,000	
第1回みずほFG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	300,000,000	303,678,000	
第3回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,321,000	
第4回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,361,000	

第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,726,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,802,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	202,500,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	99,697,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,130,000	
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,742,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,280,000	
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,196,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,255,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,883,000	
第7回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	200,000,000	199,914,000	
第16回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,921,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,284,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,016,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	103,937,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,273,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,031,000	
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,888,000	
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,408,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,136,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	202,008,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,521,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,555,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,392,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,160,000	
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,947,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	200,040,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	201,322,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	200,876,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,910,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,179,000	

第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,893,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,924,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,945,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,607,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,914,000	
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,777,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,557,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,014,000	
第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,696,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,248,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,910,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	96,398,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,598,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,238,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,348,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	231,380,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,765,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,558,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,537,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,749,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,022,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,453,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,802,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	114,423,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,775,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,288,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	500,965,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,120,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,031,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	124,323,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,701,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	107,478,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	93,807,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	93,028,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	102,326,000	

第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	193,886,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,898,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,070,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,490,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,100,000	
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	401,144,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	202,922,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	100,662,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	100,131,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,642,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,049,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,373,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,656,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	98,607,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,429,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	203,402,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,242,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,909,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,062,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,626,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,242,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,478,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,017,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,456,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	201,776,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,969,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,249,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,170,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	201,406,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	128,905,560	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,518,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,104,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,722,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	202,748,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,181,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,736,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,958,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	99,954,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	202,752,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,957,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,370,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	201,572,000	

第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,207,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,815,000	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,681,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,372,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,842,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	106,890,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,204,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,375,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,717,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	207,606,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	304,086,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,555,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	305,583,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,724,000	
第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,741,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,870,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	301,431,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	99,094,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	200,680,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	200,468,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	100,094,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,300,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	202,644,000	
社債券合計	28,926,000,000	29,302,542,560	
合計		646,932,477,403	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2021年11月10日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	90,751,396
コール・ローン	3,900,360,600
国債証券	298,087,497,691
派生商品評価勘定	38,163,082
未収入金	6,911,414
未収利息	1,660,594,976
前払費用	49,731,983
差入委託証拠金	474,669,832
流動資産合計	304,308,680,974
資産合計	304,308,680,974
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	36,300,784
前受金	37,058,196
未払金	1,455,799
未払解約金	304,547,975
未払利息	8,669
流動負債合計	379,371,423
負債合計	379,371,423
純資産の部	
元本等	
元本	97,161,984,167
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	206,767,325,384
元本等合計	303,929,309,551
純資産合計	303,929,309,551
負債純資産合計	304,308,680,974

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

	2021年11月10日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2021年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	97,161,984,167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 3.1281円 (1万口当たり純資産額) (31,281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11月10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11月10日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2.金融商品の時価等に関する事項

	2021年11月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>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。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 5月11日
期首元本額	98,661,509,279円
期中追加設定元本額	8,825,042,391円
期中一部解約元本額	10,324,567,503円
期末元本額	97,161,984,167円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,377,607,198円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	595,885,716円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	397,686,870円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,109,249,520円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,539,655円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	7,589,020,663円
世界経済インデックスファンド	11,470,686,166円
D Cマイセレクション2 5	1,898,406,082円
D Cマイセレクション5 0	1,614,831,151円
D Cマイセレクション7 5	1,118,111,315円
D C外国債券インデックス・オープン	2,250,750,402円
D CマイセレクションS 2 5	900,856,298円
D CマイセレクションS 5 0	704,388,116円
D CマイセレクションS 7 5	381,883,885円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 2 5	33,832,347円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 3 5	87,518,576円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 4 5	44,082,410円
D C世界経済インデックスファンド	11,855,298,631円
外国債券インデックス・オープン（S M A専用）	652,967,853円

区分	2021年11月10日現在
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	2,076,012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）	29,979,836円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	52,915,215円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	93,640,010円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	78,570,045円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	87,078,306円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,446,886,159円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	461,222,944円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,841,566,827円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	156,811,415円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	59,007,531円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	484,781,809円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	177,053,226円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	224,631,051円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	775,296,052円
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）	2,054,681,704円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	722,945,345円
外国債券ファンド・シリーズ1	683,707,255円
コア投資戦略ファンド（安定型）	720,536,660円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,882,347,304円
分散投資コア戦略ファンドA	259,544,875円
分散投資コア戦略ファンドS	556,972,964円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	495,274,400円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,803,633,980円
コア投資戦略ファンド（切替型）	774,547,899円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	237,196,502円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	104,075,684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）	1,318,683,072円
SMT インデックスバランス・オープン	196,879,321円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	18,278,101,623円
SMT 世界経済インデックス・オープン	210,490,096円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	245,820,538円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	403,920,377円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,850,348円
グローバル経済コア	842,117,395円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	13,656,276円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,370,879円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	230,570,686円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	29,271,580円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	5,298,310円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	4,532,402円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	2,499,126円

区分	2021年11月10日現在
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	3,388,845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)	385,326,573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)	10,653,687,339円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	334,415,052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)	334,657,084円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	253,254,245円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	27,039,892円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	22,335,375円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年11月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		2,474,981,278
合計		2,474,981,278

(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11月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	3,826,966,383	-	3,864,024,579	37,058,196
	合計	3,826,966,383	-	3,864,024,579	37,058,196

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2021年11月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	3,637,053,742	-	3,601,857,844	35,195,898
	アメリカドル	1,730,078,762	-	1,714,267,450	15,811,312
	カナダドル	155,006,052	-	153,277,423	1,728,629
	ユーロ	1,498,247,179	-	1,484,977,250	13,269,929
	イギリスポンド	253,721,749	-	249,335,721	4,386,028
	合計	3,637,053,742	-	3,601,857,844	35,195,898

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	10,000,000.00	9,919,531.30	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,669,891.42	
		T 0.125% 04/30/23	5,000,000.00	4,988,085.95	
		T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,480,957.05	
		T 0.125% 05/31/23	6,800,000.00	6,781,007.80	
		T 0.125% 07/31/23	5,000,000.00	4,980,175.80	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	8,022,218.75	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,957,343.76	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,226,513.68	
		T 0.125% 12/31/22	6,400,000.00	6,395,500.03	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,910,117.22	
		T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,147,224.58	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,913,281.30	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	7,992,031.28	
		T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,914,921.92	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	977,929.69	
		T 0.25% 07/31/25	10,000,000.00	9,766,796.90	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	7,310,449.20	

T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,502,828.11	
T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,797,812.48	
T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,966,093.75	
T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,875,312.48	
T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,948,056.25	
T 0.375% 07/31/27	9,500,000.00	9,084,375.00	
T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,962,890.65	
T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	7,625,625.04	
T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,930,273.43	
T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,903,593.76	
T 0.5% 02/28/26	11,500,000.00	11,261,015.62	
T 0.5% 03/15/23	7,770,000.00	7,796,709.37	
T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,146,389.86	
T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,838,822.66	
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,374,765.62	
T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	6,840,960.97	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,477,604.71	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	7,190,039.10	
T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	13,246,289.13	
T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,840,937.52	
T 0.625% 08/15/30	15,950,000.00	14,948,140.62	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,411,914.07	
T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	9,636,328.10	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	8,244,667.99	
T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	10,877,539.09	
T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,964,375.00	
T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	11,657,633.23	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,938,125.04	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	10,660,445.31	
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	14,690,210.93	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,944,375.04	
T 1.125% 05/15/40	6,260,000.00	5,551,837.50	
T 1.125% 08/15/40	7,300,000.00	6,457,078.12	
T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	10,086,363.33	
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	5,144,568.34	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,988,437.52	
T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	7,518,066.44	
T 1.25% 06/30/28	9,500,000.00	9,472,539.11	
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,620,649.39	
T 1.25% 08/15/31	8,580,000.00	8,430,520.35	
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	4,078,125.00	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,086,425.80	

T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	8,872,875.00	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,544,824.22	
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,073,750.00	
T 1.375% 11/15/40	13,000,000.00	11,993,515.69	
T 1.5% 01/15/23	6,200,000.00	6,295,300.75	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	6,123,281.28	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,544,809.37	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,929,187.50	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,068,984.36	
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	7,654,980.44	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,700,546.87	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,315,156.25	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,569,111.31	
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,330,474.23	
T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	11,359,933.64	
T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,020,527.34	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,897,656.25	
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,558,935.55	
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,876,125.00	
T 1.625% 11/15/22	8,080,000.00	8,200,410.90	
T 1.625% 11/15/50	11,300,000.00	10,767,664.11	
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,909,769.54	
T 1.625% 12/15/22	3,600,000.00	3,657,234.38	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,692,447.28	
T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,771,223.24	
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,470,500.00	
T 1.75% 08/15/41	2,500,000.00	2,455,468.75	
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,096,093.75	
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	7,926,539.10	
T 1.875% 02/15/51	13,600,000.00	13,733,874.99	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,389,490.62	
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,203,671.86	
T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,575,573.25	
T 1% 07/31/28	5,000,000.00	4,901,953.15	
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,287,265.62	
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,675,187.50	
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,506,781.25	
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,776,906.26	
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,993,125.02	
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	5,207,031.25	
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,771,706.25	
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,437,102.35	
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,154,531.24	

T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,465,673.85	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,902,539.10	
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,286,289.08	
T 2.25% 05/15/41	4,600,000.00	4,901,515.64	
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,060,328.12	
T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	4,526,182.05	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	6,009,609.37	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,588,914.09	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,618,248.02	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,627,218.77	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,111,390.62	
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,669,628.89	
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,793,750.00	
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,132,617.20	
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,003,000.00	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,754,882.80	
T 2.375% 05/15/27	5,840,000.00	6,222,565.61	
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	8,605,743.75	
T 2.375% 05/15/51	2,750,000.00	3,100,195.31	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	5,236,328.15	
T 2.375% 11/15/49	6,100,000.00	6,844,867.21	
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,623,303.52	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,277,539.05	
T 2.5% 02/15/45	3,210,000.00	3,597,958.60	
T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	4,510,937.52	
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,175,534.16	
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,275,867.22	
T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	5,699,792.99	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,721,602.52	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,010,239.06	
T 2.625% 02/15/29	7,490,000.00	8,166,440.62	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,443,695.31	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,691,230.50	
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,083,558.60	
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,659,550.79	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,215,578.12	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,151,289.07	
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	7,147,943.34	
T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,730,500.00	
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,027,621.89	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,871,035.17	
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,041,250.00	

T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,501,500.00	
T 2.75% 08/15/47	7,050,000.00	8,377,933.62	
T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,564,013.67	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,377,609.37	
T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,427,662.50	
T 2.75% 11/15/42	2,820,000.00	3,258,642.20	
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	3,628,785.17	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,280,468.76	
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	7,989,403.12	
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	4,895,703.12	
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	6,843,702.37	
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,091,428.91	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,858,835.96	
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	4,322,412.50	
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	2,754,609.37	
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,971,079.10	
T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,620,312.50	
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,219,115.62	
T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	8,078,320.35	
T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,113,476.55	
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,792,451.60	
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,189,062.50	
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,448,050.00	
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,427,401.56	
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,698,515.62	
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,174,750.81	
T 2% 08/15/51	4,500,000.00	4,682,460.95	
T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,180,468.80	
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,682,295.36	
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,038,789.06	
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,281,082.03	
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	2,446,406.26	
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	7,570,478.93	
T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	5,113,546.87	
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	9,423,750.00	
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,129,531.25	
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	3,852,800.00	
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	7,084,195.33	
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	980,426.56	
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,176,437.51	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,636,562.50	
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,641,875.00	
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	4,031,484.39	

	T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,938,355.47	
	T 3% 02/15/47	800,000.00	990,500.00	
	T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,548,941.42	
	T 3% 02/15/49	7,000,000.00	8,784,453.16	
	T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,942,354.69	
	T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,270,000.00	
	T 3% 05/15/47	5,710,000.00	7,087,983.62	
	T 3% 08/15/48	5,450,000.00	6,811,222.68	
	T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,535,671.89	
	T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,404,296.90	
	T 3% 11/15/44	2,800,000.00	3,399,593.76	
	T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,250,648.44	
	T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,287,429.68	
	T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,400,859.38	
	T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,691,617.19	
	T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,780,882.81	
	T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,779,257.81	
	T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,522,593.75	
	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	781,214.84	
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,432,195.32	
	T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	2,006,390.62	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,114,570.31	
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,628,945.31	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,646,835.94	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,630,062.50	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,528,031.25	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,058,593.75	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,867,158.19	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,464,750.00	
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,821,541.98	
	アメリカドル 小計	1,183,050,000.00	1,228,513,011.16 (138,649,978,439)	
カナダドル	CAN 0.25% 02/01/23	3,060,000.00	3,042,894.60	
	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,179,338.00	
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,356,968.00	
	CAN 0.25% 05/01/23	2,600,000.00	2,579,720.00	
	CAN 0.25% 08/01/23	1,360,000.00	1,345,856.00	
	CAN 0.25% 11/01/22	1,770,000.00	1,763,380.20	
	CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,411,626.40	
	CAN 0.5% 12/01/30	2,420,000.00	2,205,055.60	
	CAN 1.25% 03/01/25	1,960,000.00	1,966,370.00	
	CAN 1.25% 06/01/30	5,620,000.00	5,505,183.40	

	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,081,641.60	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,371,165.60	
	CAN 1.5% 06/01/31	3,260,000.00	3,234,115.60	
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,214,100.00	
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,667,856.40	
	CAN 1.75% 12/01/53	900,000.00	852,948.00	
	CAN 1% 06/01/27	1,730,000.00	1,693,341.30	
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,503,668.70	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,366,424.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,867,410.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,332,664.20	
	CAN 2.5% 06/01/24	300,000.00	311,091.00	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,880,000.00	2,202,081.60	
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	675,970.40	
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,356,727.70	
	CAN 2% 09/01/23	3,460,000.00	3,528,577.20	
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	4,768,404.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,300,000.00	1,694,498.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,414,465.50	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,528,031.70	
	CAN 5.75% 06/01/33	960,000.00	1,366,675.20	
	CAN 5% 06/01/37	820,000.00	1,177,470.80	
	カナダドル 小計	63,500,000.00	65,565,720.70	(5,946,810,867)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	10,559,848.50	
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	33,076,616.00	
	MBONO 5.75% 03/05/26	42,990,000.00	40,823,733.90	
	MBONO 6.75% 03/09/23	22,180,000.00	22,267,167.40	
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	39,575,750.10	
	MBONO 7.75% 05/29/31	31,580,000.00	32,676,773.40	
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	24,458,025.20	
	MBONO 7.75% 11/23/34	10,600,000.00	10,998,560.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	33,970,000.00	36,555,117.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	28,220,000.00	30,617,289.00	
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	35,321,409.00	
	MBONO 8% 11/07/47	24,630,000.00	25,500,177.90	
	MBONO 8% 12/07/23	34,870,000.00	35,645,160.10	
	メキシコペソ 小計	365,720,000.00	378,075,627.50	(2,099,416,151)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,399,057.70	
	BGB 0.2% 10/22/23	1,030,000.00	1,049,549.40	
	BGB 0.4% 06/22/40	1,140,000.00	1,128,166.80	
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,678,644.00	

BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	580,972.80
BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,820,003.20
BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,809,618.20
BGB 0.8% 06/22/28	2,160,000.00	2,325,844.80
BGB 0.9% 06/22/29	2,360,000.00	2,566,405.60
BGB 0% 10/22/27	430,000.00	440,371.60
BGB 0% 10/22/31	1,020,000.00	1,018,449.60
BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,705,305.00
BGB 1.45% 06/22/37	890,000.00	1,042,590.50
BGB 1.6% 06/22/47	1,380,000.00	1,697,524.20
BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	1,644,461.00
BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,311,954.00
BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,442,860.40
BGB 1% 06/22/31	2,480,000.00	2,734,993.60
BGB 2.15% 06/22/66	770,000.00	1,151,373.30
BGB 2.25% 06/22/23	1,010,000.00	1,060,116.20
BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	1,125,755.40
BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,329,539.80
BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	2,052,444.00
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,398,029.30
BGB 4.25% 03/28/41	1,870,000.00	3,188,761.40
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,399,669.20
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,532,520.00
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,849,382.60
BGB 5% 03/28/35	2,220,000.00	3,640,200.60
BKO 0% 03/10/23	1,210,000.00	1,222,717.10
BKO 0% 06/16/23	1,090,000.00	1,103,788.50
BKO 0% 12/15/22	4,950,000.00	4,992,372.00
BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,044,798.70
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,669,852.80
BTPS 0.3% 08/15/23	2,900,000.00	2,941,760.00
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	590,376.20
BTPS 0.5% 02/01/26	3,710,000.00	3,792,213.60
BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	2,294,067.60
BTPS 0.6% 06/15/23	1,110,000.00	1,130,967.90
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	3,103,341.20
BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	684,639.50
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,331,967.50
BTPS 0.9% 04/01/31	3,800,000.00	3,851,908.00
BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,039,400.00
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	984,555.00
BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,632,245.00
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,283,341.60

BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,476,175.80	
BTPS 0.95% 12/01/31	1,700,000.00	1,718,224.00	
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	1,007,940.00	
BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	3,022,110.00	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,062,846.50	
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	2,057,331.20	
BTPS 1.45% 03/01/36	1,700,000.00	1,772,675.00	
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,431,031.00	
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,521,560.00	
BTPS 1.5% 04/30/45	600,000.00	598,380.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,552,431.00	
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	3,033,618.50	
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,247,308.40	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,748,610.20	
BTPS 1.7% 09/01/51	1,420,000.00	1,433,206.00	
BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,373,280.00	
BTPS 1.8% 03/01/41	1,810,000.00	1,926,310.60	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,584,431.50	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,895,426.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	3,024,302.40	
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,508,736.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	736,431.30	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,533,900.80	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,840,000.00	2,112,522.40	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	3,071,772.00	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	2,145,266.30	
BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	3,072,552.60	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,257,360.50	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,197,269.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	2,731,758.90	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,020,000.00	1,225,285.20	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,202,889.50	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,575,189.50	
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,497,458.20	
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,266,855.80	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,820,866.00	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,628,346.50	
BTPS 3.35% 03/01/35	2,220,000.00	2,841,311.40	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,970,226.00	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,899,312.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,393,466.00	
BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	2,792,864.40	

BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	3,995,880.00
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,059,210.00
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,486,785.60
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,848,535.80
BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	3,982,953.00
BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,690,577.10
BTPS 4.75% 09/01/44	3,050,000.00	4,973,177.50
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	4,931,198.50
BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	4,755,810.00
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,883,786.00
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,653,067.00
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	3,465,850.80
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,290,471.60
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	4,376,740.50
BTPS 5% 09/01/40	2,880,000.00	4,629,945.60
BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,927,176.00
BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	4,369,869.00
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,899,730.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	949,384.00
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	4,064,933.30
DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,101,227.00
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,768,469.50
DBR 0.5% 02/15/25	1,350,000.00	1,404,513.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,148,500.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,710,000.00	2,891,082.20
DBR 0.5% 08/15/27	4,040,000.00	4,293,469.60
DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,696,877.80
DBR 0% 02/15/31	2,450,000.00	2,527,616.00
DBR 0% 05/15/35	2,820,000.00	2,893,940.40
DBR 0% 05/15/36	2,170,000.00	2,216,785.20
DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,480,369.50
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,622,675.00
DBR 0% 08/15/30	4,190,000.00	4,333,298.00
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	696,659.30
DBR 0% 08/15/31	3,450,000.00	3,552,465.00
DBR 0% 08/15/50	4,420,000.00	4,448,067.00
DBR 0% 08/15/52	700,000.00	699,174.00
DBR 0% 11/15/27	2,160,000.00	2,232,532.80
DBR 0% 11/15/28	900,000.00	930,690.00
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	4,844,563.40
DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,046,313.60
DBR 1.5% 05/15/23	3,020,000.00	3,126,787.20
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,421,812.40

DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,746,277.50	
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,097,860.00	
DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,894,352.00	
DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,708,993.40	
DBR 2.5% 08/15/46	3,810,000.00	6,312,484.20	
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,003,543.40	
DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	3,846,014.10	
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,857,793.50	
DBR 4.25% 07/04/39	2,310,000.00	4,178,997.90	
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,471,799.50	
DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	4,953,562.90	
DBR 4.75% 07/04/40	2,680,000.00	5,219,219.60	
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	4,421,056.40	
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	3,284,954.80	
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,724,319.20	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,954,500.00	
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,383,377.80	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,846,795.20	
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,805,885.80	
FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,321,086.00	
FRTR 0.5% 05/25/29	5,350,000.00	5,635,904.00	
FRTR 0.5% 05/25/40	2,150,000.00	2,171,865.50	
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	844,796.70	
FRTR 0.5% 06/25/44	1,530,000.00	1,519,534.80	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	6,730,237.10	
FRTR 0.75% 05/25/52	3,800,000.00	3,854,796.00	
FRTR 0.75% 05/25/53	770,000.00	774,958.80	
FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	6,272,955.00	
FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,070,172.00	
FRTR 0% 02/25/24	3,500,000.00	3,556,315.00	
FRTR 0% 02/25/26	5,210,000.00	5,325,088.90	
FRTR 0% 02/25/27	2,560,000.00	2,614,860.80	
FRTR 0% 03/25/23	5,060,000.00	5,113,028.80	
FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,049,722.00	
FRTR 0% 03/25/25	6,390,000.00	6,518,758.50	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,323,751.20	
FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	6,071,347.60	
FRTR 0% 11/25/31	3,620,000.00	3,604,723.60	
FRTR 1.25% 05/25/34	5,090,000.00	5,757,451.70	
FRTR 1.25% 05/25/36	5,930,000.00	6,746,976.10	
FRTR 1.5% 05/25/31	5,890,000.00	6,751,824.80	
FRTR 1.5% 05/25/50	3,890,000.00	4,751,362.70	

FRTR 1.75% 05/25/23	5,380,000.00	5,588,636.40
FRTR 1.75% 05/25/66	1,630,000.00	2,209,008.60
FRTR 1.75% 06/25/39	3,820,000.00	4,744,019.80
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,464,470.40
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,017,303.50
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,613,220.80
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,409,427.00
FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000.00	7,834,257.20
FRTR 2.75% 10/25/27	5,970,000.00	7,106,449.20
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	4,790,656.40
FRTR 3.25% 05/25/45	3,050,000.00	4,904,461.00
FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,495,667.00
FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,516,277.20
FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	7,980,331.20
FRTR 4.75% 04/25/35	3,130,000.00	5,034,166.80
FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	4,805,321.40
FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	4,239,979.80
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,418,656.70
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,413,883.40
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,065,693.60
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,401,980.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,135,270.00
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	957,648.90
IRISH 0.2% 10/18/30	1,030,000.00	1,048,354.60
IRISH 0.4% 05/15/35	760,000.00	769,872.40
IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	504,135.00
IRISH 0.9% 05/15/28	810,000.00	869,462.10
IRISH 0% 10/18/31	1,300,000.00	1,284,127.00
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,311,936.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	753,810.30
IRISH 1.35% 03/18/31	620,000.00	697,698.40
IRISH 1.5% 05/15/50	780,000.00	941,834.40
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	985,279.20
IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,517,113.80
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,466,447.40
IRISH 2% 02/18/45	1,150,000.00	1,521,392.50
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,064,410.10
IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,072,933.10
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,394,354.80
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,385,929.70
NETHER 0.25% 07/15/29	2,070,000.00	2,161,887.30
NETHER 0.5% 01/15/40	1,440,000.00	1,569,960.00
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,439,155.20

NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,261,540.20	
NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,747,639.80	
NETHER 0% 01/15/24	1,670,000.00	1,698,206.30	
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,888,796.80	
NETHER 0% 01/15/38	700,000.00	695,275.00	
NETHER 0% 01/15/52	1,230,000.00	1,191,378.00	
NETHER 0% 07/15/30	1,920,000.00	1,961,548.80	
NETHER 0% 07/15/31	970,000.00	986,548.20	
NETHER 1.75% 07/15/23	1,940,000.00	2,024,719.80	
NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,618,384.60	
NETHER 2.75% 01/15/47	2,430,000.00	4,093,505.10	
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,137,797.30	
NETHER 3.75% 01/15/23	1,560,000.00	1,645,441.20	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	3,949,897.50	
NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	3,522,487.60	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,377,971.50	
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	219,784.00	
OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,392,637.30	
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	3,156,973.10	
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,840,187.50	
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,245,130.40	
OBL 0% 10/09/26	2,900,000.00	2,985,202.00	
OBL 0% 10/10/25	3,500,000.00	3,592,680.00	
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,533,374.80	
OBL 0% 10/18/24	3,490,000.00	3,566,047.10	
RAGB 0.25% 10/20/36	730,000.00	733,270.40	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,770,000.00	1,868,553.60	
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	936,814.00	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,733,594.40	
RAGB 0.75% 03/20/51	680,000.00	745,830.80	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,211,664.00	
RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	339,352.20	
RAGB 0% 02/20/30	1,450,000.00	1,468,966.00	
RAGB 0% 02/20/31	880,000.00	886,556.00	
RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	948,879.00	
RAGB 0% 07/15/23	1,120,000.00	1,134,011.20	
RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,465,948.80	
RAGB 0% 10/20/40	420,000.00	396,950.40	
RAGB 1.2% 10/20/25	700,000.00	750,344.00	
RAGB 1.5% 02/20/47	1,030,000.00	1,321,593.00	
RAGB 1.5% 11/02/86	330,000.00	468,873.90	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,058,656.50	

RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,395,183.30
RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	1,455,116.40
RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,397,530.80
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,358,361.40
RAGB 3.4% 11/22/22	2,360,000.00	2,460,252.80
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	1,033,074.10
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,937,989.60
RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,699,361.70
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,640,318.00
RFGB 0.125% 04/15/36	540,000.00	539,465.40
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	435,532.60
RFGB 0.125% 09/15/31	400,000.00	407,964.00
RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	504,225.00
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	649,183.40
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	917,623.80
RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	687,050.00
RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	805,782.40
RFGB 0.75% 04/15/31	620,000.00	671,559.20
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	730,068.30
RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	547,619.40
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	428,353.80
RFGB 0% 09/15/26	700,000.00	716,548.00
RFGB 0% 09/15/30	630,000.00	639,059.40
RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	637,274.40
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	629,703.90
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	671,697.00
RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	883,230.00
RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	508,733.40
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	779,596.20
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	973,208.20
SPGB 0.1% 04/30/31	2,180,000.00	2,137,577.20
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,336,624.40
SPGB 0.35% 07/30/23	3,590,000.00	3,652,142.90
SPGB 0.45% 10/31/22	2,460,000.00	2,487,035.40
SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,976,502.00
SPGB 0.5% 10/31/31	1,710,000.00	1,730,143.80
SPGB 0.6% 10/31/29	2,950,000.00	3,061,657.50
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,566,050.40
SPGB 0.85% 07/30/37	960,000.00	969,043.20
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,312,672.40
SPGB 0% 01/31/26	1,530,000.00	1,550,043.00
SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,933,512.60
SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,403,704.80

SPGB 0% 05/31/24	1,260,000.00	1,275,132.60	
SPGB 1.2% 10/31/40	2,260,000.00	2,376,367.40	
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,324,469.50	
SPGB 1.3% 10/31/26	2,750,000.00	2,965,545.00	
SPGB 1.4% 04/30/28	2,490,000.00	2,721,196.50	
SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,616,569.00	
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,967,500.40	
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,322,841.60	
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	622,017.00	
SPGB 1.5% 04/30/27	2,650,000.00	2,895,999.50	
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,266,794.00	
SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	3,188,240.00	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,094,034.80	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,940,000.00	3,383,881.20	
SPGB 1% 10/31/50	2,470,000.00	2,381,697.50	
SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	3,094,034.80	
SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,956,914.00	
SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	2,553,499.50	
SPGB 2.75% 10/31/24	3,050,000.00	3,347,680.00	
SPGB 2.9% 10/31/46	2,050,000.00	2,900,688.50	
SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	2,865,586.40	
SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,792,815.20	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,829,838.10	
SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,961,421.00	
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,378,748.00	
SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,491,933.60	
SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,690,280.00	
SPGB 4.9% 07/30/40	2,250,000.00	3,865,500.00	
SPGB 5.15% 10/31/28	4,290,000.00	5,832,340.80	
SPGB 5.15% 10/31/44	2,260,000.00	4,236,031.00	
SPGB 5.4% 01/31/23	2,100,000.00	2,255,379.00	
SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	4,478,988.80	
SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,503,850.80	
SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,505,868.00	
ユーロ 小計	772,040,000.00	904,404,939.50 (118,323,298,234)	
イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,496,242.40
	UKT 0.125% 01/31/23	4,510,000.00	4,499,446.60
	UKT 0.125% 01/31/24	2,970,000.00	2,949,210.00
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,194,482.60
	UKT 0.25% 07/31/31	3,270,000.00	3,096,232.20
	UKT 0.375% 10/22/26	1,910,000.00	1,889,945.00

UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,341,229.00
UKT 0.5% 01/31/29	350,000.00	345,513.00
UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	1,199,983.40
UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,711,322.00
UKT 0.625% 07/31/35	2,360,000.00	2,258,331.20
UKT 0.625% 10/22/50	1,860,000.00	1,719,328.20
UKT 0.75% 07/22/23	2,360,000.00	2,375,340.00
UKT 0.875% 01/31/46	960,000.00	934,800.00
UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,725,211.00
UKT 1.125% 01/31/39	500,000.00	509,425.00
UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	986,651.00
UKT 1.25% 07/31/51	550,000.00	593,873.50
UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,922,528.00
UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,092,940.00
UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	2,661,462.60
UKT 1.5% 07/31/53	200,000.00	234,376.00
UKT 1.625% 10/22/28	1,620,000.00	1,731,682.80
UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	2,236,984.80
UKT 1.625% 10/22/71	1,120,000.00	1,552,678.40
UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,551,108.00
UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	2,805,307.70
UKT 1.75% 09/07/37	2,930,000.00	3,262,496.40
UKT 1% 04/22/24	1,600,000.00	1,623,376.00
UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,583,775.00
UKT 2.5% 07/22/65	1,920,000.00	3,132,134.40
UKT 2.75% 09/07/24	1,470,000.00	1,565,006.10
UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,883,631.60
UKT 3.25% 01/22/44	2,580,000.00	3,744,096.00
UKT 3.5% 01/22/45	2,290,000.00	3,488,082.20
UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	3,990,506.60
UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,812,080.00
UKT 4.25% 03/07/36	2,090,000.00	3,024,271.80
UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,822,337.00
UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	2,492,937.00
UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,668,043.50
UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	2,746,887.50
UKT 4.25% 12/07/46	1,920,000.00	3,314,668.80
UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	2,749,513.70
UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	3,791,732.00
UKT 4.5% 09/07/34	2,470,000.00	3,543,733.70
UKT 4.5% 12/07/42	2,340,000.00	3,909,367.80
UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,973,000.20
UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,642,788.50

	UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	3,137,703.80
	UKT 5% 03/07/25	1,800,000.00	2,069,424.00
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,714,737.50
イギリスポンド 小計		96,350,000.00	120,301,965.50 (18,402,591,662)
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	6,420,504.50
	SGB 0.75% 05/12/28	7,380,000.00	7,696,971.00
	SGB 0.75% 11/12/29	7,430,000.00	7,784,782.50
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,930,625.00
	SGB 1% 11/12/26	10,030,000.00	10,534,910.20
	SGB 2.25% 06/01/32	3,750,000.00	4,533,900.00
	SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	10,149,183.00
	SGB 3.5% 03/30/39	5,580,000.00	8,413,747.20
スウェーデンクローナ 小計		62,440,000.00	68,464,623.40 (900,994,443)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,000,000.00	2,916,720.00
	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	6,388,372.80
	NGB 1.5% 02/19/26	5,740,000.00	5,747,921.20
	NGB 1.75% 02/17/27	6,060,000.00	6,139,386.00
	NGB 1.75% 03/13/25	5,220,000.00	5,276,584.80
	NGB 1.75% 09/06/29	6,540,000.00	6,636,399.60
	NGB 2% 04/26/28	4,510,000.00	4,643,856.80
	NGB 2% 05/24/23	10,660,000.00	10,799,006.40
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	7,643,065.60
ノルウェークローネ 小計		55,570,000.00	56,191,313.20 (745,658,726)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/22	7,170,000.00	7,236,896.10
	DGB 0.25% 11/15/52	4,180,000.00	4,233,838.40
	DGB 0.5% 11/15/27	10,420,000.00	10,948,815.00
	DGB 0.5% 11/15/29	12,410,000.00	13,119,231.50
	DGB 0% 11/15/24	1,830,000.00	1,861,878.60
	DGB 0% 11/15/31	5,830,000.00	5,862,764.60
	DGB 1.5% 11/15/23	7,420,000.00	7,747,296.20
	DGB 1.75% 11/15/25	7,280,000.00	7,943,936.00
	DGB 4.5% 11/15/39	14,980,000.00	27,147,804.60
デンマーククローネ 小計		71,520,000.00	86,102,461.00 (1,514,542,288)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,200,000.00	1,942,094.00
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,321,942.80
	POLGB 0% 04/25/23	1,230,000.00	1,182,854.10
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	3,639,716.00
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,869,595.90

	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	5,858,535.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	2,890,000.00	2,869,018.60	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	5,984,492.40	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	3,720,540.60	
	POLGB 2.75% 04/25/28	5,380,000.00	5,363,537.20	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	6,185,976.60	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	4,985,417.60	
	POLGB 4% 10/25/23	3,760,000.00	3,849,450.40	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	720,456.00	
	ポーランドズロチ 小計	54,530,000.00	53,493,627.20 (1,523,530,598)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,930,000.00	2,876,381.00	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,258,521.20	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,040,000.00	1,964,785.20	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,603,520.60	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	3,129,198.60	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,760,000.00	1,506,824.00	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,010,000.00	1,999,286.70	
	ACGB 1% 11/21/31	3,250,000.00	3,030,495.00	
	ACGB 1% 12/21/30	3,310,000.00	3,117,589.70	
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,560,000.00	2,686,310.40	
	ACGB 2.25% 11/21/22	2,760,000.00	2,818,815.60	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,049,842.40	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,451,622.00	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,731,907.60	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,050,000.00	1,147,009.50	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	2,078,996.00	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,797,431.40	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,720,000.00	1,869,347.60	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,190,000.00	3,430,940.70	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,464,638.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	980,000.00	1,122,501.80	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	1,971,248.40	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,857,458.40	
ACGB 4.25% 04/21/26	1,890,000.00	2,139,309.90		
ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,444,532.60		
ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,735,442.40		
ACGB 5.5% 04/21/23	2,500,000.00	2,683,750.00		
	オーストラリアドル 小計	60,340,000.00	62,967,706.70 (5,239,542,874)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	731,985.00	
	SIGB 1.625% 07/01/31	300,000.00	297,486.00	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	811,776.00	

	SIGB 1.875% 03/01/50	680,000.00	656,757.60
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	312,832.00
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	768,919.20
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	926,214.10
	SIGB 2.375% 06/01/25	730,000.00	763,448.60
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	455,580.70
	SIGB 2.625% 05/01/28	530,000.00	564,306.90
	SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	856,580.80
	SIGB 2.75% 04/01/42	900,000.00	1,010,664.00
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,106,187.40
	SIGB 2.875% 07/01/29	950,000.00	1,031,348.50
	SIGB 2.875% 09/01/30	1,020,000.00	1,114,319.40
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	420,893.70
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	961,214.70
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	971,590.40
	SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,680,804.90
	シンガポールドル 小計	14,580,000.00	15,442,909.90 (1,293,961,420)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	790,000.00	736,374.80
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,962,009.60
	MGS 3.48% 03/15/23	2,330,000.00	2,368,887.70
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,529,237.40
	MGS 3.733% 06/15/28	2,630,000.00	2,687,754.80
	MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,113,827.40
	MGS 3.757% 05/22/40	550,000.00	522,329.50
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	954,040.50
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,659,295.30
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,063,629.50
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,539,465.00
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,165,979.20
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,032,843.00
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,495,209.60
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	621,366.00
	MGS 3.955% 09/15/25	2,380,000.00	2,467,869.60
	MGS 4.059% 09/30/24	1,780,000.00	1,848,013.80
	MGS 4.065% 06/15/50	1,560,000.00	1,515,540.00
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,329,907.20
	MGS 4.232% 06/30/31	3,000,000.00	3,120,120.00
	MGS 4.254% 05/31/35	2,030,000.00	2,078,882.40
	MGS 4.392% 04/15/26	2,910,000.00	3,072,552.60
MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	3,047,558.80	
MGS 4.642% 11/07/33	2,830,000.00	3,004,611.00	
MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,551,794.80	

	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,417,917.20	
	MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,483,180.70	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,801,346.40	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,115,047.10	
マレーシアリングット 小計		50,500,000.00	52,306,590.90 (1,422,247,590)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	700,000.00	699,563.69	
	ILGOV 0.5% 02/27/26	860,000.00	853,659.56	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,416,835.84	
	ILGOV 1.25% 11/30/22	4,960,000.00	5,021,677.10	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	2,080,941.06	
	ILGOV 1.5% 11/30/23	1,750,000.00	1,796,938.31	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,080,000.00	1,134,967.57	
	ILGOV 1% 03/31/30	2,650,000.00	2,611,609.45	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,360,000.00	2,559,945.33	
	ILGOV 2% 03/31/27	1,050,000.00	1,116,124.80	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,413,076.10	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	4,003,227.11	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,410,000.00	3,821,551.94	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	4,940,000.00	6,269,787.23	
イスラエルシェケル 小計		34,580,000.00	38,799,905.09 (1,409,600,551)	
香港・オフ ショア人民 元	CGB 1.99% 04/09/25	5,100,000.00	4,980,201.00	
	CGB 2.56% 10/21/23	8,110,000.00	8,119,002.10	
	CGB 2.68% 05/21/30	4,500,000.00	4,401,225.00	
	CGB 2.84% 04/08/24	3,100,000.00	3,121,266.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	3,750,000.00	3,758,362.50	
	CGB 3.01% 05/13/28	1,050,000.00	1,057,507.50	
	CGB 3.02% 05/27/31	500,000.00	505,350.00	
	CGB 3.03% 03/11/26	3,300,000.00	3,343,131.00	
	CGB 3.27% 11/19/30	500,000.00	513,750.00	
	CGB 3.28% 12/03/27	1,060,000.00	1,088,206.60	
	CGB 3.39% 03/16/50	920,000.00	906,614.00	
	CGB 3.72% 04/12/51	540,000.00	569,143.80	
	CGB 3.81% 09/14/50	920,000.00	979,671.20	
	CGB 3.86% 07/22/49	760,000.00	810,562.80	
CGB 4.08% 10/22/48	610,000.00	679,930.40		
香港・オフショア人民元 小計		34,720,000.00	34,833,923.90 (615,323,848)	
合計			298,087,497,691 (298,087,497,691)	

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 218銘柄	100.0%	46.5%
カナダドル	国債証券 32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 336銘柄	100.0%	39.7%
イギリスポンド	国債証券 52銘柄	100.0%	6.2%
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%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.8%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 29銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%
香港・オフショア人民元	国債証券 15銘柄	100.0%	0.2%

(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11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,259,318,766
コール・ローン	546,863,841
国債証券	76,870,033,652
未収利息	1,162,577,426
前払費用	143,506,213

	2021年11月10日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	79,982,299,898
資産合計	79,982,299,898
負債の部	
流動負債	
未払金	799,248,799
未払解約金	51,092,326
未払利息	1,215
流動負債合計	850,342,340
負債合計	850,342,340
純資産の部	
元本等	
元本	44,796,605,697
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	34,335,351,861
元本等合計	79,131,957,558
純資産合計	79,131,957,558
負債純資産合計	79,982,299,898

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2021年11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		44,796,605,697口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7665円 (17,665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11月10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11月10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	

	2021年11月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（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11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 5月11日
期首元本額	39,446,407,483円
期中追加設定元本額	6,093,915,516円
期中一部解約元本額	743,717,302円
期末元本額	44,796,605,697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	4,587,499,587円
世界経済インデックスファンド	9,910,136,787円
DC 新興国債券インデックス・オープン	5,007,535,066円
DC 世界経済インデックスファンド	9,917,225,301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）	1,798,837,446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）	76,222,253円
分散投資コア戦略ファンドA	227,137,108円
分散投資コア戦略ファンドS	487,361,674円

区分	2021年11月10日現在
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	405,351,996円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,230,586,380円
コア投資戦略ファンド（切替型）	148,300,289円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	193,825,508円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	89,771,518円
S M T インデックスバランス・オープン	165,422,913円
外国債券S M T Bセクション（S M A専用）	3,856,537,990円
S M T 世界経済インデックス・オープン	269,909,313円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	315,983,357円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	519,110,234円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	6,654,572円
グローバル経済コア	731,606,837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
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	8,467,537円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	5,423,511円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	2,531,705円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	3,013,823円
F O F s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）	79,205,033円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	326,257,124円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	35,060,113円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	4,354,318円
S M T A M海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	300,810,171円
S M T A M海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	312,177,488円
S M T A M海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	303,113,947円
S M T A M海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	301,290,551円
S M T A M海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	289,902,869円
S M T A M海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	285,373,626円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	4,625,527,918
合計	4,625,527,918

(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	31,800,000.00	39,275,226.00	
		MBONO 10% 12/05/24	100,250,000.00	108,505,587.50	
		MBONO 5.75% 03/05/26	158,800,000.00	150,798,068.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	103,700,000.00	103,944,732.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	92,600,000.00	92,963,918.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	126,500,000.00	128,664,415.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	102,100,000.00	105,645,933.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	77,000,000.00	77,853,160.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	32,600,000.00	33,825,760.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	116,900,000.00	125,796,090.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	82,000,000.00	88,965,900.00	
		MBONO 8% 09/05/24	115,400,000.00	118,250,380.00	
		MBONO 8% 11/07/47	85,100,000.00	88,106,583.00	
		MBONO 8% 12/07/23	97,950,000.00	100,127,428.50	
			メキシコペソ 小計		1,322,700,000.00
	ブラジルリアル	BLTN 0% 01/01/24	92,100,000.00	72,169,992.86	
		BLTN 0% 07/01/22	22,350,000.00	20,878,496.11	
		BLTN 0% 07/01/23	70,000,000.00	57,946,854.00	
		BLTN 0% 07/01/24	19,500,000.00	14,452,522.50	
		BNTNF 10% 01/01/23	60,400,000.00	59,098,981.57	
		BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000.00	30,398,890.72	
		BNTNF 10% 01/01/27	38,200,000.00	35,982,606.88	
		BNTNF 10% 01/01/29	23,100,000.00	21,412,407.78	
		BNTNF 10% 01/01/31	11,050,000.00	10,161,338.66	
		BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,346,625.00	
		BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,812,125.00	
			ブラジルリアル 小計		371,800,000.00
	チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	675,000,000.00	543,914,630.10	

	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,685,000,000.00	2,437,699,363.80	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,820,000,000.00	1,743,505,150.66	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,740,000,000.00	1,605,839,563.74	
	BTPCL 4% 03/01/23	840,000,000.00	827,264,564.28	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,040,000,000.00	1,836,471,156.36	
	BTPCL 5% 10/01/28	660,000,000.00	631,560,961.68	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,520,000,000.00	1,475,086,082.40	
	チリペソ 小計	11,980,000,000.00	11,101,341,473.02	(1,581,186,268)
コロンビア ペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	62,800,000,000.00	72,319,224,000.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	5,600,000,000.00	5,459,888,000.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	33,300,000,000.00	31,349,952,000.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	5,900,000,000.00	5,207,694,000.00	
	コロンビアペソ 小計	107,600,000,000.00	114,336,758,000.00	(3,332,802,158)
ペルーヌエ ボソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,500,000.00	3,851,415.00	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	6,350,000.00	5,830,697.00	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,808,484.00	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	7,400,000.00	7,651,526.00	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	6,300,000.00	6,403,383.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	7,700,000.00	8,179,941.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	6,950,000.00	7,135,634.50	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	7,700,000.00	8,343,258.00	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	6,050,000.00	6,880,786.00	
	ペルーヌエボソル 小計	56,650,000.00	58,085,124.50	(1,632,435,955)
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	24,359,750.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	12,500,000.00	12,665,000.00	
	ウルグアイペソ 小計	37,500,000.00	37,024,750.00	(95,994,069)
ドミニカペ ソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	21,582,180.00	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	33,000,000.00	38,823,840.00	
	ドミニカペソ 小計	53,400,000.00	60,406,020.00	(120,491,888)
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,950,000.00	3,410,825.00	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,650,000.00	6,264,935.50	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	11,050,000.00	8,643,641.50	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	8,650,000.00	8,323,808.50	
	TURKGB 11.7% 11/13/30	16,600,000.00	11,808,576.00	
	TURKGB 11% 02/24/27	7,400,000.00	5,569,684.00	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	9,424,206.00	
	TURKGB 12.4% 03/08/28	4,700,000.00	3,660,078.00	
	TURKGB 12.6% 10/01/25	17,400,000.00	14,775,558.00	

	TURKGB 16.2% 06/14/23	7,100,000.00	7,016,575.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	5,500,144.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	5,100,000.00	4,802,568.00	
	TURKGB 8% 03/12/25	8,300,000.00	6,267,828.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	15,600,000.00	12,773,280.00	
	トルコリラ 小計	130,600,000.00	108,241,707.50 (1,255,398,147)	
チェココ ルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	31,100,000.00	25,165,809.00	
	CZGB 0.25% 02/10/27	53,700,000.00	47,031,534.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	47,000,000.00	44,693,710.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	54,900,000.00	47,666,925.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	46,000,000.00	40,396,280.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25	53,000,000.00	50,175,100.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	22,700,000.00	18,801,048.00	
	CZGB 1.75% 06/23/32	28,000,000.00	25,844,840.00	
	CZGB 1% 06/26/26	72,800,000.00	67,045,160.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	51,900,000.00	50,868,747.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	64,800,000.00	63,777,456.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	50,300,000.00	50,266,299.00	
	CZGB 2% 10/13/33	59,700,000.00	55,722,786.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	28,000,000.00	33,386,920.00	
	CZGB 4.7% 09/12/22	35,800,000.00	36,350,604.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	37,700,000.00	40,082,640.00	
	チェココルナ 小計	737,400,000.00	697,275,858.00 (3,612,725,675)	
ハンガリー フォリ ント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	566,806,515.00	
	HGB 1.5% 08/23/23	322,500,000.00	320,213,475.00	
	HGB 1.5% 08/26/26	394,000,000.00	362,913,400.00	
	HGB 1.75% 10/26/22	275,000,000.00	274,692,000.00	
	HGB 1% 11/26/25	475,000,000.00	438,600,750.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	512,000,000.00	435,783,680.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	543,824,240.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	470,500,000.00	456,723,760.00	
	HGB 2% 05/23/29	343,000,000.00	304,896,130.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	692,000,000.00	661,275,200.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	406,291,550.00	
	HGB 3% 08/21/30	555,000,000.00	524,219,700.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	575,572,000.00	
	HGB 3% 10/27/38	380,000,000.00	325,736,000.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	716,575,200.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	471,000,000.00	506,254,350.00	
HGB 6.75% 10/22/28	382,000,000.00	455,061,320.00		

	HGB 7% 06/24/22	205,000,000.00	211,601,000.00	
ハンガリーフォリント 小計		8,290,000,000.00	8,087,040,270.00	(2,932,716,631)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	14,000,000.00	12,358,780.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	20,050,000.00	18,709,256.50	
	POLGB 1.25% 10/25/30	15,800,000.00	13,857,232.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	17,950,000.00	17,674,108.50	
	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000.00	19,895,025.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	14,250,000.00	14,146,545.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000.00	23,799,714.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	14,400,000.00	14,173,488.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	18,800,000.00	18,742,472.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	22,150,000.00	22,028,839.50	
	POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000.00	13,453,520.00	
	POLGB 4% 10/25/23	10,850,000.00	11,108,121.50	
	POLGB 5.75% 09/23/22	7,500,000.00	7,745,850.00	
	ポーランドズロチ 小計		213,000,000.00	207,692,952.00
ロシアルーブル	RFLB 4.5% 07/16/25	270,000,000.00	239,252,400.00	
	RFLB 5.7% 05/17/28	219,000,000.00	193,486,500.00	
	RFLB 6.1% 07/18/35	214,500,000.00	182,779,740.00	
	RFLB 6.5% 02/28/24	149,000,000.00	143,688,150.00	
	RFLB 6.9% 05/23/29	158,000,000.00	148,670,100.00	
	RFLB 6.9% 07/23/31	170,000,000.00	158,045,600.00	
	RFLB 6% 10/06/27	217,500,000.00	196,798,350.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	230,500,000.00	219,816,325.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	165,100,000.00	160,564,703.00	
	RFLB 7.15% 11/12/25	210,400,000.00	203,454,696.00	
	RFLB 7.25% 05/10/34	160,500,000.00	152,349,810.00	
	RFLB 7.4% 07/17/24	202,200,000.00	198,457,278.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	195,100,000.00	193,427,993.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	117,700,000.00	117,430,467.00	
	RFLB 7.65% 04/10/30	221,500,000.00	217,800,950.00	
	RFLB 7.7% 03/16/39	133,500,000.00	131,203,800.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	185,000,000.00	182,269,400.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	141,500,000.00	139,875,580.00	
	RFLB 7.95% 10/07/26	181,000,000.00	180,364,690.00	
	RFLB 7% 01/25/23	71,200,000.00	70,252,328.00	
RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	105,016,336.00		
RFLB 8.15% 02/03/27	170,000,000.00	170,804,100.00		
RFLB 8.5% 09/17/31	116,650,000.00	120,991,713.00		
ロシアルーブル 小計		4,007,050,000.00	3,826,801,009.00	(6,122,881,614)

マレーシア リングgit	MGS 2.632% 04/15/31	8,700,000.00	8,109,444.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,262,682.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	17,600,000.00	17,893,744.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	10,950,000.00	11,089,503.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	25,250,000.00	25,804,490.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	4,956,021.00	
	MGS 3.757% 05/22/40	12,650,000.00	12,013,578.50	
	MGS 3.8% 08/17/23	7,100,000.00	7,283,535.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,032,310.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	29,800,000.00	30,584,038.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	14,800,000.00	15,272,120.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,358,637.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	8,700,000.00	9,009,807.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000.00	26,959,920.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	10,900,000.00	11,316,489.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	9,250,000.00	8,986,375.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	7,600,000.00	7,896,324.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	12,950,000.00	13,261,836.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	7,350,000.00	7,794,601.50	
マレーシアリングgit 小計		235,850,000.00	239,885,455.00	(6,522,629,452)
タイバーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	90,500,000.00	90,510,860.00	
	THAIGB 0.95% 06/17/25	116,700,000.00	116,823,702.00	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	103,000,000.00	104,868,420.00	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	56,800,000.00	51,915,200.00	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	44,100,000.00	40,593,168.00	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	85,100,000.00	85,336,578.00	
	THAIGB 1.875% 06/17/22	59,300,000.00	59,783,888.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	170,600,000.00	178,824,626.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	123,000,000.00	127,452,600.00	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	20,500,000.00	20,954,690.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	83,200,000.00	90,777,024.00	
	THAIGB 2% 06/17/42	65,600,000.00	58,559,152.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	65,000,000.00	66,030,250.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	178,700,000.00	197,018,537.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	129,200,000.00	144,878,420.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	99,000,000.00	103,763,880.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	107,500,000.00	124,437,700.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	152,500,000.00	178,348,750.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	97,400,000.00	108,439,316.00	
THAIGB 4.875% 06/22/29	105,500,000.00	129,783,990.00		
タイバーツ 小計		1,953,200,000.00	2,079,100,751.00	(7,152,106,583)

フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	15,072,150.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	35,020,500.00	
フィリピンペソ 小計		45,000,000.00	50,092,650.00 (112,813,657)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	9,342,394,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	19,546,920,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	36,500,000,000.00	37,149,335,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	60,300,000,000.00	61,885,890,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	45,000,000,000.00	46,092,150,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	17,850,196,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	16,000,000,000.00	16,448,320,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	62,500,000,000.00	64,042,500,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	66,300,000,000.00	69,929,262,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	31,000,000,000.00	31,280,550,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	17,300,000,000.00	18,097,703,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	36,182,460,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	21,000,000,000.00	22,077,720,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	27,200,000,000.00	29,169,824,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	21,900,000,000.00	23,565,714,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	40,800,000,000.00	43,870,608,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	54,000,000,000.00	56,927,880,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	35,600,000,000.00	38,948,892,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	31,700,000,000.00	35,810,856,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	31,800,000,000.00	35,858,634,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	18,400,000,000.00	20,951,712,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	53,600,000,000.00	58,665,736,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000.00	59,179,640,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	24,085,744,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	29,100,000,000.00	32,966,226,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	34,700,000,000.00	40,710,040,000.00	
INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,900,590,000.00		
INDOGB 9% 03/15/29	19,700,000,000.00	23,075,792,000.00		
インドネシアルピア 小計		914,300,000,000.00	987,613,288,000.00 (7,900,906,304)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	132,100,000.00	146,394,541.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	43,600,000.00	30,943,356.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	34,100,000.00	22,867,460.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	38,900,000.00	40,078,670.00	
	SAGB 7% 02/28/31	64,700,000.00	54,705,791.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	80,700,000.00	73,026,237.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	97,700,000.00	83,867,634.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000.00	57,760,626.00	

	SAGB 8.75% 02/28/48	126,100,000.00	106,530,541.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	78,000,000.00	70,810,740.00	
	SAGB 8% 01/31/30	113,700,000.00	105,490,860.00	
	SAGB 9% 01/31/40	64,450,000.00	56,576,143.50	
	南アフリカランド 小計	942,250,000.00	849,052,599.50	(6,359,403,970)
香港・オフ ショア人民 元	CGB 1.99% 04/09/25	20,000,000.00	19,530,200.00	
	CGB 2.36% 07/02/23	18,000,000.00	17,975,340.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	26,700,765.00	
	CGB 2.69% 08/12/26	6,000,000.00	5,990,760.00	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,700,000.00	11,780,262.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	24,500,000.00	24,554,635.00	
	CGB 2.88% 11/05/23	16,900,000.00	17,023,708.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,215,740.00	
	CGB 3.01% 05/13/28	15,000,000.00	15,107,250.00	
	CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,590,950.00	
	CGB 3.02% 10/22/25	28,000,000.00	28,346,080.00	
	CGB 3.03% 03/11/26	17,500,000.00	17,728,725.00	
	CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,350,400.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	20,700,000.00	20,964,546.00	
	CGB 3.19% 04/11/24	24,100,000.00	24,483,913.00	
	CGB 3.22% 12/06/25	12,000,000.00	12,236,760.00	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,506,880.00	
	CGB 3.25% 11/22/28	14,900,000.00	15,234,952.00	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,605,000.00	
	CGB 3.28% 12/03/27	20,000,000.00	20,532,200.00	
	CGB 3.29% 05/23/29	26,000,000.00	26,699,660.00	
	CGB 3.29% 10/18/23	16,000,000.00	16,263,360.00	
	CGB 3.72% 04/12/51	7,300,000.00	7,693,981.00	
CGB 3.81% 09/14/50	22,700,000.00	24,172,322.00		
	香港・オフショア人民元 小計	444,100,000.00	450,288,389.00	(7,954,119,247)
	合計		76,870,033,652	(76,870,033,652)

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%	9.8%
ブラジルリアル	国債証券	11銘柄	100.0%	8.7%
チリペソ	国債証券	8銘柄	100.0%	2.1%
コロンビアペソ	国債証券	4銘柄	100.0%	4.3%
ペルーヌエボソル	国債証券	9銘柄	100.0%	2.1%
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%	0.2%
トルコリラ	国債証券	14銘柄	100.0%	1.6%
チェココルナ	国債証券	16銘柄	100.0%	4.7%
ハンガリーフォリント	国債証券	18銘柄	100.0%	3.8%
ポーランドズロチ	国債証券	13銘柄	100.0%	7.7%
ロシアルーブル	国債証券	23銘柄	100.0%	8.0%
マレーシアリンギット	国債証券	19銘柄	100.0%	8.5%
タイバーツ	国債証券	20銘柄	100.0%	9.3%
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	28銘柄	100.0%	10.3%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.0%	8.3%
香港・オフショア人民元	国債証券	24銘柄	100.0%	10.3%

(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

項目	2021年11月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,311,026,516
投資証券	106,812,580,450
未収入金	112,627,502
未収配当金	969,472,344
前払金	152,725,840
差入委託証拠金	183,018,000
流動資産合計	111,541,450,652
資産合計	111,541,450,652
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	152,725,840

項目	2021年11月10日現在
	金額（円）
未払金	31,183,715
未払解約金	237,164,222
未払利息	7,359
流動負債合計	421,081,136
負債合計	421,081,136
純資産の部	
元本等	
元本	50,752,359,768
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	60,368,009,748
元本等合計	111,120,369,516
純資産合計	111,120,369,516
負債純資産合計	111,541,450,652

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日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。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		2021年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		50,752,359,768口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1895円 (21,895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11月10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11月10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。	

	2021年11月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 5月11日
期首元本額	50,413,397,286円
期中追加設定元本額	5,292,793,637円
期中一部解約元本額	4,953,831,155円
期末元本額	50,752,359,768円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,657,099,646円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,840,543円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	15,835,438,347円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	23,397,493,075円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,286,420,154円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,886,625,627円
分散投資コア戦略ファンドA	720,122,850円

区分	2021年11月10日現在
分散投資コア戦略ファンドS	1,541,414,897円
コア投資戦略ファンド(切替型)	778,199,200円
SMT インデックスバランス・オープン	27,092,933円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	255,743,577円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,899,172円
グローバル経済コア	239,663,056円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	10,513,012円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	416,146,403円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	53,619,238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)	488,222,662円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	13,158,340円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	665,888,004円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	19,776,133円
J-REITパッシブ・ファンド2018-05(適格機関投資家専用)	878,687,418円
J-REITパッシブ・ファンド2018-11(適格機関投資家専用)	265,797,294円
J-REITパッシブ・ファンド2019-03(適格機関投資家専用)	302,498,187円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年11月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		14,937,275,860
合計		14,937,275,860

(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11月10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	不動産投信指数先物取引 買建	4,401,431,840	-	4,248,706,000	152,725,840
	合計	4,401,431,840	-	4,248,706,000	152,725,840

(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	1,908	268,074,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,002	367,745,000	
	S O S i L A 物流リート投資法人	3,976	677,510,400	
	東海道リート投資法人	726	78,480,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,273	2,075,082,000	
	森ヒルズリート投資法人	11,145	1,734,162,000	
	産業ファンド投資法人	13,455	2,787,876,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	9,476	3,420,836,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,473	1,400,109,900	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,051	2,298,205,000	
	G L P 投資法人	30,696	5,657,272,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,267	1,384,641,500	
	日本プロロジスリート投資法人	15,015	5,578,072,500	
	星野リゾート・リート投資法人	1,462	1,076,032,000	
	O n e リート投資法人	1,645	491,361,500	
	イオンリート投資法人	11,146	1,723,171,600	
	ヒューリックリート投資法人	8,841	1,511,811,000	
	日本リート投資法人	2,925	1,253,362,500	
	積水ハウス・リート投資法人	28,770	2,454,081,000	
	トーセイ・リート投資法人	1,980	262,548,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	3,784	1,084,494,400	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	2,021	326,189,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	2,148	255,397,200	
	野村不動産マスターファンド投資法人	30,648	5,109,021,600	
	いちごホテルリート投資法人	1,570	145,539,000	
	ラサールロジポート投資法人	11,602	2,212,501,400	
スターアジア不動産投資法人	9,794	605,269,200		
マリモ地方創生リート投資法人	888	118,015,200		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,523	2,071,524,000		
大江戸温泉リート投資法人	1,530	126,072,000		

投資法人みらい	10,804	554,245,200	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,224	310,915,200	
三菱地所物流リート投資法人	2,409	1,156,320,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	3,671	800,278,000	
ザイマックス・リート投資法人	1,376	160,579,200	
タカラレーベン不動産投資法人	3,737	412,938,500	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,695	613,370,000	
日本ビルファンド投資法人	10,741	7,647,592,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	9,478	6,454,518,000	
日本都市ファンド投資法人	47,820	4,853,730,000	
オリックス不動産投資法人	18,884	3,433,111,200	
日本プライムリアルティ投資法人	6,229	2,585,035,000	
N T T 都市開発リート投資法人	9,084	1,382,584,800	
東急リアル・エステート投資法人	6,354	1,200,906,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	6,581	780,506,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	21,336	3,040,380,000	
森トラスト総合リート投資法人	6,774	990,358,800	
インヴィンシブル投資法人	41,715	1,812,516,750	
フロンティア不動産投資法人	3,323	1,694,730,000	
平和不動産リート投資法人	6,140	970,120,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,193	2,049,883,000	
福岡リート投資法人	4,902	828,928,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	2,932	2,078,788,000	
いちごオフィスリート投資法人	7,766	669,429,200	
大和証券オフィス投資法人	2,005	1,467,660,000	
阪急阪神リート投資法人	4,281	720,492,300	
スターツプロシード投資法人	1,476	346,712,400	
大和ハウスリート投資法人	14,231	4,625,075,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	29,035	1,939,538,000	
大和証券リビング投資法人	12,806	1,448,358,600	
ジャパンエクセレント投資法人	8,794	1,228,521,800	
合計	549,536	106,812,580,450	

(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

項目	2021年11月10日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	66,834,435
コール・ローン	225,772,941
投資証券	101,604,075,350
未収入金	337,197,728
未収配当金	110,852,514
流動資産合計	102,344,732,968
資産合計	102,344,732,968
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,291
未払解約金	226,449,174
未払利息	501
流動負債合計	226,459,966
負債合計	226,459,966
純資産の部	
元本等	
元本	41,344,855,558
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	60,773,417,444
元本等合計	102,118,273,002
純資産合計	102,118,273,002
負債純資産合計	102,344,732,968

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>

2021年11月10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11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	41,344,855,558口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 2.4699円 (1万口当たり純資産額) (24,699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11月10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11月10日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年11月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2021年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 5月11日
期首元本額	41,688,637,767円
期中追加設定元本額	4,201,330,288円
期中一部解約元本額	4,545,112,497円
期末元本額	41,344,855,558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	65,498,256円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	102,813,861円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,688,304,507円
SBI資産設計オープン（分配型）	7,003,794円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,900,520,336円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	18,527,832,170円
コア投資戦略ファンド（安定型）	773,880,033円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,749,701,772円
分散投資コア戦略ファンドA	686,275,561円
分散投資コア戦略ファンドS	1,476,522,681円
コア投資戦略ファンド（切替型）	707,282,641円
SMT インデックスバランス・オープン	148,832,557円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	243,042,473円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,057,416円
グローバル経済コア	234,147,354円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	10,849,517円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	395,165,566円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	50,672,643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）	1,332,838,008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）	380,060,218円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	120,780,943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）	40,337,933円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	13,960,331円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	115,466,049円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	117,898,872円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	114,483,266円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	113,795,776円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	111,276,286円

区分	2021年11月10日現在
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	109,554,738円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年11月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		23,233,744,266
合計		23,233,744,266

(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11月10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	189,157,880	-	189,168,171	10,291
	アメリカドル	169,272,300	-	169,282,500	10,200
	イギリスポンド	19,885,580	-	19,885,671	91
合計		189,157,880	-	189,168,171	10,291

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	46,940	1,053,803.00	
		AGREE REALTY CORP	38,105	2,658,585.85	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	41,570	1,055,878.00	
		ALEXANDER'S INC	1,190	328,773.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	76,688	15,870,581.60	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	108,015.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	30,057	1,190,557.77	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	76,794	4,151,483.64	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	59,590	514,857.60	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	152,152	6,131,725.60	
		AMERICOLD REALTY TRUST	143,840	4,208,758.40	
		APARTMENT INCOME REIT CO	87,139	4,647,994.26	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	79,751	640,400.53	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	115,391	1,879,719.39	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	30,500	464,820.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	242,760.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	77,265	18,553,644.45	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	207,751.50	
		BOSTON PROPERTIES	79,135	9,299,153.85	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	156,989.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	1,306,935.20	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	164,985	4,071,829.80	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	86,966	2,265,464.30	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	101,450.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	56,019	9,128,296.05	
		CARETRUST REIT INC	52,477	1,108,839.01	
		CEDAR REALTY TRUST INC	6,800	153,952.00	
		CENTERSPACE	7,499	756,274.15	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,360	341,345.60	
		CIM COMMERCIAL TRUST CORP	13,000	106,340.00	
		CITY OFFICE REIT INC	25,050	471,942.00	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	70,810.00	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	66,258	1,268,840.70	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	12,543	594,412.77	
COREPOINT LODGING INC	22,000	342,320.00			
CORESITE REALTY CORP	24,830	3,995,147.00			
CORPORATE OFFICE PPTYS	63,159	1,784,241.75			
COUSINS PROPERTIES INC	82,626	3,293,472.36			
CTO REALTY GROWTH INC	2,800	155,092.00			
CUBESMART	111,990	6,057,539.10			
CYRUSONE INC	68,096	5,541,652.48			

DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	1,182,384.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	156,521	24,597,275.15	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	280,893	2,188,156.47	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	132,800	468,784.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	97,197	3,489,372.30	
DUKE REALTY CORP	208,984	11,838,943.60	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	40,415.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	47,668	1,030,105.48	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	22,299	4,421,222.73	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	847,683.10	
EPR PROPERTIES	41,912	2,184,872.56	
EQUINIX INC	49,977	39,871,150.83	
EQUITY COMMONWEALTH	67,845	1,757,185.50	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	94,155	7,953,272.85	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	190,281	16,299,470.46	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	68,320	2,003,142.40	
ESSEX PROPERTY TRUST	36,162	12,318,223.68	
EXTRA SPACE STORAGE INC	73,984	14,627,376.64	
FARMLAND PARTNERS INC	12,200	148,352.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	39,550	5,069,914.50	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	71,853	4,332,735.90	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	44,044	1,289,608.32	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	57,973	322,909.61	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	124,303	6,038,639.74	
GEO GROUP INC/THE	64,306	601,261.10	
GETTY REALTY CORP	21,985	719,569.05	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	456,800.50	
GLADSTONE LAND CORP	15,500	386,415.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	33,930	569,006.10	
GLOBAL NET LEASE INC	57,012	893,378.04	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	81,610	2,609,071.70	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	121,604	4,087,110.44	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	299,893	10,190,364.14	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	21,650	253,738.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	57,872	2,707,830.88	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	401,344	7,356,635.52	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	84,730	2,251,276.10	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	58,331	1,435,525.91	
INDUS REALTY TRUST INC	2,340	173,487.60	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	38,922	1,003,019.94	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	13,398	3,762,158.40	

INVITATION HOMES INC	320,490	12,989,459.70
IRON MOUNTAIN INC	160,382	7,630,975.56
JBG SMITH PROPERTIES	65,943	1,978,949.43
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	376,000.00
KILROY REALTY CORPORATION	58,949	4,220,748.40
KIMCO REALTY CORP	339,870	7,901,977.50
KITE REALTY GROUP TRUST	118,586	2,557,900.02
LEXINGTON CORP PROPERTIES	152,908	2,267,625.64
LIFE STORAGE INC	44,161	5,780,233.29
LTC PROPERTIES INC	20,624	698,741.12
MACERICH CO/THE	118,542	2,543,911.32
MACK-CALI REALTY CORP	42,236	815,154.80
MANULIFE US REAL ESTATE INV	736,564	522,960.44
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	334,846	7,132,219.80
MID-AMERICA APARTMENT COMM	64,502	13,064,880.10
MONMOUTH REIT -CL A	54,952	1,156,190.08
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	97,618	4,476,761.48
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	45,310	2,817,375.80
NATL HEALTH INVESTORS INC	25,030	1,407,436.90
NETSTREIT CORP	20,992	500,869.12
NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	927,936.10
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	757,532.60
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	135,453	3,857,701.44
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	292,280.01
PARAMOUNT GROUP INC	89,726	834,451.80
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	131,413	2,754,416.48
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,613	1,813,957.29
PENN REAL ESTATE INVEST TST	35,000	56,700.00
PHYSICIANS REALTY TRUST	118,562	2,193,397.00
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	1,281,046.64
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,900	442,338.00
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	141,190.00
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	29,639	424,430.48
PRIME US REIT	295,000	246,325.00
PROLOGIS INC	410,213	60,896,119.85
PS BUSINESS PARKS INC	11,172	1,974,204.12
PUBLIC STORAGE	84,460	27,449,500.00
REALTY INCOME CORP	307,228	21,800,898.88
REGENCY CENTERS CORP	84,860	6,254,182.00
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	69,259	1,258,436.03
RETAIL VALUE	9,529	59,270.38
	76,595	5,298,842.10

REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC			
RLJ LODGING TRUST	92,291	1,394,517.01	
RPT REALTY	43,950	610,026.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,696	2,806,228.32	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	127,744	1,866,339.84	
SAFEHOLD INC	8,340	620,412.60	
SAUL CENTERS INC	6,800	350,064.00	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	19,900	312,231.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	94,169	1,105,544.06	
SIMON PROPERTY GROUP	182,102	30,500,263.98	
SITE CENTERS CORP	99,620	1,670,627.40	
SL GREEN REALTY CORP	37,875	2,903,118.75	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	66,382	3,238,113.96	
STAG INDUSTRIAL INC	91,978	3,895,268.30	
STORE CAPITAL CORP	135,277	4,627,826.17	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	63,470	651,836.90	
SUN COMMUNITIES INC	64,445	12,486,218.75	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	124,047	1,591,523.01	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	57,370	1,157,726.60	
TERRENO REALTY CORP	38,649	2,921,477.91	
UDR INC	153,803	8,493,001.66	
UMH PROPERTIES INC	25,320	601,350.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	415,939.45	
URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	1,104,831.00	
URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	315,297.50	
VENTAS INC	218,755	11,554,639.10	
VICI PROPERTIES INC	338,799	9,906,482.76	
VORNADO REALTY TRUST	90,208	4,082,814.08	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	45,570	1,179,807.30	
WELLTOWER INC	233,908	19,973,404.12	
WHITESTONE REIT	19,090	185,173.00	
WP CAREY INC	103,444	7,941,395.88	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,030	1,224,672.90	
アメリカドル 小計	14,155,365	683,603,994.16 (77,151,546,780)	
カナダドル			
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	33,942	1,520,262.18	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	40,330	487,186.40	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	163,320.00	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,360	622,300.80	
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	83,000.00	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	45,920	2,794,232.00	

CHOICE PROPERTIES REIT	86,170	1,322,709.50	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	47,120	547,063.20	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	501,773.76	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	509,400.10	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	58,250	1,001,900.00	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	335,549.60	
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	108,506.00	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	1,097,195.40	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,705	1,884,341.70	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	81,239	1,371,314.32	
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	83,607.00	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	34,090	628,278.70	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	686,550.00	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	255,078.00	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	247,359.10	
NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT	9,000	117,810.00	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	60,470	819,368.50	
PLAZA RETAIL REIT	25,000	114,000.00	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	89,131	2,039,317.28	
SLATE GROCERY REIT	10,300	137,608.00	
SLATE OFFICE REI	17,000	88,910.00	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	41,476	1,335,941.96	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	1,090,400.00	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	192,984.00	
カナダドル 小計	1,026,375	22,187,267.50 (2,012,385,162)	
ユーロ			
AEDIFICA	19,919	2,302,636.40	
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	99,700	1,941,159.00	
ALTAREA	1,880	352,312.00	
BEFIMMO S.C.A.	14,010	498,055.50	
CARE PROPERTY INVEST	15,000	408,750.00	
CARMILA	25,000	352,500.00	
COFINIMMO	15,767	2,232,607.20	
COIMA RES SPA	11,900	87,346.00	
COVIVIO(FP)	26,753	2,021,991.74	
CROMWELL REIT EUR	160,000	411,200.00	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,783	432,390.31	
GECINA SA	30,292	3,713,799.20	

	HAMBORNER REIT AG	37,000	371,850.00
	HIBERNIA REIT PLC	365,550	469,366.20
	ICADE	18,140	1,244,404.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	137,018.45
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	143,462	1,229,469.34
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	326,700.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	260,000	426,400.00
	KLEPIERRE	107,485	2,382,942.45
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	184,620.00
	MERCIALYS	28,000	269,640.00
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	187,486	1,810,364.81
	MONTEA NV	5,300	682,640.00
	NSI NV	10,050	357,277.50
	RETAIL ESTATES	6,400	449,920.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	65,171	4,505,271.23
	VASTNED RETAIL	10,650	265,717.50
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	77,922	3,132,464.40
	WERELDHAVE NV	22,670	321,233.90
	XIOR STUDENT HOUSING NV	10,440	537,660.00
	ユーロ 小計	1,876,620	33,859,707.13 (4,429,865,483)
イギリスポ ンド	AEW UK REIT PLC	118,000	129,092.00
	ASSURA PLC	1,467,040	1,071,672.72
	BIG YELLOW GROUP PLC	97,046	1,460,542.30
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	435,000	432,390.00
	BRITISH LAND CO PLC	528,668	2,675,060.08
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	470,297	799,504.90
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	309,602.84
	CUSTODIAN REIT PLC	234,276	230,996.13
	DERWENT LONDON PLC	62,782	2,154,050.42
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	272,034.00
	GCP STUDENT LIVING PLC	258,000	543,090.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	141,780	1,063,350.00
	HAMMERSON PLC	2,291,000	775,503.50
	HOME REIT PLC	132,934	152,209.43
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	177,355	211,407.16
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	411,457	2,867,855.29
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	497,660	1,341,691.36
	LXI REIT PLC	391,008	561,487.48
	NEWRIVER REIT PL	186,000	140,802.00
PICTON PROPERTY INCOME LTD	330,000	320,760.00	

	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	728,888	1,121,758.63
	PRS REIT PLC/THE	255,000	257,550.00
	REGIONAL REIT LTD	222,000	197,580.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	116,037	1,431,896.58
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	176,050.00
	SEGR0 PLC	669,364	8,865,726.18
	SHAFTESBURY PLC	157,193	1,014,680.81
	STANDARD LIFE INV PROP INC	260,756	195,045.48
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	466,000	552,210.00
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	198,203.85
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	941,704	2,143,318.30
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	490,000	380,240.00
	UNITE GROUP PLC	220,572	2,442,834.90
	WORKSPACE GROUP PLC	70,347	577,900.60
	イギリスポンド 小計	14,539,477	37,077,366.94 (5,671,724,820)
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	232,716	830,796.12
	ARENA REIT	201,053	908,759.56
	AVENTUS GROUP	233,500	810,245.00
	BWP TRUST	262,160	1,090,585.60
	CENTURIA CAPITAL GROUP	356,300	1,190,042.00
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	301,606	1,121,974.32
	CENTURIA OFFICE REIT	240,945	566,220.75
	CHARTER HALL GROUP	259,369	4,964,322.66
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	320,312	1,553,513.20
	CHARTER HALL RETAIL REIT	296,160	1,255,718.40
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	710,062.50
	CROMWELL PROPERTY GROUP	862,633	720,298.55
	DEXUS	596,428	6,691,922.16
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	380,810.00
	GDI PROPERTY GROUP	324,500	365,062.50
	GOODMAN GROUP	939,643	22,128,592.65
	GPT GROUP	1,081,455	5,569,493.25
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	703,727.20
	HOME CONSORTIUM	107,500	856,775.00
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	268,642	397,590.16
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	82,885	290,926.35
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	156,788	1,001,875.32
	IRONGATE GROUP	272,000	432,480.00
MIRVAC GROUP	2,190,726	6,265,476.36	
NATIONAL STORAGE REIT	601,340	1,449,229.40	
RURAL FUNDS GROUP	191,095	548,442.65	
SCENTRE GROUP	2,883,991	9,026,891.83	

	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	585,060	1,696,674.00	
	STOCKLAND	1,326,376	5,995,219.52	
	VICINITY CENTERS	2,156,333	3,816,709.41	
	WAYPOINT REIT LTD	390,099	1,080,574.23	
オーストラリアドル 小計		18,190,725	84,421,010.65	(7,024,672,296)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	502,278	758,439.78	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	600,300	1,440,720.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	978,678.60	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	682,894	1,092,630.40	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	223,349	661,113.04	
ニュージーランドドル 小計		2,867,311	4,931,581.82	(396,597,809)
香港ドル	CHAMPION REIT	1,138,000	4,631,660.00	
	FORTUNE REIT	756,000	6,146,280.00	
	LINK REIT	1,163,400	80,856,300.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	2,271,040.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	2,524,500.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	818,000	2,756,660.00	
香港ドル 小計		5,188,400	99,186,440.00	(1,437,211,515)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	382,250.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	744,977	666,754.41	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,847,318	5,726,685.80	
	ASCOTT TRUST	991,877	1,091,064.70	
	CAPITALAND CHINA TRUST	507,721	604,187.99	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,805,044	6,030,844.60	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	529,844.00	
	EC WORLD REIT	180,000	146,700.00	
	ESR REIT	1,448,995	688,272.62	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	342,900.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	142,596.50	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	634,262	1,490,515.70	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,610,096	2,431,244.96	
	IREIT GLOBAL	405,985	263,890.25	
	KEPPEL DC REIT	709,903	1,668,272.05	
	KEPPEL REIT	1,051,400	1,209,110.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	555,000	499,500.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,241,473	2,644,337.49	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,088,963	2,929,310.47	

	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,580,700	3,113,979.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,222,100	1,209,879.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	560,403.36	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	225,500	1,093,675.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	252,909.00	
	SPH REIT	576,800	588,336.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	859,400	554,313.00	
	SUNTEC REIT	1,180,700	1,818,278.00	
	シンガポールドル 小計	24,807,958	38,680,053.90 (3,241,001,716)	
韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	54,685	355,452,500.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	66,167,640.00	
	JR REIT XXVII	64,338	350,642,100.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	20,000	135,000,000.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	406,612,800.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	211,099,250.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,093	152,171,210.00	
	韓国ウォン 小計	284,799	1,677,145,500.00 (160,670,538)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	103,500	2,157,975.00	
	イスラエルシェケル 小計	103,500	2,157,975.00 (78,399,231)	
	合計	83,040,530	101,604,075,350 (101,604,075,350)	

(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%	75.9%
カナダドル	投資証券 30銘柄	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券 31銘柄	100.0%	4.4%
イギリスポンド	投資証券 35銘柄	100.0%	5.6%
オーストラリアドル	投資証券 31銘柄	100.0%	6.9%
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%	1.4%

シンガポールドル	投資証券	27銘柄	100.0%	3.2%
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。

2【ファンドの現況】

【SMT 8資産インデックスバランス・オープン】

【純資産額計算書】

(2021年11月30日現在)

資産総額	104,803,101円
負債総額	32,457円
純資産総額（ - ）	104,770,644円
発行済口数	80,756,042口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2974円
（1万口当たり純資産額）	（12,974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11月30日現在)

資産総額	477,439,238,150円
負債総額	3,269,935,740円
純資産総額（ - ）	474,169,302,410円
発行済口数	252,496,810,383口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8779円
（1万口当たり純資産額）	（18,779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11月30日現在)

資産総額	525,556,748,421円
負債総額	214,064,970円
純資産総額（ - ）	525,342,683,451円
発行済口数	125,696,072,001口
1口当たり純資産額（ / ）	4.1795円
（1万口当たり純資産額）	（41,795円）

新興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11月30日現在)

資産総額	101,690,926,257円
負債総額	397,071,763円
純資産総額（ - ）	101,293,854,494円
発行済口数	28,272,655,863口
1口当たり純資産額（ / ）	3.5827円
（1万口当たり純資産額）	（35,827円）

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2021年11月30日現在)

資産総額	669,627,197,741円
負債総額	19,617,610,549円
純資産総額（ - ）	650,009,587,192円
発行済口数	460,355,876,205口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4120円
（1万口当たり純資産額）	（14,120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11月30日現在)

資産総額	304,297,876,314円
負債総額	135,517,562円
純資産総額（ - ）	304,162,358,752円
発行済口数	98,213,302,468口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0970円
（1万口当たり純資産額）	（30,970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11月30日現在）

資産総額	78,549,008,714円
負債総額	1,933,726円
純資産総額（ - ）	78,547,074,988円
発行済口数	46,011,080,981口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7071円
（1万口当たり純資産額）	（17,071円）

J - R E I Tインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2021年11月30日現在）

資産総額	109,402,781,947円
負債総額	672,685,024円
純資産総額（ - ）	108,730,096,923円
発行済口数	50,946,599,121口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1342円
（1万口当たり純資産額）	（21,342円）

グローバルR E I Tインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2021年11月30日現在）

資産総額	100,908,361,019円
負債総額	133,249,335円
純資産総額（ - ）	100,775,111,684円
発行済口数	40,851,796,101口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4668円
（1万口当たり純資産額）	（24,668円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

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、）に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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11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年間に於ける資本金の額の増減 : 2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（実行）]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

[CHECK（検証・評価）]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - D0 - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2022年 2月10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11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	15,597,102
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	74	251,989
単位型公社債投資信託	54	308,957
合計	658	16,158,048

3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35期事業年度（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。

また、第36期事業年度の中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

		(単位：百万円)	
		前事業年度 (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	301
器具備品	1	576	692
その他	1	0	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		
金		
その他有価証券評価差額	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 （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				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	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				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					

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
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・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの

軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針7.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		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 売建	投資有価証券 子会社株式				
	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いません。

[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(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売 代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

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(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,365	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

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（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

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第36期中間会計期間末

(2021年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金	18,523
金銭の信託	15,986
未収委託者報酬	9,080
未収運用受託報酬	6,066

その他		5,520
流動資産合計		55,177
固定資産		
有形固定資産	1	1,024
無形固定資産		5,276
投資その他の資産		
投資有価証券		6,629
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		208
その他		37
投資その他の資産合計		12,511
固定資産合計		18,813
資産合計		73,990
負債の部		
流動負債		
未払金		8,383
未払法人税等		474
賞与引当金		302
その他	2	1,946
流動負債合計		11,106
固定負債		
退職給付引当金		781
資産除去債務		153
その他		10
固定負債合計		945
負債合計		12,051

(単位：百万円)

第36期中間会計期間末

(2021年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		17,239
資本剰余金合計		17,239
利益剰余金		
利益準備金		500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100
繰越利益剰余金		39,182
利益剰余金合計		41,782
株主資本合計		61,022
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		995
繰延ヘッジ損益		78

評価・換算差額等合計	916
純資産合計	61,938
負債・純資産合計	73,990

中間損益計算書

(単位：百万円)

第36期中間会計期間		
(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)		
営業収益		
委託者報酬		20,978
運用受託報酬		5,746
その他営業収益		201
営業収益合計		26,925
営業費用		15,801
一般管理費	1	5,504
営業利益		5,620
営業外収益	2	971
営業外費用	3	1,067
経常利益		5,525
特別損失		120
税引前中間純利益		5,404
法人税、住民税及び事業税		1,663
法人税等調整額		19
法人税等合計		1,683
中間純利益		3,721

中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

(単位：百万円)

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

当中間期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
中間純利益			3,721	3,721	3,721
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	923	923	923
当中間期末残高	500	2,100	39,182	41,782	61,022

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	791	65	726	60,824
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,797
中間純利益				3,721
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	203	13	190	190
当中間期変動額合計	203	13	190	1,114
当中間期末残高	995	78	916	61,938

重要な会計方針

第36期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1. 資産の評価基準及び評価方法	
有価証券	
子会社株式	移動平均法による原価法によっております。
その他有価証券	
市場価格のない株式等以外のもの	時価法によっております。
	(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)
市場価格のない株式等	移動平均法による原価法によっております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法によっております。
3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法によっております。
4. 固定資産の減価償却の方法	
(1) 有形固定資産	定額法によっております。
(2) 無形固定資産	定額法によっております。
	ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法

によっております。

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. 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当中間会計期間の負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

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

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

7. 収益及び費用の計上基準

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

(1) 投資信託委託業務

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

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は子会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

9. 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。

(会計方針の変更)

第36期中間会計期間
(自 2021年4月1日
至 2021年9月30日)

1. 「収益認識に関する会計基準」の適用

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日。)等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。この変更が中間財務諸表に与える影響はありません。

2. 「時価の算定に関する会計基準」の適用

「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。この変更が中間財務諸表に与える影響はありません。

(追加情報)

第36期中間会計期間
(自 2021年4月1日
至 2021年9月30日)

退職給付債務及び費用の算定方法の変更

従来、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末の自己都合要支給額を退職給付とする方法を用いた簡便法を適用しておりましたが、対象となる従業員数の増加に伴い、当中間会計期間より原則法による計算を併用しております。これにより、退職給付引当金が120百万円増加し、同額を退職給付費用として特別損失に計上しております。

なお、退職給付見込額の各期間への帰属方法などについては、重要な会計方針 6. 引当金の計上基準(2)退職給付引当金をご参照ください。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第36期中間会計期間末
(2021年9月30日)

- | | | |
|---|--|--------|
| 1 | 有形固定資産の減価償却累計額 | 591百万円 |
| 2 | 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。 | |

(中間損益計算書関係)

第36期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	90百万円
無形固定資産	376百万円
2 営業外収益の主要項目	
金銭の信託運用益	738百万円
投資有価証券償還益	219百万円
3 営業外費用の主要項目	
デリバティブ費用	1,012百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第36期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

(金融商品関係)

第36期中間会計期間末(2021年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格のない非上場株式及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日)第26項に従い経過措置を適用した投資信託は、次表には含まれておりません。

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

区分	中間貸借対照表計上額(百万円)(*1、*2)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計

金銭の信託(*3)	1,051	1,296	-	2,347
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	242	(103)	-	138
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(79)	-	(79)
デリバティブ取引計	242	(183)	-	58

(*1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2)投資有価証券は当社が直接保有する投資信託であり、上記に含めておりません。当該投資有価証券の中間貸借対照表計上額は6,629百万円であります。

(*3)金銭の信託の信託財産のうち、投資信託は上記に含めておりません。投資信託（中間貸借対照表計上額13,639百万円）も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は15,986百万円であります。

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

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場有価証券は市場価格を用いて評価しております。当該有価証券は活発な市場で取引されているため、その時価をレベル1の時価に分類しております。また、金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

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

(注2) 市場価格のない非上場株式の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
子会社株式	5,636

(有価証券関係)

第36期中間会計期間末（2021年9月30日）

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

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

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額

貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	5,034	3,583	1,451
小計	5,034	3,583	1,451
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,595	1,611	16
小計	1,595	1,611	16
合計	6,629	5,195	1,434

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額0百万円)は、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第36期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	4,614	-	98	98
	英ポンド	260	-	1	1
	カナダドル	81	-	1	1
	スイスフラン	98	-	0	0
	香港ドル	177	-	3	3
	ユーロ	497	-	1	1
合計		5,729	-	103	103

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	19,350	-	242	242
合計		19,350	-	242	242

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		4,438	-	94
	英ポンド		3,125	-	17
	カナダドル		4	-	0
	スイスフラン		78	-	0
	香港ドル		120	-	2
	ユーロ		115	-	0
	人民元		16	-	0
	合計		7,900	-	79

（収益認識関係）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

3．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末にお

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

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

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

（関連情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,205百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド（*）	3,454百万円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第36期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）	
1株当たり純資産額	20,646,304円65銭
1株当たり中間純利益	1,240,458円75銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第36期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）
中間純利益	3,721百万円
普通株式に係る中間純利益	3,721百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業

者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2022年2月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円(2021年3月末日現在)

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

(2)販売会社

名称	資本金の額(百万円) (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。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
a uカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社三十三銀行	37,461	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

資本金の額は2021年5月1日現在です。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2021年3月末日現在）

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

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

第3【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
2021年 8月10日	有価証券届出書
2021年 8月10日	有価証券報告書

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年1月7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 後藤知弘 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SMT 8資産インデックスバランス・オープンの2021年5月11日から2021年11月10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、SMT 8資産インデックスバランス・オープンの2021年11月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 藤 澤 孝

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。