

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年5月17日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	サテライト投資戦略ファンド（株式型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

サテライト投資戦略ファンド（株式型）

愛称として「サテラップ（株式型）」という名称を用いることがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額（ ）とします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

### （５）【申込手数料】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.3%（税抜 3.0%）（ ）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「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「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。

### （６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。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「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「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）で再投資する場合は1円以上1円単位です。

(7)【申込期間】

2022年 5月18日から2022年11月17日までとします。

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

(8)【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9)【払込期日】

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとします。継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、委託会社の指定する口座を経由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」又は「受託者」ということがあります。）の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

(10)【払込取扱場所】

取得申込みを受け付けた販売会社とします。販売会社の詳細につきましては、上記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

<振替受益権について>

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

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

<受益権の取得申込みの方法>

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

「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。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、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。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、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。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 3,000億円

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。

## &lt;基本的性格&gt;

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－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  (部分 ヘッジ)  なし	日経225  T O P I X  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)  エマ－ジ ング				
不動産投信  その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、不動産投 信、その他資 産)資産配分変 更型))	その他 ( )					
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型						

(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 >

## 1. 世界の株式等の収益源泉を多面的に捉えた分散投資を行い、中期的な世界経済の成長果実を積極的に捉えます。

- 投資対象ファンドを通じて、主として相対的に高い収益が期待できる国内外の株式等\*1に分散投資を行い、積極的に世界経済の成長果実を享受することを目指します。

\*1 株式等にはリート等の株式の代替資産も含まれます。

### ●リート(不動産投資信託)

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。

## 2. 短期的な下振れリスクにも配慮した運用を目指します。

- 投資対象ファンドを通じてヘッジファンド\*2等にも投資することで、短期的な市場の下振れリスクに伴う保有資産の価値の減少を抑制し、ポートフォリオの収益の安定化を目指します。

\*2 実質的に金利、為替、株式、債券、商品等に対して裁定取引やデリバティブ取引等の様々な手法を活用してリスクを回避しながら利益を追求するファンドを指します。

## 3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへ見直します。

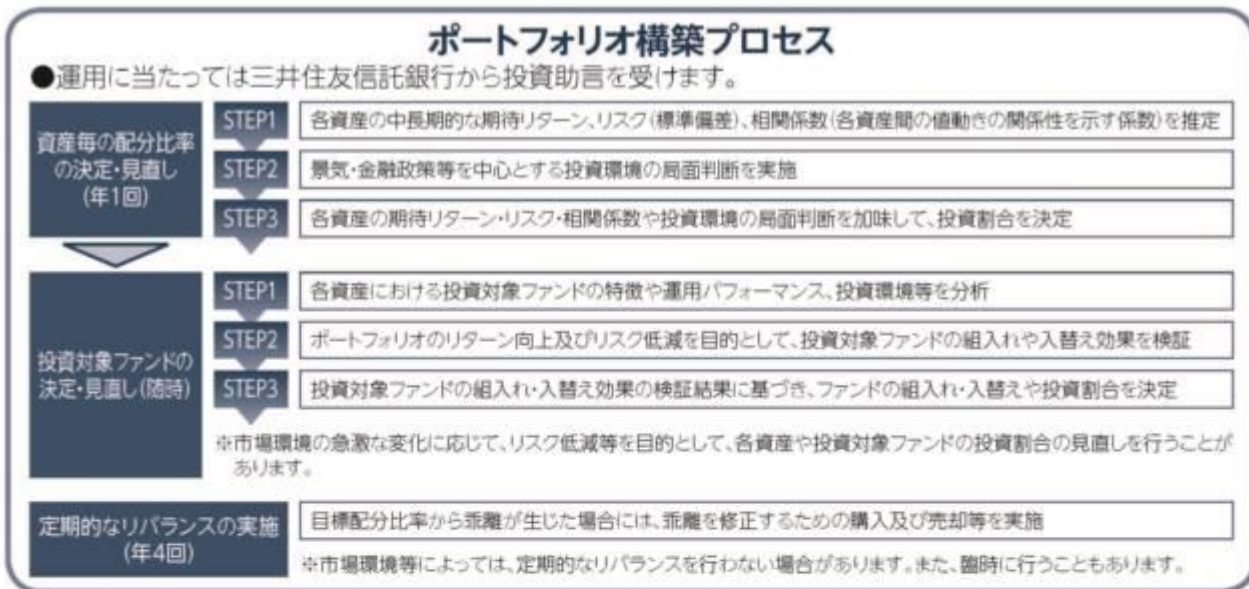
- 各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の値動きの関係(相関関係)、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性及び景気・金融政策等を中心とする投資環境の局面判断等をもとに決定します。また、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合の定期的な見直しを行うほか、市場環境等の変化に応じた調整を行います。

### 当ファンドの運用について

当ファンドは中期的に収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、投資対象とする資産及びファンドを限定していません。また、それらへの投資割合もあらかじめ定めているものではありません。運用者の判断に基づき、投資対象とする資産やファンドの追加・除外、またそれらへの投資割合の変更を行います。

### 当ファンドの投資対象ファンドの選定について

投資対象となる運用商品の見極め(デューデリジェンス)や組み入れ後のモニタリング等は、機関投資家ニーズの多様化・高度化に対応してきた三井住友信託銀行株式会社のノウハウをもとに行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。



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

#### ? ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

## 分配方針

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

## 主な投資制限

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

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】

2015年 6月16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（2022年 3月31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。なお、投資対象とするファンドは、当該ファンドの投資対象資産及び投資手法等を考慮して選定しております。

### 投資対象

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

### 投資態度

イ．主として、日本を含む先進国及び新興国の株式、株式代替資産<sup>\*1</sup>及びその他の様々な資産並びにヘッジファンドを実質的な投資対象とする投資対象ファンド<sup>\*2</sup>に分散投資します。

\*1：この投資信託において、株式代替資産とは、不動産投資信託証券（REIT）、マスター・リミテッド・パートナーシップ（MLP）、転換社債（CB）、その他上場有価証券、その他委託会社が株式と一定程度の類似性があると判断する資産等を指します。

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

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

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

ニ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

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

ヘ．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．金銭債権
- 3．約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

- 1．為替手形

## 有価証券の指図範囲

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

1. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等
2. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前号の証券の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）
4. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

## 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

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。

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

## （参考）投資対象ファンドの概要

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

以下の内容は、2022年 3月31日（（ ）のファンドに関しては2022年 4月12日）現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

なお、投資対象ファンドの運用会社より確認した情報をもとにしており、記載している定義は、当該ファンドに限定されます。

## 1. JPX日経インデックス400 マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主としてわが国の金融商品取引所等に上場されている株式に投資し、JPX日経インデックス400（配当込み）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>株式以外の資産への投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	JPX日経インデックス400（配当込み）
決算日	年1回：10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2014年1月7日
信託期間	原則として無期限



受託会社	三井住友信託銀行株式会社
------	--------------

J P X日経インデックス400（配当込み）は、東京証券取引所のプライム市場、スタンダード市場、グロース市場を主市場とする普通株式等のうち、時価総額、売買代金、ROE等を基に、株式会社J P X総研及び株式会社日本経済新聞社が選定した、原則400銘柄で構成される株価指数です。採用される400銘柄は、企業の健全性や流動性の観点から1,000銘柄に絞り込まれた上で、ROE、営業利益、時価総額の定量評価に定性評価を加味し、選定されます。起算日は2013年8月30日・基準値は10000ポイントです。「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。

「J P X日経インデックス400」は、株式会社J P X総研（以下「J P X総研」）及び株式会社日本経済新聞社（以下「日経」）によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、J P X総研及び日経は、「J P X日経インデックス400」自体及び「J P X日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

「J P X日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全てJ P X総研、株式会社日本取引所グループ及び日経に帰属しています。

当ファンドは、当社の責任のもとで運用されるものであり、J P X総研及び日経は、その運用及び当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。

J P X総研及び日経は、「J P X日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。

J P X総研及び日経は、「J P X日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「J P X日経インデックス400」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

## 2. F O F s用国内株式エンハンス運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	国内株式エンハンス運用戦略マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として、マザーファンド受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資を行ない、東証株価指数の動きを上回る投資成果を目指して運用を行ないます。</p> <p>マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</p> <p>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（ ）
決算日	年1回：2月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の利息・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。</p> <p>留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.374%（税抜 0.34%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2015年1月30日
信託期間	2015年1月30日から2025年2月17日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）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すべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

### 3. 中小型株式 マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の中小型株式を主要な投資対象とし、投資信託財産の中長期的な成長を目指して積極的な運用を行います。
主要投資対象	わが国の中小型株式を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主として、わが国の取引所上場株式（これに準ずるものを含みます）のうち、中小型株式に投資します。具体的には、以下の方針に基づいて銘柄選択を行います。市場動向、業界動向、技術動向など成長ポテンシャルの観点から投資対象候補の絞込みを行い、マネジメントに対する評価なども踏まえた上で組入銘柄を決定します。</p> <p>株式への投資比率は、原則として高位（80%以上）を保ちます。ただし、相場下落の可能性が高いと判断した場合には、キャッシュ比率の引上げおよび以下に記載する有価証券先物取引等により、実質的な株式への投資比率を引下げるよう努めます。</p> <p>株式以外の資産への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>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を行うことができるものとします。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。

決算日	年1回：6月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年9月22日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

#### 4. 国内株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している株式
投資態度	<p>原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>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者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。

同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）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すべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有しています。

JPXは、同指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は同指数に係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

JPXは、同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

JPXは、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

本件商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではありません。

JPXは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負いません。

JPXは、当社又は本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

#### 5. 国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数）（ ））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	アクティブバリュー マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券に投資を行ない、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は行ないません。 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およびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、

ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：10月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。 留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行いません。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.517%（税抜 0.47%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年9月28日
信託期間	2018年9月28日から2028年10月25日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）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すべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

#### 6. 日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	日本長期成長株集中投資マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、その組入れ比率は高位に保ちます（ただし、投資環境等により、当該受益証券の組入れ比率を引き下げる場合もあります。）。 信託財産は、マザーファンドを通じて主として日本の上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資します。マザーファンドにおいては、個別企業の分析を重視したボトム・アップ手法による銘柄選択を行い、原則として大型株式および中小型株式の中から持続的な成長が期待できると判断する比較的少数の銘柄でポートフォリオを構築し、長期的な投資元本の成長を追求します。 事業の収益性、経営陣の質に加えて株価評価基準の総合評価、目標株価からの乖離、流動性等を勘案して、銘柄選択を行います。 投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うこともあります。 ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（シンガポール）ピーティーイー・リミテッドに日本株式の運用（デリバティブ取引等に係る運用を含みます。）の指図に関する権限を委託します。 市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会規則に従い、委託者が定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以下とし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年2回：6月および12月の15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎計算期末に原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当等収益および売買損益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。</p> <p>分配金額は、基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、基準価額水準、市場動向等によっては分配を行わないこともあります。また、基準価額が当初元本を下回る場合においても分配を行うことがあります。</p> <p>収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず、元本部分と同様に運用の基本方針に基づき運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.7095%（税抜 0.645%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額
設定日	2014年6月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	みずほ信託銀行株式会社

## 7. FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）

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



主要投資対象	「日本株EVIハイアルファマザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に以下のような運用を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)（ ）をベンチマークとして、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。 <ul style="list-style-type: none"> <li>・日本の株式を主要投資対象とします。</li> <li>・運用に当たっては、独自算出に基づく企業価値や各種バリュースタシス指標（PBR、PER、配当利回り）等による割安と判断される銘柄の中から、ファンダメンタル分析により投資魅力のある銘柄に厳選投資します。</li> </ul> マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への実質投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数、配当込み）
決算日	年1回：6月6日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託者が決定します。ただし、委託者の判断により分配を行わないことがあります。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.495%（税抜 0.45%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年3月17日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数、配当込み）」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「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。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます。）に帰属します。JPXは、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXにかかる標章または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、JPXは当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

## 8. 外国株式インデックス マザーファンド

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

投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
------	--

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

#### 9. グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）

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

主要投資対象	グローバル・フランチャイズ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目指します。 有力な無形資産（特許、著作権、ブランド等）を有し、中長期的に株主価値の高い成長をもたらすことが期待される企業を厳選して投資を行います。 実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 資金状況、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合もあります。
主な投資制限	株式の実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産の実質投資割合には制限を設けません。 新株引受権証券並びに新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。 同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 同一銘柄の新株引受権証券並びに新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：4月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額は、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合には委託者の判断で分配を行わないことがあります。 収益の分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.814%（税抜0.74%） マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬は、委託者との間で別に定める取決めに基づく金額を、委託者から支払うものとします。
信託財産留保額	該当事項はありません。

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

## 10. ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）

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

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約券証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>為替予約の利用及びデリバティブの使用は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)</p>
<p>決算日</p>	<p>年1回：9月15日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<p>原則、毎決算時に分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。</p> <p>分配金は、決算日から起算して5営業日以内に支払われます。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>純資産総額に対し、年率0.671%（税抜 0.61%）</p> <p>このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の0.05%を上限）をファンドから支弁します。</p>
<p>信託財産留保額</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>設定日</p>	<p>2021年9月24日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として無期限</p>
<p>受託会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>

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

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

## 12. Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J

運用会社	Wellington Management Company LLP
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。

主要投資対象	<p>金融商品取引所等に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。</p> <p>*この投資信託においては、新興国に所在する企業のほか、新興国に資産を保有している企業、新興国で生産された商品・サービスによる収入の割合が高い企業、新興国に対する商品・サービスの販売による収入の割合が高い企業等にも投資します。</p>
投資態度	<p>MSCIエマージング・マーケット・インデックス（ ）の騰落率を上回る投資成果を追求します。</p> <p>ポートフォリオは、カンントリー・アロケーションおよび業種別アナリストの個別銘柄選択による、ファンダメンタルズ分析に基づくボトム・アップ・アプローチで構築します。</p> <p>株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。</p> <p>投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。</p> <p>運用会社が他に運用する投資信託の保有分を合算して、いずれか一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。</p> <p>流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。</p> <p>受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。</p>
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス
決算日	毎年12月31日
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	<p>年率0.8%以内</p> <p>なお、この報酬率には投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が含まれます。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年5月30日
信託期間	原則として無期限



関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 管理会社（マネージメントカンパニー） Wellington Luxembourg S.a r.l.</li> <li>・ 運用会社（インベストメントマネージャー） Wellington Management Company LLP</li> <li>・ 預託機関（デポジタリー） State Street Bank International GMBH, Luxembourg Branch</li> <li>・ 管理事務代行会社（アドミニストレーター） State Street Bank International GMBH, Luxembourg Branch</li> <li>・ 名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） State Street Bank International GMBH, Luxembourg Branch</li> </ul>
------	--

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

### 13.J-REITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券
投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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券、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。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	東証REIT指数（配当込み）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「東証REIT指数（配当込み）」とは、株式会社JPX総研が算出、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。

同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）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すべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有しています。

JPXは、同指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は同指数に係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

JPXは、同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

JPXは、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

本件商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではありません。

JPXは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負いません。

JPXは、当社又は本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

#### 14. グローバルREITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券
投資態度	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。

<p>主な投資制限</p>	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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&amp;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&amp;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。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

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

#### 15. ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 < 別に定める金現物に投資する上場投資信託証券 > （2022年 3月31日現在） iShares Gold Trust SPDR Gold Shares
投資態度	主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。 投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託者の判断により見直しを行うことがあります。 投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。 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。

<p>主な投資制限</p>	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>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。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>L B M A金価格（円ヘッジベース）（ ）（2022年 3月31日現在）</p> <p>ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。</p>
<p>決算日</p>	<p>年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>信託財産留保額</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>設定日</p>	<p>2017年10月11日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として無期限</p>
<p>受託会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>

L B M A金価格の正式名称は LBMA Gold Price PMといい、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）によってロンドン時間の午後15時に公表される1トロイオンスあたりの金現物価格（米ドル建て）を指します。なお、L B M Aは、ロンドン貴金属市場協会（London Bullion Market Association）の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。

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

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

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

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

主要投資対象	わが国を含む世界の投資適格債券を主要投資対象とし、デリバティブ取引及び為替予約取引を主要取引対象とします。 なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。
投資態度	主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。 ポートフォリオの構築は、買建（ロングポジション）だけでなく売建（ショートポジション）でも行います。また、債券投資の代替手段としてデリバティブ取引を活用することがあります。 債券の組入総額とデリバティブ取引の想定元本の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 組入外貨建資産について対円で為替ヘッジを行うことがあります。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	投資適格債券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以上とします。 投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年6月30日（休業日の場合は前営業日）
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	年率0.74% なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、管理会社・管理事務代行会社・名義書換事務受託会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2011年5月24日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・管理会社 BlueBay Funds Management Company S.A.</li> <li>・投資顧問会社 BlueBay Asset Management LLP</li> <li>・副投資顧問会社 RBC Global Asset Management (U.S.) Inc.</li> <li>・管理事務代行会社 / 名義書換事務受託会社 / 保管受託銀行 Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.</li> </ul>

#### 17. ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、ゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社の発行する円建債券（当マザーファンドの説明において、以下「円建債券」といいます。）を主要投資対象とし、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	円建債券を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主として円建債券への投資を通じて、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR - Diversified Alpha」（以下「PTRディバーシファイド・アルファ・ファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドは、世界の株式、債券、為替等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルク籍投資信託証券です。</p> <p>円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、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。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：8月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2015年12月11日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 18. F O F s 用 M A N A H L ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
------	-------------------------



運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	MAN AHL ダイバーシファイド リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてUBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます。）に投資し、AHL Partners LLPが運用する外国投資信託証券「Man AHL Diversified (Cayman) Ltd」（以下「MAN AHLファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>MAN AHLファンドは、主として世界各国の株式、債券、金利、商品、為替等の先物取引等に投資を行い、定量分析モデルを用いて市場動向を予測し、上昇局面だけでなく下落局面でも収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。なお、MAN AHLファンドは、組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、こととし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>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。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜 0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2016年1月20日
信託期間	原則として、2016年1月20日から2025年10月10日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 19. 米国株式LSマザーファンド

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

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

## 20. コモディティLSアルファ・マザーファンド

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

投資態度	<p>円建債券への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とフォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指します。</p> <p>円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、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。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年7月8日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

#### 21. ノムラF0Fs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）

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

## 投資態度

各マザーファンド受益証券を主要投資対象、株価指数先物取引を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。

各マザーファンド受益証券に投資を行うとともに、株価指数先物取引を活用します。株価指数先物取引の活用にあたっては、実質的に投資する株式に対する株式市場全体の変動の影響を抑えることを目指し、株価指数先物取引の売建てを行います。各マザーファンド受益証券への投資割合および株価指数先物取引の売建ての枚数は、市場環境や各マザーファンドの特性等を考慮し、適宜調整を行うことを基本とします。

各マザーファンド受益証券の合計組入比率は、原則として信託財産の純資産総額の70%～90%程度を維持することを基本とします。ただし、株価指数先物取引を行うにあたって必要となる証拠金の額等によっては、上記の範囲とならない場合があります。

非株式割合（株式以外の資産への実質投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

<日本成長株投資マザーファンドの投資態度>

わが国の株式の中から、個別企業の調査・分析等に基づいたボトムアップアプローチにより、企業の経営戦略や財務戦略などを通じて長期的な株主資本成長や利益成長が期待できる銘柄を選定します。

ポートフォリオの構築にあたっては、株主資本や利益等の成長率の高さ及びその継続性等に関する評価に基づき組入銘柄を決定し、バリュエーション評価（株価の割高・割安の度合い）等を勘案して組入比率を決定します。

株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。

非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

<野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンドの投資態度>

株式への投資にあたっては、財務リスク・流動性等を考慮し、投資候補銘柄を選定した上で定量モデルにより最適化を行い、ポートフォリオのボラティリティを最小化することを目指します。

ポートフォリオの最適化にあたっては、業種配分、投資銘柄数、個別銘柄への投資比率、取引コスト等を勘案します。

株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：12月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.506%（税抜 0.46%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額
設定日	2019年4月10日
信託期間	無期限
受託会社	野村信託銀行株式会社

## 22. ウェスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）（ ）

運用会社	フランクリン・templton・ジャパン株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主に「LM・ウェスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に日本の公社債に投資を行うとともに、為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング・ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。
主要投資対象	<p>「LM・ウェスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。</p> <p>&lt;マザーファンドの投資対象&gt;</p> <p>主に日本の公社債を主要投資対象とし、為替予約取引等を積極的に活用します。</p>

投資態度	<p>L M・ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。</p> <p>L M・ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>&lt;マザーファンドの投資態度&gt;</p> <p>主に、日本の公社債に投資するとともに、主要先進国通貨を中心とした為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング・ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。</p> <p>モデルによる定量分析とポートフォリオマネージャーによる定性分析を組み合わせた独自のアプローチにより、ポートフォリオを構築します。</p> <p>リスク管理を運用プロセスに組み込み、ポジション・リスクの分散化を図ります。</p> <p>資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>運用の指図に関する権限を投資顧問会社であるウエスタン・アセット・マネジメント株式会社及びウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド（在英国）に委託します。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：11月16日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	<p>純資産総額に対し、年率0.418%（税抜 0.38%）</p> <p>このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の0.05%を上限）をファンドから支弁します。</p> <p>投資顧問会社の報酬は、委託者が收受する委託者報酬から支弁されます。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年4月12日
信託期間	原則として無期限



受託会社	三井住友信託銀行株式会社
------	--------------

## 23.MA Hedge Fund Strategies Limited

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

関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 運用会社 UBS O'Connor LLC</li> <li>・ 保管銀行・管理事務代行会社 MUFG Alternative Fund Services (Ireland) Limited</li> </ul>
------	---

## 24. 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

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

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

### （3）【運用体制】

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



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

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

#### (4) 【分配方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

### イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

### ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

### ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

### ニ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

### ホ．公社債の借入れの指図及び範囲

（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。

### ヘ．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。

### ト．外国為替予約取引の指図

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

### チ．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。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

（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。

### リ．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、

原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### < その他の投資制限 >

イ．当ファンドでは直接デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引及び選択権付債券売買を含みます。）は行いませんが、投資対象とする投資信託でデリバティブ取引等を行う場合、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

##### 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。

##### 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。

##### 商品（コモディティ）の価格変動リスク

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

##### 為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。なお、投資対象ファンドにおいて、外貨建資産について、為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図る場合がありますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の金利差相当分のコストがかかりますが、さらに需給要因等によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があることにご留意ください。

##### 信用リスク

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

券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

#### 流動性リスク

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

#### カントリーリスク

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

#### 資産等の選定・配分に係るリスク

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

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

#### ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

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

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

#### 仕組み債券に係るリスク

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

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

なお、仕組み債券の発行体は少数であることが多いため、信用リスクが顕在化した場合には、投資対象ファンドは多数の発行体に分散投資を行う投資信託と比較して、大きな影響を被る可能性があります。また、発行体の財務状況や信用力の他、市場や経済環境の変動等により、仕組み債券が発行されない場合には、投資対象ファンドが償還となる可能性があります。

#### ブローカーの信用リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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性が生じた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



\*2017年4月～2022年3月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

### 各資産クラスの指数について

<b>日本株</b> TOPIX (東証株価指数、配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての可能性を有するマーケット/ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。[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。同指数の指数値及び同指数に係る権限又は登録は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という)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すべての権利/ノウハウ及び同指数に係る権限又は登録に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
<b>先進国株</b> 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中止する権利を有しています。
<b>新興国株</b> MSCI Emerging Markets インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI Emerging Markets 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中止する権利を有しています。
<b>日本債債</b> NOMURA-BPI債債	NOMURA-BPI債債とは、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金利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動/サービスに関し一切責任を負いません。
<b>先進国債</b> 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、本ファンドの権限、販売あるいは販売促進を行っていません。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、遅延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。
<b>新興国債</b> J.P. Morgan Global Emerging Markets インデックス (除く日本、円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

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

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

「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>

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

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

## （3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率1.628%（税抜1.48%）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 1.023% （税抜 0.93%）	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 0.55% （税抜 0.5%）	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、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

## （参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

各投資対象ファンドの信託報酬（投資信託財産の純資産総額に対する年率）は下記の通りです。

当該信託報酬は、投資対象とする投資信託証券に係る信託財産の運用、基準価額の計算、運用財産の管理等の対価として、投資対象ファンドから支払われます。

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
JPX日経インデックス400 マザーファンド	ありません。
F O F s用国内株式エンハンス運用戦略ファンド （適格機関投資家専用）	年率 0.374%（税抜 0.34%）
中小型株式 マザーファンド	ありません。
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.517%（税抜 0.47%）
日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.7095%（税抜 0.645%）
F O F s用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.495%（税抜 0.45%）
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.814%（税抜 0.74%）
ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.671%（税抜 0.61%）
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	年率 0.525%
Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	年率 0.8%以内
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバルREITインデックス マザーファンド	ありません。
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	年率 0.74%
ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	ありません。
F O F s用M A N A H L ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.066%（税抜 0.06%）
米国株式LSマザーファンド	ありません。
コモディティLSアルファ・マザーファンド	ありません。
ノムラF O F s用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.506%（税抜 0.46%）
ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.418%（税抜 0.38%）

MA Hedge Fund Strategies Limited	運用報酬：年率 0.6% 成功報酬：15% 月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	ありません。

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

実質的な信託報酬率：年率1.628%～1.95965%程度（税抜 1.48%～1.8013%程度）  
 （投資対象とする投資信託証券：年率0.0%～0.33165%程度（税抜0.0%～0.3213%程度））

#### （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（投資対象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（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。）。

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用（ ）は、受益者の負担とし、日々投資信託財産で負担します（投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。）。

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

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用は、仕組み債券の発行・管理にあたり発行者等に支払う手数料、仕組み債券の連動対象となるファンド及びファンドが組み入れるヘッジファンド等の運用者に支払う運用報酬（成功報酬を含みます。）等

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬の中から支払うものとし、その額は、ファンドの純資産総額に年率0.495%（税抜0.45%）を乗じて得たものとし、

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示

しておりません。

（ご参考）

《 仕組み債券の費用にかかる記載 》

・ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

主要投資対象である円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
- ・円建債券の連動対象となるPTRダイバーシファイド・アルファ・ファンドにおいては、運用報酬（PTRダイバーシファイド・アルファ・ファンドの純資産総額に対して年率1.0%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.24%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
- ・円建債券の連動対象となるMAN AHLファンドにおいては、固定報酬（運用報酬として1.35%（MAN AHLファンドの純資産総額に対する年率。以下同じ。）、加えてサービスマネジャー費用として0.25%、ブローカレッジ費用として1.00%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかりません。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・米国株式LSマザーファンド

主要投資対象である米ドル建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・米ドル建債券の評価額に対して年率0.38%が発行・管理手数料等としてかかります。加えて保管費用として年率0.02%、その他管理費用等がかかります。
- ・マーケット・ニュートラル戦略による運用額に対する運用報酬として年率2.00%、純資産価値算出費用として年率0.03%、有価証券の売買費用、借株費用、その他管理費用等がかかります。
- ・米ドル建MMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

（5）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

	税 率（内 訳）
2037年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）

2038年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）
-------------	-------------------

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されま  
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ます。）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所  
得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条  
件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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、2022年3月31日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、2022年3月31日現在の状況について記載してあります。

### 【サテライト投資戦略ファンド（株式型）】

#### （1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	2,399,617,700	24.37
	ルクセンブルク	273,672,591	2.78
	小計	2,673,290,291	27.15
投資証券	ルクセンブルク	291,775,113	2.96
	ケイマン	145,183,187	1.47
	小計	436,958,300	4.44
親投資信託受益証券	日本	6,554,426,095	66.57
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		180,845,089	1.84
合計(純資産総額)		9,845,519,775	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	外国株式インデックス マザーファンド	398,523,389	4.1238	1,643,430,752	4.4470	1,772,233,510	18.00
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	515,918,123	1.8840	971,989,744	1.9205	990,820,755	10.06
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	531,503,932	1.3053	693,818,495	1.3431	713,862,931	7.25
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	214,485,652	2.4406	523,473,682	2.7464	589,063,394	5.98
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリュウファンド(適格機関投資家専用)	473,714,535	1.1953	566,230,983	1.2167	576,368,474	5.85

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	260,548,498	2.0539	535,140,560	2.1659	564,321,991	5.73
日本	投資信託受益証券	ノムラFOfs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	538,453,621	0.9304	500,977,248	0.9302	500,869,558	5.09
日本	親投資信託受益証券	ビクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	441,623,608	1.0595	467,900,212	1.0429	460,569,260	4.68
日本	親投資信託受益証券	J P X日経インデックス400 マザーファンド	209,829,343	1.7816	373,831,958	1.8175	381,364,830	3.87
日本	親投資信託受益証券	コモディティLSアルファ・マザーファンド	337,740,708	1.1400	385,041,853	1.1152	376,648,437	3.83
日本	親投資信託受益証券	米国株式LSマザーファンド	302,946,176	1.0112	306,356,479	1.0646	322,516,498	3.28
日本	投資信託受益証券	ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	275,401,757	1.0632	292,807,148	1.0966	302,005,566	3.07
日本	投資信託受益証券	グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)	177,644,299	1.5839	281,370,805	1.6687	296,435,041	3.01
ルクセンブルク	投資証券	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	176,940.639	1,582	279,920,090	1,649	291,775,113	2.96
日本	投資信託受益証券	FOFs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	178,048,704	1.5862	282,420,854	1.6319	290,557,680	2.95
日本	投資信託受益証券	日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	128,011,956	2.1915	280,538,201	2.2343	286,017,113	2.91
ルクセンブルク	投資信託受益証券	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	22,959.11	12,706	291,718,451	11,920	273,672,591	2.78
日本	親投資信託受益証券	中小型株式 マザーファンド	53,149,377	4.7542	252,682,768	5.0037	265,943,537	2.70
日本	投資信託受益証券	FOfs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	118,938,070	1.1394	135,518,036	1.239	147,364,268	1.50
ケイマン	投資証券	MA Hedge Fund Strategies Limited	13,984	10,382.16	145,184,220	10,382.09	145,183,187	1.47
日本	親投資信託受益証券	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	147,960,259	0.7924	117,243,709	0.7913	117,080,952	1.19

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	27.15
投資証券	4.44
親投資信託受益証券	66.57
合計	98.16

(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	(2016年 2月17日)	37,286,279,341	37,286,279,341	8,647	8,647
第2期計算期間末	(2017年 2月17日)	30,621,118,809	30,621,118,809	9,555	9,555
第3期計算期間末	(2018年 2月19日)	18,433,690,243	18,433,690,243	10,131	10,131
第4期計算期間末	(2019年 2月18日)	18,337,969,638	18,337,969,638	9,864	9,864
第5期計算期間末	(2020年 2月17日)	13,138,863,682	13,138,863,682	10,917	10,917
第6期計算期間末	(2021年 2月17日)	11,518,211,025	11,518,211,025	11,845	11,845
第7期計算期間末	(2022年 2月17日)	9,679,176,610	9,679,176,610	12,563	12,563
	2021年 3月末日	11,073,876,513		12,012	
	4月末日	10,974,132,500		12,168	
	5月末日	10,891,451,714		12,321	
	6月末日	10,730,050,238		12,429	
	7月末日	10,533,296,863		12,424	
	8月末日	10,540,106,135		12,584	
	9月末日	10,282,121,565		12,572	
	10月末日	10,406,548,145		12,876	
	11月末日	10,093,352,612		12,716	
	12月末日	10,206,953,658		13,043	
	2022年 1月末日	9,569,268,611		12,348	
	2月末日	9,430,155,962		12,324	
	3月末日	9,845,519,775		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	2015年 6月16日～2016年 2月17日	0
第2期計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	0
第3期計算期間	2017年 2月18日～2018年 2月19日	0
第4期計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0
第5期計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月17日	0
第6期計算期間	2020年 2月18日～2021年 2月17日	0
第7期計算期間	2021年 2月18日～2022年 2月17日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
--	-----	--------

第1期計算期間	2015年 6月16日～2016年 2月17日	13.5
第2期計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	10.5
第3期計算期間	2017年 2月18日～2018年 2月19日	6.0
第4期計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	2.6
第5期計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月17日	10.7
第6期計算期間	2020年 2月18日～2021年 2月17日	8.5
第7期計算期間	2021年 2月18日～2022年 2月17日	6.1

(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	2015年 6月16日～2016年 2月17日	49,526,375,760	6,407,778,915	43,118,596,845
第2期計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	11,056,157,024	22,127,791,489	32,046,962,380
第3期計算期間	2017年 2月18日～2018年 2月19日	8,740,142,510	22,591,145,594	18,195,959,296
第4期計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	7,015,265,506	6,619,741,116	18,591,483,686
第5期計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月17日	1,220,521,390	7,776,843,668	12,035,161,408
第6期計算期間	2020年 2月18日～2021年 2月17日	167,978,519	2,478,672,606	9,724,467,321
第7期計算期間	2021年 2月18日～2022年 2月17日	97,944,390	2,117,977,175	7,704,434,536

(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)

J P X日経インデックス400 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	13,743,677,240	97.21
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		394,720,237	2.79
合計(純資産総額)		14,138,397,477	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		393,344,000	2.78
----------	----	----	--	-------------	------

(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	東京エレクトロン	電気機器	4,500	51,570.47	232,067,115	63,250.00	284,625,000	2.01
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	19,100	12,863.31	245,689,221	12,730.00	243,143,000	1.72
日本	株式	三菱商事	卸売業	52,700	3,604.08	189,935,138	4,601.00	242,472,700	1.71
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	315,900	663.12	209,479,684	760.30	240,178,770	1.70
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	106,500	2,037.85	217,032,076	2,222.50	236,696,250	1.67
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	63,900	3,141.62	200,749,772	3,545.00	226,525,500	1.60
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	40,700	7,203.00	293,162,234	5,414.00	220,349,800	1.56
日本	株式	KDDI	情報・通信業	51,000	3,654.28	186,368,280	4,005.00	204,255,000	1.44
日本	株式	ダイキン工業	機械	9,100	25,666.40	233,564,240	22,410.00	203,931,000	1.44
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	49,200	3,339.54	164,305,608	4,144.00	203,884,800	1.44
日本	株式	日立製作所	電気機器	32,500	6,814.74	221,479,050	6,165.00	200,362,500	1.42
日本	株式	任天堂	その他製品	3,200	50,892.47	162,855,909	61,670.00	197,344,000	1.40
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	56,200	3,474.66	195,276,321	3,487.00	195,969,400	1.39
日本	株式	HOYA	精密機器	13,900	17,417.52	242,103,528	14,030.00	195,017,000	1.38
日本	株式	キーエンス	電気機器	3,400	68,363.20	232,434,880	57,250.00	194,650,000	1.38
日本	株式	信越化学工業	化学	10,300	19,493.36	200,781,608	18,790.00	193,537,000	1.37
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	8,100	18,057.17	146,263,100	23,510.00	190,431,000	1.35
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	48,700	3,916.37	190,727,348	3,907.00	190,270,900	1.35
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	52,500	3,241.66	170,187,656	3,498.00	183,645,000	1.30
日本	株式	三井物産	卸売業	54,600	2,599.00	141,905,905	3,328.00	181,708,800	1.29
日本	株式	村田製作所	電気機器	21,000	8,644.29	181,530,261	8,117.00	170,457,000	1.21
日本	株式	日本電産	電気機器	17,300	12,587.67	217,766,691	9,748.00	168,640,400	1.19
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	23,200	6,124.72	142,093,684	7,128.00	165,369,600	1.17
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	27,500	4,781.86	131,501,202	5,813.00	159,857,500	1.13
日本	株式	第一三共	医薬品	56,100	2,759.96	154,833,820	2,680.00	150,348,000	1.06
日本	株式	S M C	機械	2,100	66,851.45	140,388,045	68,840.00	144,564,000	1.02
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	90,000	1,559.83	140,385,052	1,567.00	141,030,000	1.00
日本	株式	ファナック	電気機器	6,300	24,769.28	156,046,464	21,645.00	136,363,500	0.96

日本	株式	デンソー	輸送用機器	15,700	7,928.90	124,483,730	7,860.00	123,402,000	0.87
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	61,900	1,944.57	120,369,158	1,911.00	118,290,900	0.84

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### 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	0.04
		鉱業	0.38
		建設業	2.33
		食料品	3.56
		繊維製品	0.35
		パルプ・紙	0.20
		化学	7.04
		医薬品	6.18
		石油・石炭製品	0.58
		ゴム製品	0.84
		ガラス・土石製品	0.72
		非鉄金属	0.76
		金属製品	0.30
		機械	5.80
		電気機器	17.37
		輸送用機器	6.36
		精密機器	2.99
		その他製品	2.08
		電気・ガス業	1.18
		陸運業	1.62
		海運業	0.70
		倉庫・運輸関連業	0.03
		情報・通信業	7.36
		卸売業	7.02
		小売業	3.68
		銀行業	5.31
		証券、商品先物取引業	0.90
保険業	2.88		
その他金融業	1.35		
不動産業	2.26		
サービス業	5.05		
		小計	97.21
合計			97.21

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	J P X日経インデックス400先物	買建	224	円	379,895,404	393,344,000	2.78

(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。

## 中小型株式 マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	28,501,916,000	95.50
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,344,087,358	4.50
合計(純資産総額)		29,846,003,358	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	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	富士電機	電気機器	156,000	5,229.56	815,812,037	6,160.00	960,960,000	3.22
日本	株式	MARUWA	ガラス・土石製品	56,000	10,940.32	612,657,920	16,340.00	915,040,000	3.07
日本	株式	イビデン	電気機器	140,000	5,992.58	838,962,018	6,050.00	847,000,000	2.84
日本	株式	KADOKAWA	情報・通信業	250,000	2,376.74	594,187,104	3,220.00	805,000,000	2.70
日本	株式	ダイセキ	サービス業	160,000	4,114.35	658,296,000	4,620.00	739,200,000	2.48
日本	株式	エスプール	サービス業	590,000	996.00	587,640,000	1,247.00	735,730,000	2.47
日本	株式	デクセリアルズ	化学	210,000	3,420.73	718,353,511	3,345.00	702,450,000	2.35

日本	株式	インターネットイニシア ティブ	情報・通 信業	170,000	3,491.34	593,528,367	4,105.00	697,850,000	2.34
日本	株式	東宝	情報・通 信業	140,000	4,807.54	673,056,357	4,635.00	648,900,000	2.17
日本	株式	ネクソン	情報・通 信業	220,000	2,355.46	518,201,219	2,932.00	645,040,000	2.16
日本	株式	物語コーポレーション	小売業	105,000	7,070.58	742,411,375	5,820.00	611,100,000	2.05
日本	株式	シュッピン	小売業	450,000	1,118.20	503,190,753	1,318.00	593,100,000	1.99
日本	株式	ジャパンマテリアル	サービ ス業	335,000	1,343.01	449,908,801	1,740.00	582,900,000	1.95
日本	株式	J TOWER	情報・通 信業	80,000	4,886.40	390,912,627	7,240.00	579,200,000	1.94
日本	株式	トリケミカル研究所	化学	200,000	3,339.49	667,899,462	2,866.00	573,200,000	1.92
日本	株式	アズワン	卸売業	75,000	6,981.67	523,625,961	7,240.00	543,000,000	1.82
日本	株式	サイバーエージェント	サービ ス業	340,000	2,230.43	758,347,316	1,526.00	518,840,000	1.74
日本	株式	インソース	サービ ス業	220,000	2,369.26	521,237,200	2,334.00	513,480,000	1.72
日本	株式	日本製鋼所	機械	130,000	3,986.37	518,228,845	3,820.00	496,600,000	1.66
日本	株式	ニフコ	化学	170,000	4,074.20	692,614,000	2,790.00	474,300,000	1.59
日本	株式	セーレン	繊維製 品	210,000	2,179.72	457,741,200	2,224.00	467,040,000	1.56
日本	株式	K Hネオケム	化学	165,000	2,535.75	418,398,750	2,761.00	455,565,000	1.53
日本	株式	インターアクション	精密機 器	210,000	2,482.35	521,294,945	2,165.00	454,650,000	1.52
日本	株式	神戸物産	卸売業	120,000	3,854.74	462,569,756	3,775.00	453,000,000	1.52
日本	株式	オイシックス・ラ・大地	小売業	145,000	3,806.12	551,888,014	3,015.00	437,175,000	1.46
日本	株式	日本セラミック	電気機 器	178,000	2,897.29	515,717,620	2,445.00	435,210,000	1.46
日本	株式	イー・ギャランティ	その他 金融 業	210,000	2,326.18	488,499,678	2,051.00	430,710,000	1.44
日本	株式	S H O E I	その他 製 品	92,000	4,098.20	377,034,400	4,585.00	421,820,000	1.41
日本	株式	寿スピリッツ	食料品	63,000	7,310.00	460,530,000	6,520.00	410,760,000	1.38
日本	株式	エス・エム・エス	サービ ス業	120,000	4,314.09	517,690,846	3,395.00	407,400,000	1.37

(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	建設業	0.83
		食料品	1.38
		繊維製品	1.56
		化学	9.92
		医薬品	0.76
		ガラス・土石製品	3.07
		金属製品	2.22
		機械	4.00
		電気機器	9.89
		精密機器	2.21
		その他製品	3.16

	倉庫・運輸関連業	0.99
	情報・通信業	17.65
	卸売業	3.34
	小売業	9.08
	証券、商品先物取引業	1.63
	保険業	0.96
	その他金融業	1.44
	不動産業	1.86
	サービス業	19.54
	小計	95.50
合計		95.50

(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

該当事項はありません。

#### 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	484,011,706,440	98.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,095,985,904	1.65
合計(純資産総額)		492,107,692,344	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	7,980,650,000	1.62

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

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

## 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	9,221,200	1,841.36	16,979,613,595	2,222.50	20,494,117,000	4.16
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,140,400	10,917.37	12,450,169,870	12,730.00	14,517,292,000	2.95
日本	株式	キーエンス	電気機器	165,000	54,575.10	9,004,893,048	57,250.00	9,446,250,000	1.92
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,260,500	622.31	7,007,609,821	760.30	8,561,358,150	1.74
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	115,500	49,433.29	5,709,546,054	63,250.00	7,305,375,000	1.48
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,342,000	5,725.59	7,683,751,000	5,414.00	7,265,588,000	1.48
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,868,900	2,948.65	5,510,748,812	3,545.00	6,625,250,500	1.35
日本	株式	任天堂	その他製品	102,800	66,822.09	6,869,311,106	61,670.00	6,339,676,000	1.29
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,343,600	3,138.47	4,216,849,835	4,601.00	6,181,903,600	1.26
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,071,200	8,076.02	8,651,036,200	5,559.00	5,954,800,800	1.21
日本	株式	信越化学工業	化学	306,100	18,836.60	5,765,885,751	18,790.00	5,751,619,000	1.17
日本	株式	日立製作所	電気機器	875,600	5,782.34	5,063,019,200	6,165.00	5,398,074,000	1.10
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,302,400	3,703.46	4,823,386,369	4,005.00	5,216,112,000	1.06
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,254,100	3,270.21	4,101,173,332	4,144.00	5,196,990,400	1.06
日本	株式	ダイキン工業	機械	231,900	21,766.68	5,047,694,205	22,410.00	5,196,879,000	1.06
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,430,900	3,694.10	5,285,891,056	3,498.00	5,005,288,200	1.02
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,433,300	3,355.99	4,810,149,677	3,487.00	4,997,917,100	1.02
日本	株式	HOYA	精密機器	355,200	14,485.50	5,145,251,055	14,030.00	4,983,456,000	1.01
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,242,900	3,945.09	4,903,357,112	3,907.00	4,856,010,300	0.99
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	205,600	16,645.52	3,422,319,208	23,510.00	4,833,656,000	0.98
日本	株式	三井物産	卸売業	1,392,400	2,439.66	3,396,986,358	3,328.00	4,633,907,200	0.94
日本	株式	日本電産	電気機器	471,900	12,473.00	5,886,013,150	9,748.00	4,600,081,200	0.93
日本	株式	村田製作所	電気機器	534,900	8,299.06	4,439,171,602	8,117.00	4,341,783,300	0.88
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	591,300	5,250.44	3,104,586,322	7,128.00	4,214,786,400	0.86
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	701,500	4,768.63	3,345,195,259	5,813.00	4,077,819,500	0.83
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,705,800	1,465.11	3,964,305,686	1,428.00	3,863,882,400	0.79
日本	株式	第一三共	医薬品	1,430,600	2,537.20	3,629,729,672	2,680.00	3,834,008,000	0.78
日本	株式	S M C	機械	53,300	65,820.66	3,508,241,624	68,840.00	3,669,172,000	0.75
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,296,300	1,661.73	3,815,830,696	1,567.00	3,598,302,100	0.73
日本	株式	ファナック	電気機器	159,800	26,077.36	4,167,163,396	21,645.00	3,458,871,000	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	0.31
		建設業	2.17
		食料品	3.19
		繊維製品	0.43
		パルプ・紙	0.20
		化学	6.34
		医薬品	4.84
		石油・石炭製品	0.44
		ゴム製品	0.65
		ガラス・土石製品	0.72
		鉄鋼	0.83
		非鉄金属	0.80
		金属製品	0.56
		機械	5.26
		電気機器	17.78
		輸送用機器	8.23
		精密機器	2.48
		その他製品	2.39
		電気・ガス業	1.11
		陸運業	3.03
		海運業	0.63
		空運業	0.41
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	8.11
		卸売業	6.00
		小売業	4.16
		銀行業	5.21
		証券、商品先物取引業	0.75
		保険業	2.20
		その他金融業	1.12
		不動産業	1.93
		サービス業	5.80
	小計	98.35	
合計		98.35	

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	410円		7,843,142,400	7,980,650,000	1.62

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

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

## 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	371,234,821,033	67.04
	イギリス	22,540,194,409	4.07
	カナダ	20,734,990,114	3.74
	スイス	17,717,731,961	3.20
	フランス	16,160,039,794	2.92
	ドイツ	12,844,618,963	2.32
	オーストラリア	11,434,843,941	2.07
	オランダ	9,767,879,089	1.76
	アイルランド	9,573,467,231	1.73
	スウェーデン	5,275,163,641	0.95
	デンマーク	4,226,781,873	0.76
	スペイン	3,647,765,579	0.66
	香港	3,311,703,408	0.60
	イタリア	2,742,676,560	0.50
	フィンランド	1,821,161,412	0.33
	シンガポール	1,707,302,373	0.31
	ジャージー	1,682,220,632	0.30
	ベルギー	1,340,901,899	0.24
	ノルウェー	1,210,263,265	0.22
	ケイマン	1,196,403,486	0.22
イスラエル	1,140,245,172	0.21	
バミューダ	770,986,271	0.14	
キュラソー	553,421,690	0.10	

	ルクセンブルク	487,108,418	0.09
	ニュージーランド	450,875,849	0.08
	オーストリア	318,852,585	0.06
	ポルトガル	253,959,613	0.05
	リベリア	167,206,178	0.03
	パナマ	148,973,010	0.03
	マン島	133,029,612	0.02
	ロシア	11,336,544	0.00
	小計	524,606,925,605	94.74
投資信託受益証券	オーストラリア	147,611,875	0.03
	香港	61,378,554	0.01
	小計	208,990,429	0.04
投資証券	アメリカ	10,765,484,814	1.94
	オーストラリア	774,751,018	0.14
	イギリス	333,381,666	0.06
	フランス	255,582,079	0.05
	シンガポール	232,228,889	0.04
	香港	180,396,843	0.03
	カナダ	64,864,537	0.01
	小計	12,606,689,846	2.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		16,319,078,028	2.95
合計(純資産総額)		553,741,683,908	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	11,503,215,798	2.08
	買建	カナダ	884,941,596	0.16
	買建	ドイツ	2,689,225,155	0.49
	買建	イギリス	229,772,640	0.04
	買建	オーストラリア	550,822,400	0.10

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

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

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		248,437,297	0.04

(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	1,284,469	15,251.01	19,589,459,711	21,757.27	27,946,539,225	5.05
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	558,777	30,566.94	17,080,104,789	38,413.32	21,464,482,727	3.88
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	35,733	396,145.54	14,155,468,789	407,071.58	14,545,889,047	2.63
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	66,795	79,353.91	5,300,444,477	133,893.43	8,943,412,064	1.62
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	23,507	288,454.87	6,780,708,664	347,437.06	8,167,202,976	1.47
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	22,377	295,150.82	6,604,590,087	349,165.20	7,813,269,839	1.41
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	196,119	19,974.46	3,917,371,513	33,889.79	6,646,431,921	1.20
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	185,146	40,233.26	7,449,028,026	27,886.56	5,163,085,315	0.93
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	73,563	50,414.88	3,708,670,464	63,743.15	4,689,138,064	0.85
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	205,370	20,714.50	4,254,138,405	21,980.02	4,514,036,728	0.82
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	101,985	35,424.56	3,612,773,914	43,767.88	4,463,668,047	0.81
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	231,226	20,101.33	4,647,950,963	17,200.69	3,977,246,885	0.72
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	130,637	27,819.24	3,634,222,970	27,409.24	3,580,660,951	0.65
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	189,391	16,504.29	3,125,764,272	18,895.79	3,578,692,962	0.65
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	219,354	14,727.84	3,230,611,668	15,981.67	3,505,643,943	0.63
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	330,112	7,143.90	2,358,288,536	10,253.83	3,384,913,715	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	81,549	39,031.39	3,182,971,223	37,752.41	3,078,672,050	0.56
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	150,711	12,702.85	1,914,460,447	20,253.09	3,052,364,532	0.55
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	68,686	44,131.38	3,031,208,393	44,334.55	3,045,163,149	0.55
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	576,261	5,188.11	2,989,706,667	5,262.77	3,032,729,103	0.55

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	437,000	4,740.16	2,071,451,974	6,418.13	2,804,723,509	0.51
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	137,691	13,854.54	1,907,646,569	20,041.36	2,759,515,244	0.50
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	32,248	75,499.41	2,434,704,974	85,054.74	2,742,845,256	0.50
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	54,689	41,829.62	2,287,620,307	49,145.83	2,687,736,406	0.49
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	32,460	58,174.96	1,888,359,213	77,239.10	2,507,181,352	0.45
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	141,614	21,864.97	3,096,386,357	17,252.09	2,443,138,096	0.44
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	319,753	6,766.94	2,163,750,357	7,613.88	2,434,561,579	0.44
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	34,433	46,296.46	1,594,126,190	70,554.16	2,429,391,505	0.44
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	328,253	6,474.43	2,125,251,399	6,859.95	2,251,802,286	0.41
アメリカ	株式	LILLY (ELI) & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	63,296	24,446.17	1,547,345,321	35,479.63	2,245,719,110	0.41

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.33
		素材	4.29
		資本財	5.85
		商業・専門サービス	1.13
		運輸	2.00
		自動車・自動車部品	2.45
		耐久消費財・アパレル	1.64
		消費者サービス	1.72
		メディア・娯楽	6.20
		小売	5.03
		食品・生活必需品小売り	1.49
		食品・飲料・タバコ	3.73
		家庭用品・パーソナル用品	1.57
		ヘルスケア機器・サービス	4.67

	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.00
	銀行	5.79
	各種金融	4.70
	保険	3.04
	不動産	0.43
	ソフトウェア・サービス	10.93
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.53
	電気通信サービス	1.48
	公益事業	2.88
	半導体・半導体製造装置	4.90
	小計	94.74
投資信託受益証券		0.04
投資証券		2.28
合計		97.05

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	409	アメリカドル	86,590,983	10,597,870,409	93,988,200	11,503,215,798	2.08
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	34	カナダドル	8,796,503	861,177,644	9,039,240	884,941,596	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	70	スイスフラン	8,064,490	1,068,867,505	8,456,700	1,120,851,018	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	297	ユーロ	10,945,259	1,496,216,905	11,473,110	1,568,374,137	0.28
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	32	オーストラリアドル	5,713,499	525,641,908	5,987,200	550,822,400	0.10
	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	19	イギリスポンド	1,364,916.25	219,601,375	1,428,135	229,772,640	0.04

(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	売建	2,030,000.00	248,478,400	248,437,297	0.04

(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。

## 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	112,068,097,500	96.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,134,171,618	3.56
合計(純資産総額)		116,202,269,118	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	4,124,626,000	3.55

(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	11,781	705,893.39	8,316,130,040	692,000	8,152,452,000	7.02
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	10,106	675,734.88	6,828,976,777	639,000	6,457,734,000	5.56
日本	投資証券	G L P 投資法人	32,729	183,916.1	6,019,390,090	185,400	6,067,956,600	5.22
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	16,534	370,025.27	6,117,997,840	356,500	5,894,371,000	5.07
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	32,679	165,633.04	5,412,722,347	161,200	5,267,854,800	4.53
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	50,988	100,928.73	5,146,154,217	103,000	5,251,764,000	4.52
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	15,173	325,118.08	4,933,016,755	328,000	4,976,744,000	4.28

日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	10,104	358,906.09	3,626,387,212	344,500	3,480,828,000	3.00
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	20,135	180,432.48	3,633,008,055	165,300	3,328,315,500	2.86
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	22,749	141,696.85	3,223,461,774	140,700	3,200,784,300	2.75
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,905	410,281.13	2,832,991,232	399,500	2,758,547,500	2.37
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	14,346	205,391.5	2,946,546,521	184,900	2,652,575,400	2.28
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	30,675	84,704.96	2,598,324,712	80,700	2,475,472,500	2.13
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	3,981	584,849.21	2,328,284,709	575,000	2,289,075,000	1.97
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,126	706,894.02	2,209,750,715	731,000	2,285,106,000	1.97
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	5,386	449,779.62	2,422,513,055	424,000	2,283,664,000	1.97
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,489	632,792.95	2,207,814,609	640,000	2,232,960,000	1.92
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	12,371	189,540.92	2,344,810,766	175,200	2,167,399,200	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	6,814	328,645.1	2,239,387,717	317,500	2,163,445,000	1.86
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	30,959	65,951.24	2,041,784,569	62,300	1,928,745,700	1.66
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	44,478	42,937.87	1,909,790,697	42,200	1,876,971,600	1.62
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,543	507,260.46	1,797,223,828	507,000	1,796,301,000	1.55
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	11,883	154,436.59	1,835,170,062	151,100	1,795,521,300	1.55
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,884	153,951.98	1,829,565,376	151,000	1,794,484,000	1.54
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,136	728,818.26	1,556,755,815	757,000	1,616,952,000	1.39
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	13,655	112,816.28	1,540,506,312	115,100	1,571,690,500	1.35
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,427	170,307.73	1,605,491,048	166,600	1,570,538,200	1.35
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	9,686	152,025.3	1,472,517,119	161,100	1,560,414,600	1.34
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,701	323,104.3	1,518,913,359	328,500	1,544,278,500	1.33
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	7,231	213,747.81	1,545,610,441	213,500	1,543,818,500	1.33

(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。

(注3)銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.44
合計	96.44

(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	3,911,208,400	4,124,626,000	3.55



(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	83,586,004,976	75.91
	オーストラリア	7,483,709,844	6.80
	イギリス	5,818,446,300	5.28
	シンガポール	3,760,184,833	3.41
	カナダ	2,091,822,986	1.90
	フランス	1,958,965,424	1.78
	ベルギー	1,410,247,901	1.28
	香港	1,400,197,678	1.27
	スペイン	453,446,940	0.41
	ニュージーランド	391,403,649	0.36
	ガーンジー	292,509,378	0.27
	韓国	225,566,312	0.20
	オランダ	220,690,626	0.20
	アイルランド	123,683,412	0.11
	イスラエル	86,737,212	0.08
	ドイツ	60,497,542	0.05
	イタリア	32,868,708	0.03
	小計	109,396,983,721	99.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		711,059,421	0.65
合計(純資産総額)		110,108,043,142	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		91,999,300	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	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	402,543	18,197.69	7,325,354,491	20,089.09	8,086,724,408	7.34
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	49,025	97,132.64	4,761,927,749	92,258.80	4,522,987,959	4.11
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	83,069	40,096.71	3,330,793,647	48,486.02	4,027,685,395	3.66
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	179,108	20,255.66	3,627,952,422	16,496.94	2,954,735,380	2.68
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	237,280	10,449.11	2,479,365,830	11,977.08	2,841,922,824	2.58
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	154,666	19,138.32	2,960,047,844	17,643.74	2,728,887,062	2.48
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	308,371	8,417.76	2,595,794,740	8,601.56	2,652,474,496	2.41
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	76,205	29,419.97	2,241,949,090	30,836.16	2,349,869,611	2.13
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	186,424	10,498.26	1,957,129,050	11,198.68	2,087,703,652	1.90
オースト ラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	927,489	2,163.75	2,006,860,022	2,121.51	1,967,686,463	1.79
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	79,449	25,229.40	2,004,451,130	24,732.57	1,964,978,049	1.78
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	72,690	24,237.39	1,761,816,029	25,573.39	1,858,929,755	1.69
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	216,784	6,466.16	1,401,760,641	7,689.76	1,667,017,734	1.51
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	62,649	24,863.47	1,557,671,764	26,070.29	1,633,277,843	1.48
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	324,163	4,961.73	1,608,411,878	5,006.97	1,623,076,005	1.47
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	35,241	41,575.02	1,465,145,407	42,679.84	1,504,080,270	1.37
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	207,021	6,927.21	1,434,078,610	7,234.47	1,497,687,814	1.36
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	653,773	2,127.47	1,390,886,457	2,188.90	1,431,049,243	1.30
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	63,064	23,615.39	1,489,281,520	21,798.88	1,374,724,751	1.25
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	292,028	4,144.48	1,210,304,932	4,262.84	1,244,869,720	1.13
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	77,348	14,413.29	1,114,839,688	16,015.95	1,238,802,118	1.13
香港	投資証券	LINK REIT	1,153,700	1,083.13	1,249,616,726	1,058.04	1,220,667,670	1.11
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	340,688	3,565.16	1,214,609,149	3,541.96	1,206,705,517	1.10
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	55,368	19,982.63	1,106,398,425	20,758.56	1,149,360,388	1.04
アメリカ	投資証券	UDR INC	161,184	6,772.31	1,091,588,260	7,101.06	1,144,578,512	1.04
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	157,081	5,808.98	912,481,295	6,787.74	1,066,226,464	0.97
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	102,741	9,405.16	966,295,741	10,065.35	1,034,124,494	0.94
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	334,107	2,852.03	952,884,394	3,059.74	1,022,283,893	0.93
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	387,230	2,235.57	865,681,395	2,439.23	944,544,078	0.86
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	92,811	10,308.83	956,772,961	9,472.98	879,197,304	0.80

(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	99.35
合計	99.35

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

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	オーストラリアドル	買建	1,000,000.00	91,922,000	91,999,300	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。

## ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	32,463,818,770	99.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		33,588,126	0.10
合計(純資産総額)		32,497,406,896	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		32,299,836,320	99.39

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	7,215,695	4,224.51	30,482,839,436	4,499.05	32,463,818,770	99.90

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.90
合計	99.90

(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	263,936,932.00	30,538,045,232	32,299,836,320	99.39

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

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

#### ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	ケイマン	43,834,878,640	97.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,211,660,623	2.69
合計(純資産総額)		45,046,539,263	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 (%)
ケイマン	社債券	SIGNUM GENEVA1 0% 12/15/25	41,356,000,000	108.38	44,825,283,480	105.99	43,834,878,640	0.000	2025/12/15	97.31

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	97.31
合計	97.31

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 米国株式LSマザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	アイルランド	21,398,410,581	103.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		781,634,574	3.79
合計(純資産総額)		20,616,776,007	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		21,520,488,000	104.38

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アイルラ ンド	社債券	STAR HELIOS 004 10/18/22	150,000,000	13,024.66	19,536,998,940	14,265.60	21,398,410,581	0.000	2022/10/18	103.79

(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(%)
社債券	103.79
合計	103.79

(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	176,000,000.00	21,478,688,000	21,520,488,000	104.38

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

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

### コモディティLSアルファ・マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	アイルランド	22,483,675,000	98.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		331,366,519	1.45
合計(純資産総額)		22,815,041,519	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 0% 07/13/22	20,030,000,000	112.26	22,486,714,000	112.25	22,483,675,000	0.000	2022/7/13	98.55

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	98.55
合計	98.55

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

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

### 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	アイルランド	8,398,152,000	98.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		103,281,672	1.21
合計(純資産総額)		8,501,433,672	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アイルラ ンド	社債券	STAR HELI OS 0% 10/ 18 / 22	10,640,000,000	78.30	8,331,120,000	78.93	8,398,152,000	0.000	2022/10/18	98.79

(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(%)
社債券	98.79
合計	98.79

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

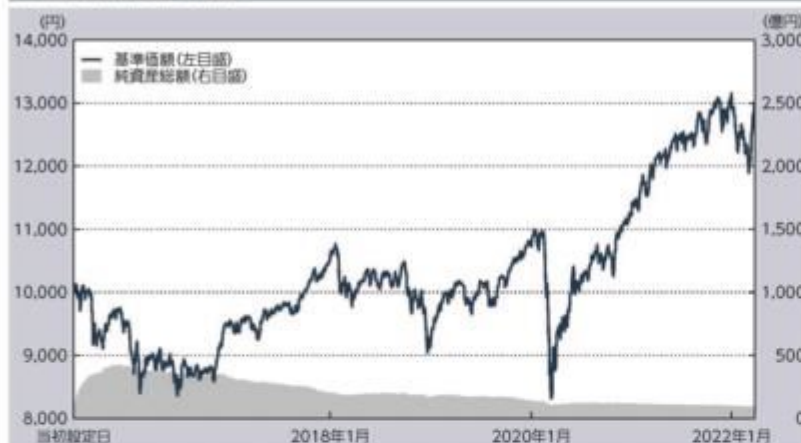


## 運用実績

当初設定日：2015年6月16日

作成基準日：2022年3月31日

### 基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額 12,974円

純資産総額 98.46億円

### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年2月	0円
2019年2月	0円
2020年2月	0円
2021年2月	0円
2022年2月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

### 主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	18.0%
国内株式インデックス マザーファンド	10.1%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	7.3%
グローバルREITインデックス マザーファンド	6.0%
国内株式アクティブ/バリューファンド(適格機関投資家専用)	5.9%
J-REIT インデックス マザーファンド	5.7%
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	5.1%
ビクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	4.7%
JPX日経インデックス400 マザーファンド	3.9%
コモディティLSアルファ・マザーファンド	3.8%

※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)



※2015年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2022年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### < 申込手続 >

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

#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

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

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等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々営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

#### < 受付不可日 >

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

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

<一部解約受付の中止等>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、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（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 >

内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

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

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

外国投資信託証券の評価方法

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

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

・国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

・公社債等（仕組債を含みます。）

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

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】

2015年 6月16日（設定日）から2026年 2月17日までとします。

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。

なお、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

### （４）【計算期間】

原則として、毎年2月18日から翌年2月17日までとします。

ただし、第1計算期間は2015年6月16日から2016年2月17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れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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、本手続きに従います。

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

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約  
当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

収益分配金は、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て）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

#### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

#### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

(1)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7期計算期間(2021年2月18日から2022年2月17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】

## 【サテライト投資戦略ファンド（株式型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 （2021年 2月17日現在）	第7期 （2022年 2月17日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	205,599,097	205,442,561
投資信託受益証券	2,450,667,667	2,760,840,637
投資証券	135,733,418	415,624,310
親投資信託受益証券	8,840,608,893	6,414,137,884
未収入金	20,121,563	-
流動資産合計	11,652,730,638	9,796,045,392
資産合計	11,652,730,638	9,796,045,392
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	38,103,631	32,754,135
未払受託者報酬	3,246,328	2,832,129
未払委託者報酬	92,844,876	80,999,053
未払利息	203	306
その他未払費用	324,575	283,159
流動負債合計	134,519,613	116,868,782
負債合計	134,519,613	116,868,782
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	9,724,467,321	7,704,434,536
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,793,743,704	1,974,742,074
（分配準備積立金）	1,922,926,468	2,053,668,196
元本等合計	11,518,211,025	9,679,176,610
純資産合計	11,518,211,025	9,679,176,610
負債純資産合計	11,652,730,638	9,796,045,392

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期		第7期	
	自 至	2020年 2月18日 2021年 2月17日	自 至	2021年 2月18日 2022年 2月17日
営業収益				
受取配当金		-		5,289,458
受取利息		743		584
有価証券売買等損益		1,085,109,121		818,379,145
その他収益		2,140		-
営業収益合計		1,085,112,004		823,669,187
営業費用				
支払利息		64,974		60,767
受託者報酬		6,396,878		5,804,648
委託者報酬		182,950,696		166,012,920
その他費用		639,873		580,352
営業費用合計		190,052,421		172,458,687
営業利益又は営業損失（ ）		895,059,583		651,210,500
経常利益又は経常損失（ ）		895,059,583		651,210,500
当期純利益又は当期純損失（ ）		895,059,583		651,210,500
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（ ）		18,935,022		103,320,397
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,103,702,274		1,793,743,704
剰余金増加額又は欠損金減少額		612,867		24,130,393
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		612,867		24,130,393
剰余金減少額又は欠損金増加額		224,566,042		391,022,126
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		224,566,042		391,022,126
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,793,743,704		1,974,742,074

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 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>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

	第6期 (2021年 2月17日現在)	第7期 (2022年 2月17日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,724,467,321口	7,704,434,536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	<p>1口当たり純資産額 1.1845円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (11,845円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.2563円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (12,563円)</p>

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第6期 自 2020年 2月18日 至 2021年 2月17日	第7期 自 2021年 2月18日 至 2022年 2月17日													
<p>分配金の計算過程</p> <table border="1" data-bbox="172 1966 754 2056"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>106,564,058円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	106,564,058円	<p>分配金の計算過程</p> <table border="1" data-bbox="834 1966 1417 2056"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>85,352,496円</td> </tr> </tbody> </table>		項目			費用控除後の配当等収益額	A	85,352,496円
項目														
費用控除後の配当等収益額	A	106,564,058円												
項目														
費用控除後の配当等収益額	A	85,352,496円												

第6期 自 2020年 2月18日 至 2021年 2月17日			第7期 自 2021年 2月18日 至 2022年 2月17日		
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	807,430,547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	462,537,607円
収益調整金額	C	195,951,740円	収益調整金額	C	173,010,683円
分配準備積立金額	D	1,008,931,863円	分配準備積立金額	D	1,505,778,093円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,118,878,208円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,226,678,879円
当ファンドの期末残存口数	F	9,724,467,321口	当ファンドの期末残存口数	F	7,704,434,536口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,178円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,890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7期 自 2021年 2月18日 至 2022年 2月17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（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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第7期 (2022年 2月17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

	第7期 (2022年 2月17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>「(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)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>

## ( 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6期 自 2020年 2月18日 至 2021年 2月17日	第7期 自 2021年 2月18日 至 2022年 2月17日
	投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	12,035,161,408円	9,724,467,321円
期中追加設定元本額	167,978,519円	97,944,390円
期中一部解約元本額	2,478,672,606円	2,117,977,175円

## ( 有価証券に関する注記 )

売買目的有価証券

種類	第6期 (2021年 2月17日現在)	第7期 (2022年 2月17日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	281,538,869	62,228,481
投資証券	4,305,267	30,109,108

親投資信託受益証券	766,103,417	443,443,364
合計	1,051,947,553	475,562,737

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	ノムラ F O F s 用 日本株ベータヘッジ戦略 ファンド(適格機関投資家専用)	538,453,621	500,977,248	
	国内株式アクティブバリューファンド(適格機 関投資家専用)	519,917,535	621,457,429	
	F O F s 用国内株式エンハンス運用戦略ファンド (適格機関投資家専用)	188,893,704	299,623,193	
	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	24,214.841	307,673,769	
	グローバル株式コンセントレイト・ファンド (適格機関投資家専用)	188,353,299	298,332,790	
	日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投 資家専用)	128,627,956	281,888,165	
	ブランディワイン・グローバル株式ファンド (適格機関投資家専用)	292,157,757	310,622,127	
	F O F s 用 M A N A H L ダイバーシファイ ド リンクファンド(適格機関投資家専用)	123,105,070	140,265,916	
投資信託受益証券合計		1,979,533,156.841	2,760,840,637	
投資証券	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	176,940.639	279,920,090	
	MA Hedge Fund Strategies Limited	13,064	135,704,220	
投資証券合計		190,004.639	415,624,310	
親投資信託受益証券	J - R E I T インデックス マザーファンド	260,548,498	535,140,560	
	グローバル R E I T インデックス マザーファ ンド	214,485,652	523,473,682	
	中小型株式 マザーファンド	53,149,377	252,682,768	
	国内株式インデックス マザーファンド	551,200,014	1,038,460,826	
	外国株式インデックス マザーファンド	431,357,615	1,778,832,532	



J P X日経インデックス400 マザーファンド	238,093,157	424,186,768	
ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	441,623,608	467,900,212	
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	501,509,930	653,818,495	
コモディティLSアルファ・マザーファンド	290,633,114	335,041,853	
米国株式LSマザーファンド	284,398,733	287,356,479	
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	147,960,259	117,243,709	
親投資信託受益証券合計	3,414,959,957	6,414,137,884	
合計		9,590,602,831	

(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。

### J P X日経インデックス400 マザーファンド

#### 貸借対照表

項目	2022年 2月17日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,200,089,937	
株式	34,048,726,970	
派生商品評価勘定	5,575,840	
未収入金	410,940	
未収配当金	57,506,165	
差入委託証拠金	12,787,870	
流動資産合計	36,325,097,722	
資産合計	36,325,097,722	
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	360,170	
前受金	5,238,000	
未払金	81,480	
未払解約金	1,911,370,033	
未払利息	3,282	
流動負債合計	1,917,052,965	

	2022年 2月17日現在
項目	金額（円）
負債合計	1,917,052,965
純資産の部	
元本等	
元本	19,312,677,912
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	15,095,366,845
元本等合計	34,408,044,757
純資産合計	34,408,044,757
負債純資産合計	36,325,097,722

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 2月17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)

	2022年 2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	19,312,677,912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 1.7816円 (1万口当たり純資産額) (17,816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

	2022年 2月17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（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。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2月17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。

	2022年 2月17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	2022年 2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	26,827,957,599円
期中追加設定元本額	6,570,550,592円
期中一部解約元本額	14,085,830,279円
期末元本額	19,312,677,912円
期末元本額の内訳	
SMT JPX日経インデックス400・オープン	5,249,121,912円
SMTAM JPX日経インデックス400オープン	766,737,404円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	11,004,109,660円
JPX日経インデックス400・オープン（SMA専用）	609,207,691円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	238,093,157円
JPX日経400オープン（適格機関投資家専用）	1,445,408,088円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 2月17日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	1,585,750,666	
合計	1,585,750,666	

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「J P X日経インデックス400 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

(2022年 2月17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	347,170,000	-	352,408,000	5,238,000
合計		347,170,000	-	352,408,000	5,238,000

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、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)	
日本水産	24,200	571.00	13,818,200	
I N P E X	97,100	1,170.00	113,607,000	
ミライト・ホールディングス	7,800	1,956.00	15,256,800	
安藤・間	12,000	936.00	11,232,000	
東急建設	7,100	733.00	5,204,300	
コムシスホールディングス	7,800	2,799.00	21,832,200	
東建コーポレーション	700	9,230.00	6,461,000	
大成建設	16,200	3,840.00	62,208,000	
大林組	55,900	974.00	54,446,600	
清水建設	52,400	780.00	40,872,000	
長谷工コーポレーション	16,600	1,532.00	25,431,200	
鹿島建設	41,000	1,587.00	65,067,000	

西松建設	3,400	3,855.00	13,107,000
三井住友建設	12,600	454.00	5,720,400
戸田建設	23,200	771.00	17,887,200
熊谷組	2,800	2,911.00	8,150,800
大東建託	5,700	12,900.00	73,530,000
五洋建設	22,200	630.00	13,986,000
住友林業	14,300	2,338.00	33,433,400
大和ハウス工業	51,600	3,336.00	172,137,600
積水ハウス	60,600	2,376.00	143,985,600
関電工	9,100	879.00	7,998,900
エクシオグループ	8,400	2,432.00	20,428,800
九電工	4,300	3,100.00	13,330,000
インフロニア・ホールディングス	23,500	1,061.00	24,933,500
森永製菓	4,200	3,645.00	15,309,000
カルビー	8,200	2,540.00	20,828,000
森永乳業	3,300	5,650.00	18,645,000
ヤクルト本社	13,200	6,100.00	80,520,000
明治ホールディングス	11,800	6,840.00	80,712,000
プリマハム	2,200	2,359.00	5,189,800
日本ハム	6,800	4,390.00	29,852,000
アサヒグループホールディングス	42,100	5,219.00	219,719,900
キリンホールディングス	65,700	2,003.50	131,629,950
サントリー食品インターナショナル	12,000	4,590.00	55,080,000
伊藤園	5,400	6,730.00	36,342,000
キッコーマン	12,900	8,870.00	114,423,000
味の素	39,500	3,303.00	130,468,500
キューピー	9,400	2,463.00	23,152,200
カゴメ	6,800	3,005.00	20,434,000
アリアケジャパン	1,600	5,760.00	9,216,000
ニチレイ	8,200	2,610.00	21,402,000
東洋水産	8,600	4,930.00	42,398,000
日清食品ホールディングス	7,000	9,080.00	63,560,000
日本たばこ産業	95,900	2,350.00	225,365,000
帝人	16,400	1,416.00	23,222,400
東レ	126,400	680.30	85,989,920
ゴールドウイン	3,200	6,150.00	19,680,000
王子ホールディングス	73,000	624.00	45,552,000
大王製紙	8,400	1,787.00	15,010,800
レンゴー	16,500	871.00	14,371,500
クラレ	25,500	1,105.00	28,177,500
旭化成	115,700	1,119.50	129,526,150
昭和電工	15,100	2,327.00	35,137,700

住友化学	128,200	563.00	72,176,600
日産化学	9,500	6,560.00	62,320,000
東ソー	25,200	1,875.00	47,250,000
トクヤマ	5,600	1,921.00	10,757,600
デンカ	6,400	3,605.00	23,072,000
信越化学工業	25,800	18,245.00	470,721,000
エア・ウォーター	16,500	1,721.00	28,396,500
日本酸素ホールディングス	16,800	2,337.00	39,261,600
三菱瓦斯化学	16,200	2,077.00	33,647,400
三井化学	15,900	3,030.00	48,177,000
三菱ケミカルホールディングス	116,700	845.10	98,623,170
ダイセル	25,100	901.00	22,615,100
積水化学工業	36,500	1,980.00	72,270,000
日本ゼオン	15,700	1,370.00	21,509,000
アイカ工業	4,900	3,285.00	16,096,500
宇部興産	8,200	2,213.00	18,146,600
日油	6,000	5,210.00	31,260,000
花王	39,400	5,224.00	205,825,600
日本ペイントホールディングス	65,600	1,022.00	67,043,200
関西ペイント	18,100	2,457.00	44,471,700
D I C	7,400	2,757.00	20,401,800
富士フイルムホールディングス	31,300	7,633.00	238,912,900
資生堂	33,200	6,731.00	223,469,200
ライオン	21,500	1,470.00	31,605,000
ファンケル	7,200	3,270.00	23,544,000
コーセー	3,400	13,320.00	45,288,000
ポーラ・オルビスホールディングス	7,600	1,834.00	13,938,400
小林製薬	5,000	9,870.00	49,350,000
日東電工	10,800	8,610.00	92,988,000
エフピコ	3,300	3,310.00	10,923,000
ニフコ	5,900	3,585.00	21,151,500
ユニ・チャーム	34,400	4,242.00	145,924,800
協和キリン	20,900	3,050.00	63,745,000
武田薬品工業	131,200	3,543.00	464,841,600
アステラス製薬	154,500	2,018.00	311,781,000
大日本住友製薬	11,000	1,272.00	13,992,000
塩野義製薬	22,400	7,634.00	171,001,600
日本新薬	4,700	7,670.00	36,049,000
中外製薬	55,700	3,868.00	215,447,600
科研製薬	2,800	4,205.00	11,774,000
エーザイ	21,300	5,907.00	125,819,100
ロート製薬	9,100	3,680.00	33,488,000

小野薬品工業	40,900	2,853.00	116,687,700
参天製薬	33,200	1,293.00	42,927,600
JCRファーマ	5,000	2,161.00	10,805,000
東和薬品	2,600	3,100.00	8,060,000
第一三共	140,100	2,483.50	347,938,350
大塚ホールディングス	37,000	4,001.00	148,037,000
ペプチドリーム	9,400	2,063.00	19,392,200
サワイグループホールディングス	3,900	4,450.00	17,355,000
出光興産	19,800	3,085.00	61,083,000
E N E O Sホールディングス	268,100	460.50	123,460,050
コスモエネルギーホールディングス	5,200	2,538.00	13,197,600
横浜ゴム	10,300	1,774.00	18,272,200
TOYO TIRE	9,400	1,617.00	15,199,800
ブリヂストン	51,300	5,263.00	269,991,900
住友ゴム工業	16,000	1,183.00	18,928,000
AGC	16,400	5,610.00	92,004,000
太平洋セメント	10,100	2,358.00	23,815,800
東海カーボン	14,900	1,162.00	17,313,800
TOTO	12,700	4,940.00	62,738,000
日本碍子	19,300	1,876.00	36,206,800
日本特殊陶業	13,600	2,169.00	29,498,400
ニチアス	4,100	2,659.00	10,901,900
三井金属鉱業	4,800	3,405.00	16,344,000
住友金属鉱山	22,500	5,325.00	119,812,500
住友電気工業	65,900	1,607.00	105,901,300
アサヒホールディングス	7,100	2,187.00	15,527,700
SUMCO	27,100	2,100.00	56,910,000
三和ホールディングス	16,600	1,289.00	21,397,400
リンナイ	3,300	9,870.00	32,571,000
日本製鋼所	5,300	3,625.00	19,212,500
三浦工業	7,600	3,270.00	24,852,000
アマダ	27,800	1,060.00	29,468,000
FUJ I	8,100	2,431.00	19,691,100
オーエスジー	8,200	1,997.00	16,375,400
D M G 森精機	10,500	1,774.00	18,627,000
ディスコ	2,600	34,650.00	90,090,000
オプトラン	2,200	1,983.00	4,362,600
ナブテスコ	10,000	3,315.00	33,150,000
S M C	5,200	68,710.00	357,292,000
小松製作所	80,800	2,769.50	223,775,600
住友重機械工業	10,200	2,906.00	29,641,200
日立建機	7,100	2,975.00	21,122,500



クボタ	86,300	2,118.00	182,783,400
荏原製作所	7,400	5,840.00	43,216,000
ダイキン工業	22,700	21,765.00	494,065,500
ダイフク	9,800	8,710.00	85,358,000
竹内製作所	2,700	2,645.00	7,141,500
ホシザキ	5,200	8,110.00	42,172,000
日本精工	33,600	756.00	25,401,600
マキタ	21,700	4,106.00	89,100,200
三菱重工業	28,000	3,334.00	93,352,000
I H I	11,100	2,678.00	29,725,800
ブラザー工業	21,800	2,107.00	45,932,600
ミネベアミツミ	30,700	2,560.00	78,592,000
日立製作所	81,200	6,150.00	499,380,000
三菱電機	178,200	1,445.50	257,588,100
富士電機	10,700	6,170.00	66,019,000
安川電機	19,200	4,855.00	93,216,000
日本電産	43,200	10,060.00	434,592,000
オムロン	14,800	8,036.00	118,932,800
M C J	6,200	1,000.00	6,200,000
日本電気	22,600	5,140.00	116,164,000
富士通	16,000	16,425.00	262,800,000
ルネサスエレクトロニクス	96,700	1,440.00	139,248,000
セイコーエプソン	22,100	1,821.00	40,244,100
ワコム	13,800	847.00	11,688,600
アルバック	3,600	6,090.00	21,924,000
エレコム	4,100	1,543.00	6,326,300
パナソニック	190,100	1,227.50	233,347,750
アンリツ	11,500	1,618.00	18,607,000
ソニーグループ	47,700	12,160.00	580,032,000
T D K	25,800	4,730.00	122,034,000
横河電機	17,800	1,858.00	33,072,400
アズビル	10,400	4,150.00	43,160,000
日本光電工業	7,400	3,180.00	23,532,000
堀場製作所	3,300	6,820.00	22,506,000
アドバンテスト	13,200	9,760.00	128,832,000
キーエンス	8,500	54,880.00	466,480,000
シスメックス	15,100	8,771.00	132,442,100
レーザーテック	7,800	22,000.00	171,600,000
スタンレー電気	12,400	2,876.00	35,662,400
カシオ計算機	12,900	1,366.00	17,621,400
ファナック	15,600	22,780.00	355,368,000
浜松ホトニクス	12,800	5,680.00	72,704,000

京セラ	25,100	6,862.00	172,236,200
太陽誘電	8,600	5,150.00	44,290,000
村田製作所	52,400	8,116.00	425,278,400
小糸製作所	9,800	6,200.00	60,760,000
S C R E E Nホールディングス	3,100	12,010.00	37,231,000
東京エレクトロン	11,300	58,220.00	657,886,000
トヨタ紡織	7,300	2,165.00	15,804,500
豊田自動織機	14,400	9,170.00	132,048,000
デンソー	39,200	8,523.00	334,101,600
いすゞ自動車	55,900	1,591.00	88,936,900
トヨタ自動車	265,900	2,160.50	574,476,950
日野自動車	22,300	1,095.00	24,418,500
アイシン	13,000	4,435.00	57,655,000
本田技研工業	140,300	3,681.00	516,444,300
スズキ	40,800	4,776.00	194,860,800
S U B A R U	51,100	1,959.50	100,130,450
ヤマハ発動機	23,300	2,713.00	63,212,900
豊田合成	5,800	2,275.00	13,195,000
シマノ	7,200	26,600.00	191,520,000
テイ・エス テック	7,500	1,589.00	11,917,500
テルモ	50,400	3,771.00	190,058,400
島津製作所	22,900	4,105.00	94,004,500
ブイ・テクノロジー	800	3,520.00	2,816,000
東京精密	3,000	4,845.00	14,535,000
オリンパス	93,500	2,268.50	212,104,750
H O Y A	34,800	15,485.00	538,878,000
朝日インテック	19,500	2,197.00	42,841,500
バンダイナムコホールディングス	16,000	7,838.00	125,408,000
パイロットコーポレーション	3,000	4,655.00	13,965,000
ヤマハ	10,400	5,430.00	56,472,000
ピジョン	10,800	2,281.00	24,634,800
任天堂	7,900	58,760.00	464,204,000
中部電力	54,500	1,136.00	61,912,000
関西電力	67,500	1,163.00	78,502,500
中国電力	27,800	902.00	25,075,600
東北電力	41,700	739.00	30,816,300
九州電力	36,700	846.00	31,048,200
北海道電力	15,500	503.00	7,796,500
電源開発	15,200	1,896.00	28,819,200
イーレックス	2,600	1,699.00	4,417,400
レノバ	3,500	1,386.00	4,851,000
東京瓦斯	34,200	2,341.00	80,062,200

大阪瓦斯	32,300	2,116.00	68,346,800
東海旅客鉄道	14,800	16,350.00	241,980,000
阪急阪神ホールディングス	21,100	3,600.00	75,960,000
ヤマトホールディングス	23,700	2,188.00	51,855,600
山九	4,400	4,005.00	17,622,000
センコーグループホールディングス	8,500	933.00	7,930,500
日立物流	3,300	5,810.00	19,173,000
丸和運輸機関	3,600	1,087.00	3,913,200
九州旅客鉄道	13,100	2,650.00	34,715,000
S Gホールディングス	31,900	2,503.00	79,845,700
NIPPON EXPRESSホールディングス	5,800	7,470.00	43,326,000
日本郵船	14,100	10,000.00	141,000,000
商船三井	9,300	9,040.00	84,072,000
近鉄エクスプレス	3,200	2,950.00	9,440,000
NEC ネットエスアイ	5,800	1,737.00	10,074,600
システナ	24,900	381.00	9,486,900
日鉄ソリューションズ	2,500	3,575.00	8,937,500
T I S	16,700	2,635.00	44,004,500
コーエーテクモホールディングス	5,600	4,000.00	22,400,000
ネクソン	39,500	2,394.00	94,563,000
ティーガイア	1,600	1,720.00	2,752,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,500	2,778.00	12,501,000
GMO ペイメントゲートウェイ	3,400	10,230.00	34,782,000
ラクス	8,000	1,753.00	14,024,000
アカツキ	800	2,878.00	2,302,400
野村総合研究所	33,800	3,790.00	128,102,000
インフォコム	1,900	2,058.00	3,910,200
オービック	5,500	18,400.00	101,200,000
ジャストシステム	2,500	5,340.00	13,350,000
Zホールディングス	254,200	546.30	138,869,460
トレンドマイクロ	9,300	6,000.00	55,800,000
日本オラクル	2,800	8,100.00	22,680,000
伊藤忠テクノソリューションズ	8,000	2,924.00	23,392,000
大塚商会	9,500	4,270.00	40,565,000
電通国際情報サービス	2,500	3,650.00	9,125,000
東映アニメーション	700	10,040.00	7,028,000
デジタルガレージ	2,900	3,960.00	11,484,000
日本ユニシス	5,500	3,060.00	16,830,000
USEN - NEXT HOLDINGS	1,700	2,376.00	4,039,200
日本電信電話	159,600	3,288.00	524,764,800
KDDI	127,500	3,780.00	481,950,000
光通信	2,000	14,490.00	28,980,000

東宝	10,300	4,775.00	49,182,500
エヌ・ティ・ティ・データ	46,600	2,101.00	97,906,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,100	5,530.00	44,793,000
カプコン	16,500	2,790.00	46,035,000
S C S K	12,100	1,926.00	23,304,600
コナミホールディングス	6,400	6,660.00	42,624,000
ソフトバンクグループ	50,200	5,117.00	256,873,400
双日	19,400	1,958.00	37,985,200
アルフレッサ ホールディングス	19,500	1,746.00	34,047,000
神戸物産	13,600	3,805.00	51,748,000
ダイワボウホールディングス	8,500	1,773.00	15,070,500
T O K A Iホールディングス	8,500	909.00	7,726,500
シップヘルスケアホールディングス	5,600	2,367.00	13,255,200
コメダホールディングス	3,800	2,146.00	8,154,800
メディパルホールディングス	18,900	2,087.00	39,444,300
日本ライフライン	5,200	1,026.00	5,335,200
伊藤忠商事	122,800	3,849.00	472,657,200
丸紅	173,100	1,228.50	212,653,350
豊田通商	17,600	5,120.00	90,112,000
兼松	6,500	1,380.00	8,970,000
三井物産	136,300	3,098.00	422,257,400
住友商事	110,800	1,912.00	211,849,600
三菱商事	131,500	4,120.00	541,780,000
岩谷産業	4,200	5,370.00	22,554,000
P A L T A C	2,500	4,525.00	11,312,500
日鉄物産	1,300	5,350.00	6,955,000
ミスミグループ本社	22,000	3,600.00	79,200,000
ローソン	3,900	4,845.00	18,895,500
エービーシー・マート	2,700	5,250.00	14,175,000
日本マクドナルドホールディングス	8,100	4,955.00	40,135,500
セリア	4,200	2,905.00	12,201,000
ビックカメラ	10,400	1,010.00	10,504,000
MonotaRO	22,200	2,138.00	47,463,600
マツキヨココカラ&カンパニー	7,900	4,270.00	33,733,000
Z O Z O	12,100	3,085.00	37,328,500
ウエルシアホールディングス	9,300	3,060.00	28,458,000
クリエイティブSDホールディングス	2,600	3,140.00	8,164,000
コスモス薬品	1,800	14,890.00	26,802,000
セブン&アイ・ホールディングス	68,700	5,709.00	392,208,300
ツルハホールディングス	3,800	9,120.00	34,656,000
クスリのアオキホールディングス	1,700	6,900.00	11,730,000
FOOD & LIFE COMPANIES	10,300	3,765.00	38,779,500

ノジマ	2,800	2,580.00	7,224,000
良品計画	20,200	1,729.00	34,925,800
コーナン商事	2,500	3,590.00	8,975,000
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	35,100	1,908.00	66,970,800
ゼンショーホールディングス	8,600	2,734.00	23,512,400
ワークマン	2,300	4,815.00	11,074,500
スギホールディングス	3,500	6,330.00	22,155,000
ライフコーポレーション	1,600	3,020.00	4,832,000
丸井グループ	13,900	2,322.00	32,275,800
イズミ	3,200	3,235.00	10,352,000
ヤオコー	2,000	6,540.00	13,080,000
ケーズホールディングス	16,200	1,266.00	20,509,200
アインホールディングス	2,400	6,440.00	15,456,000
ニトリホールディングス	7,000	16,470.00	115,290,000
ファーストリテイリング	2,300	63,700.00	146,510,000
サンドラッグ	6,600	3,090.00	20,394,000
めぶきフィナンシャルグループ	91,300	286.00	26,111,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	100,400	498.00	49,999,200
新生銀行	11,500	2,240.00	25,760,000
あおぞら銀行	9,800	2,708.00	26,538,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	788,800	738.80	582,765,440
りそなホールディングス	201,200	549.60	110,579,520
三井住友トラスト・ホールディングス	33,200	4,235.00	140,602,000
三井住友フィナンシャルグループ	121,700	4,321.00	525,865,700
千葉銀行	58,700	787.00	46,196,900
ふくおかフィナンシャルグループ	14,800	2,442.00	36,141,600
セブン銀行	52,200	249.00	12,997,800
みずほフィナンシャルグループ	224,800	1,610.50	362,040,400
F P G	5,900	873.00	5,150,700
G M Oフィナンシャルホールディングス	3,300	811.00	2,676,300
S B Iホールディングス	21,700	3,105.00	67,378,500
ジャフコ グループ	6,700	1,699.00	11,383,300
大和証券グループ本社	131,600	692.90	91,185,640
野村ホールディングス	268,400	545.30	146,358,520
S O M P Oホールディングス	28,900	5,414.00	156,464,600
M S & A Dインシュアランスグループホール ディングス	39,400	3,999.00	157,560,600
第一生命ホールディングス	86,500	2,658.00	229,917,000
東京海上ホールディングス	57,900	7,061.00	408,831,900
T & Dホールディングス	45,600	1,807.00	82,399,200
全国保証	4,200	4,850.00	20,370,000
芙蓉総合リース	1,800	7,920.00	14,256,000

みずほリース	2,700	3,285.00	8,869,500
東京センチュリー	3,400	5,770.00	19,618,000
イオンフィナンシャルサービス	9,600	1,273.00	12,220,800
アコム	34,700	331.00	11,485,700
オリエントコーポレーション	47,600	127.00	6,045,200
オリックス	106,700	2,376.00	253,519,200
三菱HCキャピタル	64,900	605.00	39,264,500
日本取引所グループ	44,500	2,254.00	100,303,000
いちご	19,600	283.00	5,546,800
ヒューリック	42,000	1,060.00	44,520,000
野村不動産ホールディングス	9,100	2,806.00	25,534,600
サムティ	2,800	2,129.00	5,961,200
プレサンスコーポレーション	2,300	1,824.00	4,195,200
オープンハウスグループ	5,600	5,120.00	28,672,000
東急不動産ホールディングス	51,800	665.00	34,447,000
飯田グループホールディングス	14,700	2,181.00	32,060,700
三井不動産	80,100	2,585.00	207,058,500
三菱地所	115,500	1,789.50	206,687,250
東京建物	17,400	1,813.00	31,546,200
住友不動産	36,900	3,608.00	133,135,200
スターツコーポレーション	2,400	2,543.00	6,103,200
日本エスコン	3,300	757.00	2,498,100
イオンモール	8,800	1,655.00	14,564,000
カチタス	4,400	3,350.00	14,740,000
ミクシィ	3,900	2,291.00	8,934,900
日本M&Aセンターホールディングス	27,900	1,769.00	49,355,100
UTグループ	2,500	3,405.00	8,512,500
エス・エム・エス	5,800	3,075.00	17,835,000
パーソルホールディングス	17,000	2,479.00	42,143,000
総合警備保障	6,800	4,210.00	28,628,000
カカクコム	12,500	2,587.00	32,337,500
ディップ	3,000	3,485.00	10,455,000
ベネフィット・ワン	6,200	2,465.00	15,283,000
エムスリー	30,000	4,042.00	121,260,000
アウトソーシング	9,800	1,343.00	13,161,400
博報堂DYホールディングス	23,700	1,547.00	36,663,900
オリエンタルランド	20,100	22,425.00	450,742,500
ユー・エス・エス	19,100	1,958.00	37,397,800
フルキャストホールディングス	1,500	2,183.00	3,274,500
エン・ジャパン	2,800	2,886.00	8,080,800
テクノプロ・ホールディングス	10,200	3,290.00	33,558,000
アイ・アールジャパンホールディングス	800	3,855.00	3,084,000

ジャパンマテリアル	5,200	1,741.00	9,053,200	
リクルートホールディングス	101,700	4,828.00	491,007,600	
ベルシステム24ホールディングス	2,400	1,392.00	3,340,800	
ペイカレント・コンサルティング	1,200	39,950.00	47,940,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,400	1,539.00	8,310,600	
リログループ	9,300	1,742.00	16,200,600	
カナモト	3,000	2,327.00	6,981,000	
セコム	16,800	8,614.00	144,715,200	
メイテック	2,100	6,970.00	14,637,000	
イオンディライト	2,100	2,994.00	6,287,400	
合 計	11,938,700		34,048,726,970	

## (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。

## 中小型株式 マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2022年 2月17日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,767,899,541
株式	27,295,655,000
未収入金	390,296,603
未収配当金	56,209,000
流動資産合計	30,510,060,144
資産合計	30,510,060,144
負債の部	
流動負債	
未払金	335,518,469
未払解約金	1,948,955,751
未払利息	4,129
流動負債合計	2,284,478,349
負債合計	2,284,478,349
純資産の部	
元本等	

	2022年 2月17日現在
項目	金額（円）
元本	5,936,933,069
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	22,288,648,726
元本等合計	28,225,581,795
純資産合計	28,225,581,795
負債純資産合計	30,510,060,144

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 2月17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. 収益及び費用の計上基準	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。

(貸借対照表に関する注記)

	2022年 2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	5,936,933,069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 4.7542円 (1万口当たり純資産額) (47,542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

	2022年 2月17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。



	2022年 2月17日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2月17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	2022年 2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	6,556,166,178円
期中追加設定元本額	906,326,960円
期中一部解約元本額	1,525,560,069円
期末元本額	5,936,933,069円
期末元本額の内訳	
中小型株式オープン	2,983,191,058円
中小型株式オープン（SMA専用）	173,231,570円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	2,727,361,064円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	53,149,377円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 2月17日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,642,979,821
合計	2,642,979,821

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

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

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
日揮ホールディングス	270,000	1,115.00	301,050,000	
寿スピリッツ	63,000	5,960.00	375,480,000	

セーレン	230,000	2,188.00	503,240,000
KHネオケム	165,000	2,852.00	470,580,000
恵和	75,000	4,595.00	344,625,000
トリケミカル研究所	200,000	2,875.00	575,000,000
ミルボン	58,000	6,010.00	348,580,000
デクセリアルズ	210,000	3,040.00	638,400,000
ニフコ	260,000	3,585.00	932,100,000
JCRファーマ	70,000	2,161.00	151,270,000
MARUWA	56,000	14,560.00	815,360,000
横河ブリッジホールディングス	150,000	2,135.00	320,250,000
三益半導体工業	145,000	2,397.00	347,565,000
日本製鋼所	110,000	3,625.00	398,750,000
芝浦機械	90,000	3,065.00	275,850,000
ヒラノテクシード	98,000	2,201.00	215,698,000
技研製作所	50,000	3,735.00	186,750,000
イビデン	140,000	5,730.00	802,200,000
富士電機	156,000	6,170.00	962,520,000
ローランド ディー・ジー	100,000	2,911.00	291,100,000
マクセル	165,000	1,227.00	202,455,000
スタンレー電気	220,000	2,876.00	632,720,000
日本セラミック	190,000	2,478.00	470,820,000
インターアクション	210,000	2,037.00	427,770,000
メニコン	70,000	2,925.00	204,750,000
前田工織	70,000	3,170.00	221,900,000
SHOEI	124,000	4,540.00	562,960,000
ランコム	45,000	7,280.00	327,600,000
ネクソン	220,000	2,394.00	526,680,000
GMOペイメントゲートウェイ	11,000	10,230.00	112,530,000
インターネットイニシアティブ	170,000	3,410.00	579,700,000
カナミックネットワーク	200,000	432.00	86,400,000
ヤプリー	85,000	1,981.00	168,385,000
ビジョナル	40,000	8,080.00	323,200,000
J TOWER	20,000	4,050.00	81,000,000
ビザスク	40,000	3,535.00	141,400,000
ウェザーニューズ	40,000	7,550.00	302,000,000
KADOKAWA	240,000	2,462.00	590,880,000
東宝	140,000	4,775.00	668,500,000
カブコン	110,000	2,790.00	306,900,000
神戸物産	120,000	3,805.00	456,600,000
アズワン	75,000	6,430.00	482,250,000
サンエー	95,000	4,065.00	386,175,000
物語コーポレーション	90,000	6,730.00	605,700,000

シュッピン	450,000	1,180.00	531,000,000	
オイシックス・ラ・大地	135,000	2,611.00	352,485,000	
ネクステージ	110,000	2,561.00	281,710,000	
良品計画	320,000	1,729.00	553,280,000	
ウェルスナビ	115,000	1,869.00	214,935,000	
SBIホールディングス	200,000	3,105.00	621,000,000	
アニコムホールディングス	440,000	791.00	348,040,000	
イー・ギャランティ	210,000	2,047.00	429,870,000	
スター・マイカ・ホールディングス	202,000	1,203.00	243,006,000	
SREホールディングス	50,000	3,680.00	184,000,000	
日本M&Aセンターホールディングス	110,000	1,769.00	194,590,000	
エス・エム・エス	120,000	3,075.00	369,000,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	71,000	580.00	41,180,000	
カカクコム	105,000	2,587.00	271,635,000	
エスプール	590,000	984.00	580,560,000	
手間いらず	85,000	5,140.00	436,900,000	
サイバーエージェント	340,000	1,497.00	508,980,000	
弁護士ドットコム	32,000	4,555.00	145,760,000	
Keeper 技研	60,000	2,090.00	125,400,000	
ジャパンマテリアル	335,000	1,741.00	583,235,000	
エラン	235,000	968.00	227,480,000	
アトラエ	112,000	2,003.00	224,336,000	
インソース	220,000	1,923.00	423,060,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	95,000	1,539.00	146,205,000	
ユーピーアール	55,000	1,603.00	88,165,000	
LITALICO	110,000	3,100.00	341,000,000	
ダイセキ	160,000	4,395.00	703,200,000	
合計	10,553,000		27,295,655,000	

## (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

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2022年 2月17日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,077,210,895
株式	473,906,465,400
派生商品評価勘定	22,404,900
未収入金	378,900
未収配当金	741,942,091
前払金	31,011,300
差入委託証拠金	105,210,000
流動資産合計	481,884,623,486
資産合計	481,884,623,486
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	53,459,650
未払金	241,100
未払解約金	4,477,170,550
未払利息	10,557
流動負債合計	4,530,881,857
負債合計	4,530,881,857
純資産の部	
元本等	
元本	253,376,742,235
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	223,976,999,394
元本等合計	477,353,741,629
純資産合計	477,353,741,629
負債純資産合計	481,884,623,486

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 2月17日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</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)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>先物取引</p>

2022年 2月17日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<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。 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 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。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2022年 2月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	253,376,742,235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 1.8840円 (1万口当たり純資産額) (18,840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

2022年 2月17日現在	
1.金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
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、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。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。</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（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。</p>

	2022年 2月17日現在

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2月17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	2022年 2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	255,196,239,050円
期中追加設定元本額	26,989,462,083円
期中一部解約元本額	28,808,958,898円
期末元本額	253,376,742,235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）	407,171,405円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,934,955,955円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,811,302円
S M T T O P I X インデックス・オープン	11,328,157,194円
世界経済インデックスファンド	3,572,150,729円
日本株式インデックス・オープン	3,372,131,448円
D C マイセレクション 2 5	6,127,835,710円
D C マイセレクション 5 0	18,390,888,527円
D C マイセレクション 7 5	18,484,757,297円
D C 日本株式インデックス・オープン	6,060,470,975円
D C マイセレクション S 2 5	3,024,480,079円
D C マイセレクション S 5 0	8,875,961,222円
D C マイセレクション S 7 5	6,557,374,516円
D C 日本株式インデックス・オープン S	8,055,115,586円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	223,927,552円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	703,045,444円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	506,199,990円
D C 世界経済インデックスファンド	3,469,655,101円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,600,112,410円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	5,445,200円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	19,069,354円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	20,644,035円
日本株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	190,286,197円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	2,239,914円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	32,070,132円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	119,535,189円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	25,775,239円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	76,065,012円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	959,978,412円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	442,787,244円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	2,887,519,126円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	68,494,009円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	26,309,071円



区分	2022年 2月17日現在
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	507,745,829円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	280,793,456円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	362,761,620円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	37,133,693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）	594,004,390円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,360,498,643円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,897,751,707円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,344,624,777円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,711,030,971円
分散投資コア戦略ファンドA	1,375,097,034円
分散投資コア戦略ファンドS	5,837,881,242円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	452,081,648円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	409,824,667円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,816,992,074円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	217,167,442円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,792,435円
SMT インデックスバランス・オープン	58,128,648円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	24,628,900,927円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	551,200,014円
SMT 世界経済インデックス・オープン	42,598,757円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	155,480,311円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	29,288,192円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,520,642円
グローバル経済コア	214,791,753円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	25,955,449円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	96,298,130円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	21,256,129円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	755,085,424円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	177,996,925円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	7,195,625円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	5,004,360円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	2,537,383円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	3,138,445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）	43,446,467,819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）	1,049,948,953円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	259,425,898円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	49,867,245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）	47,733,604,004円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	11,106,205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）	241,342,793円

（有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 2月17日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	2,008,363,391	
合計	2,008,363,391	

(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

(2022年 2月17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	3,364,721,300	-	3,333,710,000	31,011,300
	合計	3,364,721,300	-	3,333,710,000	31,011,300

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	8,500	3,225.00	27,412,500	
日本水産	243,900	571.00	139,266,900	
マルハニチロ	38,200	2,647.00	101,115,400	
雪国まいたけ	17,800	1,218.00	21,680,400	
カネコ種苗	6,900	1,568.00	10,819,200	
サカタのタネ	29,100	3,395.00	98,794,500	
ホクト	20,500	1,965.00	40,282,500	
ホクリヨウ	3,300	688.00	2,270,400	
住石ホールディングス	42,700	138.00	5,892,600	
日鉄鉱業	5,600	6,490.00	36,344,000	
三井松島ホールディングス	10,200	1,662.00	16,952,400	

INPEX	978,400	1,170.00	1,144,728,000
石油資源開発	28,700	2,810.00	80,647,000
K&Oエナジーグループ	11,100	1,561.00	17,327,100
ヒノキヤグループ	5,300	2,355.00	12,481,500
ショーボンドホールディングス	34,800	5,260.00	183,048,000
ミライト・ホールディングス	78,500	1,956.00	153,546,000
タマホーム	14,800	2,342.00	34,661,600
サンヨーホームズ	2,800	752.00	2,105,600
日本アクア	9,700	593.00	5,752,100
ファーストコーポレーション	6,000	729.00	4,374,000
ベステラ	4,900	1,294.00	6,340,600
Robot Home	40,600	211.00	8,566,600
キャンディル	4,200	491.00	2,062,200
ダイセキ環境ソリューション	4,700	1,122.00	5,273,400
第一カッター興業	6,000	1,351.00	8,106,000
安藤・間	121,100	936.00	113,349,600
東急建設	71,400	733.00	52,336,200
コムシスホールディングス	78,600	2,799.00	220,001,400
ピーアールホールディングス	33,200	349.00	11,586,800
高松コンストラクショングループ	15,200	2,015.00	30,628,000
東建コーポレーション	6,800	9,230.00	62,764,000
ソネック	2,500	1,031.00	2,577,500
ヤマウラ	11,800	989.00	11,670,200
オリエンタル白石	82,000	245.00	20,090,000
大成建設	162,800	3,840.00	625,152,000
大林組	563,200	974.00	548,556,800
清水建設	527,600	780.00	411,528,000
飛島建設	15,100	1,106.00	16,700,600
長谷工コーポレーション	167,700	1,532.00	256,916,400
松井建設	22,200	743.00	16,494,600
銭高組	2,500	4,100.00	10,250,000
鹿島建設	412,700	1,587.00	654,954,900
不動テトラ	12,000	1,575.00	18,900,000
大末建設	5,900	1,343.00	7,923,700
鉄建建設	12,200	1,938.00	23,643,600
西松建設	34,100	3,855.00	131,455,500
三井住友建設	127,000	454.00	57,658,000
大豊建設	8,200	3,670.00	30,094,000
佐田建設	12,100	467.00	5,650,700
ナカノフドー建設	13,500	347.00	4,684,500
奥村組	33,200	3,265.00	108,398,000
東鉄工業	26,200	2,562.00	67,124,400

イチケン	4,100	1,939.00	7,949,900	
富士ピー・エス	7,300	498.00	3,635,400	
浅沼組	6,300	5,370.00	33,831,000	
戸田建設	233,900	771.00	180,336,900	
熊谷組	28,700	2,911.00	83,545,700	
北野建設	3,400	2,172.00	7,384,800	
植木組	5,000	1,517.00	7,585,000	
矢作建設工業	24,900	793.00	19,745,700	
ピーエス三菱	18,500	613.00	11,340,500	
日本ハウスホールディングス	38,400	455.00	17,472,000	
大東建託	57,600	12,900.00	743,040,000	
新日本建設	23,900	761.00	18,187,900	
東亜道路工業	2,900	5,020.00	14,558,000	
日本道路	5,400	9,810.00	52,974,000	
東亜建設工業	13,800	2,670.00	36,846,000	
日本国土開発	54,800	531.00	29,098,800	
若築建設	9,400	1,931.00	18,151,400	
東洋建設	63,100	589.00	37,165,900	
五洋建設	223,300	630.00	140,679,000	
世紀東急工業	27,000	816.00	22,032,000	
福田組	6,000	4,355.00	26,130,000	
住友林業	144,100	2,338.00	336,905,800	
日本基礎技術	15,500	675.00	10,462,500	
巴コーポレーション	25,000	508.00	12,700,000	
大和ハウス工業	520,100	3,336.00	1,735,053,600	
ライト工業	35,500	1,936.00	68,728,000	
積水ハウス	610,800	2,376.00	1,451,260,800	
日特建設	11,600	737.00	8,549,200	
北陸電気工事	11,700	809.00	9,465,300	
ユアテック	32,200	730.00	23,506,000	
日本リーテック	11,800	1,519.00	17,924,200	
四電工	6,100	1,594.00	9,723,400	
中電工	25,900	2,167.00	56,125,300	
関電工	91,600	879.00	80,516,400	
きんでん	125,800	1,662.00	209,079,600	
東京エネシス	18,700	945.00	17,671,500	
トーエネック	5,700	3,255.00	18,553,500	
住友電設	13,900	2,241.00	31,149,900	
日本電設工業	30,900	1,573.00	48,605,700	
エクシオグループ	84,700	2,432.00	205,990,400	
新日本空調	14,900	2,051.00	30,559,900	
九電工	43,500	3,100.00	134,850,000	

三機工業	36,600	1,483.00	54,277,800
日揮ホールディングス	173,500	1,115.00	193,452,500
中外炉工業	5,700	1,573.00	8,966,100
ヤマト	16,500	702.00	11,583,000
太平電業	12,500	2,726.00	34,075,000
高砂熱学工業	50,900	2,016.00	102,614,400
三晃金属工業	2,200	2,513.00	5,528,600
朝日工業社	3,800	3,000.00	11,400,000
明星工業	36,400	725.00	26,390,000
大気社	27,400	3,185.00	87,269,000
ダイダン	12,500	2,318.00	28,975,000
日比谷総合設備	18,100	1,888.00	34,172,800
フィル・カンパニー	3,200	1,191.00	3,811,200
テスホールディングス	10,400	1,289.00	13,405,600
インフロニア・ホールディングス	240,100	1,061.00	254,746,100
東洋エンジニアリング	23,600	606.00	14,301,600
レイズネクスト	27,200	1,143.00	31,089,600
ニッポン	52,700	1,702.00	89,695,400
日清製粉グループ本社	203,600	1,687.00	343,473,200
日東富士製粉	2,600	4,550.00	11,830,000
昭和産業	17,100	2,683.00	45,879,300
鳥越製粉	16,000	667.00	10,672,000
中部飼料	20,300	1,060.00	21,518,000
フィード・ワン	24,200	688.00	16,649,600
東洋精糖	3,000	1,101.00	3,303,000
日本甜菜製糖	9,400	1,723.00	16,196,200
D M三井製糖ホールディングス	16,400	2,013.00	33,013,200
塩水港精糖	21,500	215.00	4,622,500
日新製糖	8,500	1,788.00	15,198,000
森永製菓	42,300	3,645.00	154,183,500
中村屋	4,300	3,390.00	14,577,000
江崎グリコ	49,600	3,905.00	193,688,000
名糖産業	7,900	1,677.00	13,248,300
井村屋グループ	10,200	2,312.00	23,582,400
不二家	10,100	2,491.00	25,159,100
山崎製パン	135,100	1,519.00	205,216,900
第一屋製パン	3,500	571.00	1,998,500
モロゾフ	5,700	2,707.00	15,429,900
亀田製菓	10,300	4,135.00	42,590,500
寿スピリッツ	17,400	5,960.00	103,704,000
カルビー	82,100	2,540.00	208,534,000
森永乳業	33,400	5,650.00	188,710,000

六甲バター	13,200	1,560.00	20,592,000
ヤクルト本社	133,500	6,100.00	814,350,000
明治ホールディングス	119,200	6,840.00	815,328,000
雪印メグミルク	43,400	1,981.00	85,975,400
プリマハム	22,500	2,359.00	53,077,500
日本ハム	68,900	4,390.00	302,471,000
林兼産業	5,500	507.00	2,788,500
丸大食品	17,700	1,527.00	27,027,900
S Foods	16,200	3,250.00	52,650,000
柿安本店	6,200	2,600.00	16,120,000
伊藤ハム米久ホールディングス	116,100	686.00	79,644,600
サッポロホールディングス	61,500	2,424.00	149,076,000
アサヒグループホールディングス	424,000	5,219.00	2,212,856,000
キリンホールディングス	662,500	2,003.50	1,327,318,750
宝ホールディングス	122,500	1,169.00	143,202,500
オエノンホールディングス	51,200	344.00	17,612,800
養命酒製造	5,500	1,777.00	9,773,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	126,500	1,530.00	193,545,000
サントリー食品インターナショナル	120,600	4,590.00	553,554,000
ダイトーグループホールディングス	9,200	5,140.00	47,288,000
伊藤園	54,700	6,730.00	368,131,000
キーコーヒー	17,700	2,074.00	36,709,800
ユニカフェ	5,400	967.00	5,221,800
ジャパンフーズ	2,600	1,229.00	3,195,400
日清オイリオグループ	22,600	2,990.00	67,574,000
不二製油グループ本社	39,100	2,231.00	87,232,100
かどや製油	2,000	3,530.00	7,060,000
J - オイルミルズ	16,800	1,732.00	29,097,600
キッコーマン	129,700	8,870.00	1,150,439,000
味の素	398,100	3,303.00	1,314,924,300
ブルドックソース	7,600	2,012.00	15,291,200
キューピー	94,700	2,463.00	233,246,100
ハウス食品グループ本社	67,400	3,025.00	203,885,000
カゴメ	68,400	3,005.00	205,542,000
焼津水産化学工業	8,700	912.00	7,934,400
アリアケジャパン	16,500	5,760.00	95,040,000
ピエトロ	2,400	1,808.00	4,339,200
エバラ食品工業	3,900	2,816.00	10,982,400
やまみ	1,600	1,892.00	3,027,200
ニチレイ	82,200	2,610.00	214,542,000
東洋水産	86,600	4,930.00	426,938,000
イトアンドホールディングス	6,800	2,318.00	15,762,400

大冷	2,000	1,896.00	3,792,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,300	526.00	4,891,800
日清食品ホールディングス	70,700	9,080.00	641,956,000
永谷園ホールディングス	8,000	1,984.00	15,872,000
一正蒲鉾	7,100	794.00	5,637,400
フジッコ	16,800	1,960.00	32,928,000
ロック・フィールド	19,400	1,582.00	30,690,800
日本たばこ産業	966,500	2,350.00	2,271,275,000
ケンコーマヨネーズ	10,100	1,451.00	14,655,100
わらべや日洋ホールディングス	11,800	1,852.00	21,853,600
なとり	10,100	2,065.00	20,856,500
イフジ産業	3,100	938.00	2,907,800
ピクルスコーポレーション	8,600	1,547.00	13,304,200
ファーマフーズ	17,000	1,648.00	28,016,000
ユーグレナ	91,800	805.00	73,899,000
紀文食品	10,500	1,195.00	12,547,500
ミヨシ油脂	6,900	1,139.00	7,859,100
理研ビタミン	18,700	1,726.00	32,276,200
片倉工業	19,800	2,257.00	44,688,600
ゲンゼ	12,000	3,870.00	46,440,000
東洋紡	69,900	1,270.00	88,773,000
ユニチカ	49,800	310.00	15,438,000
富士紡ホールディングス	8,000	3,700.00	29,600,000
倉敷紡績	15,300	1,944.00	29,743,200
シキボウ	9,200	915.00	8,418,000
日本毛織	53,500	890.00	47,615,000
トーア紡コーポレーション	6,500	411.00	2,671,500
帝国繊維	20,100	1,935.00	38,893,500
帝人	165,900	1,416.00	234,914,400
東レ	1,274,200	680.30	866,838,260
住江織物	3,400	1,960.00	6,664,000
日本フェルト	11,000	448.00	4,928,000
イチカワ	2,600	1,415.00	3,679,000
日東製網	1,900	1,454.00	2,762,600
アツギ	13,800	612.00	8,445,600
ダイニック	6,600	741.00	4,890,600
セーレン	36,300	2,188.00	79,424,400
ソトー	6,600	840.00	5,544,000
東海染工	2,200	1,167.00	2,567,400
小松マテーレ	29,000	1,291.00	37,439,000
ワコールホールディングス	44,000	2,050.00	90,200,000
ホギメディカル	23,700	3,250.00	77,025,000

TSIホールディングス	59,300	330.00	19,569,000
マツオカコーポレーション	5,800	1,172.00	6,797,600
ワールド	23,200	1,250.00	29,000,000
三陽商会	8,400	876.00	7,358,400
ナイガイ	6,600	280.00	1,848,000
オンワードホールディングス	106,300	294.00	31,252,200
ルックホールディングス	5,700	1,579.00	9,000,300
ゴールドウイン	31,800	6,150.00	195,570,000
デサント	34,400	3,140.00	108,016,000
キング	8,600	536.00	4,609,600
ヤマトインターナショナル	16,100	290.00	4,669,000
特種東海製紙	10,800	4,195.00	45,306,000
王子ホールディングス	735,300	624.00	458,827,200
日本製紙	84,300	1,165.00	98,209,500
三菱製紙	24,900	324.00	8,067,600
北越コーポレーション	115,300	741.00	85,437,300
中越パルプ工業	6,700	1,013.00	6,787,100
巴川製紙所	5,200	876.00	4,555,200
大王製紙	84,800	1,787.00	151,537,600
阿波製紙	4,500	326.00	1,467,000
レンゴー	166,200	871.00	144,760,200
トモク	10,800	1,750.00	18,900,000
ザ・パック	13,300	2,736.00	36,388,800
北の達人コーポレーション	62,900	220.00	13,838,000
クラレ	257,200	1,105.00	284,206,000
旭化成	1,165,800	1,119.50	1,305,113,100
共和レザー	10,900	680.00	7,412,000
昭和電工	152,500	2,327.00	354,867,500
住友化学	1,292,200	563.00	727,508,600
住友精化	7,800	3,370.00	26,286,000
日産化学	95,700	6,560.00	627,792,000
ラサ工業	6,200	1,627.00	10,087,400
クレハ	13,900	9,210.00	128,019,000
多木化学	6,900	4,920.00	33,948,000
テイカ	12,900	1,338.00	17,260,200
石原産業	29,300	1,104.00	32,347,200
片倉コープアグリ	4,000	1,173.00	4,692,000
日本曹達	22,500	3,450.00	77,625,000
東ソー	253,800	1,875.00	475,875,000
トクヤマ	56,300	1,921.00	108,152,300
セントラル硝子	28,800	2,104.00	60,595,200
東亜合成	97,700	1,108.00	108,251,600



大阪ソーダ	16,400	3,145.00	51,578,000
関東電化工業	38,500	1,173.00	45,160,500
デンカ	64,200	3,605.00	231,441,000
信越化学工業	302,000	18,245.00	5,509,990,000
日本カーバイド工業	6,300	1,446.00	9,109,800
堺化学工業	12,300	2,049.00	25,202,700
第一稀元素化学工業	16,300	1,014.00	16,528,200
エア・ウォーター	166,500	1,721.00	286,546,500
日本酸素ホールディングス	169,000	2,337.00	394,953,000
日本化学工業	5,500	2,558.00	14,069,000
東邦アセチレン	2,900	1,232.00	3,572,800
日本パーカラライジング	88,700	1,018.00	90,296,600
高压ガス工業	27,900	703.00	19,613,700
チタン工業	2,000	1,681.00	3,362,000
四国化成工業	22,900	1,455.00	33,319,500
戸田工業	3,700	2,708.00	10,019,600
ステラ ケミファ	8,800	2,446.00	21,524,800
保土谷化学工業	5,600	4,400.00	24,640,000
日本触媒	29,600	5,890.00	174,344,000
大日精化工業	14,500	2,214.00	32,103,000
カネカ	45,500	3,850.00	175,175,000
三菱瓦斯化学	163,600	2,077.00	339,797,200
三井化学	159,800	3,030.00	484,194,000
J S R	163,900	3,490.00	572,011,000
東京応化工業	28,500	7,150.00	203,775,000
大阪有機化学工業	15,000	3,110.00	46,650,000
三菱ケミカルホールディングス	1,175,800	845.10	993,668,580
K Hネオケム	29,000	2,852.00	82,708,000
ダイセル	253,400	901.00	228,313,400
住友ベークライト	27,700	5,070.00	140,439,000
積水化学工業	368,100	1,980.00	728,838,000
日本ゼオン	158,600	1,370.00	217,282,000
アイカ工業	49,000	3,285.00	160,965,000
宇部興産	82,900	2,213.00	183,457,700
積水樹脂	26,600	1,969.00	52,375,400
タキロンシーアイ	38,100	568.00	21,640,800
旭有機材	9,900	2,101.00	20,799,900
ニチバン	10,400	1,766.00	18,366,400
リケンテクノス	42,900	465.00	19,948,500
大倉工業	9,000	1,911.00	17,199,000
積水化成成品工業	23,600	462.00	10,903,200
群栄化学工業	4,000	3,545.00	14,180,000

タイガースポリマー	9,300	458.00	4,259,400	
ミライアル	5,600	1,553.00	8,696,800	
ダイキアクシス	6,800	720.00	4,896,000	
ダイキョーニシカワ	37,100	591.00	21,926,100	
竹本容器	6,300	789.00	4,970,700	
森六ホールディングス	9,500	1,972.00	18,734,000	
恵和	4,800	4,595.00	22,056,000	
日本化薬	138,600	1,164.00	161,330,400	
カーリットホールディングス	17,400	705.00	12,267,000	
日本精化	14,100	1,954.00	27,551,400	
扶桑化学工業	15,800	4,695.00	74,181,000	
トリケミカル研究所	18,100	2,875.00	52,037,500	
A D E K A	81,000	2,707.00	219,267,000	
日油	60,000	5,210.00	312,600,000	
新日本理化	29,100	245.00	7,129,500	
ハリマ化成グループ	13,100	823.00	10,781,300	
花王	397,300	5,224.00	2,075,495,200	
第一工業製薬	6,600	2,770.00	18,282,000	
石原ケミカル	8,900	1,324.00	11,783,600	
日華化学	5,900	779.00	4,596,100	
ニイタカ	3,600	2,328.00	8,380,800	
三洋化成工業	10,500	5,130.00	53,865,000	
有機合成薬品工業	12,300	271.00	3,333,300	
大日本塗料	21,500	820.00	17,630,000	
日本ペイントホールディングス	660,900	1,022.00	675,439,800	
関西ペイント	182,400	2,457.00	448,156,800	
神東塗料	13,800	153.00	2,111,400	
中国塗料	41,500	902.00	37,433,000	
日本特殊塗料	13,200	871.00	11,497,200	
藤倉化成	21,900	460.00	10,074,000	
太陽ホールディングス	25,900	3,140.00	81,326,000	
D I C	74,300	2,757.00	204,845,100	
サカタインクス	34,900	961.00	33,538,900	
東洋インキＳＣホールディングス	37,200	1,934.00	71,944,800	
T & K T O K A	14,200	904.00	12,836,800	
富士フイルムホールディングス	315,600	7,633.00	2,408,974,800	
資生堂	334,500	6,731.00	2,251,519,500	
ライオン	216,800	1,470.00	318,696,000	
高砂香料工業	12,400	2,750.00	34,100,000	
マンダム	37,700	1,379.00	51,988,300	
ミルボン	22,200	6,010.00	133,422,000	
ファンケル	72,700	3,270.00	237,729,000	

コーセー	33,800	13,320.00	450,216,000
コタ	11,400	1,578.00	17,989,200
シーボン	2,300	1,831.00	4,211,300
ポーラ・オルビスホールディングス	76,700	1,834.00	140,667,800
ノエビアホールディングス	15,200	5,210.00	79,192,000
アジュバンホールディングス	4,000	1,126.00	4,504,000
新日本製薬	4,900	1,389.00	6,806,100
エステー	11,500	1,566.00	18,009,000
アグロ カネショウ	6,000	1,258.00	7,548,000
コニシ	29,500	1,596.00	47,082,000
長谷川香料	31,000	2,362.00	73,222,000
星光PMC	10,100	613.00	6,191,300
小林製薬	50,300	9,870.00	496,461,000
荒川化学工業	15,000	1,131.00	16,965,000
メック	13,400	3,055.00	40,937,000
日本高純度化学	4,900	2,551.00	12,499,900
タカラバイオ	47,000	2,368.00	111,296,000
JCU	20,200	4,775.00	96,455,000
新田ゼラチン	11,300	661.00	7,469,300
OATアグリオ	3,700	1,885.00	6,974,500
デクセリアルズ	46,700	3,040.00	141,968,000
アース製薬	14,800	5,590.00	82,732,000
北興化学工業	16,700	854.00	14,261,800
大成ラミック	5,500	2,746.00	15,103,000
クミアイ化学工業	66,800	814.00	54,375,200
日本農薬	32,000	539.00	17,248,000
アキレス	11,500	1,288.00	14,812,000
有沢製作所	26,200	1,005.00	26,331,000
日東電工	108,600	8,610.00	935,046,000
レック	23,400	955.00	22,347,000
三光合成	19,000	364.00	6,916,000
きもと	27,500	211.00	5,802,500
藤森工業	16,100	4,135.00	66,573,500
前澤化成工業	11,400	1,269.00	14,466,600
未来工業	6,400	1,523.00	9,747,200
ウェーブロックホールディングス	6,800	710.00	4,828,000
JSP	10,500	1,608.00	16,884,000
エフピコ	33,000	3,310.00	109,230,000
天馬	14,100	2,596.00	36,603,600
信越ポリマー	32,200	1,122.00	36,128,400
東リ	44,700	225.00	10,057,500
ニフコ	59,900	3,585.00	214,741,500

バルカー	14,600	2,536.00	37,025,600
ユニ・チャーム	346,200	4,242.00	1,468,580,400
ショーエイコーポレーション	4,800	634.00	3,043,200
協和キリン	210,800	3,050.00	642,940,000
武田薬品工業	1,411,500	3,543.00	5,000,944,500
アステラス製薬	1,557,100	2,018.00	3,142,227,800
大日本住友製薬	110,900	1,272.00	141,064,800
塩野義製薬	225,900	7,634.00	1,724,520,600
わかもと製薬	21,400	296.00	6,334,400
日本新薬	47,000	7,670.00	360,490,000
中外製薬	561,700	3,868.00	2,172,655,600
科研製薬	28,200	4,205.00	118,581,000
エーザイ	215,000	5,907.00	1,270,005,000
ロート製薬	92,200	3,680.00	339,296,000
小野薬品工業	412,400	2,853.00	1,176,577,200
久光製薬	47,500	3,725.00	176,937,500
持田製薬	22,700	3,835.00	87,054,500
参天製薬	334,900	1,293.00	433,025,700
扶桑薬品工業	6,300	2,330.00	14,679,000
日本ケミファ	2,100	2,192.00	4,603,200
ツムラ	55,600	3,260.00	181,256,000
日医工	55,700	830.00	46,231,000
キッセイ薬品工業	31,800	2,443.00	77,687,400
生化学工業	31,700	905.00	28,688,500
栄研化学	31,600	1,743.00	55,078,800
日水製薬	6,600	987.00	6,514,200
鳥居薬品	9,600	2,922.00	28,051,200
JCRファーマ	50,600	2,161.00	109,346,600
東和薬品	25,900	3,100.00	80,290,000
富士製薬工業	11,000	1,018.00	11,198,000
ゼリア新薬工業	32,600	1,982.00	64,613,200
第一三共	1,411,300	2,483.50	3,504,963,550
キョーリン製薬ホールディングス	36,000	1,853.00	66,708,000
大幸薬品	27,100	659.00	17,858,900
ダイト	11,600	2,933.00	34,022,800
大塚ホールディングス	373,200	4,001.00	1,493,173,200
大正製薬ホールディングス	42,700	5,720.00	244,244,000
ペプチドリーム	94,200	2,063.00	194,334,600
あすか製薬ホールディングス	20,400	1,070.00	21,828,000
サワイグループホールディングス	39,300	4,450.00	174,885,000
日本コークス工業	151,700	138.00	20,934,600
ニチレキ	23,000	1,319.00	30,337,000

ユシロ化学工業	9,300	1,068.00	9,932,400
ビーピー・カストロール	6,400	1,293.00	8,275,200
富士石油	48,000	266.00	12,768,000
MORESCO	5,900	1,156.00	6,820,400
出光興産	199,300	3,085.00	614,840,500
Eneosホールディングス	2,701,700	460.50	1,244,132,850
コスモエネルギーホールディングス	52,000	2,538.00	131,976,000
横浜ゴム	104,000	1,774.00	184,496,000
TOYO TIRE	94,500	1,617.00	152,806,500
ブリヂストン	517,300	5,263.00	2,722,549,900
住友ゴム工業	161,300	1,183.00	190,817,900
藤倉コンポジット	14,400	710.00	10,224,000
オカモト	10,600	4,110.00	43,566,000
フコク	7,900	950.00	7,505,000
ニッタ	18,600	2,789.00	51,875,400
住友理工	34,800	615.00	21,402,000
三ツ星ベルト	21,800	2,123.00	46,281,400
バンドー化学	29,000	867.00	25,143,000
日東紡績	26,800	3,205.00	85,894,000
AGC	164,900	5,610.00	925,089,000
日本板硝子	86,200	513.00	44,220,600
石塚硝子	3,100	2,057.00	6,376,700
日本山村硝子	7,000	823.00	5,761,000
日本電気硝子	72,200	2,898.00	209,235,600
オハラ	7,200	1,145.00	8,244,000
住友大阪セメント	33,300	3,575.00	119,047,500
太平洋セメント	102,100	2,358.00	240,751,800
日本ヒューム	18,200	696.00	12,667,200
日本コンクリート工業	35,900	299.00	10,734,100
三谷セキサン	8,400	6,450.00	54,180,000
アジアパイルホールディングス	27,900	439.00	12,248,100
東海カーボン	150,600	1,162.00	174,997,200
日本カーボン	9,300	4,185.00	38,920,500
東洋炭素	11,800	3,145.00	37,111,000
ノリタケカンパニーリミテド	10,000	4,530.00	45,300,000
TOTO	128,300	4,940.00	633,802,000
日本碍子	194,600	1,876.00	365,069,600
日本特殊陶業	136,700	2,169.00	296,502,300
MARUWA	6,200	14,560.00	90,272,000
品川リフラクトリーズ	4,200	3,910.00	16,422,000
黒崎播磨	3,100	4,310.00	13,361,000
ヨータイ	11,500	1,263.00	14,524,500

イソライト工業	8,000	1,195.00	9,560,000
東京窯業	23,300	305.00	7,106,500
ニッカトー	8,300	571.00	4,739,300
フジインコーポレーテッド	14,400	6,610.00	95,184,000
クニミネ工業	5,800	1,001.00	5,805,800
エーアンドエーマテリアル	3,000	912.00	2,736,000
ニチアス	41,600	2,659.00	110,614,400
ニチハ	25,000	2,628.00	65,700,000
日本製鉄	794,800	2,014.00	1,600,727,200
神戸製鋼所	331,600	613.00	203,270,800
中山製鋼所	28,300	465.00	13,159,500
合同製鐵	9,600	1,364.00	13,094,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	479,700	1,674.00	803,017,800
東京製鐵	60,600	1,136.00	68,841,600
共英製鋼	20,100	1,667.00	33,506,700
大和工業	34,000	3,695.00	125,630,000
東京鐵鋼	7,900	1,381.00	10,909,900
大阪製鐵	9,500	1,239.00	11,770,500
淀川製鋼所	23,300	2,767.00	64,471,100
丸一鋼管	62,900	3,015.00	189,643,500
モリ工業	5,300	2,537.00	13,446,100
大同特殊鋼	29,100	4,300.00	125,130,000
日本高周波鋼業	6,700	348.00	2,331,600
日本冶金工業	13,000	2,952.00	38,376,000
山陽特殊製鋼	18,300	2,198.00	40,223,400
愛知製鋼	10,000	2,593.00	25,930,000
日立金属	191,300	2,089.00	399,625,700
日本金属	4,500	1,293.00	5,818,500
大平洋金属	10,900	3,315.00	36,133,500
新日本電工	114,800	356.00	40,868,800
栗本鐵工所	8,100	1,547.00	12,530,700
虹技	2,500	956.00	2,390,000
三菱製鋼	11,400	1,221.00	13,919,400
日亜鋼業	23,300	280.00	6,524,000
日本精線	2,900	4,465.00	12,948,500
エンビプロ・ホールディングス	5,900	1,306.00	7,705,400
シンニッタン	21,700	235.00	5,099,500
新家工業	4,400	1,742.00	7,664,800
大紀アルミニウム工業所	26,800	1,671.00	44,782,800
日本輕金属ホールディングス	45,000	1,860.00	83,700,000
三井金属鋳業	48,000	3,405.00	163,440,000
東邦亜鉛	9,900	2,762.00	27,343,800

三菱マテリアル	117,300	2,129.00	249,731,700
住友金属鉱山	227,000	5,325.00	1,208,775,000
DOWAホールディングス	48,400	4,900.00	237,160,000
古河機械金属	29,400	1,304.00	38,337,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,600	876.00	18,045,600
東邦チタニウム	31,900	928.00	29,603,200
UACJ	27,000	2,332.00	62,964,000
CKサンエツ	3,700	4,025.00	14,892,500
古河電気工業	55,200	2,397.00	132,314,400
住友電気工業	664,100	1,607.00	1,067,208,700
フジクラ	198,100	663.00	131,340,300
昭和電線ホールディングス	15,500	1,898.00	29,419,000
東京特殊電線	2,700	2,831.00	7,643,700
タツタ電線	31,500	460.00	14,490,000
カナレ電気	2,700	1,503.00	4,058,100
平河ヒューテック	9,900	1,170.00	11,583,000
リョービ	21,900	1,126.00	24,659,400
アーレスティ	19,100	381.00	7,277,100
アサヒホールディングス	71,200	2,187.00	155,714,400
稲葉製作所	10,000	1,302.00	13,020,000
宮地エンジニアリンググループ	5,400	3,700.00	19,980,000
トーカロ	45,800	1,345.00	61,601,000
アルファC o	6,800	1,083.00	7,364,400
SUMCO	273,300	2,100.00	573,930,000
川田テクノロジーズ	3,600	3,810.00	13,716,000
RS Technologies	5,800	5,520.00	32,016,000
ジェイテックコーポレーション	2,000	1,523.00	3,046,000
信和	11,000	823.00	9,053,000
東洋製罐グループホールディングス	113,100	1,615.00	182,656,500
ホッカンホールディングス	9,800	1,401.00	13,729,800
コロナ	9,800	892.00	8,741,600
横河ブリッジホールディングス	30,500	2,135.00	65,117,500
駒井ハルテック	3,300	2,118.00	6,989,400
高田機工	1,600	2,871.00	4,593,600
三和ホールディングス	167,400	1,289.00	215,778,600
文化シャッター	56,400	1,063.00	59,953,200
三協立山	22,900	620.00	14,198,000
アルインコ	12,900	910.00	11,739,000
東洋シャッター	3,900	553.00	2,156,700
LIXIL	279,500	2,576.00	719,992,000
日本フィルコン	12,400	518.00	6,423,200
ノーリツ	34,000	1,617.00	54,978,000

長府製作所	18,100	1,974.00	35,729,400
リンナイ	33,500	9,870.00	330,645,000
ダイニチ工業	8,500	694.00	5,899,000
日東精工	22,300	518.00	11,551,400
三洋工業	2,200	1,844.00	4,056,800
岡部	33,900	749.00	25,391,100
ジーテクト	22,000	1,459.00	32,098,000
東プレ	33,100	1,261.00	41,739,100
高周波熱錬	31,700	607.00	19,241,900
東京製綱	10,900	850.00	9,265,000
サンコール	15,200	501.00	7,615,200
モリテック スチール	13,800	319.00	4,402,200
パイオラックス	25,500	1,764.00	44,982,000
エイチワン	17,400	667.00	11,605,800
日本発條	163,300	891.00	145,500,300
中央発條	8,500	806.00	6,851,000
アドバネクス	2,300	1,647.00	3,788,100
立川ブラインド工業	7,800	1,087.00	8,478,600
三益半導体工業	13,900	2,397.00	33,318,300
日本ドライケミカル	4,500	1,804.00	8,118,000
日本製鋼所	54,000	3,625.00	195,750,000
三浦工業	76,900	3,270.00	251,463,000
タクマ	60,300	1,487.00	89,666,100
ツガミ	39,200	1,298.00	50,881,600
オークマ	20,800	4,880.00	101,504,000
芝浦機械	20,100	3,065.00	61,606,500
アマダ	280,600	1,060.00	297,436,000
アイダエンジニアリング	46,700	1,012.00	47,260,400
滝澤鉄工所	5,200	1,210.00	6,292,000
F U J I	81,900	2,431.00	199,098,900
牧野フライス製作所	19,500	3,710.00	72,345,000
オーエスジー	82,300	1,997.00	164,353,100
ダイジェット工業	2,200	1,024.00	2,252,800
旭ダイヤモンド工業	47,000	594.00	27,918,000
D M G 森精機	105,500	1,774.00	187,157,000
ソディック	39,100	781.00	30,537,100
ディスコ	26,200	34,650.00	907,830,000
日東工器	9,800	1,630.00	15,974,000
日進工具	14,000	1,412.00	19,768,000
パンチ工業	15,000	494.00	7,410,000
富士ダイス	9,100	620.00	5,642,000
豊和工業	9,400	829.00	7,792,600



OKK	6,400	751.00	4,806,400
東洋機械金属	11,700	566.00	6,622,200
津田駒工業	3,400	595.00	2,023,000
エンシュウ	4,300	672.00	2,889,600
島精機製作所	26,100	1,852.00	48,337,200
オプトラン	22,300	1,983.00	44,220,900
NCホールディングス	5,100	1,838.00	9,373,800
イワキポンプ	11,400	1,024.00	11,673,600
フリー	15,900	1,026.00	16,313,400
ヤマシンフィルタ	36,100	367.00	13,248,700
日阪製作所	22,000	821.00	18,062,000
やまびこ	34,500	1,335.00	46,057,500
野村マイクロ・サイエンス	4,700	3,660.00	17,202,000
平田機工	8,400	5,540.00	46,536,000
ペガサスミシン製造	18,200	518.00	9,427,600
マルマエ	7,300	2,412.00	17,607,600
タツモ	8,400	1,524.00	12,801,600
ナプテスコ	101,300	3,315.00	335,809,500
三井海洋開発	19,000	1,161.00	22,059,000
レオン自動機	19,100	1,046.00	19,978,600
S M C	52,600	68,710.00	3,614,146,000
ホソカワミクロン	12,500	2,829.00	35,362,500
ユニオンツール	6,600	3,530.00	23,298,000
オイレス工業	24,900	1,594.00	39,690,600
日精エー・エス・ビー機械	6,000	2,989.00	17,934,000
サトーホールディングス	23,400	2,013.00	47,104,200
技研製作所	15,700	3,735.00	58,639,500
日本エアーテック	8,200	1,024.00	8,396,800
カワタ	5,700	1,016.00	5,791,200
日精樹脂工業	12,700	1,019.00	12,941,300
オカダアイヨン	5,700	1,446.00	8,242,200
ワイエイシイホールディングス	7,100	1,090.00	7,739,000
小松製作所	814,000	2,769.50	2,254,373,000
住友重機械工業	102,900	2,906.00	299,027,400
日立建機	72,000	2,975.00	214,200,000
日工	24,900	625.00	15,562,500
巴工業	7,100	2,298.00	16,315,800
井関農機	16,800	1,263.00	21,218,400
T O W A	15,400	2,310.00	35,574,000
丸山製作所	3,800	1,528.00	5,806,400
北川鉄工所	8,300	1,359.00	11,279,700
ローツェ	8,900	10,760.00	95,764,000

タカキタ	6,400	612.00	3,916,800
クボタ	870,100	2,118.00	1,842,871,800
荏原実業	8,400	2,154.00	18,093,600
三菱化工機	5,900	2,001.00	11,805,900
月島機械	33,300	1,045.00	34,798,500
帝国電機製作所	12,600	1,427.00	17,980,200
新東工業	39,900	704.00	28,089,600
澁谷工業	15,800	2,537.00	40,084,600
アイチ コーポレーション	25,800	885.00	22,833,000
小森コーポレーション	45,800	740.00	33,892,000
鶴見製作所	13,900	1,810.00	25,159,000
住友精密工業	2,700	1,920.00	5,184,000
日本ギア工業	6,700	274.00	1,835,800
酒井重工業	3,200	2,975.00	9,520,000
荏原製作所	74,600	5,840.00	435,664,000
石井鐵工所	2,600	3,005.00	7,813,000
西島製作所	16,500	966.00	15,939,000
北越工業	16,900	904.00	15,277,600
ダイキン工業	228,800	21,765.00	4,979,832,000
オルガノ	5,200	7,860.00	40,872,000
トーヨーカネツ	6,900	2,409.00	16,622,100
栗田工業	97,200	4,735.00	460,242,000
椿本チエイン	23,600	3,375.00	79,650,000
大同工業	8,200	925.00	7,585,000
木村化工機	15,200	789.00	11,992,800
アネスト岩田	28,000	814.00	22,792,000
ダイフク	98,900	8,710.00	861,419,000
サムコ	4,500	2,333.00	10,498,500
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	94,100	1,005.00	94,570,500
フジテック	66,600	2,692.00	179,287,200
C K D	53,100	2,047.00	108,695,700
キトー	15,300	1,680.00	25,704,000
平和	50,100	1,934.00	96,893,400
理想科学工業	15,100	2,249.00	33,959,900
S A N K Y O	38,800	3,195.00	123,966,000
日本金銭機械	18,300	664.00	12,151,200
マースグループホールディングス	11,500	1,615.00	18,572,500
フクシマガリレイ	12,300	3,900.00	47,970,000
オーイズミ	6,500	397.00	2,580,500
ダイコク電機	8,300	1,248.00	10,358,400

竹内製作所	27,400	2,645.00	72,473,000
アマノ	47,100	2,281.00	107,435,100
JUKI	25,000	702.00	17,550,000
ジャノメ	15,400	726.00	11,180,400
マックス	23,900	1,706.00	40,773,400
グローリー	46,200	2,142.00	98,960,400
新晃工業	16,700	1,737.00	29,007,900
大和冷機工業	26,000	1,137.00	29,562,000
セガサミーホールディングス	178,200	2,129.00	379,387,800
日本ピストンリング	6,600	1,381.00	9,114,600
リケン	7,800	2,621.00	20,443,800
TPR	24,200	1,441.00	34,872,200
ツバキ・ナカシマ	39,500	1,131.00	44,674,500
ホシザキ	52,500	8,110.00	425,775,000
大豊工業	14,800	725.00	10,730,000
日本精工	338,200	756.00	255,679,200
NTN	386,000	235.00	90,710,000
ジェイテクト	172,400	1,048.00	180,675,200
不二越	15,300	4,235.00	64,795,500
日本トムソン	49,300	561.00	27,657,300
THK	101,400	2,900.00	294,060,000
ユーシン精機	14,000	697.00	9,758,000
前澤給装工業	13,600	980.00	13,328,000
イーグル工業	22,300	1,062.00	23,682,600
前澤工業	11,000	647.00	7,117,000
日本ピラー工業	18,200	2,915.00	53,053,000
キッツ	60,600	682.00	41,329,200
マキタ	218,600	4,106.00	897,571,600
三井E & Sホールディングス	64,900	365.00	23,688,500
日立造船	152,200	785.00	119,477,000
三菱重工業	282,200	3,334.00	940,854,800
IHI	112,200	2,678.00	300,471,600
スター精密	27,100	1,482.00	40,162,200
日清紡ホールディングス	109,800	1,038.00	113,972,400
イビデン	94,400	5,730.00	540,912,000
コニカミノルタ	394,200	510.00	201,042,000
ブラザー工業	219,700	2,107.00	462,907,900
ミネベアミツミ	309,900	2,560.00	793,344,000
日立製作所	863,800	6,150.00	5,312,370,000
東芝	313,900	4,590.00	1,440,801,000
三菱電機	1,795,800	1,445.50	2,595,828,900
富士電機	108,200	6,170.00	667,594,000

東洋電機製造	6,500	970.00	6,305,000
安川電機	193,300	4,855.00	938,471,500
シンフォニアテクノロジー	21,600	1,319.00	28,490,400
明電舎	30,500	2,425.00	73,962,500
オリジン	4,500	1,246.00	5,607,000
山洋電気	8,100	5,010.00	40,581,000
デンヨー	15,300	1,715.00	26,239,500
PHCホールディングス	21,200	1,589.00	33,686,800
東芝テック	19,300	5,000.00	96,500,000
芝浦メカトロニクス	3,300	8,040.00	26,532,000
マブチモーター	41,800	4,055.00	169,499,000
日本電産	465,500	10,060.00	4,682,930,000
トレックス・セミコンダクター	9,400	2,589.00	24,336,600
東光高岳	10,600	1,462.00	15,497,200
ダイヘン	19,600	4,140.00	81,144,000
ヤーマン	30,200	922.00	27,844,400
JVCケンウッド	150,900	188.00	28,369,200
ミマキエンジニアリング	17,200	739.00	12,710,800
I-PEX	8,900	1,519.00	13,519,100
日新電機	42,100	1,499.00	63,107,900
大崎電気工業	33,000	489.00	16,137,000
オムロン	149,500	8,036.00	1,201,382,000
日東工業	24,000	1,597.00	38,328,000
IDEC	22,200	2,400.00	53,280,000
正興電機製作所	6,400	1,080.00	6,912,000
不二電機工業	4,200	1,088.00	4,569,600
ジーエス・ユアサコーポレーション	58,800	2,402.00	141,237,600
サクサホールディングス	4,200	1,387.00	5,825,400
メルコホールディングス	4,200	3,850.00	16,170,000
テクノメディカ	4,600	1,537.00	7,070,200
日本電気	228,200	5,140.00	1,172,948,000
富士通	161,600	16,425.00	2,654,280,000
沖電気工業	72,900	917.00	66,849,300
岩崎通信機	7,300	820.00	5,986,000
電気興業	9,400	2,355.00	22,137,000
サンケン電気	16,800	5,150.00	86,520,000
ナカヨ	3,200	1,125.00	3,600,000
アイホン	10,200	2,168.00	22,113,600
ルネサスエレクトロニクス	975,200	1,440.00	1,404,288,000
セイコーエプソン	222,800	1,821.00	405,718,800
ワコム	140,300	847.00	118,834,100
アルバック	35,800	6,090.00	218,022,000

アクセル	8,300	1,143.00	9,486,900	
E I Z O	13,900	3,725.00	51,777,500	
日本信号	45,700	886.00	40,490,200	
京三製作所	38,500	431.00	16,593,500	
能美防災	24,200	2,020.00	48,884,000	
ホーチキ	13,700	1,213.00	16,618,100	
星和電機	9,900	493.00	4,880,700	
エレコム	41,700	1,543.00	64,343,100	
パナソニック	1,915,500	1,227.50	2,351,276,250	
シャープ	204,700	1,310.00	268,157,000	
アンリツ	115,700	1,618.00	187,202,600	
富士通ゼネラル	48,800	2,599.00	126,831,200	
ソニーグループ	1,125,000	12,160.00	13,680,000,000	
T D K	260,300	4,730.00	1,231,219,000	
帝国通信工業	8,600	1,422.00	12,229,200	
タムラ製作所	69,200	616.00	42,627,200	
アルプスアルパイン	159,600	1,226.00	195,669,600	
池上通信機	5,300	664.00	3,519,200	
日本電波工業	16,900	1,189.00	20,094,100	
鈴木	9,300	823.00	7,653,900	
メイコー	14,800	3,900.00	57,720,000	
日本トリム	3,700	2,700.00	9,990,000	
ローランド ディー . ジー .	10,900	2,911.00	31,729,900	
フォスター電機	18,100	799.00	14,461,900	
S M K	4,200	2,169.00	9,109,800	
ヨコオ	13,600	2,799.00	38,066,400	
ホシデン	44,000	1,196.00	52,624,000	
ヒロセ電機	27,700	17,280.00	478,656,000	
日本航空電子工業	41,200	1,851.00	76,261,200	
T O A	19,300	781.00	15,073,300	
マクセル	36,400	1,227.00	44,662,800	
古野電気	22,200	1,048.00	23,265,600	
ユニデンホールディングス	3,900	3,490.00	13,611,000	
スミダコーポレーション	17,800	881.00	15,681,800	
アイコム	6,600	2,368.00	15,628,800	
リオン	7,300	2,097.00	15,308,100	
本多通信工業	15,800	481.00	7,599,800	
横河電機	179,700	1,858.00	333,882,600	
新電元工業	6,900	3,005.00	20,734,500	
アズビル	105,200	4,150.00	436,580,000	
東亜ディーケーケー	9,800	916.00	8,976,800	
日本光電工業	74,500	3,180.00	236,910,000	

チノー	5,700	1,525.00	8,692,500
共和電業	17,200	383.00	6,587,600
日本電子材料	9,100	2,081.00	18,937,100
堀場製作所	33,200	6,820.00	226,424,000
アドバンテスト	133,500	9,760.00	1,302,960,000
小野測器	9,300	500.00	4,650,000
エスベック	15,000	2,045.00	30,675,000
キーエンス	162,700	54,880.00	8,928,976,000
日置電機	8,700	6,520.00	56,724,000
シスメックス	152,100	8,771.00	1,334,069,100
日本マイクロニクス	31,800	1,742.00	55,395,600
メガチップス	16,900	3,940.00	66,586,000
O B A R A G R O U P	8,400	3,095.00	25,998,000
澤藤電機	2,800	1,542.00	4,317,600
原田工業	9,400	990.00	9,306,000
コーセル	21,000	825.00	17,325,000
イリソ電子工業	15,300	4,450.00	68,085,000
オブテックスグループ	30,100	1,600.00	48,160,000
千代田インテグレ	8,000	1,914.00	15,312,000
アイ・オー・データ機器	6,500	1,297.00	8,430,500
レーザーテック	78,900	22,000.00	1,735,800,000
スタンレー電気	125,700	2,876.00	361,513,200
岩崎電気	6,900	2,295.00	15,835,500
ウシオ電機	92,500	1,882.00	174,085,000
岡谷電機産業	15,600	308.00	4,804,800
ヘリオス テクノ ホールディング	18,300	297.00	5,435,100
エノモト	5,500	1,516.00	8,338,000
日本セラミック	17,100	2,478.00	42,373,800
遠藤照明	9,100	1,009.00	9,181,900
古河電池	13,500	1,248.00	16,848,000
双信電機	10,000	569.00	5,690,000
山一電機	13,400	2,034.00	27,255,600
図研	12,000	2,958.00	35,496,000
日本電子	37,500	6,690.00	250,875,000
カシオ計算機	130,000	1,366.00	177,580,000
ファナック	157,600	22,780.00	3,590,128,000
日本シイエムケイ	36,600	625.00	22,875,000
エンプラス	4,800	2,682.00	12,873,600
大真空	25,000	1,145.00	28,625,000
ローム	80,500	9,530.00	767,165,000
浜松ホトニクス	129,000	5,680.00	732,720,000
三井ハイテック	17,700	8,130.00	143,901,000

新光電気工業	52,900	4,990.00	263,971,000
京セラ	252,800	6,862.00	1,734,713,600
太陽誘電	87,300	5,150.00	449,595,000
村田製作所	527,700	8,116.00	4,282,813,200
双葉電子工業	32,100	683.00	21,924,300
北陸電気工業	7,400	1,306.00	9,664,400
ニチコン	57,200	1,281.00	73,273,200
日本ケミコン	17,100	1,939.00	33,156,900
K O A	27,700	1,467.00	40,635,900
市光工業	23,300	524.00	12,209,200
小糸製作所	98,800	6,200.00	612,560,000
ミツバ	33,000	403.00	13,299,000
S C R E E Nホールディングス	31,200	12,010.00	374,712,000
キャノン電子	17,000	1,597.00	27,149,000
キャノン	892,400	2,827.50	2,523,261,000
リコー	498,400	1,063.00	529,799,200
象印マホービン	49,200	1,435.00	70,602,000
M U T O Hホールディングス	2,700	2,117.00	5,715,900
東京エレクトロン	114,000	58,220.00	6,637,080,000
トヨタ紡織	73,200	2,165.00	158,478,000
芦森工業	3,400	908.00	3,087,200
ユニプレス	26,800	812.00	21,761,600
豊田自動織機	145,300	9,170.00	1,332,401,000
モリタホールディングス	28,800	1,258.00	36,230,400
三櫻工業	24,800	723.00	17,930,400
デンソー	395,400	8,523.00	3,369,994,200
東海理化電機製作所	47,300	1,579.00	74,686,700
川崎重工業	131,100	2,110.00	276,621,000
名村造船所	53,900	249.00	13,421,100
日本車輛製造	6,500	2,057.00	13,370,500
三菱ロジスネクスト	23,800	995.00	23,681,000
近畿車輛	2,700	1,075.00	2,902,500
日産自動車	2,118,000	608.50	1,288,803,000
いすゞ自動車	563,500	1,591.00	896,528,500
トヨタ自動車	9,096,700	2,160.50	19,653,420,350
日野自動車	224,300	1,095.00	245,608,500
三菱自動車工業	664,700	335.00	222,674,500
エフテック	12,500	546.00	6,825,000
レシップホールディングス	7,100	549.00	3,897,900
G M B	3,200	787.00	2,518,400
ファルテック	3,100	703.00	2,179,300
武蔵精密工業	40,000	1,927.00	77,080,000

日産車体	26,300	679.00	17,857,700
新明和工業	50,700	936.00	47,455,200
極東開発工業	33,400	1,494.00	49,899,600
トピー工業	14,800	1,123.00	16,620,400
ティラド	5,100	2,537.00	12,938,700
曙ブレーキ工業	98,600	173.00	17,057,800
タチエス	31,400	1,151.00	36,141,400
N O K	86,900	1,242.00	107,929,800
フタバ産業	45,000	408.00	18,360,000
K Y B	18,700	3,100.00	57,970,000
大同メタル工業	34,400	635.00	21,844,000
プレス工業	89,000	389.00	34,621,000
ミクニ	22,800	418.00	9,530,400
太平洋工業	37,600	1,046.00	39,329,600
河西工業	22,000	292.00	6,424,000
アイシン	131,400	4,435.00	582,759,000
マツダ	563,600	926.00	521,893,600
今仙電機製作所	11,800	589.00	6,950,200
本田技研工業	1,414,000	3,681.00	5,204,934,000
スズキ	410,800	4,776.00	1,961,980,800
S U B A R U	514,600	1,959.50	1,008,358,700
安永	8,700	854.00	7,429,800
ヤマハ発動機	234,300	2,713.00	635,655,900
T B K	19,700	407.00	8,017,900
エクセディ	27,100	1,722.00	46,666,200
豊田合成	58,000	2,275.00	131,950,000
愛三工業	28,100	744.00	20,906,400
盟和産業	2,500	1,003.00	2,507,500
日本プラスト	14,100	558.00	7,867,800
ヨロズ	16,800	970.00	16,296,000
エフ・シー・シー	29,400	1,458.00	42,865,200
シマノ	72,100	26,600.00	1,917,860,000
テイ・エス テック	75,800	1,589.00	120,446,200
ジャムコ	10,500	822.00	8,631,000
テルモ	508,200	3,771.00	1,916,422,200
クリエートメディック	5,400	975.00	5,265,000
日機装	53,900	796.00	42,904,400
日本エム・ディ・エム	10,400	1,568.00	16,307,200
島津製作所	231,100	4,105.00	948,665,500
J M S	15,200	621.00	9,439,200
長野計器	13,000	1,306.00	16,978,000
ブイ・テクノロジー	7,900	3,520.00	27,808,000



東京計器	11,500	1,043.00	11,994,500
愛知時計電機	7,800	1,883.00	14,687,400
インターアクション	9,000	2,037.00	18,333,000
オーバル	16,200	272.00	4,406,400
東京精密	30,300	4,845.00	146,803,500
マニー	71,600	1,635.00	117,066,000
ニコン	274,300	1,365.00	374,419,500
トプコン	84,500	1,529.00	129,200,500
オリンパス	941,800	2,268.50	2,136,473,300
理研計器	14,500	4,835.00	70,107,500
タムロン	14,000	2,359.00	33,026,000
H O Y A	350,400	15,485.00	5,425,944,000
シード	8,400	507.00	4,258,800
ノーリツ鋼機	16,200	1,879.00	30,439,800
エー・アンド・デイ	16,400	925.00	15,170,000
朝日インテック	196,900	2,197.00	432,589,300
シチズン時計	210,400	511.00	107,514,400
リズム	5,600	1,420.00	7,952,000
大研医器	14,300	531.00	7,593,300
メニコン	59,600	2,925.00	174,330,000
シンシア	2,000	497.00	994,000
松風	7,500	1,838.00	13,785,000
セイコーホールディングス	25,400	2,347.00	59,613,800
ニプロ	133,900	1,081.00	144,745,900
中本パックス	5,000	1,702.00	8,510,000
スノーピーク	23,400	2,760.00	64,584,000
パラマウントベッドホールディングス	34,400	1,974.00	67,905,600
トランザクション	9,800	1,034.00	10,133,200
粧美堂	5,200	416.00	2,163,200
ニホンフラッシュ	15,400	1,073.00	16,524,200
前田工織	19,800	3,170.00	62,766,000
永大産業	23,500	305.00	7,167,500
アートネイチャー	15,300	743.00	11,367,900
バンダイナムコホールディングス	160,900	7,838.00	1,261,134,200
アイフィスジャパン	4,600	686.00	3,155,600
共立印刷	30,100	152.00	4,575,200
S H O E I	16,800	4,540.00	76,272,000
フランスベッドホールディングス	23,100	912.00	21,067,200
パイロットコーポレーション	30,300	4,655.00	141,046,500
萩原工業	11,600	1,233.00	14,302,800
フジシールインターナショナル	43,600	1,756.00	76,561,600
タカラトミー	75,200	1,284.00	96,556,800

広済堂ホールディングス	11,100	854.00	9,479,400
エステールホールディングス	4,300	654.00	2,812,200
タカノ	6,100	709.00	4,324,900
プロネクサス	13,900	1,076.00	14,956,400
ホクシン	12,700	152.00	1,930,400
ウッドワン	5,500	1,029.00	5,659,500
大建工業	10,600	2,316.00	24,549,600
凸版印刷	273,000	2,319.00	633,087,000
大日本印刷	212,300	2,990.00	634,777,000
共同印刷	5,100	2,781.00	14,183,100
N I S S H A	36,900	1,395.00	51,475,500
光村印刷	1,600	1,519.00	2,430,400
TAKARA & COMPANY	8,900	1,847.00	16,438,300
アシックス	158,800	2,248.00	356,982,400
ツツミ	4,500	1,815.00	8,167,500
ローランド	12,500	4,135.00	51,687,500
小松ウオール工業	5,500	1,869.00	10,279,500
ヤマハ	104,400	5,430.00	566,892,000
河合楽器製作所	5,000	3,005.00	15,025,000
クリナップ	16,700	550.00	9,185,000
ピジョン	108,500	2,281.00	247,488,500
兼松サステック	1,200	1,710.00	2,052,000
キングジム	14,600	878.00	12,818,800
リンテック	38,500	2,700.00	103,950,000
イトーキ	33,100	361.00	11,949,100
任天堂	101,400	58,760.00	5,958,264,000
三菱鉛筆	29,600	1,277.00	37,799,200
タカラスタANDARD	37,100	1,369.00	50,789,900
コクヨ	86,100	1,601.00	137,846,100
ナカバヤシ	16,100	508.00	8,178,800
グローブライド	16,100	2,758.00	44,403,800
オカムラ	61,700	1,172.00	72,312,400
美津濃	17,800	2,296.00	40,868,800
東京電力ホールディングス	1,344,000	364.00	489,216,000
中部電力	549,400	1,136.00	624,118,400
関西電力	680,400	1,163.00	791,305,200
中国電力	280,600	902.00	253,101,200
北陸電力	164,200	557.00	91,459,400
東北電力	420,600	739.00	310,823,400
四国電力	161,700	810.00	130,977,000
九州電力	370,100	846.00	313,104,600
北海道電力	156,100	503.00	78,518,300

沖縄電力	38,100	1,416.00	53,949,600
電源開発	153,100	1,896.00	290,277,600
エフオン	10,900	534.00	5,820,600
イーレックス	26,400	1,699.00	44,853,600
レノバ	35,100	1,386.00	48,648,600
東京瓦斯	344,200	2,341.00	805,772,200
大阪瓦斯	325,300	2,116.00	688,334,800
東邦瓦斯	82,400	3,080.00	253,792,000
北海道瓦斯	8,900	1,513.00	13,465,700
広島ガス	34,200	354.00	12,106,800
西部ガスホールディングス	20,200	2,228.00	45,005,600
静岡ガス	46,700	870.00	40,629,000
メタウォーター	18,600	2,052.00	38,167,200
SBSホールディングス	13,300	3,020.00	40,166,000
東武鉄道	175,500	3,015.00	529,132,500
相鉄ホールディングス	57,500	2,346.00	134,895,000
東急	452,900	1,630.00	738,227,000
京浜急行電鉄	230,600	1,299.00	299,549,400
小田急電鉄	267,100	2,234.00	596,701,400
京王電鉄	93,200	5,470.00	509,804,000
京成電鉄	125,000	3,520.00	440,000,000
富士急行	21,400	4,275.00	91,485,000
新京成電鉄	4,100	2,022.00	8,290,200
東日本旅客鉄道	316,100	7,278.00	2,300,575,800
西日本旅客鉄道	217,700	5,207.00	1,133,563,900
東海旅客鉄道	149,300	16,350.00	2,441,055,000
西武ホールディングス	234,500	1,296.00	303,912,000
鴻池運輸	28,600	1,182.00	33,805,200
西日本鉄道	49,800	2,790.00	138,942,000
ハマキョウレックス	12,700	2,894.00	36,753,800
サカイ引越センター	8,300	4,535.00	37,640,500
近鉄グループホールディングス	170,100	3,720.00	632,772,000
阪急阪神ホールディングス	212,700	3,600.00	765,720,000
南海電気鉄道	75,900	2,444.00	185,499,600
京阪ホールディングス	75,700	3,140.00	237,698,000
神戸電鉄	4,000	3,390.00	13,560,000
名古屋鉄道	139,800	2,182.00	305,043,600
山陽電気鉄道	13,100	1,992.00	26,095,200
アルプス物流	11,900	1,075.00	12,792,500
ヤマトホールディングス	238,300	2,188.00	521,400,400
山九	44,800	4,005.00	179,424,000
丸運	9,700	243.00	2,357,100

丸全昭和運輸	13,800	3,175.00	43,815,000
センコーグループホールディングス	85,300	933.00	79,584,900
トナミホールディングス	4,100	3,815.00	15,641,500
ニッコンホールディングス	57,100	2,165.00	123,621,500
日本石油輸送	1,900	2,654.00	5,042,600
福山通運	28,000	4,005.00	112,140,000
セイノーホールディングス	115,800	1,216.00	140,812,800
エスライン	5,100	911.00	4,646,100
神奈川中央交通	4,200	3,520.00	14,784,000
日立物流	32,800	5,810.00	190,568,000
丸和運輸機関	35,900	1,087.00	39,023,300
C & F ロジホールディングス	17,200	1,247.00	21,448,400
九州旅客鉄道	131,600	2,650.00	348,740,000
S Gホールディングス	321,400	2,503.00	804,464,200
NIPPON EXPRESSホールディングス	58,900	7,470.00	439,983,000
日本郵船	142,600	10,000.00	1,426,000,000
商船三井	94,500	9,040.00	854,280,000
川崎汽船	52,400	7,540.00	395,096,000
NSユナイテッド海運	10,200	4,115.00	41,973,000
飯野海運	83,400	831.00	69,305,400
共栄タンカー	6,400	1,026.00	6,566,400
乾汽船	11,600	2,939.00	34,092,400
日本航空	390,000	2,411.00	940,290,000
ANAホールディングス	432,000	2,664.50	1,151,064,000
パスコ	3,200	1,334.00	4,268,800
トランコム	4,700	7,280.00	34,216,000
日新	13,600	1,718.00	23,364,800
三菱倉庫	53,900	2,805.00	151,189,500
三井倉庫ホールディングス	18,000	2,326.00	41,868,000
住友倉庫	60,100	2,143.00	128,794,300
澁澤倉庫	10,200	2,213.00	22,572,600
東陽倉庫	28,500	318.00	9,063,000
日本トランスシティ	37,400	618.00	23,113,200
ケイヒン	2,900	1,406.00	4,077,400
中央倉庫	10,400	982.00	10,212,800
川西倉庫	3,100	1,114.00	3,453,400
安田倉庫	14,000	981.00	13,734,000
ファイズホールディングス	3,600	602.00	2,167,200
東洋埠頭	5,200	1,467.00	7,628,400
上組	93,600	2,198.00	205,732,800
サンリツ	4,700	839.00	3,943,300
キムラユニティー	4,400	1,363.00	5,997,200

キューソー流通システム	8,500	965.00	8,202,500
近鉄エクスプレス	32,100	2,950.00	94,695,000
東海運	9,700	307.00	2,977,900
エーアイティー	10,700	1,403.00	15,012,100
内外トランスライン	6,600	1,900.00	12,540,000
日本コンセプト	5,400	1,400.00	7,560,000
NEC ネットズエスアイ	58,400	1,737.00	101,440,800
クロスキャット	4,700	1,793.00	8,427,100
システナ	251,900	381.00	95,973,900
デジタルアーツ	9,500	6,150.00	58,425,000
日鉄ソリューションズ	25,600	3,575.00	91,520,000
キューブシステム	9,100	922.00	8,390,200
WOW WORLD	2,600	1,124.00	2,922,400
コア	7,600	1,538.00	11,688,800
ラクーンホールディングス	12,700	1,167.00	14,820,900
ソリトンシステムズ	8,900	1,520.00	13,528,000
ソフトクリエイイトホールディングス	7,700	4,120.00	31,724,000
T I S	168,100	2,635.00	442,943,500
J N Sホールディングス	8,100	416.00	3,369,600
グリー	80,400	841.00	67,616,400
G M Oペパボ	1,900	2,336.00	4,438,400
コーエーテクモホールディングス	56,300	4,000.00	225,200,000
三菱総合研究所	7,600	3,640.00	27,664,000
電算	2,000	2,289.00	4,578,000
A G S	9,200	797.00	7,332,400
ファインデックス	15,100	694.00	10,479,400
ブレインパッド	13,900	1,099.00	15,276,100
K L a b	32,300	412.00	13,307,600
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	25,700	1,014.00	26,059,800
ネクソン	397,700	2,394.00	952,093,800
アイスタイル	46,400	192.00	8,908,800
エムアップホールディングス	20,600	868.00	17,880,800
エイチーム	12,400	732.00	9,076,800
エニグモ	19,300	675.00	13,027,500
テクノスジャパン	14,000	443.00	6,202,000
コロプラ	58,200	643.00	37,422,600
ブロードリーフ	87,900	326.00	28,655,400
クロス・マーケティンググループ	6,900	992.00	6,844,800
デジタルハーツホールディングス	8,100	1,508.00	12,214,800
システム情報	13,400	1,002.00	13,426,800
メディアドゥ	6,300	2,480.00	15,624,000
じげん	50,400	299.00	15,069,600

ブイキューブ	18,200	743.00	13,522,600
エンカレッジ・テクノロジー	4,200	525.00	2,205,000
サイバーリンクス	6,100	896.00	5,465,600
フィックスターズ	19,000	707.00	13,433,000
CARTA HOLDINGS	7,200	2,419.00	17,416,800
オブティム	12,500	868.00	10,850,000
セレス	6,600	1,409.00	9,299,400
SHIFT	8,900	19,770.00	175,953,000
ティーガイア	15,700	1,720.00	27,004,000
セック	2,700	2,109.00	5,694,300
テクマトリックス	29,900	1,593.00	47,630,700
プロシップ	5,900	1,395.00	8,230,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,800	2,778.00	127,232,400
GMOペイメントゲートウェイ	34,200	10,230.00	349,866,000
ザッパラス	7,200	484.00	3,484,800
システムリサーチ	5,200	1,780.00	9,256,000
インターネットイニシアティブ	47,000	3,410.00	160,270,000
さくらインターネット	19,200	522.00	10,022,400
ヴィンクス	5,100	955.00	4,870,500
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,000	3,865.00	15,460,000
SRAホールディングス	8,600	2,899.00	24,931,400
システムインテグレータ	5,900	538.00	3,174,200
朝日ネット	16,400	592.00	9,708,800
eBASE	21,300	591.00	12,588,300
アバント	19,000	1,034.00	19,646,000
アドソル日進	6,400	1,605.00	10,272,000
ODKソリューションズ	3,900	649.00	2,531,100
フリービット	9,300	906.00	8,425,800
コムチュア	19,800	2,755.00	54,549,000
サイバーコム	2,900	980.00	2,842,000
アステリア	12,900	724.00	9,339,600
アイル	9,900	1,310.00	12,969,000
マークライnz	8,900	2,570.00	22,873,000
メディカル・データ・ビジョン	22,500	1,017.00	22,882,500
gumi	24,700	566.00	13,980,200
ショーケース	4,200	440.00	1,848,000
モバイルファクトリー	4,200	923.00	3,876,600
テラスカイ	6,500	1,429.00	9,288,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,900	1,304.00	10,301,600
PCIホールディングス	8,100	947.00	7,670,700
パイブドHD	3,300	2,573.00	8,490,900
アイビーシー	3,100	565.00	1,751,500

ネオジャパン	5,200	1,058.00	5,501,600
P R T I M E S	3,800	2,925.00	11,115,000
ラクス	60,700	1,753.00	106,407,100
ランドコンピュータ	4,200	855.00	3,591,000
ダブルスタンダード	5,400	1,871.00	10,103,400
オープンドア	10,600	2,080.00	22,048,000
マイネット	6,300	485.00	3,055,500
アカツキ	7,900	2,878.00	22,736,200
ベネフィットジャパン	1,400	1,913.00	2,678,200
U b i c o mホールディングス	4,700	1,927.00	9,056,900
カナミックネットワーク	19,200	432.00	8,294,400
ノムラシステムコーポレーション	9,700	220.00	2,134,000
チェンジ	32,600	1,591.00	51,866,600
シンクロ・フード	9,500	250.00	2,375,000
オークネット	9,500	1,493.00	14,183,500
キャピタル・アセット・プランニング	3,700	774.00	2,863,800
セグエグループ	4,800	536.00	2,572,800
エイトレッド	2,600	1,957.00	5,088,200
マクロミル	36,500	1,200.00	43,800,000
ビーグリー	4,300	1,208.00	5,194,400
オロ	5,600	2,377.00	13,311,200
ユーザーローカル	5,500	1,519.00	8,354,500
テモナ	4,200	401.00	1,684,200
ニーズウェル	4,200	606.00	2,545,200
マネーフォワード	26,800	4,555.00	122,074,000
サインポスト	5,700	866.00	4,936,200
電算システムホールディングス	7,300	2,724.00	19,885,200
ソルクシーズ	15,400	412.00	6,344,800
フェイス	4,900	699.00	3,425,100
プロトコーポレーション	18,800	1,266.00	23,800,800
ハイマックス	4,800	1,196.00	5,740,800
野村総合研究所	340,600	3,790.00	1,290,874,000
サイバネットシステム	12,800	636.00	8,140,800
C Eホールディングス	9,700	463.00	4,491,100
日本システム技術	3,500	2,080.00	7,280,000
インテージホールディングス	20,400	1,791.00	36,536,400
東邦システムサイエンス	4,800	920.00	4,416,000
ソースネクスト	77,100	150.00	11,565,000
インフォコム	19,400	2,058.00	39,925,200
シンプレクス・ホールディングス	19,100	1,642.00	31,362,200
H E R O Z	5,200	864.00	4,492,800
ラクスル	19,300	3,185.00	61,470,500

I P S	4,900	1,976.00	9,682,400
F I G	19,700	283.00	5,575,100
システムサポート	5,400	1,021.00	5,513,400
イーソル	11,100	490.00	5,439,000
アルテリア・ネットワークス	22,400	1,315.00	29,456,000
東海ソフト	2,900	904.00	2,621,600
ウイングアーク1 s t	10,200	1,282.00	13,076,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,100	1,728.00	7,084,800
サーバーワークス	3,100	2,323.00	7,201,300
東名	1,800	954.00	1,717,200
ヴィッツ	1,800	1,217.00	2,190,600
トピラシステムズ	3,700	815.00	3,015,500
S a n s a n	62,800	1,027.00	64,495,600
L i n k - U	3,400	752.00	2,556,800
ギフティ	16,200	892.00	14,450,400
ベース	3,000	4,810.00	14,430,000
J M D C	16,600	5,660.00	93,956,000
フォーカスシステムズ	12,000	912.00	10,944,000
クレスコ	12,900	1,719.00	22,175,100
フジ・メディア・ホールディングス	169,900	1,284.00	218,151,600
オービック	55,500	18,400.00	1,021,200,000
ジャストシステム	25,100	5,340.00	134,034,000
T D C ソフト	15,600	1,104.00	17,222,400
Zホールディングス	2,561,700	546.30	1,399,456,710
トレンドマイクロ	94,200	6,000.00	565,200,000
I Dホールディングス	11,300	850.00	9,605,000
日本オラクル	28,600	8,100.00	231,660,000
アルファシステムズ	4,700	3,675.00	17,272,500
フューチャー	37,300	1,338.00	49,907,400
C A C H o l d i n g s	10,400	1,304.00	13,561,600
S B テクノロジー	7,700	2,487.00	19,149,900
トーセ	5,000	726.00	3,630,000
オービックビジネスコンサルタント	16,900	4,170.00	70,473,000
伊藤忠テクノソリューションズ	80,300	2,924.00	234,797,200
アイティフォー	21,600	780.00	16,848,000
東計電算	2,100	4,915.00	10,321,500
エクスネット	2,900	983.00	2,850,700
大塚商会	95,400	4,270.00	407,358,000
サイボウズ	23,700	1,320.00	31,284,000
電通国際情報サービス	25,500	3,650.00	93,075,000
A C C E S S	20,200	579.00	11,695,800
デジタルガレージ	29,200	3,960.00	115,632,000



EMシステムズ	29,300	710.00	20,803,000
ウェザーニューズ	5,400	7,550.00	40,770,000
C I J	11,600	801.00	9,291,600
ビジネスエンジニアリング	2,100	3,560.00	7,476,000
日本エンタープライズ	18,900	169.00	3,194,100
WOWOW	8,500	1,750.00	14,875,000
スカラ	15,000	675.00	10,125,000
インテリジェント ウェイブ	9,100	566.00	5,150,600
I M A G I C A G R O U P	15,300	625.00	9,562,500
ネットワンシステムズ	67,200	2,800.00	188,160,000
システムソフト	39,600	93.00	3,682,800
アルゴグラフィックス	13,800	3,115.00	42,987,000
マーベラス	28,000	726.00	20,328,000
エイベックス	30,500	1,337.00	40,778,500
日本ユニシス	55,100	3,060.00	168,606,000
兼松エレクトロニクス	9,600	3,880.00	37,248,000
都築電気	9,100	1,377.00	12,530,700
T B S ホールディングス	107,200	1,941.00	208,075,200
日本テレビホールディングス	147,200	1,359.00	200,044,800
朝日放送グループホールディングス	17,700	761.00	13,469,700
テレビ朝日ホールディングス	42,500	1,659.00	70,507,500
スカパーJ S A Tホールディングス	149,600	449.00	67,170,400
テレビ東京ホールディングス	12,700	2,148.00	27,279,600
日本BS放送	6,100	1,070.00	6,527,000
ビジョン	30,300	1,166.00	35,329,800
スマートバリュー	4,400	448.00	1,971,200
U S E N - N E X T H O L D I N G S	16,800	2,376.00	39,916,800
ワイヤレスゲート	7,800	298.00	2,324,400
コネクシオ	12,600	1,410.00	17,766,000
クロップス	3,400	889.00	3,022,600
日本電信電話	1,843,600	3,288.00	6,061,756,800
K D D I	1,284,800	3,780.00	4,856,544,000
ソフトバンク	2,669,300	1,443.00	3,851,799,900
光通信	20,300	14,490.00	294,147,000
エムティーアイ	17,400	489.00	8,508,600
G M O インターネット	62,500	2,493.00	155,812,500
ファイバーゲート	5,900	1,228.00	7,245,200
アйдママーケティングコミュニケーション	4,400	291.00	1,280,400
K A D O K A W A	96,300	2,462.00	237,090,600
学研ホールディングス	25,100	1,006.00	25,250,600
ゼンリン	28,900	1,058.00	30,576,200
昭文社ホールディングス	7,500	443.00	3,322,500

インプレスホールディングス	14,600	205.00	2,993,000	
アイネット	9,200	1,272.00	11,702,400	
松竹	11,700	12,290.00	143,793,000	
東宝	104,000	4,775.00	496,600,000	
東映	5,800	17,370.00	100,746,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	469,300	2,101.00	985,999,300	
ピー・シー・エー	10,400	1,508.00	15,683,200	
ビジネスブレイン太田昭和	6,100	1,486.00	9,064,600	
D T S	33,800	2,716.00	91,800,800	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	82,000	5,530.00	453,460,000	
シーイーシー	19,000	1,078.00	20,482,000	
カブコン	166,200	2,790.00	463,698,000	
アイ・エス・ピー	8,400	969.00	8,139,600	
ジャステック	10,400	1,061.00	11,034,400	
S C S K	122,100	1,926.00	235,164,600	
日本システムウエア	6,700	2,109.00	14,130,300	
アイネス	16,100	1,531.00	24,649,100	
T K C	29,900	3,060.00	91,494,000	
富士ソフト	18,800	5,220.00	98,136,000	
N S D	56,700	2,148.00	121,791,600	
コナミホールディングス	64,000	6,660.00	426,240,000	
福井コンピュータホールディングス	8,100	3,010.00	24,381,000	
J B C Cホールディングス	12,000	1,456.00	17,472,000	
ミロク情報サービス	15,700	1,401.00	21,995,700	
ソフトバンクグループ	1,056,800	5,117.00	5,407,645,600	
ハウスイ	1,400	821.00	1,149,400	
高千穂交易	6,800	1,552.00	10,553,600	
オルバヘルスケアホールディングス	2,900	1,505.00	4,364,500	
伊藤忠食品	4,300	5,060.00	21,758,000	
エレマテック	14,200	1,088.00	15,449,600	
J A L U X	5,000	2,556.00	12,780,000	
あらた	14,100	3,905.00	55,060,500	
トーメンデバイス	2,700	6,280.00	16,956,000	
東京エレクトロン デバイス	5,200	5,380.00	27,976,000	
フィールズ	15,500	657.00	10,183,500	
双日	195,400	1,958.00	382,593,200	
アルフレッサ ホールディングス	196,600	1,746.00	343,263,600	
横浜冷凍	49,600	877.00	43,499,200	
ラサ商事	9,400	1,011.00	9,503,400	
アルコニックス	22,000	1,357.00	29,854,000	
神戸物産	137,300	3,805.00	522,426,500	
ハイパー	4,500	479.00	2,155,500	

あい ホールディングス	25,300	1,765.00	44,654,500
ディーブイエックス	6,000	1,064.00	6,384,000
ダイワボウホールディングス	86,000	1,773.00	152,478,000
マクニカ・富士エレホールディングス	42,200	2,633.00	111,112,600
ラクト・ジャパン	6,100	2,015.00	12,291,500
グリムス	7,900	2,072.00	16,368,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30,800	806.00	24,824,800
八洲電機	12,800	963.00	12,326,400
メディアスホールディングス	10,100	896.00	9,049,600
レスターホールディングス	16,800	1,977.00	33,213,600
ジューテックホールディングス	4,100	1,219.00	4,997,900
大光	6,900	700.00	4,830,000
O C H Iホールディングス	5,200	1,338.00	6,957,600
T O K A Iホールディングス	85,700	909.00	77,901,300
黒谷	4,900	656.00	3,214,400
C o m i n i x	3,100	741.00	2,297,100
三洋貿易	17,800	1,025.00	18,245,000
ビューティガレージ	2,900	3,250.00	9,425,000
ウイン・パートナーズ	12,800	1,050.00	13,440,000
ミタチ産業	4,500	870.00	3,915,000
シップヘルスケアホールディングス	56,700	2,367.00	134,208,900
明治電機工業	5,600	1,265.00	7,084,000
デリカフーズホールディングス	6,900	550.00	3,795,000
スターティアホールディングス	4,000	640.00	2,560,000
コメダホールディングス	38,600	2,146.00	82,835,600
ピーバンドットコム	2,500	592.00	1,480,000
アセンテック	6,100	690.00	4,209,000
富士興産	4,400	944.00	4,153,600
協栄産業	1,800	1,500.00	2,700,000
フルサト・マルカホールディングス	17,000	2,270.00	38,590,000
ヤマエグループホールディングス	11,900	1,066.00	12,685,400
小野建	17,200	1,625.00	27,950,000
南陽	3,600	1,940.00	6,984,000
佐島電機	11,000	912.00	10,032,000
エコートレーディング	3,800	599.00	2,276,200
伯東	10,800	2,355.00	25,434,000
コンドーテック	13,700	1,021.00	13,987,700
中山福	9,400	407.00	3,825,800
ナガイレーベン	23,500	2,116.00	49,726,000
三菱食品	17,000	3,165.00	53,805,000
松田産業	12,900	2,207.00	28,470,300
第一興商	33,600	3,715.00	124,824,000

メディバルホールディングス	190,900	2,087.00	398,408,300
S P K	7,000	1,311.00	9,177,000
萩原電気ホールディングス	6,600	2,025.00	13,365,000
アズワン	25,400	6,430.00	163,322,000
スズデン	6,100	2,054.00	12,529,400
尾家産業	4,700	1,007.00	4,732,900
シモジマ	10,900	1,013.00	11,041,700
ドウシシャ	16,700	1,551.00	25,901,700
小津産業	3,900	2,015.00	7,858,500
高速	10,600	1,525.00	16,165,000
たけびし	6,600	1,451.00	9,576,600
リックス	4,000	1,586.00	6,344,000
丸文	15,700	723.00	11,351,100
ハビネット	14,800	1,589.00	23,517,200
橋本総業ホールディングス	3,600	2,021.00	7,275,600
日本ライフライン	52,400	1,026.00	53,762,400
タカショー	13,500	671.00	9,058,500
I D O M	53,700	656.00	35,227,200
進和	10,500	2,029.00	21,304,500
エスケイジャパン	4,400	423.00	1,861,200
ダイトロン	7,500	1,833.00	13,747,500
シークス	25,300	1,234.00	31,220,200
田中商事	5,500	650.00	3,575,000
オーハシテクニカ	9,500	1,365.00	12,967,500
白銅	5,700	2,642.00	15,059,400
ダイコー通産	2,100	1,172.00	2,461,200
伊藤忠商事	1,237,200	3,849.00	4,761,982,800
丸紅	1,744,800	1,228.50	2,143,486,800
高島	2,600	2,379.00	6,185,400
長瀬産業	97,100	1,889.00	183,421,900
蝶理	9,900	1,808.00	17,899,200
豊田通商	177,700	5,120.00	909,824,000
三共生興	23,500	570.00	13,395,000
兼松	66,000	1,380.00	91,080,000
ツカモトコーポレーション	2,900	1,342.00	3,891,800
三井物産	1,373,600	3,098.00	4,255,412,800
日本紙パルプ商事	9,200	4,100.00	37,720,000
カメイ	21,000	1,053.00	22,113,000
東都水産	900	3,910.00	3,519,000
O U Gホールディングス	2,600	2,743.00	7,131,800
スターゼン	13,100	2,132.00	27,929,200
山善	74,400	1,028.00	76,483,200

椿本興業	3,600	4,165.00	14,994,000
住友商事	1,116,400	1,912.00	2,134,556,800
内田洋行	7,600	4,645.00	35,302,000
三菱商事	1,325,400	4,120.00	5,460,648,000
第一実業	8,000	4,310.00	34,480,000
キャノンマーケティングジャパン	43,900	2,498.00	109,662,200
西華産業	9,300	1,609.00	14,963,700
佐藤商事	14,600	1,213.00	17,709,800
菱洋エレクトロ	10,500	2,149.00	22,564,500
東京産業	16,000	704.00	11,264,000
ユアサ商事	16,800	2,978.00	50,030,400
神鋼商事	4,000	3,830.00	15,320,000
トルク	9,500	222.00	2,109,000
阪和興業	35,400	3,345.00	118,413,000
正栄食品工業	11,500	4,175.00	48,012,500
カナデン	14,400	1,006.00	14,486,400
菱電商事	14,000	1,776.00	24,864,000
岩谷産業	42,500	5,370.00	228,225,000
ナイス	6,100	1,888.00	11,516,800
ニチモウ	2,500	2,843.00	7,107,500
極東貿易	5,100	2,353.00	12,000,300
アステナホールディングス	25,000	420.00	10,500,000
三愛石油	43,600	945.00	41,202,000
稲畑産業	39,000	2,450.00	95,550,000
G S I クレオス	8,500	1,141.00	9,698,500
明和産業	16,300	1,118.00	18,223,400
クワザワホールディングス	7,000	606.00	4,242,000
ワキタ	37,700	1,023.00	38,567,100
東邦ホールディングス	56,800	1,881.00	106,840,800
サンゲツ	46,800	1,586.00	74,224,800
ミツウロコグループホールディングス	26,100	1,085.00	28,318,500
シナネンホールディングス	6,600	3,295.00	21,747,000
伊藤忠エネクス	39,100	1,040.00	40,664,000
サンリオ	54,600	2,488.00	135,844,800
サンワテクノス	10,800	1,390.00	15,012,000
リョーサン	19,500	2,349.00	45,805,500
新光商事	26,500	908.00	24,062,000
トーホー	8,000	1,073.00	8,584,000
三信電気	8,100	1,682.00	13,624,200
東陽テクニカ	17,500	1,089.00	19,057,500
モスフードサービス	23,200	3,020.00	70,064,000
加賀電子	16,000	3,275.00	52,400,000

ソーダニッカ	17,400	853.00	14,842,200
立花エレテック	14,200	1,600.00	22,720,000
フォーバル	7,800	854.00	6,661,200
PALTAC	24,800	4,525.00	112,220,000
三谷産業	20,800	315.00	6,552,000
西本Wismettacホールディングス	4,000	2,889.00	11,556,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,600	2,000.00	3,200,000
コア商事ホールディングス	11,100	699.00	7,758,900
国際紙パルプ商事	36,900	360.00	13,284,000
ヤマタネ	8,200	1,629.00	13,357,800
丸紅建材リース	1,600	1,784.00	2,854,400
日鉄物産	12,600	5,350.00	67,410,000
泉州電業	4,800	6,310.00	30,288,000
トラスコ中山	36,800	2,541.00	93,508,800
オートバックスセブン	59,500	1,426.00	84,847,000
モリト	12,900	742.00	9,571,800
加藤産業	25,500	3,235.00	82,492,500
北恵	4,500	906.00	4,077,000
イノテック	10,700	1,436.00	15,365,200
イエローハット	30,600	1,626.00	49,755,600
JKホールディングス	14,200	1,088.00	15,449,600
日伝	14,700	2,317.00	34,059,900
北沢産業	12,100	229.00	2,770,900
杉本商事	8,300	2,129.00	17,670,700
因幡電機産業	47,200	2,623.00	123,805,600
東テク	5,900	2,515.00	14,838,500
ミスミグループ本社	222,000	3,600.00	799,200,000
アルテック	12,000	298.00	3,576,000
タキヒヨー	5,300	1,346.00	7,133,800
蔵王産業	3,400	1,889.00	6,422,600
スズケン	69,200	3,595.00	248,774,000
ジェコス	12,200	830.00	10,126,000
グローセル	20,700	441.00	9,128,700
ローソン	39,200	4,845.00	189,924,000
サンエー	13,500	4,065.00	54,877,500
カワチ薬品	13,900	2,377.00	33,040,300
エービーシー・マート	27,700	5,250.00	145,425,000
ハードオフコーポレーション	8,300	806.00	6,689,800
アスクル	40,300	1,663.00	67,018,900
ゲオホールディングス	23,900	1,512.00	36,136,800
アダストリア	19,300	1,733.00	33,446,900
くら寿司	18,600	3,770.00	70,122,000

キャンドウ	6,700	2,060.00	13,802,000
アイケイ	6,200	418.00	2,591,600
パルグループホールディングス	15,700	1,603.00	25,167,100
エディオン	81,500	1,182.00	96,333,000
サーラコーポレーション	36,500	648.00	23,652,000
ワッツ	9,100	711.00	6,470,100
ハローズ	8,200	2,804.00	22,992,800
フジオフードグループ本社	14,900	1,334.00	19,876,600
あみやき亭	4,300	3,005.00	12,921,500
大黒天物産	5,700	4,810.00	27,417,000
ハニーズホールディングス	14,500	1,025.00	14,862,500
ファーマライズホールディングス	4,900	718.00	3,518,200
アルペン	13,300	2,140.00	28,462,000
ハブ	6,400	610.00	3,904,000
クオールホールディングス	22,000	1,332.00	29,304,000
ジーンズホールディングス	12,100	6,630.00	80,223,000
ビックカメラ	105,300	1,010.00	106,353,000
D C Mホールディングス	109,500	1,100.00	120,450,000
MonotaRO	223,800	2,138.00	478,484,400
東京一番フーズ	5,200	596.00	3,099,200
きちりホールディングス	4,700	430.00	2,021,000
アークランドサービスホールディングス	13,100	2,239.00	29,330,900
J.フロント リテイリング	211,600	1,059.00	224,084,400
ドトール・日レスホールディングス	30,800	1,641.00	50,542,800
マツキヨココカラ & カンパニー	108,900	4,270.00	465,003,000
ブロンコビリー	10,300	2,270.00	23,381,000
Z O Z O	121,800	3,085.00	375,753,000
トレジャー・ファクトリー	5,600	976.00	5,465,600
物語コーポレーション	8,800	6,730.00	59,224,000
三越伊勢丹ホールディングス	310,100	977.00	302,967,700
H a m e e	5,000	1,088.00	5,440,000
マーケットエンタープライズ	1,700	646.00	1,098,200
ウエルシアホールディングス	93,600	3,060.00	286,416,000
クリエイトSDホールディングス	26,200	3,140.00	82,268,000
丸善C H Iホールディングス	20,600	369.00	7,601,400
ミサワ	4,200	643.00	2,700,600
ティーライフ	2,700	1,342.00	3,623,400
チムニー	5,400	1,160.00	6,264,000
シュッピン	15,100	1,180.00	17,818,000
オイシックス・ラ・大地	25,600	2,611.00	66,841,600
ネクステージ	35,900	2,561.00	91,939,900
ジョイフル本田	52,500	1,543.00	81,007,500

鳥貴族ホールディングス	6,700	1,876.00	12,569,200
ホットランド	13,500	1,312.00	17,712,000
すかいらーくホールディングス	228,600	1,497.00	342,214,200
SFPホールディングス	8,600	1,438.00	12,366,800
綿半ホールディングス	13,600	1,310.00	17,816,000
ヨシックスホールディングス	3,600	2,247.00	8,089,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	51,800	1,065.00	55,167,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,500	1,102.00	10,469,000
B E E N O S	9,200	1,500.00	13,800,000
あさひ	14,900	1,328.00	19,787,200
日本調剤	11,000	1,396.00	15,356,000
コスモス薬品	17,900	14,890.00	266,531,000
トーエル	9,100	885.00	8,053,500
セブン&アイ・ホールディングス	692,000	5,709.00	3,950,628,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	94,200	763.00	71,874,600
ツルハホールディングス	38,600	9,120.00	352,032,000
サンマルクホールディングス	14,200	1,645.00	23,359,000
フェリシモ	4,200	1,200.00	5,040,000
トリドールホールディングス	44,100	2,676.00	118,011,600
T O K Y O B A S E	17,100	445.00	7,609,500
ウイルプラスホールディングス	3,200	902.00	2,886,400
J Mホールディングス	12,100	1,753.00	21,211,300
サツドラホールディングス	8,600	634.00	5,452,400
アレンザホールディングス	13,800	1,090.00	15,042,000
串カツ田中ホールディングス	4,900	2,120.00	10,388,000
パロックジャパンリミテッド	12,700	869.00	11,036,300
クスリのアオキホールディングス	17,600	6,900.00	121,440,000
力の源ホールディングス	9,000	568.00	5,112,000
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	103,700	3,765.00	390,430,500
メディカルシステムネットワーク	17,900	519.00	9,290,100
はるやまホールディングス	9,000	532.00	4,788,000
ノジマ	28,800	2,580.00	74,304,000
カップ・クリエイト	24,800	1,389.00	34,447,200
ライトオン	13,200	702.00	9,266,400
良品計画	203,700	1,729.00	352,197,300
三城ホールディングス	23,500	247.00	5,804,500
アドヴァングループ	18,400	946.00	17,406,400
アルビス	5,900	2,202.00	12,991,800
コナカ	20,800	358.00	7,446,400
ハウス オブ ローゼ	2,400	1,713.00	4,111,200



G - 7ホールディングス	19,900	1,650.00	32,835,000
イオン北海道	31,300	1,211.00	37,904,300
コジマ	31,100	543.00	16,887,300
ヒマラヤ	6,600	1,009.00	6,659,400
コーナン商事	25,300	3,590.00	90,827,000
エコス	6,700	2,020.00	13,534,000
ワタミ	21,400	970.00	20,758,000
マルシェ	4,300	453.00	1,947,900
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	353,800	1,908.00	675,050,400
西松屋チェーン	39,100	1,376.00	53,801,600
ゼンショーホールディングス	86,500	2,734.00	236,491,000
幸楽苑ホールディングス	11,200	1,408.00	15,769,600
ハークスレイ	8,200	473.00	3,878,600
サイゼリヤ	26,400	2,954.00	77,985,600
V Tホールディングス	67,400	489.00	32,958,600
魚力	5,100	2,088.00	10,648,800
フジ・コーポレーション	9,700	1,166.00	11,310,200
ユナイテッドアローズ	18,800	1,779.00	33,445,200
ハイデイ日高	25,800	1,775.00	45,795,000
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	12,400	200.00	2,480,000
コロワイド	72,700	1,750.00	127,225,000
ピーシーデボコーポレーション	21,900	280.00	6,132,000
壱番屋	12,500	4,720.00	59,000,000
P L A N T	5,100	652.00	3,325,200
スギホールディングス	35,400	6,330.00	224,082,000
薬王堂ホールディングス	9,000	2,401.00	21,609,000
スクロール	27,700	916.00	25,373,200
ヨンドシーホールディングス	16,500	1,713.00	28,264,500
木曽路	23,900	2,244.00	53,631,600
S R Sホールディングス	24,900	825.00	20,542,500
リテールパートナーズ	21,800	1,210.00	26,378,000
ケーヨー	32,900	873.00	28,721,700
上新電機	20,500	2,082.00	42,681,000
日本瓦斯	86,200	1,755.00	151,281,000
ロイヤルホールディングス	30,400	2,025.00	61,560,000
いなげや	22,100	1,401.00	30,962,100
チヨダ	17,800	745.00	13,261,000
ライフコーポレーション	16,600	3,020.00	50,132,000
リンガーハット	21,800	2,254.00	49,137,200
M r M a x H D	22,700	613.00	13,915,100
A O K Iホールディングス	34,900	618.00	21,568,200

オークワ	28,000	915.00	25,620,000
コメリ	27,400	2,755.00	75,487,000
青山商事	37,100	767.00	28,455,700
しまむら	20,600	9,950.00	204,970,000
はせがわ	10,700	300.00	3,210,000
高島屋	129,000	1,180.00	152,220,000
松屋	35,900	742.00	26,637,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	84,000	886.00	74,424,000
近鉄百貨店	6,900	2,698.00	18,616,200
丸井グループ	139,700	2,322.00	324,383,400
アクシアル リテイリング	13,800	3,235.00	44,643,000
イオン	680,700	2,642.00	1,798,409,400
イズミ	32,000	3,235.00	103,520,000
平和堂	32,800	1,939.00	63,599,200
フジ	21,500	1,981.00	42,591,500
ヤオコー	20,100	6,540.00	131,454,000
ゼビオホールディングス	24,500	967.00	23,691,500
ケーズホールディングス	163,400	1,266.00	206,864,400
Olympicグループ	9,700	714.00	6,925,800
日産東京販売ホールディングス	27,700	232.00	6,426,400
シルバーライフ	4,000	1,128.00	4,512,000
Genky DrugStores	7,900	3,630.00	28,677,000
ナルミヤ・インターナショナル	4,300	1,016.00	4,368,800
ブックオフグループホールディングス	10,300	1,043.00	10,742,900
ギフト	2,900	2,358.00	6,838,200
アインホールディングス	23,800	6,440.00	153,272,000
元気寿司	5,100	2,575.00	13,132,500
ヤマダホールディングス	647,800	400.00	259,120,000
アークランドサカモト	28,000	1,535.00	42,980,000
ニトリホールディングス	70,200	16,470.00	1,156,194,000
グルメ杵屋	14,400	1,035.00	14,904,000
愛眼	12,900	184.00	2,373,600
ケーユーホールディングス	9,600	1,082.00	10,387,200
吉野家ホールディングス	61,900	2,442.00	151,159,800
松屋フーズホールディングス	8,600	3,660.00	31,476,000
サガミホールディングス	27,400	1,203.00	32,962,200
関西フードマーケット	13,700	1,121.00	15,357,700
王将フードサービス	11,800	6,060.00	71,508,000
プレナス	20,000	2,033.00	40,660,000
ミニストップ	13,200	1,485.00	19,602,000
アークス	33,900	2,173.00	73,664,700
バローホールディングス	39,300	2,222.00	87,324,600

ベルク	7,900	5,250.00	41,475,000
大庄	9,800	1,035.00	10,143,000
ファーストリテイリング	23,700	63,700.00	1,509,690,000
サンドラッグ	66,700	3,090.00	206,103,000
サクスパー ホールディングス	17,400	521.00	9,065,400
ヤマザワ	4,400	1,644.00	7,233,600
やまや	3,600	2,541.00	9,147,600
ペルーナ	38,500	725.00	27,912,500
島根銀行	5,600	572.00	3,203,200
じもとホールディングス	12,600	711.00	8,958,600
めぶきフィナンシャルグループ	920,400	286.00	263,234,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,200	2,049.00	45,487,800
九州フィナンシャルグループ	361,700	430.00	155,531,000
ゆうちょ銀行	418,100	1,026.00	428,970,600
富山第一銀行	42,200	321.00	13,546,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,011,700	498.00	503,826,600
西日本フィナンシャルホールディングス	115,700	869.00	100,543,300
三十三フィナンシャルグループ	16,400	1,554.00	25,485,600
第四北越フィナンシャルグループ	28,800	2,803.00	80,726,400
ひろぎんホールディングス	261,300	705.00	184,216,500
おきなわフィナンシャルグループ	16,000	2,440.00	39,040,000
十六フィナンシャルグループ	23,800	2,479.00	59,000,200
北國フィナンシャルホールディングス	16,500	3,440.00	56,760,000
新生銀行	115,500	2,240.00	258,720,000
あおぞら銀行	98,900	2,708.00	267,821,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,108,500	738.80	8,206,959,800
りそなホールディングス	2,027,400	549.60	1,114,259,040
三井住友トラスト・ホールディングス	334,800	4,235.00	1,417,878,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,226,100	4,321.00	5,297,978,100
千葉銀行	591,100	787.00	465,195,700
群馬銀行	340,300	407.00	138,502,100
武蔵野銀行	26,400	1,968.00	51,955,200
千葉興業銀行	41,600	286.00	11,897,600
筑波銀行	69,000	224.00	15,456,000
七十七銀行	55,600	1,585.00	88,126,000
青森銀行	13,700	1,969.00	26,975,300
秋田銀行	11,300	1,789.00	20,215,700
山形銀行	19,900	1,033.00	20,556,700
岩手銀行	11,600	1,963.00	22,770,800
東邦銀行	147,800	227.00	33,550,600
東北銀行	8,500	1,030.00	8,755,000
みちのく銀行	11,400	900.00	10,260,000

ふくおかフィナンシャルグループ	149,200	2,442.00	364,346,400	
静岡銀行	431,400	917.00	395,593,800	
スルガ銀行	155,300	455.00	70,661,500	
八十二銀行	399,000	449.00	179,151,000	
山梨中央銀行	19,200	981.00	18,835,200	
大垣共立銀行	35,000	2,107.00	73,745,000	
福井銀行	15,100	1,498.00	22,619,800	
清水銀行	7,300	1,651.00	12,052,300	
富山銀行	3,200	2,261.00	7,235,200	
滋賀銀行	33,300	2,310.00	76,923,000	
南都銀行	27,600	2,189.00	60,416,400	
百五銀行	170,000	369.00	62,730,000	
京都銀行	63,400	5,720.00	362,648,000	
紀陽銀行	60,000	1,611.00	96,660,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	110,500	987.00	109,063,500	
山陰合同銀行	105,000	706.00	74,130,000	
中国銀行	141,500	945.00	133,717,500	
鳥取銀行	5,600	1,322.00	7,403,200	
伊予銀行	234,700	648.00	152,085,600	
百十四銀行	18,800	1,809.00	34,009,200	
四国銀行	26,900	820.00	22,058,000	
阿波銀行	27,100	2,390.00	64,769,000	
大分銀行	10,200	2,077.00	21,185,400	
宮崎銀行	11,100	2,304.00	25,574,400	
佐賀銀行	10,000	1,572.00	15,720,000	
琉球銀行	38,500	869.00	33,456,500	
セブン銀行	526,000	249.00	130,974,000	
みずほフィナンシャルグループ	2,265,300	1,610.50	3,648,265,650	
高知銀行	6,400	775.00	4,960,000	
山口フィナンシャルグループ	206,400	747.00	154,180,800	
長野銀行	5,800	1,278.00	7,412,400	
名古屋銀行	13,200	3,290.00	43,428,000	
北洋銀行	267,000	275.00	73,425,000	
愛知銀行	6,400	4,870.00	31,168,000	
中京銀行	6,400	1,697.00	10,860,800	
大光銀行	6,100	1,510.00	9,211,000	
愛媛銀行	24,700	1,003.00	24,774,100	
トマト銀行	6,300	1,069.00	6,734,700	
京葉銀行	75,500	545.00	41,147,500	
栃木銀行	85,600	240.00	20,544,000	
北日本銀行	5,500	1,750.00	9,625,000	
東和銀行	31,100	583.00	18,131,300	

福島銀行	20,300	252.00	5,115,600
大東銀行	8,500	764.00	6,494,000
トモニホールディングス	136,900	373.00	51,063,700
フィデアホールディングス	16,200	1,434.00	23,230,800
池田泉州ホールディングス	203,700	194.00	39,517,800
F P G	59,800	873.00	52,205,400
ジャパンインベストメントアドバイザー	13,900	1,174.00	16,318,600
マーキュリアホールディングス	7,300	534.00	3,898,200
S B Iホールディングス	218,600	3,105.00	678,753,000
ジャフコ グループ	67,800	1,699.00	115,192,200
大和証券グループ本社	1,326,800	692.90	919,339,720
野村ホールディングス	2,704,700	545.30	1,474,872,910
岡三証券グループ	139,700	390.00	54,483,000
丸三証券	52,900	542.00	28,671,800
東洋証券	59,500	156.00	9,282,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	203,800	412.00	83,965,600
光世証券	4,100	473.00	1,939,300
水戸証券	47,900	281.00	13,459,900
いちよし証券	33,400	665.00	22,211,000
松井証券	86,900	821.00	71,344,900
マネックスグループ	144,700	536.00	77,559,200
極東証券	24,000	775.00	18,600,000
岩井コスモホールディングス	16,900	1,409.00	23,812,100
アイザワ証券グループ	29,300	946.00	27,717,800
マネーパートナーズグループ	19,600	236.00	4,625,600
スパークス・グループ	82,500	259.00	21,367,500
かんぽ生命保険	178,300	2,089.00	372,468,700
S O M P Oホールディングス	290,800	5,414.00	1,574,391,200
アニコム ホールディングス	54,400	791.00	43,030,400
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	397,200	3,999.00	1,588,402,800
第一生命ホールディングス	871,900	2,658.00	2,317,510,200
東京海上ホールディングス	583,400	7,061.00	4,119,387,400
T & Dホールディングス	459,800	1,807.00	830,858,600
アドバンスクリエイト	8,500	1,014.00	8,619,000
全国保証	42,300	4,850.00	205,155,000
あんしん保証	6,800	288.00	1,958,400
イントラスト	8,200	585.00	4,797,000
日本モーゲージサービス	10,300	1,021.00	10,516,300
C a s a	6,700	841.00	5,634,700
アルヒ	26,600	1,034.00	27,504,400
プレミアグループ	9,000	4,335.00	39,015,000
ネットプロテクションズホールディングス	40,900	598.00	24,458,200

クレディセゾン	114,100	1,381.00	157,572,100
芙蓉総合リース	18,600	7,920.00	147,312,000
みずほリース	27,500	3,285.00	90,337,500
東京センチュリー	34,400	5,770.00	198,488,000
日本証券金融	70,100	900.00	63,090,000
アイフル	298,500	366.00	109,251,000
リコーリース	15,800	3,850.00	60,830,000
イオンフィナンシャルサービス	96,700	1,273.00	123,099,100
アコム	350,700	331.00	116,081,700
ジャックス	19,700	3,270.00	64,419,000
オリエントコーポレーション	482,600	127.00	61,290,200
オリックス	1,075,500	2,376.00	2,555,388,000
三菱HCキャピタル	655,000	605.00	396,275,000
九州リースサービス	9,400	601.00	5,649,400
日本取引所グループ	448,800	2,254.00	1,011,595,200
イー・ギャランティ	26,300	2,047.00	53,836,100
アサックス	9,800	684.00	6,703,200
NECキャピタルソリューション	7,400	2,153.00	15,932,200
いちご	202,400	283.00	57,279,200
日本駐車場開発	204,400	136.00	27,798,400
スター・マイカ・ホールディングス	10,700	1,203.00	12,872,100
SREホールディングス	4,700	3,680.00	17,296,000
ADワークスグループ	36,200	142.00	5,140,400
ヒューリック	424,300	1,060.00	449,758,000
三栄建築設計	8,000	1,640.00	13,120,000
野村不動産ホールディングス	92,100	2,806.00	258,432,600
三重交通グループホールディングス	38,900	475.00	18,477,500
サムティ	29,200	2,129.00	62,166,800
ディア・ライフ	25,500	513.00	13,081,500
地主	12,000	1,796.00	21,552,000
プレサンスコーポレーション	23,800	1,824.00	43,411,200
ハウスコム	4,200	1,254.00	5,266,800
日本管理センター	9,900	1,032.00	10,216,800
サンセイランディック	6,900	817.00	5,637,300
フージャースホールディングス	22,600	693.00	15,661,800
オープンハウスグループ	56,500	5,120.00	289,280,000
東急不動産ホールディングス	523,900	665.00	348,393,500
飯田グループホールディングス	148,300	2,181.00	323,442,300
イーランド	3,800	1,396.00	5,304,800
ムゲンエステート	13,800	484.00	6,679,200
And Doホールディングス	8,700	881.00	7,664,700
シーアールイー	5,700	1,696.00	9,667,200

ケイアイスター不動産	8,200	5,350.00	43,870,000
グッドコムアセット	8,900	1,177.00	10,475,300
ジェイ・エス・ビー	4,100	3,120.00	12,792,000
テンポイノベーション	6,600	836.00	5,517,600
フェイスネットワーク	2,800	1,329.00	3,721,200
パーク24	95,900	1,808.00	173,387,200
パラカ	5,400	1,663.00	8,980,200
三井不動産	808,000	2,585.00	2,088,680,000
三菱地所	1,164,600	1,789.50	2,084,051,700
平和不動産	30,700	4,090.00	125,563,000
東京建物	175,800	1,813.00	318,725,400
京阪神ビルディング	28,300	1,466.00	41,487,800
住友不動産	372,000	3,608.00	1,342,176,000
テオオーシー	33,800	727.00	24,572,600
東京楽天地	3,300	3,925.00	12,952,500
スターツコーポレーション	24,600	2,543.00	62,557,800
フジ住宅	22,700	663.00	15,050,100
空港施設	20,200	565.00	11,413,000
明和地所	10,700	603.00	6,452,100
ゴールドクレスト	14,700	1,864.00	27,400,800
エスリード	7,700	1,765.00	13,590,500
日神グループホールディングス	31,700	496.00	15,723,200
日本エスコン	33,000	757.00	24,981,000
タカラレーベン	74,200	321.00	23,818,200
A V A N T I A	10,800	849.00	9,169,200
イオンモール	89,700	1,655.00	148,453,500
毎日コムネット	8,000	698.00	5,584,000
ファースト住建	7,800	1,180.00	9,204,000
カチタス	44,300	3,350.00	148,405,000
トーセイ	25,800	1,084.00	27,967,200
穴吹興産	4,600	2,006.00	9,227,600
サンフロンティア不動産	25,800	1,095.00	28,251,000
F Jネクストホールディングス	18,800	993.00	18,668,400
インテリックス	4,000	631.00	2,524,000
ランドビジネス	7,500	243.00	1,822,500
サンネクスタグループ	7,000	1,017.00	7,119,000
グランディハウス	14,400	581.00	8,366,400
日本空港ビルデング	67,800	5,700.00	386,460,000
明豊ファシリティワークス	8,300	708.00	5,876,400
日本工営	10,300	3,000.00	30,900,000
L I F U L L	53,700	232.00	12,458,400
ミクシィ	39,400	2,291.00	90,265,400

ジェイエイシーリクルートメント	14,000	1,752.00	24,528,000
日本M&Aセンターホールディングス	281,700	1,769.00	498,327,300
メンバーズ	5,200	2,960.00	15,392,000
中広	3,500	391.00	1,368,500
UTグループ	24,800	3,405.00	84,444,000
アイティメディア	8,300	1,613.00	13,387,900
E・Jホールディングス	9,300	1,134.00	10,546,200
夢真ビーネックスグループ	56,000	1,560.00	87,360,000
コシダカホールディングス	46,400	659.00	30,577,600
アルトナー	4,500	867.00	3,901,500
パソナグループ	18,700	2,385.00	44,599,500
CDS	4,400	1,615.00	7,106,000
リンクアンドモチベーション	37,800	428.00	16,178,400
エス・エム・エス	58,400	3,075.00	179,580,000
サニーサイドアップグループ	6,400	743.00	4,755,200
パーソルホールディングス	171,700	2,479.00	425,644,300
リニカル	10,100	679.00	6,857,900
クックパッド	55,100	256.00	14,105,600
アイ・ケイ・ケイホールディングス	8,900	580.00	5,162,000
学情	7,300	1,000.00	7,300,000
スタジオアリス	7,800	2,197.00	17,136,600
シミックホールディングス	9,700	1,549.00	15,025,300
エプコ	4,100	693.00	2,841,300
NJS	3,900	2,000.00	7,800,000
総合警備保障	68,300	4,210.00	287,543,000
カカクコム	126,000	2,587.00	325,962,000
アイロムグループ	6,200	2,008.00	12,449,600
セントケア・ホールディング	11,500	815.00	9,372,500
サイネックス	3,400	607.00	2,063,800
ルネサンス	12,200	1,105.00	13,481,000
ディップ	30,300	3,485.00	105,595,500
デジタルホールディングス	12,200	1,554.00	18,958,800
新日本科学	21,100	1,595.00	33,654,500
キャリアデザインセンター	4,600	1,216.00	5,593,600
ベネフィット・ワン	62,500	2,465.00	154,062,500
エムスリー	302,900	4,042.00	1,224,321,800
ツカダ・グローバルホールディング	10,900	330.00	3,597,000
アウトソーシング	98,500	1,343.00	132,285,500
ウェルネット	18,000	441.00	7,938,000
ワールドホールディングス	7,000	2,046.00	14,322,000
ディー・エヌ・エー	65,500	1,747.00	114,428,500
博報堂DYホールディングス	239,100	1,547.00	369,887,700



ぐるなび	28,900	431.00	12,455,900
タカミヤ	21,600	384.00	8,294,400
ジャパンベストレスキューシステム	11,600	972.00	11,275,200
ファンコミュニケーションズ	43,700	387.00	16,911,900
ライク	4,800	1,834.00	8,803,200
ビジネス・ブレイクスルー	7,100	441.00	3,131,100
エスプール	48,800	984.00	48,019,200
WDBホールディングス	7,900	2,692.00	21,266,800
手間いらず	2,300	5,140.00	11,822,000
ティア	10,700	440.00	4,708,000
C D G	2,100	1,340.00	2,814,000
アドウェイズ	26,000	670.00	17,420,000
バリューコマース	13,500	3,435.00	46,372,500
インフォマート	188,500	613.00	115,550,500
J Pホールディングス	45,400	230.00	10,442,000
エコナックホールディングス	34,600	86.00	2,975,600
C Lホールディングス	3,900	1,107.00	4,317,300
プレステージ・インターナショナル	64,800	713.00	46,202,400
アミューズ	9,500	2,117.00	20,111,500
ドリームインキュベータ	4,800	2,530.00	12,144,000
クイック	11,900	1,580.00	18,802,000
T A C	10,700	223.00	2,386,100
電通グループ	177,000	4,885.00	864,645,000
イオンファンタジー	6,800	2,148.00	14,606,400
シーティーエス	19,700	818.00	16,114,600
ネクシィーズグループ	6,500	651.00	4,231,500
H . U . グループホールディングス	44,900	3,035.00	136,271,500
アルプス技研	15,300	1,937.00	29,636,100
ダイオーズ	3,700	1,000.00	3,700,000
日本空調サービス	18,400	789.00	14,517,600
オリエンタルランド	202,800	22,425.00	4,547,790,000
ダスキン	39,900	2,757.00	110,004,300
明光ネットワークジャパン	20,700	573.00	11,861,100
ファルコホールディングス	8,300	1,999.00	16,591,700
ラウンドワン	48,100	1,418.00	68,205,800
リゾートトラスト	78,800	2,042.00	160,909,600
ビー・エム・エル	22,200	3,425.00	76,035,000
りらいあコミュニケーションズ	25,600	1,060.00	27,136,000
リソー教育	79,200	389.00	30,808,800
早稲田アカデミー	9,800	1,001.00	9,809,800
ユー・エス・エス	192,300	1,958.00	376,523,400
東京個別指導学院	15,600	622.00	9,703,200

サイバーエージェント	423,200	1,497.00	633,530,400
楽天グループ	882,200	965.00	851,323,000
クリーク・アンド・リバー社	9,200	1,680.00	15,456,000
モーニングスター	30,600	564.00	17,258,400
テー・オー・ダブリュー	31,300	297.00	9,296,100
山田コンサルティンググループ	9,200	1,140.00	10,488,000
セントラルスポーツ	6,500	2,443.00	15,879,500
フルキャストホールディングス	14,800	2,183.00	32,308,400
エン・ジャパン	27,800	2,886.00	80,230,800
リソルホールディングス	1,900	4,345.00	8,255,500
テクノプロ・ホールディングス	102,900	3,290.00	338,541,000
アトラグループ	3,800	264.00	1,003,200
インターワークス	5,700	372.00	2,120,400
アイ・アールジャパンホールディングス	8,000	3,855.00	30,840,000
Keeper 技研	11,200	2,090.00	23,408,000
ファーストロジック	3,700	803.00	2,971,100
三機サービス	3,300	1,011.00	3,336,300
Gunosy	9,800	793.00	7,771,400
デザインワン・ジャパン	5,900	188.00	1,109,200
イー・ガーディアン	7,100	2,608.00	18,516,800
リブセンス	11,300	170.00	1,921,000
ジャパンマテリアル	53,000	1,741.00	92,273,000
ベクトル	24,400	1,057.00	25,790,800
ウチヤマホールディングス	9,400	329.00	3,092,600
チャーム・ケア・コーポレーション	13,100	1,054.00	13,807,400
キャリアリンク	6,500	1,445.00	9,392,500
I B J	14,400	819.00	11,793,600
アサンテ	7,800	1,603.00	12,503,400
バリューHR	7,000	2,497.00	17,479,000
M&Aキャピタルパートナーズ	14,200	5,090.00	72,278,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,900	1,348.00	9,301,200
E R Iホールディングス	5,100	1,126.00	5,742,600
アビスト	2,800	2,916.00	8,164,800
シグマクシス・ホールディングス	10,500	2,008.00	21,084,000
ウィルグループ	12,900	1,215.00	15,673,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	24,600	192.00	4,723,200
メドピア	13,400	2,616.00	35,054,400
レアジョブ	3,600	794.00	2,858,400
リクルートホールディングス	1,323,900	4,828.00	6,391,789,200
エラン	24,000	968.00	23,232,000
土木管理総合試験所	8,900	322.00	2,865,800
ネットマーケティング	9,100	405.00	3,685,500

日本郵政	2,241,200	982.40	2,201,754,880	
ベルシステム24ホールディングス	24,900	1,392.00	34,660,800	
鎌倉新書	20,100	510.00	10,251,000	
S MN	4,200	593.00	2,490,600	
グローバルキッズCOMPANY	3,500	791.00	2,768,500	
エアトリ	11,200	3,470.00	38,864,000	
アトラエ	12,100	2,003.00	24,236,300	
ストライク	6,500	4,420.00	28,730,000	
ソラスト	42,400	1,001.00	42,442,400	
セラク	5,700	1,162.00	6,623,400	
インソース	16,800	1,923.00	32,306,400	
ベйкаレント・コンサルティング	12,100	39,950.00	483,395,000	
Orchestra Holdings	3,400	2,778.00	9,445,200	
アイモバイル	5,100	1,225.00	6,247,500	
キャリアインデックス	6,300	705.00	4,441,500	
MS - Japan	7,300	836.00	6,102,800	
船場	3,800	743.00	2,823,400	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	54,600	1,539.00	84,029,400	
フルテック	2,600	1,328.00	3,452,800	
GameWith	5,800	435.00	2,523,000	
ソウルドアウト	4,400	1,804.00	7,937,600	
MS&Consulting	2,900	699.00	2,027,100	
ウェルビー	11,500	1,151.00	13,236,500	
エル・ティー・エス	2,300	1,982.00	4,558,600	
ミダックホールディングス	7,900	2,306.00	18,217,400	
日総工産	13,800	822.00	11,343,600	
キュービーネットホールディングス	8,100	1,756.00	14,223,600	
RPAホールディングス	25,100	348.00	8,734,800	
スプリックス	5,100	1,517.00	7,736,700	
マネジメントソリューションズ	8,500	3,115.00	26,477,500	
プロレド・パートナーズ	4,100	801.00	3,284,100	
テノ・ホールディングス	2,600	565.00	1,469,000	
フロンティア・マネジメント	4,800	811.00	3,892,800	
ピアラ	3,300	540.00	1,782,000	
コプロ・ホールディングス	3,600	1,054.00	3,794,400	
ギークス	3,200	1,120.00	3,584,000	
カーブスホールディングス	47,500	712.00	33,820,000	
フォーラムエンジニアリング	12,300	857.00	10,541,100	
Fast Fitness Japan	2,500	1,812.00	4,530,000	
ダイレクトマーケティングミックス	20,000	1,448.00	28,960,000	
ポピンズホールディングス	4,100	2,345.00	9,614,500	
LITALICO	14,000	3,100.00	43,400,000	

アドバンテッジリスクマネジメント	9,100	663.00	6,033,300	
リログループ	94,000	1,742.00	163,748,000	
東祥	13,000	1,765.00	22,945,000	
TREホールディングス	23,700	1,503.00	35,621,100	
人・夢・技術グループ	7,000	1,882.00	13,174,000	
エイチ・アイ・エス	38,300	2,117.00	81,081,100	
ラックランド	5,100	2,794.00	14,249,400	
共立メンテナンス	30,700	4,550.00	139,685,000	
イチネンホールディングス	17,800	1,311.00	23,335,800	
建設技術研究所	10,400	2,312.00	24,044,800	
スペース	12,600	933.00	11,755,800	
燦ホールディングス	7,700	1,484.00	11,426,800	
スバル興業	1,100	8,040.00	8,844,000	
東京テアトル	6,700	1,251.00	8,381,700	
タナベ経営	7,100	642.00	4,558,200	
ナガワ	5,500	9,660.00	53,130,000	
東京都競馬	12,900	4,130.00	53,277,000	
カナモト	30,400	2,327.00	70,740,800	
西尾レントオール	15,900	2,872.00	45,664,800	
トランス・コスモス	21,900	3,180.00	69,642,000	
乃村工藝社	73,900	939.00	69,392,100	
藤田観光	7,500	2,385.00	17,887,500	
KNT-CTホールディングス	10,700	1,562.00	16,713,400	
日本管財	18,500	2,771.00	51,263,500	
トーカイ	15,200	1,843.00	28,013,600	
セコム	169,100	8,614.00	1,456,627,400	
セントラル警備保障	8,400	2,410.00	20,244,000	
丹青社	35,500	737.00	26,163,500	
メイテック	20,800	6,970.00	144,976,000	
応用地質	19,500	2,076.00	40,482,000	
船井総研ホールディングス	35,300	2,230.00	78,719,000	
進学会ホールディングス	6,500	363.00	2,359,500	
オオバ	12,500	715.00	8,937,500	
いであ	4,800	1,763.00	8,462,400	
学究社	5,700	1,628.00	9,279,600	
ベネッセホールディングス	57,300	2,382.00	136,488,600	
イオンディライト	21,200	2,994.00	63,472,800	
ナック	8,400	982.00	8,248,800	
ダイセキ	31,300	4,395.00	137,563,500	
ステップ	6,400	1,856.00	11,878,400	
合 計	194,828,100		473,906,465,400	

## (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

	2022年 2月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	9,977,704,214
コール・ローン	520,949,684
株式	488,501,778,636
投資信託受益証券	208,759,162
投資証券	10,913,864,908
派生商品評価勘定	73,898,302
未収入金	7,713,406,958
未収配当金	352,185,576
前払金	214,374,875
差入委託証拠金	1,291,347,249
流動資産合計	519,768,269,564
資産合計	519,768,269,564
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	277,926,981
未払解約金	8,134,476,089
未払利息	777
流動負債合計	8,412,403,847
負債合計	8,412,403,847
純資産の部	
元本等	
元本	124,000,147,376
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	387,355,718,341
元本等合計	511,355,865,717
純資産合計	511,355,865,717
負債純資産合計	519,768,269,564

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 2月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>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</p> <p>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> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</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。 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>

	2022年 2月17日現在
	<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 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 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）

	2022年 2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	124,000,147,376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 4.1238円 (1万口当たり純資産額) (41,238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

	2022年 2月17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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2月17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	2022年 2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	144,587,616,478円
期中追加設定元本額	14,020,192,335円
期中一部解約元本額	34,607,661,437円
期末元本額	124,000,147,376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）	1,887,692,780円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,140,691円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	30,589,035,543円
世界経済インデックスファンド	9,806,830,867円
外国株式インデックス・オープン	846,959,621円
D C マイセレクション 2 5	823,712,366円
D C マイセレクション 5 0	3,829,101,839円
D C マイセレクション 7 5	4,418,034,754円
D C 外国株式インデックス・オープン	11,705,449,168円
D C マイセレクション S 2 5	399,344,940円
D C マイセレクション S 5 0	1,818,852,871円
D C マイセレクション S 7 5	1,541,557,509円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	52,490,162円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	166,057,692円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	119,530,065円
D C 世界経済インデックスファンド	9,554,487,769円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,466,837,313円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	3,831,300円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	4,613,649円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	30,766,017円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	15,776,271円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	56,114,603円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	11,848,771円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	34,972,916円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	310,154,622円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	185,084,115円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,354,182,116円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	157,984,586円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	36,361,026円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	180,165,447円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	60,255,657円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	1,102,480,578円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,193,083,661円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,152,990,678円
コア投資戦略ファンド（安定型）	721,771,604円

区分	2022年 2月17日現在
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,549,904,973円
分散投資コア戦略ファンドA	1,477,970,855円
分散投資コア戦略ファンドS	8,169,385,937円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,247,563,708円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,072,483,569円
コア投資戦略ファンド(切替型)	592,582,232円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	600,806,511円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	29,312,120円
SMT インデックスバランス・オープン	159,134,165円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	431,357,615円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	15,716,495,282円
SMT 世界経済インデックス・オープン	178,524,967円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	664,279,304円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	128,911,558円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,827,912円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	153,030,857円
グローバル経済コア	634,173,895円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	12,813,298円
DCターゲット・イヤーフンド2055	5,015,160円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	238,103,886円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	66,161,665円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	20,178,399円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	13,987,538円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	7,043,244円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	8,892,264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)	338,306,010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)	516,610,919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)	1,061,230,999円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,119,291,996円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	211,231,458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)	111,785,723円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	47,367,185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)	84,594,406円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	248,911,281円
SMTAM海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	260,033,035円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	252,448,023円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	250,931,421円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	239,889,089円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	236,166,458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2021-11(適格機関投資家専用)	193,854,892円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 2月17日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	22,470,536,450	
投資信託受益証券	5,667,982	
投資証券	432,876,370	
合計	22,897,744,838	

(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

（2022年 2月17日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	11,892,333,281	-	11,677,958,406	214,374,875
	合計	11,892,333,281	-	11,677,958,406	214,374,875

## (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

（2022年 2月17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	214,774,200	-	214,782,756	8,556
	アメリカドル	214,774,200	-	214,782,756	8,556
	売建	7,793,132,600	-	7,782,794,960	10,337,640
	アメリカドル	6,062,680,000	-	6,051,094,360	11,585,640
	カナダドル	254,584,400	-	254,852,080	267,680
	ユーロ	814,680,000	-	814,874,680	194,680
	イギリスポンド	407,399,200	-	408,035,680	636,480

	スイスフラン	150,000,000	-	150,338,160	338,160
	香港ドル	103,789,000	-	103,600,000	189,000
	合計	8,007,906,800	-	7,997,577,716	10,346,196

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 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	62,788	29.71	1,865,431.48	
	CHENIERE ENERGY INC	19,034	114.89	2,186,816.26	
	CHEVRON CORP	150,711	134.30	20,240,487.30	
	CONOCOPHILLIPS	104,031	90.21	9,384,636.51	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	22.87	1,463,680.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	51,677	53.85	2,782,806.45	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	129.82	1,722,321.94	
	EOG RESOURCES INC	46,119	111.77	5,154,720.63	
	EXXON MOBIL	330,112	78.35	25,864,275.20	
	HALLIBURTON CO	68,269	33.57	2,291,790.33	
	HESS CORP	22,781	94.26	2,147,337.06	
	KINDER MORGAN INC	159,310	17.13	2,728,980.30	
	MARATHON PETROLEUM CORP	49,827	78.06	3,889,495.62	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	69,966	39.65	2,774,151.90	
	ONEOK INC	33,279	62.65	2,084,929.35	
	PHILLIPS 66	35,503	88.30	3,134,914.90	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	18,224	222.48	4,054,475.52	
	SCHLUMBERGER	107,126	41.69	4,466,082.94	
	VALERO ENERGY CORP	30,763	88.04	2,708,374.52	
	WILLIAMS COS	98,553	30.01	2,957,575.53	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,541	245.34	4,303,508.94	
	ALBEMARLE CORP	9,440	246.00	2,322,240.00	
	AMCOR PLC	111,485	11.77	1,312,178.45	
	AVERY DENNISON CORP	6,638	184.67	1,225,839.46	
BALL CORP	25,605	92.04	2,356,684.20		

CELANESE CORP-SERIES A	8,582	156.09	1,339,564.38
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	14,951	74.42	1,112,653.42
CORTEVA INC	58,500	51.46	3,010,410.00
CROWN HOLDINGS INC	11,212	124.04	1,390,736.48
DOW INC	57,346	62.08	3,560,039.68
DUPONT DE NEMOURS INC	40,980	82.12	3,365,277.60
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	124.27	1,376,290.25
ECOLAB INC	19,895	182.81	3,637,004.95
FMC CORP	10,507	119.59	1,256,532.13
FREEMONT-MCMORAN INC	113,194	44.25	5,008,834.50
INT'L PAPER CO	30,800	46.57	1,434,356.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,494	137.48	2,680,035.12
LINDE PLC	40,161	303.83	12,202,116.63
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,803	103.15	2,042,679.45
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,631	391.06	1,810,998.86
MOSAIC CO/THE	27,732	46.29	1,283,714.28
NEWMONT CORPORATION	61,555	64.28	3,956,755.40
NUCOR CORP	23,355	122.66	2,864,724.30
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	148.49	1,141,442.63
PPG INDUSTRIES INC	19,278	151.87	2,927,749.86
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	86.69	906,430.64
SEALED AIR CORP	11,690	64.14	749,796.60
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,719	272.63	5,375,990.97
STEEL DYNAMICS INC	15,552	64.29	999,838.08
VULCAN MATERIALS CO	10,247	191.72	1,964,554.84
WESTROCK CO	21,356	47.16	1,007,148.96
3 M COMPANY	44,860	155.63	6,981,561.80
ALLEGION PLC	7,601	115.24	875,939.24
AMETEK INC	18,006	131.80	2,373,190.80
BOEING CO	43,246	218.93	9,467,846.78
CARRIER GLOBAL CORP	63,164	45.65	2,883,436.60
CATERPILLAR	42,499	203.64	8,654,496.36
CUMMINS INC	11,214	223.31	2,504,198.34
DEERE&CO	23,252	390.56	9,081,301.12
DOVER CORP	10,672	162.95	1,739,002.40
EATON CORP	31,624	157.03	4,965,916.72
EMERSON ELECTRIC CO	46,305	95.87	4,439,260.35
FASTENAL CO	44,846	52.34	2,347,239.64
FORTIVE CORP	25,722	65.36	1,681,189.92
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	91.11	939,344.10
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	316.44	1,648,968.84
GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	214.41	4,067,357.70

GENERAL ELECTRIC CO	85,187	101.41	8,638,813.67
GRAINGER (WW) INC	3,236	474.80	1,536,452.80
HEICO CORP	3,640	143.97	524,050.80
HEICO CORP-CLASS A	6,449	118.60	764,851.40
HONEYWELL INTL INC	53,646	189.06	10,142,312.76
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	35.73	1,128,853.62
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	182.58	643,046.76
IDEX CORP	5,916	189.98	1,123,921.68
ILLINOIS TOOL WORKS	25,097	220.08	5,523,347.76
INGERSOLL-RAND INC	31,562	54.92	1,733,385.04
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	60.28	1,066,956.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	56,689	67.49	3,825,940.61
KORNIT DIGITAL LTD	2,776	95.92	266,273.92
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,684	221.62	3,475,888.08
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	261.93	661,635.18
LOCKHEED MARTIN CORP	19,332	386.90	7,479,550.80
MASCO CORP	19,462	58.68	1,142,030.16
NORDSON CORP	4,121	235.14	969,011.94
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,113	393.66	4,768,403.58
OTIS WORLDWIDE CORP	30,653	78.87	2,417,602.11
OWENS CORNING	8,642	100.80	871,113.60
PACCAR INC	28,106	94.98	2,669,507.88
PARKER HANNIFIN CORP	9,900	310.23	3,071,277.00
PENTAIR PLC	14,533	59.27	861,370.91
PLUG POWER INC	41,884	23.90	1,001,027.60
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	117,233	94.75	11,107,826.75
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,098	273.01	2,483,844.98
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,314	445.00	3,699,730.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	59.18	818,341.04
SMITH (A.O.) CORP	9,016	72.32	652,037.12
SNAP-ON INC	4,000	218.36	873,440.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	167.17	2,106,007.66
SUNRUN INC	13,917	24.62	342,636.54
TEXTRON	18,893	72.20	1,364,074.60
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	152.63	2,844,717.94
TRANSDIGM GROUP INC	4,075	667.97	2,721,977.75
UNITED RENTALS INC	5,393	325.12	1,753,372.16
WABTEC CORP	15,024	95.51	1,434,942.24
XYLEM INC	13,269	90.67	1,203,100.23
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	73.97	840,595.08
CINTAS CORP	7,423	378.57	2,810,125.11
CLARIVATE PLC	27,357	16.67	456,041.19

COPART INC	16,617	126.87	2,108,198.79
COSTAR GROUP INC	32,116	67.29	2,161,085.64
EQUIFAX INC	9,509	221.73	2,108,430.57
IHS MARKIT LTD	29,073	109.35	3,179,132.55
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,661	121.66	1,297,017.26
LEIDOS HOLDINGS	11,220	88.72	995,438.40
REPUBLIC SERVICES INC	16,942	117.55	1,991,532.10
ROBERT HALF INTL INC	9,566	124.49	1,190,871.34
ROLLINS INC	17,468	31.37	547,971.16
TRANSUNION	15,741	101.84	1,603,063.44
VERISK ANALYTICS INC	12,503	194.07	2,426,457.21
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	119.52	2,542,788.00
WASTE MANAGEMENT INC	32,770	142.57	4,672,018.90
AMERCO	734	599.54	440,062.36
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,292	90.41	1,020,909.72
CSX CORP	176,986	35.17	6,224,597.62
DELTA AIR LINES INC	14,609	44.41	648,785.69
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	107.38	1,532,527.36
FEDEX CORP	19,524	229.01	4,471,191.24
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	191.00	1,346,932.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	54.07	578,549.00
LYFT INC-A	21,288	43.82	932,840.16
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	276.76	5,282,518.12
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	297.27	2,379,051.81
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	47.42	641,734.86
UBER TECHNOLOGIES INC	93,848	36.58	3,432,959.84
UNION PACIFIC CORP	50,721	253.81	12,873,497.01
UNITED PARCEL SERVICE B	56,644	215.31	12,196,019.64
APTIV PLC	20,714	146.26	3,029,629.64
BORGWARNER INC	19,781	45.22	894,496.82
FORD MOTOR COMPANY	305,209	18.01	5,496,814.09
GENERAL MOTORS CO	103,796	50.43	5,234,432.28
LEAR CORP	5,287	175.56	928,185.72
LUCID GROUP INC	31,234	29.00	905,786.00
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	13,363	66.25	885,298.75
TESLA INC	65,692	923.39	60,659,335.88
DR HORTON INC	27,764	85.30	2,368,269.20
GARMIN LTD	12,854	119.59	1,537,209.86
HASBRO INC	10,572	97.04	1,025,906.88
LENNAR CORP-CL A	20,844	92.02	1,918,064.88
LULULEMON ATHLETICA INC	9,305	320.04	2,977,972.20
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	150.17	760,160.54

NEWELL BRANDS INC	31,461	26.01	818,300.61
NIKE B	99,467	146.49	14,570,920.83
NVR INC	247	5,113.01	1,262,913.47
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	32.05	696,638.80
PULTE GROUP INC	21,609	49.28	1,064,891.52
VF CORP	25,718	60.95	1,567,512.10
WHIRLPOOL CORP	5,220	206.37	1,077,251.40
AIRBNB INC-CLASS A	18,489	186.64	3,450,786.96
ARAMARK	20,955	38.27	801,947.85
BOOKING HOLDINGS INC	3,187	2,703.26	8,615,289.62
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	85.42	1,499,975.20
CARNIVAL CORPORATION	62,102	23.31	1,447,597.62
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,164	1,575.43	3,409,230.52
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	148.86	1,594,588.32
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	433.34	1,234,152.32
DRAFTKINGS INC - CL A	27,674	22.99	636,225.26
EXPEDIA GROUP INC	11,638	213.80	2,488,204.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,878	156.34	3,420,406.52
LAS VEGAS SANDS CORP	24,370	47.61	1,160,255.70
MARRIOTT INTL A	21,139	183.26	3,873,933.14
MCDONALD'S CORP	58,134	253.09	14,713,134.06
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	11.50	203,113.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,874	45.17	1,304,238.58
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,767	87.06	1,459,735.02
STARBUCKS CORP	91,531	95.18	8,711,920.58
VAIL RESORTS INC	3,014	275.46	830,236.44
WYNN RESORTS LTD	9,302	94.23	876,527.46
YUM BRANDS INC	22,637	123.35	2,792,273.95
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,643	81.46	5,021,438.78
ALPHABET INC-CL A	23,507	2,754.76	64,756,143.32
ALPHABET INC-CL C	22,496	2,749.75	61,858,376.00
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	38,290	19.67	753,164.30
CABLE ONE INC	445	1,506.61	670,441.45
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	10,148	609.46	6,184,800.08
COMCAST CORP-CL A	356,721	48.09	17,154,712.89
DISCOVERY INC - A	12,804	29.38	376,181.52
DISCOVERY INC-C	28,190	29.28	825,403.20
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	31.59	635,969.88
ELECTRONIC ARTS INC	21,814	133.29	2,907,588.06
FOX CORP - CLASS A	27,658	43.01	1,189,570.58
FOX CORP- CLASS B	10,345	38.91	402,523.95
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	120.88	812,434.48



INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	36.60	1,238,324.40
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	150.64	388,500.56
LIBERTY BROADBAND-C	11,268	153.40	1,728,511.20
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	63.33	973,952.07
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	52.34	710,986.56
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	52.46	334,904.64
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,343	120.25	1,484,245.75
MATCH GROUP INC	20,191	117.33	2,369,010.03
META PLATFORMS INC-CLASS A	186,018	216.54	40,280,337.72
NETFLIX INC	34,441	398.08	13,710,273.28
NEWS CORP-CLASS A	33,479	23.68	792,782.72
OMNICOM GROUP	18,031	86.34	1,556,796.54
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	25.73	1,177,584.91
ROKU INC	9,122	161.45	1,472,746.90
SEA LTD-ADR	10,483	141.58	1,484,183.14
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	6.17	373,087.56
SNAP INC - A	83,375	40.01	3,335,833.75
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,738	166.09	1,617,384.42
THE WALT DISNEY CO	141,614	156.35	22,141,348.90
TWITTER INC	63,066	36.24	2,285,511.84
VIACOMCBS INC-CLASS B	48,586	29.58	1,437,173.88
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	17,304	56.22	972,830.88
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	222.39	1,184,004.36
AMAZON.COM	35,599	3,162.01	112,564,393.99
AUTOZONE INC	1,639	1,927.47	3,159,123.33
BATH & BODY WORKS INC	19,806	55.45	1,098,242.70
BEST BUY COMPANY INC	18,175	99.63	1,810,775.25
BURLINGTON STORES INC	5,108	229.15	1,170,498.20
CARMAX INC	12,051	109.58	1,320,548.58
CARVANA CO	5,700	138.62	790,134.00
CHEWY INC - CLASS A	6,878	49.56	340,873.68
DOLLAR GENERAL CORP	18,686	197.35	3,687,682.10
DOLLAR TREE INC	17,931	136.76	2,452,243.56
DOORDASH INC - A	8,334	94.89	790,813.26
EBAY	51,021	57.65	2,941,360.65
ETSY INC	10,294	140.41	1,445,380.54
FIVERR INTERNATIONAL LTD	1,486	75.84	112,698.24
GENUINE PARTS CO	10,119	129.96	1,315,065.24
HOME DEPOT	82,306	350.09	28,814,507.54
LKQ CORP	22,779	55.60	1,266,512.40
LOWES COMPANIES	53,857	227.01	12,226,077.57
MERCADOLIBRE INC	3,567	1,133.84	4,044,407.28

O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,407	678.44	3,668,325.08
POOL CORP	3,304	460.18	1,520,434.72
ROSS STORES INC	28,076	95.70	2,686,873.20
TARGET (DAYTON HUDSON)	38,552	207.81	8,011,491.12
TJX COMPANIES INC	93,142	67.10	6,249,828.20
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	215.05	1,918,676.10
ULTA BEAUTY INC	3,990	381.60	1,522,584.00
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	136.54	819,240.00
COSTCO WHOLESALE CORP	34,433	512.40	17,643,469.20
KROGER CO	56,126	44.57	2,501,535.82
SYSCO CORP	40,288	85.57	3,447,444.16
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	47.88	2,861,643.96
WALMART INC	120,012	133.53	16,025,202.36
ALTRIA GROUP INC	142,972	50.61	7,235,812.92
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,967	76.90	3,304,162.30
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	66.60	1,598,799.60
BUNGE LIMITED	11,604	102.76	1,192,427.04
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	43.67	692,999.23
COCA-COLA CO	319,753	60.90	19,472,957.70
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	56.44	868,837.36
CONAGRA BRANDS INC	35,941	35.43	1,273,389.63
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	220.91	2,858,575.40
GENERAL MILLS INC	46,541	66.76	3,107,077.16
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,352	202.65	2,300,482.80
HORMEL FOODS CORP	23,338	47.11	1,099,453.18
JM SMUCKER CO	9,145	135.72	1,241,159.40
KELLOGG CO	21,630	64.32	1,391,241.60
KEURIG DR PEPPER INC	52,526	37.92	1,991,785.92
KRAFT HEINZ CO/THE	52,188	36.62	1,911,124.56
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,909	98.39	1,860,456.51
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	49.44	725,235.36
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	108,376	65.71	7,121,386.96
MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	83.22	2,685,259.74
PEPSICO INC	107,665	166.30	17,904,689.50
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	121,262	111.57	13,529,201.34
TYSON FOODS INC	21,804	94.45	2,059,387.80
CHURCH & DWIGHT CO INC	17,995	96.03	1,728,059.85
CLOROX COMPANY	9,570	141.28	1,352,049.60
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,788	78.34	4,997,151.92
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,438	308.65	5,690,888.70
KIMBERLY-CLARK CORP	25,886	131.02	3,391,583.72
PROCTER & GAMBLE CO	189,391	158.01	29,925,671.91

ABBOTT LABORATORIES	138,079	123.68	17,077,610.72
ABIOMED INC	3,781	325.42	1,230,413.02
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	526.38	3,128,276.34
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	142.73	1,840,646.08
ANTHEM INC	18,926	458.58	8,679,085.08
BAXTER INTERNATIONAL	38,403	85.13	3,269,247.39
BECTON DICKINSON & CO	22,232	271.13	6,027,762.16
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,802	44.19	4,984,720.38
CARDINAL HEALTH	24,692	54.54	1,346,701.68
CENTENE CORP	44,550	84.22	3,752,001.00
CERNER CORP	22,894	91.92	2,104,416.48
CIGNA CORP	26,327	229.00	6,028,883.00
CVS HEALTH CORP	102,569	103.94	10,661,021.86
DAVITA INC	5,784	120.00	694,080.00
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	56.63	1,006,541.62
DEXCOM INC	7,647	413.63	3,163,028.61
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	48,336	110.66	5,348,861.76
HCA HEALTHCARE INC	20,149	251.99	5,077,346.51
HENRY SCHEIN INC	11,747	84.23	989,449.81
HOLOGIC INC	19,018	71.04	1,351,038.72
HUMANA INC	9,953	428.77	4,267,547.81
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	508.01	3,429,575.51
INMODE LTD	5,500	46.47	255,585.00
INSULET CORP	5,311	252.33	1,340,124.63
INTUITIVE SURGICAL INC	27,694	291.14	8,062,831.16
LABORATORY CRP OF AMER	7,595	269.62	2,047,763.90
MASIMO CORP	4,147	144.20	597,997.40
MCKESSON CORP	12,089	275.82	3,334,387.98
MEDTRONIC PLC	104,586	103.15	10,788,045.90
MOLINA HEALTHCARE INC	4,940	322.43	1,592,804.20
NOVOCURE LTD	7,933	82.91	657,725.03
OAK STREET HEALTH INC	7,613	17.44	132,770.72
QUEST DIAGNOSTICS	10,005	131.72	1,317,858.60
RESMED INC	11,440	237.57	2,717,800.80
STERIS PLC	8,018	232.99	1,868,113.82
STRYKER CORP	26,295	259.59	6,825,919.05
TELADOC HEALTH INC	11,375	73.77	839,133.75
TELEFLEX INC	3,934	327.00	1,286,418.00
THE COOPER COS INC	4,134	401.29	1,658,932.86
UNITEDHEALTH GROUP INC	73,563	480.05	35,313,918.15
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	137.81	840,916.62
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	229.36	2,581,446.80

ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,300	122.50	2,119,250.00
10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	94.98	537,111.90
ABBVIE INC	137,691	145.87	20,084,986.17
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	135.15	3,214,542.75
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	153.28	1,478,079.04
AMGEN	44,845	222.66	9,985,187.70
AVANTOR INC	42,980	35.48	1,524,930.40
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	612.69	1,135,314.57
BIO-TECHNE CORP	3,245	412.03	1,337,037.35
BIOGEN INC	11,860	214.55	2,544,563.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	92.69	1,370,236.27
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	172,791	67.60	11,680,671.60
CATALENT INC	13,739	99.93	1,372,938.27
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	305.28	1,283,397.12
DANAHER CORP	50,501	267.69	13,518,612.69
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	25.89	933,619.29
EXACT SCIENCES CORP	14,756	78.38	1,156,575.28
GILEAD SCIENCES INC	97,060	61.90	6,008,014.00
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	97.70	1,751,370.20
ILLUMINA INC	11,258	333.86	3,758,595.88
INCYTE CORP	15,212	67.83	1,031,829.96
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	232.18	3,511,954.68
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	144.59	718,756.89
JOHNSON & JOHNSON	205,370	167.21	34,339,917.70
LILLY (ELI) & CO	63,296	245.58	15,544,231.68
MERCK & CO	197,066	77.22	15,217,436.52
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,462.20	2,643,657.60
MODERNA INC	27,309	151.81	4,145,779.29
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	85.87	727,662.38
NOVAVAX INC	5,754	86.55	498,008.70
PERKINELMER INC	9,372	181.92	1,704,954.24
PFIZER	437,000	49.68	21,710,160.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,116	630.90	5,120,384.40
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,128	40.50	1,058,184.00
SEAGEN INC	10,071	128.67	1,295,835.57
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	8.49	682,604.49
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,643	550.35	16,864,375.05
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,030	235.77	4,722,473.10
VIATRIS INC	90,748	15.25	1,383,907.00
WATERS CORP	4,749	319.56	1,517,590.44
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	379.32	2,187,538.44
ZOETIS INC	36,750	195.09	7,169,557.50

BANK OF AMERICA CORP	590,618	47.68	28,160,666.24
CITIGROUP	157,531	66.95	10,546,700.45
CITIZENS FINANCIAL GROUP	32,251	55.23	1,781,222.73
FIFTH THIRD BANCORP	52,803	49.51	2,614,276.53
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	788.03	748,628.50
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,787	175.13	2,414,517.31
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	16.19	1,847,473.28
JPMORGAN CHASE & CO	233,132	155.00	36,135,460.00
KEY CORP	71,472	26.61	1,901,869.92
M & T BANK CORP	10,537	186.10	1,960,935.70
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,936	208.59	6,870,120.24
REGIONS FINL CORP	70,814	25.24	1,787,345.36
SIGNATURE BANK	4,686	349.86	1,639,443.96
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	654.14	2,973,066.30
TRUIST FINANCIAL CORP	103,413	64.71	6,691,855.23
US BANCORP	109,092	58.60	6,392,791.20
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	61.98	884,640.54
WELLS FARGO & CO	319,909	58.14	18,599,509.26
ALLY FINANCIAL INC	27,761	50.44	1,400,264.84
AMERICAN EXPRESS	53,334	198.38	10,580,398.92
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	312.11	2,715,981.22
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	26,880	67.96	1,826,764.80
BANK NEW YORK CO	64,343	62.50	4,021,437.50
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	103,390	315.65	32,635,053.50
BLACKROCK INC	11,820	783.42	9,260,024.40
BLACKSTONE INC	54,507	126.78	6,910,397.46
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	35,046	158.86	5,567,407.56
CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	47.89	603,174.55
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	121.22	1,075,827.50
CME GROUP INC	27,828	238.92	6,648,665.76
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	2,868	207.96	596,429.28
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,403	126.82	2,967,968.46
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,355	34.59	946,209.45
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	412.32	1,297,983.36
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	31.38	818,076.60
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	45.64	196,982.24
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,636	360.05	9,590,291.80
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,703	125.72	5,620,061.16
INVESCO LTD	26,420	23.58	622,983.60
KKR & CO INC	39,913	62.20	2,482,588.60
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	374.78	1,201,919.46
MOODY'S CORP	13,365	330.62	4,418,736.30

MORGAN STANLEY	106,388	101.15	10,761,146.20
MSCI INC	6,518	543.60	3,543,184.80
NASDAQ INC	9,657	174.66	1,686,691.62
NORTHERN TRUST CORP	15,902	126.28	2,008,104.56
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	146.15	2,617,108.05
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	112.79	1,746,665.94
ROBINHOOD MARKETS INC - A	13,050	13.51	176,305.50
S&P GLOBAL INC	18,686	386.55	7,223,073.30
SCHWAB (CHARLES) CORP	112,432	89.33	10,043,550.56
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	60.55	578,252.50
SOFI TECHNOLOGIES INC	38,996	13.08	510,067.68
STATE STREET CORP	27,998	100.28	2,807,639.44
SYNCHRONY FINANCIAL	45,369	44.85	2,034,799.65
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	83.94	760,580.34
UPSTART HOLDINGS INC	1,362	148.01	201,589.62
AFLAC	50,591	64.52	3,264,131.32
ALLEGHANY CORP	906	693.45	628,265.70
ALLSTATE CORP	23,095	123.48	2,851,770.60
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	140.99	890,915.81
AMERICAN INT'L GROUP	65,898	60.34	3,976,285.32
AON PLC	17,508	285.05	4,990,655.40
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	47.65	1,416,443.90
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	156.21	2,555,439.39
ASSURANT INC	4,726	167.20	790,187.20
BROWN & BROWN INC	19,873	66.61	1,323,740.53
CHUBB LTD	34,591	204.91	7,088,041.81
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	128.14	1,639,038.74
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	184.46	399,540.36
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	303.08	996,527.04
FNF GROUP	20,461	48.69	996,246.09
GLOBE LIFE INC	8,106	105.89	858,344.34
HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,721	71.22	1,974,289.62
LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	73.51	991,208.84
LOEWS CORP	18,851	62.06	1,169,893.06
MARKEL CORP	1,156	1,275.06	1,473,969.36
MARSH & MCLENNAN COS	39,216	153.94	6,036,911.04
METLIFE INC	57,127	71.53	4,086,294.31
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,719	75.65	1,567,392.35
PROGRESSIVE CORP	45,110	106.08	4,785,268.80
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,037	118.16	3,667,331.92
TRAVELERS COS INC/THE	19,772	172.27	3,406,122.44
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,061	225.79	2,271,673.19

MR BERKLEY CORP	11,715	90.95	1,065,479.25
CBRE GROUP INC-A	25,382	101.65	2,580,080.30
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	5.70	562,590.00
WEYERHAEUSER CO	58,295	41.86	2,440,228.70
ZILLOW GROUP INC-A	5,497	63.31	348,015.07
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	64.02	859,596.54
ACCENTURE PLC-CL A	49,381	333.72	16,479,427.32
ADOBE INC	37,107	477.70	17,726,013.90
AFFIRM HOLDINGS INC	6,631	42.92	284,602.52
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	104.86	1,433,750.78
ANSYS INC	6,794	323.60	2,198,538.40
ASANA INC - CL A	4,986	74.13	369,612.18
AUTODESK INC	17,467	233.74	4,082,736.58
AUTOMATIC DATA PROCESS	32,782	204.24	6,695,395.68
AVALARA INC	6,847	101.76	696,750.72
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	40.12	561,519.52
BILL.COM HOLDINGS INC	5,794	256.90	1,488,478.60
BLACK KNIGHT INC	11,543	60.44	697,658.92
BLOCK INC	37,499	109.00	4,087,391.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	145.97	1,422,039.74
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,922	145.85	3,197,323.70
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	71.06	758,068.08
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	132.55	1,076,836.20
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	101.95	1,064,765.80
CLOUDFLARE INC - CLASS A	18,620	111.99	2,085,253.80
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	40,421	89.42	3,614,445.82
COUPA SOFTWARE INC	6,059	128.79	780,338.61
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	14,479	183.28	2,653,711.12
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	155.16	480,996.00
DATADOG INC - CLASS A	15,147	173.92	2,634,366.24
DOCUSIGN INC	14,969	120.14	1,798,375.66
DROPBOX INC-CLASS A	28,845	24.90	718,240.50
DYNATRACE INC	14,790	43.73	646,766.70
EPAM SYSTEMS INC	4,403	450.39	1,983,067.17
FAIR ISAAC CORP	2,125	511.56	1,087,065.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	48,175	100.43	4,838,215.25
FISERV INC	46,421	96.81	4,494,017.01
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,523	244.29	1,593,503.67
FORTINET INC	10,645	320.36	3,410,232.20
GARTNER INC	6,340	298.23	1,890,778.20
GLOBAL PAYMENTS INC	22,567	144.29	3,256,192.43
GODADDY INC - CLASS A	13,798	84.26	1,162,619.48

GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	95.45	603,053.10
HUBSPOT INC	3,646	542.80	1,979,048.80
INTL BUSINESS MACHINES CORP	69,612	129.18	8,992,478.16
INTUIT INC	21,247	528.15	11,221,603.05
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	169.54	1,066,576.14
MASTERCARD INC-CLASS A	68,686	382.93	26,301,929.98
MICROSOFT CORP	557,977	299.50	167,114,111.50
MONGODB INC	4,623	436.13	2,016,228.99
NORTONLIFELOCK INC	43,549	28.84	1,255,953.16
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,967	55.28	1,269,615.76
OKTA INC	10,230	188.55	1,928,866.50
ORACLE CORP	130,191	79.19	10,309,825.29
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	13.97	1,749,658.68
PALO ALTO NETWORKS INC	7,648	526.41	4,025,983.68
PAYCHEX INC	25,433	120.02	3,052,468.66
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	344.48	1,458,872.80
PAYPAL HOLDINGS INC	88,224	110.54	9,752,280.96
PTC INC	8,304	114.65	952,053.60
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	164.94	1,054,461.42
SALESFORCE.COM INC	76,228	211.74	16,140,516.72
SERVICENOW INC	15,383	590.89	9,089,660.87
SNOWFLAKE INC-CLASS A	16,606	304.70	5,059,848.20
SPLUNK INC	13,355	123.55	1,650,010.25
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	76.27	1,474,680.45
SYNOPSYS INC	12,038	306.79	3,693,138.02
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,090	80.91	2,677,311.90
TWILIO INC - A	12,842	186.99	2,401,325.58
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	469.74	1,568,461.86
UNITY SOFTWARE INC	4,329	110.28	477,402.12
VERISIGN INC	7,790	212.25	1,653,427.50
VISA INC-CLASS A SHARES	131,624	228.82	30,118,203.68
VMWARE INC-CLASS A	16,717	125.90	2,104,670.30
WESTERN UNION CO	29,297	19.83	580,959.51
WIX.COM LTD	5,010	89.06	446,190.60
WORKDAY INC-CLASS A	14,681	228.31	3,351,819.11
ZENDESK INC	8,890	118.00	1,049,020.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,028	138.51	2,358,548.28
ZSCALER INC	6,234	280.87	1,750,943.58
AMPHENOL CORPORATION	45,988	76.95	3,538,776.60
APPLE INC	1,291,969	172.55	222,929,250.95
ARISTA NETWORKS INC	18,880	132.44	2,500,467.20
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	127.70	778,970.00



CDW CORP/DE	10,882	185.48	2,018,393.36
CISCO SYSTEMS	328,253	54.25	17,807,725.25
COGNEX CORP	14,352	64.12	920,250.24
CORNING	64,989	42.39	2,754,883.71
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	60.29	1,355,379.49
F5 INC	4,150	204.07	846,890.50
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	98,742	17.64	1,741,808.88
HP INC	92,346	37.89	3,498,989.94
IPG PHOTONICS CORP	3,207	140.65	451,064.55
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	34.75	879,904.75
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	170.13	2,550,078.57
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,961	221.00	2,864,381.00
NETAPP INC	18,303	91.55	1,675,639.65
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	15,060	111.85	1,684,461.00
TE CONNECTIVITY LTD	26,068	149.74	3,903,422.32
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	426.47	1,662,806.53
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	68.59	1,452,461.84
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	56.39	1,454,298.10
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	430.97	1,793,697.14
AT&T INC	555,579	23.94	13,300,561.26
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	28.99	449,808.84
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	28.94	795,473.78
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	9.86	727,362.34
T-MOBILE US INC	49,657	127.46	6,329,281.22
VERIZON COMMUNICATIONS	322,452	53.40	17,218,936.80
AES CORP	54,375	21.89	1,190,268.75
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	56.33	1,170,424.74
AMEREN CORPORATION	20,898	84.47	1,765,254.06
AMERICAN ELECTRIC POWER	38,104	85.41	3,254,462.64
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,174	146.29	2,073,514.46
ATMOS ENERGY CORP	9,688	106.09	1,027,799.92
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	26.88	1,294,594.56
CMS ENERGY CORP	23,697	61.92	1,467,318.24
CONSOLIDATED EDISON INC	27,507	81.08	2,230,267.56
CONSTELLATION ENERGY	25,732	47.20	1,214,550.40
DOMINION ENERGY INC	62,375	78.67	4,907,041.25
DTE ENERGY COMPANY	14,651	116.49	1,706,694.99
DUKE ENERGY CORP	59,845	99.51	5,955,175.95
EDISON INTL	28,027	59.92	1,679,377.84
ENTERGY CORP	15,166	103.96	1,576,657.36
ESSENTIAL UTILITIES INC	17,002	45.19	768,320.38
EVERGY INC	18,475	61.21	1,130,854.75

EVERSOURCE ENERGY	26,753	81.65	2,184,382.45	
EXELON CORP	77,196	42.00	3,242,232.00	
FIRSTENERGY CORP	41,156	41.08	1,690,688.48	
NEXTERA ENERGY INC	152,538	75.23	11,475,433.74	
NISOURCE INC	28,687	28.40	814,710.80	
NRG ENERGY INC	19,068	39.09	745,368.12	
PG&E CORP	118,132	11.74	1,386,869.68	
PPL CORPORATION	63,429	28.23	1,790,600.67	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	64.79	2,557,131.72	
SEMPRA ENERGY	24,535	135.23	3,317,868.05	
SOUTHERN CO	84,113	64.87	5,456,410.31	
UGI CORP	18,019	37.98	684,361.62	
VISTRA CORP	37,797	21.72	820,950.84	
WEC ENERGY GROUP INC	24,561	89.12	2,188,876.32	
XCEL ENERGY INC	43,741	65.94	2,884,281.54	
ADVANCED MICRO DEVICES	129,220	117.69	15,207,901.80	
ANALOG DEVICES	41,625	168.34	7,007,152.50	
APPLIED MATERIALS	71,368	140.96	10,060,033.28	
BROADCOM INC	31,960	597.21	19,086,831.60	
ENPHASE ENERGY INC	10,113	154.03	1,557,705.39	
ENTEGRIS INC	10,491	135.39	1,420,376.49	
INTEL CORP	318,822	48.23	15,376,785.06	
KLA CORP	12,119	385.65	4,673,692.35	
LAM RESEARCH CORP	10,992	591.47	6,501,438.24	
MARVELL TECHNOLOGY INC	63,360	72.10	4,568,256.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	42,031	75.50	3,173,340.50	
MICRON TECHNOLOGY	87,336	96.06	8,389,496.16	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	487.57	1,721,609.67	
NVIDIA CORP	195,119	265.11	51,727,998.09	
NXP SEMICONDUCTORS NV	20,848	199.66	4,162,511.68	
ON SEMICONDUCTOR CORP	31,766	63.11	2,004,752.26	
QORVO INC	8,556	136.80	1,170,460.80	
QUALCOMM	87,800	172.60	15,154,280.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	140.20	1,874,754.40	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	3,750	266.72	1,000,200.00	
TERADYNE INC	12,318	119.11	1,467,196.98	
TEXAS INSTRUMENTS	71,796	168.24	12,078,959.04	
アメリカドル 小計	24,839,270		3,079,509,120.32 (355,621,713,214)	
カナダドル				
CAMECO CORP	26,880	27.34	734,899.20	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,194	68.43	6,377,265.42	
CENOVUS ENERGY INC	96,666	19.73	1,907,220.18	

ENBRIDGE	156,497	52.79	8,261,476.63
IMPERIAL OIL	16,573	55.51	919,967.23
KEYERA CORP	18,607	30.39	565,466.73
PARKLAND CORP	14,075	34.55	486,291.25
PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	42.64	1,947,198.24
SUNCOR ENERGY	116,208	37.57	4,365,934.56
TC ENERGY CORP	77,328	66.49	5,141,538.72
TOURMALINE OIL CORP	22,173	46.85	1,038,805.05
AGNICO EAGLE MINES	38,883	66.31	2,578,331.73
BARRICK GOLD CORP	139,009	28.21	3,921,443.89
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	64.25	844,180.75
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	34.76	1,494,680.00
FRANCO-NEVADA CORP	15,363	184.41	2,833,090.83
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	11.49	595,722.03
KINROSS GOLD CORP	108,451	7.45	807,959.95
LUNDIN MINING CORP	62,243	12.05	750,028.15
NUTRIEN LTD	44,786	95.28	4,267,210.08
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	30.83	567,611.13
TECK RESOURCES LTD-CL B	34,747	45.93	1,595,929.71
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	125.01	975,078.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,238	54.32	1,859,808.16
BALLARD POWER SYSTEMS INC	19,724	13.26	261,540.24
CAE INC	25,999	33.49	870,706.51
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,585	112.56	628,647.60
WSP GLOBAL INC	8,602	159.23	1,369,696.46
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	37.34	504,276.70
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	73.54	753,417.30
THOMSON REUTERS CORP	13,293	130.06	1,728,887.58
AIR CANADA	13,805	25.11	346,643.55
CANADIAN NATL RAILWAY CO	55,489	161.04	8,935,948.56
CP RAILWAY LIMITED	73,737	94.43	6,962,984.91
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	133.46	779,006.02
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	101.19	2,355,905.58
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	50.52	862,831.08
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	74.32	1,714,785.36
QUEBECOR INC -CL B	15,200	30.72	466,944.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	37.48	1,327,616.56
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,579	184.53	660,432.87
DOLLARAMA INC	22,000	64.81	1,425,820.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	62,004	51.50	3,193,206.00
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	39.39	600,815.67
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	99.09	1,279,549.17

METRO INC	18,840	66.94	1,261,149.60
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	138.51	723,853.26
SAPUTO INC	14,489	30.62	443,653.18
BAUSCH HEALTH COS INC	20,800	32.31	672,048.00
CANOPY GROWTH CORP	20,989	11.08	232,558.12
BANK MONTREAL	51,389	149.38	7,676,488.82
BANK NOVA SCOTIA	96,500	92.74	8,949,410.00
CANADIAN IMPERIAL BANK	34,494	162.91	5,619,417.54
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	102.90	2,808,038.10
ROYAL BANK OF CANADA	110,677	144.87	16,033,776.99
TORONTO-DOMINION BANK	141,487	107.75	15,245,224.25
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	110,505	71.50	7,901,107.50
IGM FINANCIAL INC	7,685	45.88	352,587.80
ONEX CORP	6,603	90.74	599,156.22
TMX GROUP LTD	4,685	130.18	609,893.30
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	654.99	1,397,093.67
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	39.39	937,009.32
IA FINANCIAL CORP INC	10,099	80.63	814,282.37
INTACT FINANCIAL CORP	13,312	184.53	2,456,463.36
MANULIFE FINANCIAL CORP	147,886	27.48	4,063,907.28
POWER CORP OF CANADA	43,577	41.20	1,795,372.40
SUN LIFE FINANCIAL INC	45,702	68.77	3,142,926.54
FIRSTSERVICE CORP	2,690	189.26	509,109.40
BLACKBERRY LIMITED	39,400	9.09	358,146.00
CGI INC - CL A	16,178	107.92	1,745,929.76
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,527	2,092.13	3,194,682.51
LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	38.91	322,797.36
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	79.42	341,585.42
OPEN TEXT CORP	20,463	56.03	1,146,541.89
SHOPIFY INC - CLASS A	8,756	938.91	8,221,095.96
BCE INC	6,203	66.52	412,623.56
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	26,167	67.04	1,754,235.68
TELUS CORP	32,908	31.80	1,046,474.40
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	17.74	919,251.32
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	27.69	675,497.55
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	44.51	502,740.45
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	34.78	359,068.72
EMERA INC	18,723	58.26	1,090,801.98
FORTIS INC	36,823	57.16	2,104,802.68
HYDRO ONE LTD	23,269	31.43	731,344.67
NORTHLAND POWER INC	17,854	36.55	652,563.70
	3,090,955		201,691,509.97

	カナダドル 小計			(18,357,961,237)
ユーロ	ENI	197,669	13.30	2,630,579.05
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	27,945	10.23	285,877.35
	NESTE OIL OYJ	32,126	38.43	1,234,602.18
	OMV AG	12,549	57.46	721,065.54
	REPSOL SA	111,112	11.93	1,326,010.60
	TENARIS SA	40,648	11.85	481,882.04
	TOTALENERGIES SE	194,564	51.42	10,004,480.88
	AIR LIQUIDE	36,913	148.40	5,477,889.20
	AKZO NOBEL	15,301	94.74	1,449,616.74
	ARCELORMITTAL	55,231	27.77	1,534,041.02
	ARKEMA	4,369	128.75	562,508.75
	BASF SE	71,168	68.52	4,876,431.36
	COVESTRO AG	14,454	54.68	790,344.72
	CRH PLC	59,653	44.17	2,634,873.01
	EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	29.58	584,323.32
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	37.98	218,840.76
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	67.44	879,485.04
	KONINKLIJKE DSM NV	13,707	164.75	2,258,228.25
	LANXESS	7,293	54.58	398,051.94
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	48.16	939,312.64
	SOLVAY SA	5,356	110.90	593,980.40
	STORA ENSO OYJ R	42,169	18.47	778,861.43
	SYMRISE AG	9,776	104.00	1,016,704.00
	UMICORE	17,605	35.50	624,977.50
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	33.84	1,432,244.16
	VOESTALPINE AG	7,152	31.44	224,858.88
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,729	22.53	467,024.37
	ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	20,729	0.44	9,234.76
	AIRBUS SE	45,872	117.88	5,407,391.36
	ALSTOM	24,388	26.29	641,160.52
	BOUYGUES ORD	16,606	32.51	539,861.06
	BRENTAG SE	12,514	78.50	982,349.00
	CNH INDUSTRIAL NV	81,026	14.25	1,154,620.50
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,388	31.50	1,051,722.00
	DASSAULT AVIATION SA	2,130	117.60	250,488.00
	EIFFAGE	5,924	98.14	581,381.36
	FERROVIAL SA	33,914	25.17	853,615.38
	GEA GROUP AG	13,382	41.23	551,739.86
	IMCD NV	4,641	142.65	662,038.65
	KINGSPAN GROUP PLC	12,398	90.82	1,125,986.36
	KION GROUP AG	5,887	79.96	470,724.52

KNORR-BREMSE AG	5,022	90.64	455,194.08
KONE OYJ-B	26,311	54.72	1,439,737.92
LEGRAND SA	21,768	86.42	1,881,190.56
MTU AERO ENGINES AG	3,962	210.60	834,397.20
PRYSMIAN SPA	21,155	29.18	617,302.90
RATIONAL AG	483	688.00	332,304.00
SAFRAN SA	26,190	116.00	3,038,040.00
SAINT-GOBAIN	40,093	62.19	2,493,383.67
SCHNEIDER ELECTRIC SE	41,726	145.74	6,081,147.24
SIEMENS	59,486	142.54	8,479,134.44
SIEMENS ENERGY AG	26,851	19.08	512,317.08
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	17.06	382,853.27
THALES SA	7,437	84.56	628,872.72
VINCI S.A.	41,084	102.56	4,213,575.04
WARTSILA OYJ	41,917	10.54	441,805.18
BUREAU VERITAS SA	25,073	24.57	616,043.61
RANDSTAD NV	7,558	64.82	489,909.56
TELEPERFORMANCE	4,734	316.70	1,499,257.80
WOLTERS KLUWER	20,839	87.02	1,813,409.78
ADP	2,382	135.40	322,522.80
AENA SME SA	5,508	154.65	851,812.20
ATLANTIA SPA	35,937	16.63	597,811.99
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	7.80	181,684.50
DEUTSCHE POST AG-REG	78,714	50.93	4,008,904.02
GETLINK	29,362	14.38	422,372.37
INPOST SA	12,480	6.18	77,201.28
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	94.05	2,455,363.35
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	80.25	400,527.75
CONTINENTAL AG	8,168	87.36	713,556.48
FAURECIA	10,948	41.50	454,342.00
FERRARI NV	10,170	195.65	1,989,760.50
MERCEDES-BENZ GROUP AG	66,777	75.82	5,063,032.14
MICHELIN	13,839	137.90	1,908,398.10
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	87.76	1,030,741.20
RENAULT SA	17,362	37.17	645,432.35
STELLANTIS NV	159,744	17.17	2,742,804.48
VALEO SA	21,538	26.62	573,341.56
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,282	186.02	2,656,737.64
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	253.80	630,946.80
ADIDAS AG	14,703	234.25	3,444,177.75
ESSILORLUXOTTICA	22,072	167.84	3,704,564.48
HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,241.50	3,152,168.50

KERING	5,855	632.60	3,703,873.00
LVMH	21,584	687.60	14,841,158.40
MONCLER SPA	14,361	55.88	802,492.68
PUMA SE	9,220	90.16	831,275.20
SEB SA	2,282	138.00	314,916.00
ACCOR	14,436	34.00	490,824.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,048	132.15	1,724,293.20
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	37.84	306,806.72
SODEXO	6,027	84.98	512,174.46
BOLLORE	83,646	4.89	409,698.10
PUBLICIS GROUPE	17,077	63.60	1,086,097.20
SCOUT24 SE	7,492	52.14	390,632.88
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	45.66	322,861.86
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	61,243	20.60	1,261,605.80
VIVENDI SE	61,243	11.58	709,500.15
DELIVERY HERO SE	13,414	49.67	666,273.38
INDITEX	87,326	25.43	2,220,700.18
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	39.38	613,225.36
PROSUS	72,497	67.65	4,904,422.05
ZALANDO SE	17,664	63.02	1,113,185.28
CARREFOUR	52,544	17.18	902,968.64
COLRUYT SA	5,424	36.24	196,565.76
HELLOFRESH SE	13,805	51.38	709,300.90
JERONIMO MARTINS	24,901	19.83	493,786.83
KESKO OYJ-B SHS	20,083	27.02	542,642.66
KONINKLIJKE AHOLD NV	79,170	26.86	2,126,902.05
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,098	56.30	3,383,517.40
DANONE (GROUPE)	51,543	55.37	2,853,935.91
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	10.47	513,836.19
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	77.95	721,115.45
HEINEKEN NV	20,157	97.00	1,955,229.00
JDE PEET'S BV	7,000	26.76	187,320.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	108.95	1,421,797.50
PERNOD-RICARD	15,976	190.90	3,049,818.40
REMY COINTREAU	1,382	176.20	243,508.40
BEIERSDORF AG	7,430	88.24	655,623.20
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	70.75	621,185.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	73.18	1,056,646.02
LOREAL	19,839	355.15	7,045,820.85
AMPLIFON SPA	11,650	35.67	415,555.50
BIOMERIEUX	3,044	103.15	313,988.60
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	140.10	480,543.00

DIASORIN SPA	2,070	121.75	252,022.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	14,472	59.48	860,794.56
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	37.88	1,276,139.32
KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	29.78	2,136,863.90
ORPEA	4,336	37.94	164,507.84
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	420.50	766,992.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	54.90	1,184,028.30
ARGENX SE	3,428	259.50	889,566.00
BAYER	76,002	54.07	4,109,428.14
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	85.78	876,671.60
GRIFOLS SA	27,685	14.89	412,368.07
IPSEN	3,532	96.88	342,180.16
MERCK KGAA	10,555	180.90	1,909,399.50
ORION OYJ-CLASS B	9,854	36.42	358,882.68
QIAGEN N.V.	17,038	42.87	730,419.06
RECORDATI SPA	9,859	45.51	448,683.09
SANOFI	88,048	93.49	8,231,607.52
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,939	356.20	690,671.80
UCB (GROUPE)	9,389	86.82	815,152.98
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	12.96	517,615.68
BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	5.81	3,110,780.65
BANCO SANTANDER SA	1,339,491	3.37	4,526,140.08
BNP PARIBAS	86,730	62.75	5,442,307.50
CAIXABANK	330,447	3.28	1,084,196.60
COMMERZBANK AG	61,889	8.57	530,883.84
CREDIT AGRICOLE SA	89,515	13.43	1,202,902.57
ERSTE GROUP BANK AG	23,905	41.91	1,001,858.55
FINECOBANK SPA	53,120	15.98	848,857.60
ING GROEP NV-CVA	301,618	12.94	3,903,540.15
INTESA SANPAOLO	1,251,055	2.79	3,491,694.50
KBC GROEP NV	18,608	76.28	1,419,418.24
MEDIOBANCA	53,990	10.38	560,416.20
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	26.20	327,238.00
SOCIETE GENERALE	63,329	33.89	2,146,219.81
UNICREDIT SPA	168,352	15.09	2,540,768.38
AMUNDI SA	4,626	68.30	315,955.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	160,613	13.88	2,229,950.89
DEUTSCHE BOERSE	14,999	159.05	2,385,590.95
EURAZEO SA	3,357	71.85	241,200.45
EURONEXT NV	6,480	82.40	533,952.00
EXOR NV	7,825	74.34	581,710.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	94.88	807,903.20



SOFINA	1,238	350.20	433,547.60
WENDEL	2,023	93.25	188,644.75
AEGON	114,647	4.89	560,853.12
AGEAS	11,086	44.35	491,664.10
ALLIANZ SE-REG	32,037	225.40	7,221,139.80
ASSICURAZIONI GENERALI	85,637	18.95	1,623,249.33
AXA SA	148,584	28.00	4,160,352.00
CNP ASSURANCES	16,287	21.82	355,382.34
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	176.05	762,824.65
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,795	267.65	2,889,281.75
NN GROUP NV	22,611	50.60	1,144,116.60
POSTE ITALIANE SPA	46,035	11.09	510,758.32
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	44.51	1,720,534.05
AROUNDTOWN SA	64,068	5.60	358,780.80
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	115.85	611,108.75
VONOVIA SE	59,080	47.91	2,830,522.80
ADYEN NV	1,566	2,032.00	3,182,112.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	62.70	2,231,116.80
BECHTLE AG	7,659	47.75	365,717.25
CAPGEMINI SA	12,715	183.00	2,326,845.00
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	41.02	2,164,766.17
EDENRED	18,664	39.22	732,002.08
NEMETSCHKE SE	5,455	77.58	423,198.90
NEXI SPA	31,458	12.99	408,796.71
SAP SE	81,213	105.50	8,567,971.50
WORLDLINE SA	20,332	45.99	935,068.68
NOKIA OYJ	427,600	5.10	2,184,608.40
CELLNEX TELECOM SA	41,435	39.32	1,629,224.20
DEUTSCHE TELEKOM	258,113	17.50	4,516,977.50
ELISA A	10,227	51.22	523,826.94
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	8.86	269,244.00
KPN (KON.)	282,927	3.09	874,810.28
ORANGE	153,815	10.87	1,672,584.31
PROXIMUS	13,141	18.29	240,348.89
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.41	353,297.54
TELEFONICA	417,939	4.38	1,832,244.57
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.65	262,384.47
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	34.82	331,242.66
E.ON SE	170,377	12.01	2,046,227.77
EDP RENOVAVEIS SA	21,466	17.92	384,670.72
ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	8.35	330,158.43
ELIA GROUP SA/NV	2,925	116.90	341,932.50

	ENAGAS	15,690	18.57	291,363.30
	ENDESA	25,972	18.63	483,858.36
	ENEL	617,915	6.51	4,022,626.65
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.12	930,102.36
	ENGIE	141,564	14.13	2,000,582.44
	FORTUM OYJ	32,550	23.26	757,113.00
	IBERDROLA SA	449,446	9.41	4,231,084.64
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	24.91	249,349.10
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	16.99	521,372.61
	RWE STAMM	49,680	36.88	1,832,198.40
	SNAM SPA	147,559	4.82	711,381.93
	TERNA SPA	102,810	6.78	697,257.42
	UNIPER SE	7,335	38.60	283,131.00
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,027	32.26	1,646,131.02
	VERBUND AG	6,430	93.40	600,562.00
	ASM INTERNATIONAL NV	3,483	286.30	997,182.90
	ASML HOLDING NV	32,248	573.90	18,507,127.20
	INFINEON TECHNOLOGIES	105,296	33.19	3,495,300.72
	STMICROELECTRONICS	55,076	39.90	2,197,807.78
	ユーロ 小計	14,405,132		375,762,264.93 (49,386,434,479)
イギリスポンド	BP PLC	1,555,608	4.03	6,280,767.30
	SHELL PLC-NEW	598,230	20.23	12,105,184.05
	ANGLO AMERICAN PLC	102,156	35.82	3,659,227.92
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	14.03	503,059.68
	BHP GROUP LIMITED	167,196	25.26	4,223,370.96
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	73.22	799,855.28
	GLENCORE PLC	767,331	4.25	3,263,458.74
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	18.20	306,717.84
	MONDI PLC	36,710	19.14	702,629.40
	RIO TINTO PLC REG	87,100	57.08	4,971,668.00
	ASHTED GROUP PLC	34,104	49.36	1,683,373.44
	BAE SYSTEMS PLC	260,104	5.98	1,555,942.12
	BUNZL PLC	24,880	27.07	673,501.60
	DCC PLC	6,622	62.84	416,126.48
	FERGUSON PLC	17,761	110.55	1,963,478.55
	MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	1.58	506,526.76
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	1.21	774,028.43
	SMITHS GROUP PLC	26,476	15.42	408,259.92
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	120.10	662,231.40
	EXPERIAN PLC	74,115	29.10	2,156,746.50
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	52.20	725,058.00

RELX PLC	149,517	22.61	3,380,579.37
RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	5.00	703,242.88
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	6.12	448,289.04
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7,688	40.52	311,517.76
BURBERRY GROUP PLC	29,776	19.68	585,991.68
PERSIMMON PLC	25,686	24.44	627,765.84
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.52	403,418.86
COMPASS GROUP PLC	142,427	17.79	2,533,776.33
ENTAIN PLC	49,630	17.04	845,695.20
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,541	51.02	639,841.82
WHITBREAD PLC	17,434	31.92	556,493.28
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.40	464,191.57
INFORMA PLC	110,598	6.20	685,707.60
PEARSON	66,305	6.23	413,212.76
WPP PLC	95,821	12.12	1,161,829.62
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.66	343,329.50
KINGFISHER PLC	153,717	3.18	490,203.51
NEXT PLC	11,468	69.78	800,237.04
OCADO GROUP PLC	35,862	13.42	481,447.35
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.80	415,783.00
TESCO PLC	601,050	2.94	1,771,594.87
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	19.00	489,060.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO	168,277	34.39	5,787,046.03
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	24.46	439,301.60
DIAGEO	180,509	36.05	6,507,349.45
IMPERIAL BRANDS PLC	68,756	18.05	1,241,389.58
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	54,630	58.07	3,172,364.10
UNILEVER PLC	204,424	38.18	7,804,908.32
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	12.12	831,371.40
ASTRAZENECA	120,234	89.16	10,720,063.44
GLAXOSMITHKLINE	388,893	15.76	6,128,953.68
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	19.84	326,447.36
BARCLAYS	1,339,545	1.96	2,625,508.20
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,583,882	5.48	8,684,425.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,443,807	0.51	2,826,968.97
NATWEST GROUP PLC	443,701	2.43	1,079,968.23
STANDARD CHARTERED PLC	212,446	5.48	1,165,478.75
3I GROUP PLC	74,757	13.45	1,005,481.65
ABRDN PLC	153,430	2.41	370,993.74
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	13.09	433,169.50
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	24,732	68.84	1,702,550.88
M&G PLC	229,107	2.16	495,787.54

	SCHRODERS PLC	11,794	32.70	385,663.80
	ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	15.16	620,764.11
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	30.42	494,477.10
	AVIVA PIC	296,550	4.41	1,309,861.35
	LEGAL & GENERAL GROUP	460,759	2.77	1,276,763.18
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.63	338,442.63
	PRUDENTIAL	210,968	12.16	2,565,370.88
	AVEVA GROUP PLC	10,917	27.01	294,868.17
	SAGE GROUP PLC	76,660	6.88	527,420.80
	HALMA PLC	31,069	23.46	728,878.74
	BT GROUP PLC	648,635	2.00	1,303,107.71
	VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	1.39	3,075,620.67
	NATIONAL GRID PLC	286,046	10.80	3,091,585.16
	SEVERN TRENT PLC	22,468	28.42	638,540.56
	SSE PLC	81,663	15.84	1,293,541.92
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.54	617,433.20
	イギリスポンド 小計	22,574,042		148,806,288.65 (23,353,658,940)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	17.16	298,636.67
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	947.00	543,578.00
	GIVAUDAN-REG	748	3,681.00	2,753,388.00
	HOLCIM LTD	40,627	51.62	2,097,165.74
	SIKA AG-BR	10,926	302.90	3,309,485.40
	ABB LTD	127,656	32.37	4,132,224.72
	GEBERIT AG-REG	2,964	608.40	1,803,297.60
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,375	212.80	292,600.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	214.70	663,852.40
	VAT GROUP AG	1,956	353.00	690,468.00
	ADECCO GROUP AG-REG	10,450	47.42	495,539.00
	SGS SA	506	2,597.00	1,314,082.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	256.10	1,172,169.70
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,341	132.00	5,457,012.00
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	289.10	717,835.30
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	55.70	219,346.60
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,112.00	591,360.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	104,900.00	839,200.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,120.00	829,840.00
	NESTLE SA - REGISTERED	219,354	117.30	25,730,224.20
	ALCON INC	39,333	73.98	2,909,855.34
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,007	327.40	1,311,891.80
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	854	1,462.00	1,248,548.00
	BACHEM HOLDING AG-REG B	370	516.00	190,920.00

	LONZA GROUP AG-REG	5,895	613.00	3,613,635.00
	NOVARTIS	170,286	80.73	13,747,188.78
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,799	379.80	1,063,060.20
	ROCHE HOLDING GENUSS	54,689	349.30	19,102,867.70
	VIFOR PHARMA AG	3,360	162.90	547,344.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	8.45	1,803,175.03
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	59.58	1,125,883.26
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	1,276.00	2,338,908.00
	UBS GROUP AG	271,096	18.92	5,130,491.80
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,174	160.90	510,696.60
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	599.40	1,449,948.60
	SWISS RE LTD	22,836	99.44	2,270,811.84
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,660	442.00	5,153,720.00
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	89.50	508,270.50
	TEMENOS AG - REG	5,150	101.15	520,922.50
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	74.46	1,093,519.56
	SWISSCOM	2,187	546.60	1,195,414.20
	スイスフラン 小計	1,344,888		120,788,378.04 (15,132,368,000)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	330.80	5,697,037.60
	BOLIDEN AB	18,479	403.70	7,459,972.30
	SCA SV CELLULOSA B	43,887	164.45	7,217,217.15
	ALFA LAVAL AB	27,268	294.60	8,033,152.80
	ASSA ABLOY AB-B	78,158	267.80	20,930,712.40
	ATLAS COPCO A	51,320	508.00	26,070,560.00
	ATLAS COPCO B	31,902	447.00	14,260,194.00
	EPIROC AB-A	46,999	197.25	9,270,552.75
	EPIROC AB-B	37,972	168.80	6,409,673.60
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	122.00	4,722,864.00
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	274.30	3,840,748.60
	LIFCO AB-B SHS	17,970	210.40	3,780,888.00
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	107,624	89.42	9,623,738.08
	SANDVIK AB	87,644	244.10	21,393,900.40
	SKANSKA B	25,507	240.50	6,134,433.50
	SKF AB-B	24,865	192.00	4,774,080.00
	VOLVO AB-A SHS	13,514	218.20	2,948,754.80
	VOLVO B	111,799	214.65	23,997,655.35
	SECURITAS B	29,533	120.05	3,545,436.65
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	184.60	3,926,257.40
	EVOLUTION AB	14,096	1,077.20	15,184,211.20
	EMBRACER GROUP AB	37,510	80.25	3,010,177.50
	HENNES & MAURITZ B	55,229	179.30	9,902,559.70

	SWEDISH MATCH AB	127,270	73.20	9,316,164.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	264.40	13,080,925.60	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	361.40	6,431,474.40	
	NORDEA BANK ABP	253,851	109.00	27,669,759.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	120,740	121.85	14,712,169.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	110,736	97.36	10,781,256.96	
	SWEDBANK AB-A	72,526	169.92	12,323,617.92	
	EQT AB	23,207	343.40	7,969,283.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	297.40	3,514,673.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	292.60	3,267,756.80	
	INVESTOR AB-A SHS	38,925	214.40	8,345,520.00	
	INVESTOR AB-B SHS	142,777	200.40	28,612,510.80	
	KINNEVIK AB - B	18,792	255.50	4,801,356.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	484.70	3,528,616.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	9,450	616.80	5,828,760.00	
	SAGAX AB-B	12,402	272.00	3,373,344.00	
	SINCH AB	44,150	99.14	4,377,031.00	
	ERICSSON (LM) B	225,508	99.11	22,350,097.88	
	HEXAGON AB-B SHS	153,838	124.95	19,222,058.10	
	TELE2 AB-B SHS	32,829	132.30	4,343,276.70	
	TELIA CO AB	230,643	37.70	8,696,394.31	
	スウェーデンクローナ 小計	2,667,661		444,680,823.25 (5,527,382,632)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	6,114	263.10	1,608,593.40	
	EQUINOR ASA	76,370	265.85	20,302,964.50	
	NORSK HYDRO	96,800	77.54	7,505,872.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	448.80	5,609,102.40	
	ADEVINTA ASA	19,117	86.10	1,645,973.70	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	206.60	1,916,008.40	
	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	232.80	1,648,689.60	
	MOWI ASA	31,968	239.30	7,649,942.40	
	ORKLA	69,804	82.66	5,769,998.64	
	DNB BANK ASA	71,795	210.80	15,134,386.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	214.20	3,978,550.80	
	TELENOR ASA	51,193	138.45	7,087,670.85	
	ノルウェークローネ 小計	470,589		79,857,752.69 (1,036,553,629)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	486.30	4,125,282.90	
	NOVOZYMES A/S	17,111	399.20	6,830,711.20	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	755	2,706.00	2,043,030.00	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	81,654	172.40	14,077,149.60	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	22,080.00	4,835,520.00	

	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	23,180.00	10,060,120.00	
	DSV A/S	16,380	1,270.00	20,802,600.00	
	PANDORA A/S	8,163	724.00	5,910,012.00	
	CARLSBERG AS-B	7,077	1,071.50	7,583,005.50	
	AMBU A/S-B	13,555	121.35	1,644,899.25	
	COLOPLAST-B	9,208	934.00	8,600,272.00	
	DEMANT A/S	8,512	278.80	2,373,145.60	
	GN STORE NORD A/S	9,226	371.80	3,430,226.80	
	GENMAB A/S	5,250	2,229.00	11,702,250.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	132,369	673.00	89,084,337.00	
	DANSKE BANK A/S	56,132	130.40	7,319,612.80	
	TRYG A/S	29,772	153.35	4,565,536.20	
	ORSTED A/S	15,439	670.40	10,350,305.60	
	デンマーククローネ 小計	419,739		215,338,016.45 (3,802,869,370)	
ロシアグループ	RASPADSKAYA OJSC	18,298	517.00	9,460,066.00	
	ロシアグループ 小計	18,298		9,460,066.00 (14,473,900)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	32.18	663,841.22	
	SANTOS	236,159	7.19	1,697,983.21	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	26.16	335,188.08	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,404	26.63	1,981,378.52	
	BHP GROUP LTD	234,548	47.33	11,101,156.84	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	18.92	657,848.40	
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	4.01	489,837.54	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	127,366	21.15	2,693,790.90	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	46.99	1,736,186.52	
	NEWCREST MINING LIMITED	61,178	23.50	1,437,683.00	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	9.04	918,717.12	
	ORICA LTD	38,288	14.93	571,639.84	
	RIO TINTO LTD	28,818	118.56	3,416,662.08	
	SOUTH32 LTD	341,133	4.45	1,518,041.85	
	REECE LTD	16,814	20.44	343,678.16	
	BRAMBLES LTD	108,007	10.01	1,081,150.07	
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.63	434,115.33	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.36	455,600.00	
	TRANSURBAN GROUP	233,493	12.88	3,007,389.84	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	40.98	1,893,685.80	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	12.56	380,919.68	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	105.03	371,911.23	
	IDP EDUCATION LTD	17,793	28.34	504,253.62	
	TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	5.15	937,366.95	

	REA GROUP LTD	3,586	138.59	496,983.74
	SEEK LTD	28,001	29.01	812,309.01
	WESFARMERS LTD	87,120	54.92	4,784,630.40
	COLES GROUP LTD	108,486	16.62	1,803,037.32
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	6.36	698,970.36
	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	34.55	3,451,579.55
	TREASURY WINE ESTATES LTD	45,808	11.77	539,160.16
	COCHLEAR LIMITED	4,783	194.07	928,236.81
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	64.73	1,051,733.04
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	38.02	1,416,283.02
	CSL LIMITED	35,618	263.69	9,392,110.42
	AUST AND NZ BANKING GROUP	225,511	28.10	6,336,859.10
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	137,483	98.57	13,551,699.31
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	253,530	30.64	7,768,159.20
	WESTPAC BANKING	283,793	23.29	6,609,538.97
	ASX LTD	14,549	82.03	1,193,454.47
	MACQUARIE GROUP LIMITED	27,074	196.99	5,333,307.26
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	18.33	200,016.96
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	168,725	4.70	793,007.50
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.22	747,629.26
	QBE INSURANCE GROUP	111,591	12.67	1,413,857.97
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	11.52	1,092,833.28
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	23.13	1,026,416.88
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	47.00	648,647.00
	XERO LTD	11,340	109.04	1,236,513.60
	TELSTRA CORP	308,467	4.07	1,255,460.69
	ORIGIN ENERGY LIMITED	119,082	6.10	726,400.20
	オーストラリアドル 小計	4,947,610		113,938,861.28 (9,467,179,983)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.14	841,598.94
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	29.35	1,173,413.00
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	9.35	339,563.95
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.49	778,165.41
	MERCURY NZ LTD	64,613	5.85	377,986.05
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.99	551,614.56
	ニュージーランドドル 小計	542,443		4,062,341.91 (313,775,289)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	193,996	59.10	11,465,163.60
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	135.80	14,530,600.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	22.15	3,809,800.00
	MTR CORP	125,000	42.80	5,350,000.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	32.25	3,870,000.00



	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	48.40	8,421,600.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	23.55	4,662,900.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	15.88	2,734,536.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	23.30	3,399,470.00	
	WH GROUP LTD	474,801	5.66	2,687,373.66	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	32.10	9,036,150.00	
	HANG SENG BANK	59,400	167.80	9,967,320.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,800	439.60	42,113,680.00	
	AIA GROUP LTD	933,800	88.30	82,454,540.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	52.85	8,693,613.60	
	ESR CAYMAN LTD	157,000	25.75	4,042,750.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	16.36	2,830,280.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	34.50	4,320,366.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	32.95	4,493,556.25	
	SINO LAND CO	315,400	10.42	3,286,468.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	99.00	10,692,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	48.20	1,952,100.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	21.50	2,068,300.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	36.75	4,373,250.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	50.40	3,402,000.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	79.80	10,972,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	12.16	11,000,629.12	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	50.15	5,616,800.00	
	香港ドル 小計	5,910,253		282,247,746.23 (4,177,266,644)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	137,300	6.08	834,784.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.86	568,964.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.33	577,409.56	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.78	482,775.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.72	842,992.00	
	DBS GROUP	141,500	36.80	5,207,200.00	
	OCBC BANK	257,100	13.40	3,445,140.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	32.75	3,075,225.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	45,100	9.79	441,529.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.69	824,715.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	7.33	313,724.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.25	344,375.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	18.52	475,964.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	584,543	2.55	1,490,584.65	
	シンガポールドル 小計	2,648,275		18,925,381.21 (1,627,772,037)	
	ICL LTD	42,053	32.30	1,358,311.90	

イスラエルシェケル	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	561.00	1,203,906.00	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	34.07	3,349,421.70	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	35.17	3,828,746.88	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	21.70	2,159,150.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	126.90	1,586,630.70	
	AZRIELI GROUP	4,323	279.50	1,208,278.50	
	NICE LTD	4,991	831.50	4,150,016.50	
イスラエルシェケル 小計		372,690		18,844,462.18 (682,369,282)	
合 計		84,251,845		488,501,778,636 (488,501,778,636)	

## (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	821,141.49	
		LENDLEASE GROUP	64,786	655,634.32	
	オーストラリアドル 小計		147,479	1,476,775.81 (122,705,302)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,741,950.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,072,500.00	
	香港ドル 小計		595,500	5,814,450.00 (86,053,860)	
投資信託受益証券合計			742,979	208,759,162 (208,759,162)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	640,238.40	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,971	2,052,564.39	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	35,326	8,207,289.58	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	95,067	692,087.76	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,718,206.84	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	1,380,128.22	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	1,269,053.73	
		CROWN CASTLE INTL CORP	33,199	5,466,879.33	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	22,174	2,984,620.40	
		DUKE REALTY CORP	27,540	1,483,579.80	
		EQUINIX INC	7,120	4,795,889.60	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	1,090,988.70	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	27,140	2,340,282.20	
		ESSEX PROPERTY TRUST	4,770	1,522,488.60	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	2,073,179.68	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,449,385.30	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,096,286.63			

	INVITATION HOMES INC	46,840	1,894,678.00	
	IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,026,577.26	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	1,033,243.40	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,403	1,753,369.98	
	PROLOGIS INC	57,379	8,284,380.02	
	PUBLIC STORAGE	12,441	4,375,748.52	
	REALTY INCOME CORP	41,563	2,803,008.72	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	841,614.97	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,607,772.89	
	SIMON PROPERTY GROUP	25,518	3,671,019.48	
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,739,482.85	
	UDR INC	24,265	1,336,273.55	
	VENTAS INC	31,565	1,654,637.30	
	VICI PROPERTIES INC	43,921	1,264,046.38	
	VORNADO REALTY TRUST	11,390	512,550.00	
	WELLTOWER INC	32,739	2,746,474.71	
	WP CAREY INC	14,258	1,093,018.28	
	アメリカドル 小計	920,706	79,901,045.47 (9,226,972,730)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	271,130.76	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	381,208.90	
	カナダドル 小計	20,377	652,339.66 (59,375,955)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	372,546.96	
	GECINA SA	3,139	362,554.50	
	KLEPIERRE	17,225	429,763.75	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	752,760.00	
	ユーロ 小計	35,781	1,917,625.21 (252,033,481)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	434,394.58	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	46,289	373,737.38	
	SEGRO PLC	93,383	1,193,434.74	
	イギリスポンド 小計	219,086	2,001,566.70 (314,125,877)	
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	996,413.10	
	GOODMAN GROUP	124,848	2,996,352.00	
	GPT GROUP	167,884	842,777.68	
	MIRVAC GROUP	266,683	688,042.14	
	SCENTRE GROUP	382,183	1,203,876.45	
	STOCKLAND	207,412	844,166.84	
	VICINITY CENTERS	365,149	681,002.88	
	オーストラリアドル 小計	1,608,249	8,252,631.09 (685,711,117)	

香港ドル	LINK REIT	170,500	11,346,775.00	
香港ドル 小計		170,500	11,346,775.00	(167,932,270)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	804,110.54	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	340,429	714,900.90	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	400,400.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	495,580.75	
シンガポールドル 小計		1,127,756	2,414,992.19	(207,713,478)
投資証券合計		4,102,455	10,913,864,908	(10,913,864,908)
合計			11,122,624,070	(11,122,624,070)

(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

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

通貨	銘柄数	組入株式 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 608銘柄	97.5%			71.2%
	投資証券 34銘柄			2.5%	1.8%
カナダドル	株式 86銘柄	99.7%			3.7%
	投資証券 2銘柄			0.3%	0.0%
ユーロ	株式 228銘柄	99.5%			9.9%
	投資証券 4銘柄			0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式 79銘柄	98.7%			4.7%
	投資証券 3銘柄			1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 41銘柄	100.0%			3.0%
スウェーデンクローナ	株式 44銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%			0.8%
ロシアルーブル	株式 1銘柄	100.0%			0.0%
オーストラリアドル	株式 51銘柄	92.1%			1.9%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.2%		0.0%
	投資証券 7銘柄			6.7%	0.1%

ニュージーランドドル	株式 6銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 28銘柄	94.3%			0.8%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.8%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	88.7%			0.3%
	投資証券 4銘柄			11.3%	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。

## J-REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 2月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,155,453,712
投資証券	104,429,318,895
未収入金	36,903,078
未収配当金	666,976,042
前払金	214,038,000
差入委託証拠金	258,500,000
流動資産合計	108,761,189,727
資産合計	108,761,189,727
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	214,038,000
未払金	165,674,487
未払解約金	8,469,547
未払利息	4,707
流動負債合計	388,186,741
負債合計	388,186,741
純資産の部	
元本等	
元本	52,764,805,211
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	55,608,197,775
元本等合計	108,373,002,986
純資産合計	108,373,002,986
負債純資産合計	108,761,189,727

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 2月17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)

	2022年 2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	52,764,805,211口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.0539円 (1万口当たり純資産額) (20,539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

	2022年 2月17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（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。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2月17日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2022年 2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	54,273,798,554円
期中追加設定元本額	9,212,695,304円
期中一部解約元本額	10,721,688,647円
期末元本額	52,764,805,211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）	1,673,829,089円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,902,276円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	16,521,586,211円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	24,900,917,443円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,311,353,253円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,959,775,127円
分散投資コア戦略ファンド A	795,726,284円
分散投資コア戦略ファンド S	1,687,481,776円
コア投資戦略ファンド（切替型）	791,804,026円
S M T インデックスバランス・オープン	26,458,903円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	260,548,498円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	6,608,514円
グローバル経済コア	238,260,172円
S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型）	11,246,851円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	398,473,908円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	64,163,833円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンド S（適格機関投資家専用）	491,008,972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）	18,903,327円
S M T A M 9 資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	75,117,190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）	78,700,205円



区分	2022年 2月17日現在
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	878,053,706円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	265,605,611円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	302,280,036円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 2月17日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	7,490,131,770
合計	7,490,131,770

(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

(2022年 2月17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	4,149,442,000	-	3,935,404,000	214,038,000
	合計	4,149,442,000	-	3,935,404,000	214,038,000

## (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	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	1,987	273,212,500	

サンケイリアルエステート投資法人	3,126	354,175,800
S O S i L A物流リート投資法人	4,592	687,881,600
東海道リート投資法人	756	84,596,400
日本アコモデーションファンド投資法人	3,408	2,102,736,000
森ヒルズリート投資法人	11,606	1,628,321,800
産業ファンド投資法人	14,012	2,401,656,800
アドバンス・レジデンス投資法人	9,869	3,222,228,500
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,743	1,324,325,200
アクティブア・プロパティーズ投資法人	5,260	2,038,250,000
G L P 投資法人	31,967	5,607,011,800
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,591	1,441,574,000
日本プロロジスリート投資法人	16,148	5,490,320,000
星野リゾート・リート投資法人	1,654	1,091,640,000
O n e リート投資法人	1,713	508,247,100
イオンリート投資法人	11,607	1,699,264,800
ヒューリックリート投資法人	9,208	1,501,824,800
日本リート投資法人	3,046	1,190,986,000
積水ハウス・リート投資法人	29,960	2,336,880,000
トーセイ・リート投資法人	2,062	266,616,600
ケネディクス商業リート投資法人	3,941	1,058,552,600
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,418	345,774,000
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,236	262,953,600
野村不動産マスターファンド投資法人	31,918	5,081,345,600
いちごホテルリート投資法人	1,635	137,667,000
ラサールロジポート投資法人	12,083	2,104,858,600
スターアジア不動産投資法人	10,200	618,120,000
マリモ地方創生リート投資法人	1,156	145,309,200
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,888	2,122,848,000
大江戸温泉リート投資法人	1,593	109,439,100
投資法人みらい	11,956	584,648,400
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,316	298,532,400
三菱地所物流リート投資法人	2,509	1,117,759,500
三菱地所物流リート投資法人	95	41,648,095
C R E ロジスティクスファンド投資法人	3,822	746,818,800
ザイマックス・リート投資法人	1,433	175,542,500
タカラレーベン不動産投資法人	3,892	458,477,600
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,848	576,430,400
日本ビルファンド投資法人	11,507	7,491,057,000
ジャパンリアルエステイト投資法人	9,870	6,060,180,000
日本都市ファンド投資法人	49,800	4,800,720,000
オリックス不動産投資法人	19,666	3,278,322,200
日本プライムリアルティ投資法人	6,744	2,545,860,000

NTT都市開発リート投資法人	9,461	1,429,557,100	
東急リアル・エステート投資法人	6,617	1,222,821,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	6,854	775,187,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	22,219	2,992,899,300	
森トラスト総合リート投資法人	7,054	981,916,800	
インヴィンシブル投資法人	43,442	1,772,433,600	
フロンティア不動産投資法人	3,460	1,650,420,000	
平和不動産リート投資法人	6,394	912,423,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,543	2,011,972,500	
福岡リート投資法人	5,105	831,604,500	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,053	2,112,676,000	
いちごオフィスリート投資法人	8,087	678,499,300	
大和証券オフィス投資法人	2,087	1,444,204,000	
阪急阪神リート投資法人	4,458	661,121,400	
スタートアップリート投資法人	1,537	345,825,000	
大和ハウスリート投資法人	14,820	4,742,400,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	30,237	1,850,504,400	
大和証券リビング投資法人	13,337	1,420,390,500	
ジャパンエクセレント投資法人	9,159	1,177,847,400	
合計	575,765	104,429,318,895	

(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

	2022年 2月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	393,230,202
コール・ローン	90,739,533
投資証券	94,287,744,020
派生商品評価勘定	1,288
未収入金	5,077,593
未収配当金	126,583,878
流動資産合計	94,903,376,514

	2022年 2月17日現在
項目	金額（円）
資産合計	94,903,376,514
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	44,220
未払解約金	58,121,676
未払利息	135
流動負債合計	58,166,031
負債合計	58,166,031
純資産の部	
元本等	
元本	38,861,225,129
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	55,983,985,354
元本等合計	94,845,210,483
純資産合計	94,845,210,483
負債純資産合計	94,903,376,514

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 2月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</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。 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 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>

	2022年 2月17日現在
	(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)

	2022年 2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	38,861,225,129口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産 の額	1口当たり純資産額 2.4406円 (1万口当たり純資産額) (24,406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

	2022年 2月17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（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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2月17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。

2022年 2月17日現在	
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	2022年 2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	45,206,250,834円
期中追加設定元本額	6,806,540,485円
期中一部解約元本額	13,151,566,190円
期末元本額	38,861,225,129円

区分	2022年 2月17日現在
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	61,766,844円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	97,873,344円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,696,883,356円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,881,073円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,958,162,677円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	16,636,781,987円
コア投資戦略ファンド（安定型）	709,208,254円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,597,861,481円
分散投資コア戦略ファンドA	647,769,269円
分散投資コア戦略ファンドS	1,393,496,043円
コア投資戦略ファンド（切替型）	600,833,516円
SMT インデックスバランス・オープン	139,524,861円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	214,485,652円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,448,117円
グローバル経済コア	231,464,376円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	11,477,146円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	235,263,379円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	53,538,906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）	1,164,734,799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）	342,656,126円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	156,554,251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）	80,780,294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）	49,129,754円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	104,725,440円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	109,950,868円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	106,743,611円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	106,102,447円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	100,929,508円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	99,363,358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2021-11（適格機関投資家専用）	140,834,392円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 2月17日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	3,732,929,255
合計	3,732,929,255

(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

(2022年 2月17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	55,471,600	-	55,428,668	42,932
	アメリカドル	55,471,600	-	55,428,668	42,932
	合計	55,471,600	-	55,428,668	42,932

(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	980,107.20	
		AGREE REALTY CORP	35,505	2,249,596.80	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	36,270	830,945.70	
		ALEXANDER'S INC	1,190	310,613.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	73,517	13,754,295.53	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	108,870.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	25,957	945,094.37	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	73,094	3,673,704.44	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	149,800	5,743,332.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST	140,148	3,983,006.16	
		APARTMENT INCOME REIT CO	82,539	4,337,424.45	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	79,751	563,839.57	



APPLE HOSPITALITY REIT INC	115,391	2,063,191.08	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	30,500	441,335.00	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	166,260.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	73,525	17,636,441.75	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	394,861.50	
BOSTON PROPERTIES	73,915	9,060,500.70	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	185,115.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	1,281,657.80	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	155,985	3,979,177.35	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	86,966	1,935,863.16	
BRT APARTMENTS CORP	5,000	118,850.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	53,124	8,700,117.48	
CARETRUST REIT INC	52,477	1,021,202.42	
CEDAR REALTY TRUST INC	6,800	159,324.00	
CENTERSPACE	7,499	709,855.34	
CHATHAM LODGING TRUST	25,360	378,624.80	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	5,000	38,200.00	
CITY OFFICE REIT INC	25,050	454,908.00	
CLIPPER REALTY INC	7,300	68,766.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	12,543	553,898.88	
COREPOINT LODGING INC	22,000	345,840.00	
CORPORATE OFFICE PPTYS	56,459	1,476,967.44	
COUSINS PROPERTIES INC	77,826	3,124,713.90	
CTO REALTY GROWTH INC	2,800	167,132.00	
CUBESMART	114,400	5,614,752.00	
CYRUSONE INC	66,927	6,013,390.95	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	1,175,529.60	
DIGITAL REALTY TRUST INC	149,255	20,089,723.00	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	261,093	1,916,422.62	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	364,416.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	91,897	2,954,488.55	
DUKE REALTY CORP	198,230	10,678,650.10	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	47,668	993,877.80	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	21,399	4,084,855.11	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	777,110.44	
EPR PROPERTIES	38,712	1,822,948.08	
EQUINIX INC	47,326	31,877,847.08	
EQUITY COMMONWEALTH	60,845	1,631,862.90	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	90,411	7,000,523.73	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	179,605	15,487,339.15	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	61,267	1,542,090.39	

ESSEX PROPERTY TRUST	33,880	10,813,818.40
EXTRA SPACE STORAGE INC	70,529	13,454,112.04
FARMLAND PARTNERS INC	12,200	138,836.00
FEDERAL REALTY INVS TRUST	36,885	4,415,503.35
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	68,553	3,974,017.41
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	38,344	1,009,597.52
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	260,207.18
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	119,295	5,352,766.65
GETTY REALTY CORP	21,985	615,580.00
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	442,292.50
GLADSTONE LAND CORP	15,500	474,610.00
GLOBAL MEDICAL REIT INC	33,930	559,845.00
GLOBAL NET LEASE INC	57,012	826,674.00
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	77,110	2,418,940.70
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	116,104	3,591,096.72
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	280,422	8,979,112.44
HERSHA HOSPITALITY TRUST	13,650	141,960.00
HIGHWOODS PROPERTIES INC	54,472	2,392,410.24
HOST HOTELS AND RESORTS INC	377,230	7,284,311.30
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	77,330	1,970,368.40
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	58,331	1,399,360.69
INDUS REALTY TRUST INC	3,840	296,716.80
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	744,908.36
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	12,508	2,418,922.12
INVITATION HOMES INC	310,944	12,577,684.80
IRON MOUNTAIN INC	152,781	6,723,891.81
JBG SMITH PROPERTIES	59,093	1,665,240.74
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	343,100.00
KILROY REALTY CORPORATION	55,095	3,939,292.50
KIMCO REALTY CORP	326,054	7,913,330.58
KITE REALTY GROUP TRUST	111,886	2,481,631.48
LIFE STORAGE INC	43,307	5,628,177.72
LTC PROPERTIES INC	20,624	711,115.52
LXP INDUSTRIAL TRUST	152,908	2,339,492.40
MACERICH CO/THE	110,542	1,820,626.74
MANULIFE US REAL ESTATE INV	736,564	489,815.06
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	315,119	6,507,207.35
MID-AMERICA APARTMENT COMM	59,980	12,515,426.80
MONMOUTH REIT -CL A	54,952	1,151,244.40
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	92,518	3,994,002.06
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	42,810	2,539,061.10
NATL HEALTH INVESTORS INC	25,030	1,386,161.40
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	71,590	616,389.90

NETSTREIT CORP	20,992	461,194.24
NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	1,065,825.67
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	707,716.90
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	125,588	3,679,728.40
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	257,712.03
ORION OFFICE REIT INC	30,374	522,736.54
PARAMOUNT GROUP INC	89,726	855,986.04
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	123,413	2,492,942.60
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,613	1,783,879.83
PENN REAL ESTATE INVEST TST	35,000	32,896.50
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	11,699	383,259.24
PHYSICIANS REALTY TRUST	118,562	2,066,535.66
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	1,179,160.64
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	16,890	473,595.60
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	124,530.00
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	29,639	764,686.20
PRIME US REIT	295,000	244,850.00
PROLOGIS INC	388,383	56,074,737.54
PS BUSINESS PARKS INC	10,122	1,613,143.14
PUBLIC STORAGE	80,199	28,207,592.28
REALTY INCOME CORP	297,602	20,070,278.88
REGENCY CENTERS CORP	81,307	5,469,521.89
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	60,059	1,120,100.35
RETAIL VALUE	9,529	30,588.09
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	79,955	5,606,444.60
RLJ LODGING TRUST	92,291	1,415,743.94
RPT REALTY	43,950	562,560.00
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	28,796	2,712,007.28
SABRA HEALTH CARE REIT INC	118,413	1,638,835.92
SAFEHOLD INC	8,335	543,608.70
SAUL CENTERS INC	6,800	323,068.00
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	19,900	190,642.00
SERVICE PROPERTIES TRUST	84,169	776,879.87
SIMON PROPERTY GROUP	172,780	24,856,130.80
SITE CENTERS CORP	90,220	1,425,476.00
SL GREEN REALTY CORP	34,892	2,847,187.20
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	64,542	3,038,637.36
STAG INDUSTRIAL INC	91,903	3,655,901.34
STORE CAPITAL CORP	129,077	3,962,663.90
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	52,970	557,244.40
SUN COMMUNITIES INC	60,353	11,581,137.17
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	109,347	1,306,696.65

	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	52,370	905,477.30	
	TERRENO REALTY CORP	39,224	2,717,830.96	
	UDR INC	151,083	8,320,140.81	
	UMH PROPERTIES INC	25,320	590,209.20	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	402,551.29	
	URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	1,117,399.50	
	URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	291,067.00	
	VENTAS INC	207,705	10,887,896.10	
	VERIS RESIDENTIAL INC	42,236	745,465.40	
	VICI PROPERTIES INC	327,065	9,412,930.70	
	VORNADO REALTY TRUST	81,778	3,680,010.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	45,570	1,118,287.80	
	WELLTOWER INC	229,006	19,211,313.34	
	WHITESTONE REIT	19,090	225,834.70	
	WP CAREY INC	98,486	7,549,936.76	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,030	1,217,739.60	
	アメリカドル 小計	13,498,458	620,366,475.17 (71,639,920,552)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	33,942	1,467,312.66	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	395,806.50	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	172,680.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,260	614,458.20	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	81,600.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	43,620	2,420,037.60	
	CHOICE PROPERTIES REIT	86,170	1,262,390.50	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	47,120	548,948.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	462,971.34	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	478,619.80	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	58,250	942,485.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	351,442.60	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	102,531.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	1,046,591.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,205	1,521,001.30	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	72,239	931,160.71	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	89,697.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	34,090	547,826.30	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	652,222.50	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	242,979.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	242,718.70	

	NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT	9,000	110,970.00
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	60,470	813,321.50
	PLAZA RETAIL REIT	25,000	120,750.00
	PRIMARIS REIT	20,309	283,310.55
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	78,631	1,935,108.91
	SLATE GROCERY REIT	10,300	159,444.00
	SLATE OFFICE REI	17,000	87,210.00
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	35,776	1,122,293.12
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	1,014,260.00
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	190,920.00
	カナダドル 小計	1,006,584	20,413,067.79 (1,857,997,430)
ユーロ	AEDIFICA	19,037	1,883,711.15
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	7,200	119,088.00
	ALTAREA	2,480	381,920.00
	BEFIMMO S.C.A.	12,010	393,928.00
	CARE PROPERTY INVEST	15,000	345,750.00
	CARMILA	25,000	390,500.00
	COFINIMMO	15,317	1,805,874.30
	COIMA RES SPA	11,900	94,605.00
	COVIVIO(FP)	24,053	1,805,899.24
	CROMWELL REIT EUR	160,000	377,600.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,783	482,996.92
	GECINA SA	28,292	3,267,726.00
	HAMBORNER REIT AG	37,000	373,626.00
	HIBERNIA REIT PLC	365,550	444,508.80
	ICADE	16,840	1,000,296.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	144,790.15
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	141,462	1,097,037.81
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	327,305.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	325,500.00
	KLEPIERRE	103,485	2,581,950.75
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	182,580.00
	MERCIALYS	28,000	277,340.00
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	170,949	1,778,724.34
	MONTEA NV	5,300	590,420.00
	NSI NV	10,050	355,267.50
	RETAIL ESTATES	6,400	453,760.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	61,271	4,411,512.00
	VASTNED RETAIL	10,650	289,680.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	72,372	2,566,311.12
	WERELDHAVE NV	22,670	395,591.50

	XIOR STUDENT HOUSING NV	10,440	511,560.00
	ユーロ 小計	1,693,401	29,457,359.58 (3,871,580,769)
イギリスポンド	AEW UK REIT PLC	118,000	137,824.00
	ASSURA PLC	1,493,040	924,191.76
	BIG YELLOW GROUP PLC	90,946	1,301,437.26
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	435,000	484,590.00
	BRITISH LAND CO PLC	488,668	2,673,013.96
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	428,297	734,957.65
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	291,119.09
	CUSTODIAN REIT PLC	234,276	245,521.24
	DERWENT LONDON PLC	59,382	1,929,321.18
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	277,542.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	129,780	927,927.00
	HAMMERSON PLC	2,111,000	815,268.20
	HOME REIT PLC	309,934	350,225.42
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	177,355	202,184.70
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	392,457	3,168,697.81
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	463,660	1,223,135.08
	LXI REIT PLC	391,008	541,937.08
	NEWRIVER REIT PL	126,000	115,290.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	271,752.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	677,888	913,115.13
	PRS REIT PLC/THE	325,000	336,375.00
	REGIONAL REIT LTD	222,000	196,914.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	109,137	1,387,131.27
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	194,600.00
	SEGRO PLC	633,864	8,100,781.92
	SHAFTESBURY PLC	145,193	876,965.72
	STANDARD LIFE INV PROP INC	260,756	210,169.33
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	544,000	644,640.00
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	189,869.12
TRITAX BIG BOX REIT PLC	972,704	2,248,891.64	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	490,000	399,840.00	
UNITE GROUP PLC	210,572	2,146,781.54	
WORKSPACE GROUP PLC	70,347	539,209.75	
	イギリスポンド 小計	14,089,577	35,010,489.85 (5,494,546,277)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	197,716	693,983.16
	ARENA REIT	171,053	850,133.41
	AVENTUS GROUP	233,500	747,200.00
	BWP TRUST	262,160	1,043,396.80

	CENTURIA CAPITAL GROUP	316,300	942,574.00
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	301,606	1,134,038.56
	CENTURIA OFFICE REIT	240,945	534,897.90
	CHARTER HALL GROUP	243,969	4,008,410.67
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	320,312	1,582,341.28
	CHARTER HALL RETAIL REIT	261,160	1,073,367.60
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	732,784.50
	CROMWELL PROPERTY GROUP	672,633	598,643.37
	DEXUS	561,641	5,947,778.19
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	363,860.00
	GDI PROPERTY GROUP	324,500	335,857.50
	GOODMAN GROUP	894,343	21,464,232.00
	GPT GROUP	1,000,455	5,022,284.10
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	677,045.60
	HOME CONSORTIUM LTD	90,500	580,105.00
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	268,642	368,039.54
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	117,885	410,239.80
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	193,766	1,073,463.64
	IRONGATE GROUP	272,000	504,560.00
	MIRVAC GROUP	2,056,122	5,304,794.76
	NATIONAL STORAGE REIT	546,840	1,328,821.20
	RURAL FUNDS GROUP	191,095	563,730.25
	SCENTRE GROUP	2,728,991	8,596,321.65
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	577,060	1,667,703.40
	STOCKLAND	1,245,728	5,070,112.96
	VICINITY CENTERS	1,991,333	3,713,836.04
	WAYPOINT REIT LTD	390,099	1,068,871.26
	オーストラリアドル 小計	17,141,464	78,003,428.14 (6,481,304,844)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	417,278	584,189.20
	GOODMAN PROPERTY TRUST	535,300	1,330,220.50
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	944,339.00
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	682,894	1,085,801.46
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	223,349	699,082.37
	ニュージーランドドル 小計	2,717,311	4,643,632.53 (358,674,176)
香港ドル	CHAMPION REIT	938,000	3,705,100.00
	FORTUNE REIT	756,000	6,138,720.00
	LINK REIT	1,103,400	73,431,270.00
	PROSPERITY REIT	752,000	2,286,080.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	2,457,180.00
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,120,660	3,686,971.40

香港ドル 小計		5,231,060	91,705,321.40 (1,357,238,756)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	390,500.00
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	744,977	644,405.10
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,747,318	4,944,909.94
	ASCOTT TRUST	981,877	1,011,333.31
	CAPITALAND CHINA TRUST	557,721	658,110.78
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,600,044	5,460,092.40
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	496,468.00
	EC WORLD REIT	180,000	134,100.00
	ESR REIT	1,448,995	637,557.80
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	318,600.00
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	164,120.50
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	574,262	1,315,059.98
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,500,096	2,130,136.32
	IREIT GLOBAL	405,985	263,890.25
	KEPPEL DC REIT	709,903	1,540,489.51
	KEPPEL REIT	1,051,400	1,188,082.00
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	555,000	466,200.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,181,473	2,150,280.86
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	998,963	2,537,366.02
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,529,185	2,676,073.75
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	1,047,100	1,141,339.00
	OUÉ COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,273,644	547,666.92
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE TRUST	195,500	891,480.00
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	295,800	241,077.00
SPH REIT	446,800	433,396.00	
STARHILL GLOBAL REIT	659,400	405,531.00	
SUNTEC REIT	1,090,700	1,766,934.00	
シンガポールドル 小計		23,546,443	34,555,200.44 (2,972,092,789)
韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	81,340	492,107,000.00
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	65,830,050.00
	JR REIT XXVII	64,338	341,634,780.00
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	20,000	130,600,000.00
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	392,841,600.00
	MIRAE ASIA PAC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-1	42,950	196,496,250.00
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,093	154,271,440.00
韓国ウォン 小計		311,454	1,773,781,120.00 (171,524,634)
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	103,500	2,288,385.00



	イスラエルシェケル 小計	103,500	2,288,385.00 (82,863,793)
	合計	79,339,252	94,287,744,020 (94,287,744,020)

(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

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 155銘柄	100.0%	76.0%
カナダドル	投資証券 31銘柄	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券 31銘柄	100.0%	4.1%
イギリスポンド	投資証券 34銘柄	100.0%	5.8%
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。

### ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

#### 貸借対照表

	2022年 2月17日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	32,303,107
コール・ローン	63,718,081

	2022年 2月17日現在
項目	金額（円）
投資信託受益証券	27,896,200,921
流動資産合計	27,992,222,109
資産合計	27,992,222,109
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	78,266,621
未払解約金	19,341,274
未払利息	95
流動負債合計	97,607,990
負債合計	97,607,990
純資産の部	
元本等	
元本	21,395,733,413
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,498,880,706
元本等合計	27,894,614,119
純資産合計	27,894,614,119
負債純資産合計	27,992,222,109

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 2月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
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>
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>

	2022年 2月17日現在

## (貸借対照表に関する注記)

	2022年 2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	21,395,733,413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 1.3037円 (1万口当たり純資産額) (13,037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

	2022年 2月17日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2月17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。

	2022年 2月17日現在
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	2022年 2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	25,443,545,465円
期中追加設定元本額	6,084,303,052円
期中一部解約元本額	10,132,115,104円
期末元本額	21,395,733,413円

区分	2022年 2月17日現在
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,210,009,688円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,275,277,651円
分散投資コア戦略ファンドA	1,942,701,798円
分散投資コア戦略ファンドS	7,022,243,579円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,376,776,538円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	501,509,930円
グローバル経済コア	847,653,891円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	2,572,926,454円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	678,991,983円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	89,182,469円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	249,998,980円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	549,130,927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）	79,329,525円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 2月17日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	963,558,751
合計	963,558,751

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（2022年 2月17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	27,174,354,628	-	27,252,621,249	78,266,621
	アメリカドル	27,174,354,628	-	27,252,621,249	78,266,621
合計		27,174,354,628	-	27,252,621,249	78,266,621

## (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
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST	6,783,695	241,567,378.95	
	アメリカドル 小計		6,783,695	241,567,378.95 (27,896,200,921)	
合計			6,783,695	27,896,200,921 (27,896,200,921)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

## 貸借対照表

	2022年 2月17日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,162,603,584
社債券	43,747,280,160
流動資産合計	44,909,883,744
資産合計	44,909,883,744
負債の部	
流動負債	
未払利息	1,734
流動負債合計	1,734
負債合計	1,734
純資産の部	
元本等	
元本	42,386,122,270
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,523,759,740
元本等合計	44,909,882,010
純資産合計	44,909,882,010
負債純資産合計	44,909,883,744

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 2月17日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	42,386,122,270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 1.0595円 (1万口当たり純資産額) (10,595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

	2022年 2月17日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、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（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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2月17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	2022年 2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	34,923,179,852円
期中追加設定元本額	7,985,557,078円
期中一部解約元本額	522,614,660円
期末元本額	42,386,122,270円
期末元本額の内訳	
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	441,623,608円
ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（SMA専用）	892,414,607円
ヘッジファンドSMTBセクション（SMA専用）	20,127,585,827円
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	20,145,824,948円
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンドS（適格機関投資家専用）	778,673,280円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 2月17日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	278,060,820
合計	278,060,820

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	SIGNUM GENEVA1 0% 12/15/25	40,606,000,000	43,747,280,160	
合計		40,606,000,000	43,747,280,160	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 米国株式LSマザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 2月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	727,720,319
社債券	17,876,638,892
流動資産合計	18,604,359,211
資産合計	18,604,359,211
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	277,773,600
未払利息	1,085
流動負債合計	277,774,685
負債合計	277,774,685
純資産の部	
元本等	
元本	18,137,161,748
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	189,422,778
元本等合計	18,326,584,526
純資産合計	18,326,584,526
負債純資産合計	18,604,359,211

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2022年 2月17日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

2022年 2月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	18,137,161,748口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.0104円 (1万口当たり純資産額) (10,104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

2022年 2月17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。

	2022年 2月17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、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</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（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。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2月17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	2022年 2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	25,924,256,698円
期中追加設定元本額	1,417,080,677円
期中一部解約元本額	9,204,175,627円
期末元本額	18,137,161,748円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,562,126,344円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,935,006,558円
コア投資戦略ファンド（切替型）	866,643,807円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	284,398,733円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	11,998,660,565円
米国株式LSファンド（SMA専用）	504,201,603円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	407,617,912円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	41,652,745円
FOFs用 米国株式LSファンドS（適格機関投資家専用）	536,853,481円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 2月17日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	738,952,363
合計	738,952,363

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

（デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

(2022年 2月17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	17,733,768,000	-	18,011,541,600	277,773,600
	アメリカドル	17,733,768,000	-	18,011,541,600	277,773,600
合計		17,733,768,000	-	18,011,541,600	277,773,600

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	STAR HELIOS 004 10/18/22	140,000,000.00	154,802,900.00	
	アメリカドル 小計		140,000,000.00	154,802,900.00 (17,876,638,892)	
合計				17,876,638,892 (17,876,638,892)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	社債券 1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

### コモディティLSアルファ・マザーファンド

#### 貸借対照表

項目	2022年 2月17日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	205,333,573
社債券	21,005,418,000
流動資産合計	21,210,751,573
資産合計	21,210,751,573
負債の部	
流動負債	
未払利息	306
流動負債合計	306
負債合計	306
純資産の部	
元本等	
元本	18,399,737,776
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	2,811,013,491
元本等合計	21,210,751,267
純資産合計	21,210,751,267
負債純資産合計	21,210,751,573

#### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 2月17日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2022年 2月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		18,399,737,776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)	1.1528円 (11,528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

	2022年 2月17日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2月17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。



	2022年 2月17日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	15,707,334,651円
期中追加設定元本額	3,338,179,022円
期中一部解約元本額	645,775,897円
期末元本額	18,399,737,776円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,549,333,027円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,877,245,194円
コア投資戦略ファンド（切替型）	873,847,723円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	290,633,114円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	12,492,067,565円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	414,385,952円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	40,593,456円
コモディティLSアルファ・ファンド（SMA専用）	331,986,542円
FOFs用 コモディティLSアルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	529,645,203円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 2月17日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
社債券		660,154,000
合計		660,154,000

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	STAR HELIOS 0% 07/13/22	18,130,000,000	21,005,418,000	
合計		18,130,000,000	21,005,418,000	

##### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

##### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

##### 貸借対照表

項目	2022年 2月17日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		206,179,472
社債券		18,255,930,000

	2022年 2月17日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	18,462,109,472
資産合計	18,462,109,472
負債の部	
流動負債	
未払利息	307
流動負債合計	307
負債合計	307
純資産の部	
元本等	
元本	23,299,242,162
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,837,132,997
元本等合計	18,462,109,165
純資産合計	18,462,109,165
負債純資産合計	18,462,109,472

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 2月17日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2022年 2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	23,299,242,162口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 4,837,132,997円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.7924円 (1万口当たり純資産額) (7,924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

	2022年 2月17日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2月17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	2022年 2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月18日
期首元本額	19,052,814,135円
期中追加設定元本額	5,718,303,199円
期中一部解約元本額	1,471,875,172円
期末元本額	23,299,242,162円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	620,000,000円
コア投資戦略ファンド（成長型）	755,000,000円
分散投資コア戦略ファンドA	2,451,736,764円
分散投資コア戦略ファンドS	10,130,805,762円
コア投資戦略ファンド（切替型）	280,000,000円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	147,960,259円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	7,294,191,710円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	122,244,049円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	15,915,197円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（SMA専用）	248,537,459円
FOFs用 米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドS（適格機関投資家専用）	199,599,602円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（適格機関投資家専用）	1,033,251,360円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 2月17日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	2,639,774,000
合計	2,639,774,000

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	STAR HELIOS 0% 10/18/ 22	23,100,000,000	18,255,930,000	
合計		23,100,000,000	18,255,930,000	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【サテライト投資戦略ファンド（株式型）】

## 【純資産額計算書】

（2022年 3月31日現在）

資産総額	9,870,564,384円
負債総額	25,044,609円
純資産総額（ - ）	9,845,519,775円
発行済口数	7,588,636,236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）

## J P X日経インデックス400 マザーファンド

## 純資産額計算書

（2022年 3月31日現在）

資産総額	14,224,069,070円
負債総額	85,671,593円
純資産総額（ - ）	14,138,397,477円
発行済口数	7,778,890,481口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8175円
（1万口当たり純資産額）	（18,175円）

## 中小型株式 マザーファンド

## 純資産額計算書

（2022年 3月31日現在）

資産総額	29,965,868,263円
負債総額	119,864,905円
純資産総額（ - ）	29,846,003,358円
発行済口数	5,964,727,518口
1口当たり純資産額（ / ）	5.0037円
（1万口当たり純資産額）	（50,037円）

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 3月31日現在)

資産総額	495,706,283,548円
負債総額	3,598,591,204円
純資産総額（ - ）	492,107,692,344円
発行済口数	256,238,599,722口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9205円
（1万口当たり純資産額）	（19,205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

(2022年 3月31日現在)

資産総額	555,085,613,017円
負債総額	1,343,929,109円
純資産総額（ - ）	553,741,683,908円
発行済口数	124,518,911,903口
1口当たり純資産額（ / ）	4.4470円
（1万口当たり純資産額）	（44,470円）

## J-REITインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 3月31日現在)

資産総額	116,810,554,073円
負債総額	608,284,955円
純資産総額（ - ）	116,202,269,118円
発行済口数	53,649,850,113口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1659円
（1万口当たり純資産額）	（21,659円）

## グローバルREITインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書



(2022年 3月31日現在)

資産総額	110,805,805,894円
負債総額	697,762,752円
純資産総額（ - ）	110,108,043,142円
発行済口数	40,091,542,112口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7464円
（1万口当たり純資産額）	（27,464円）

## ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

## 純資産額計算書

(2022年 3月31日現在)

資産総額	36,636,197,287円
負債総額	4,138,790,391円
純資産総額（ - ）	32,497,406,896円
発行済口数	24,195,657,263口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3431円
（1万口当たり純資産額）	（13,431円）

## ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 3月31日現在)

資産総額	45,046,540,446円
負債総額	1,183円
純資産総額（ - ）	45,046,539,263円
発行済口数	43,191,641,954口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0429円
（1万口当たり純資産額）	（10,429円）

## 米国株式LSマザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 3月31日現在)

資産総額	22,049,223,242円
負債総額	1,432,447,235円
純資産総額（ - ）	20,616,776,007円

発行済口数	19,365,915,938口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0646円
（1万口当たり純資産額）	（10,646円）

## コモディティLSアルファ・マザーファンド

## 純資産額計算書

（2022年 3月31日現在）

資産総額	23,825,485,102円
負債総額	1,010,443,583円
純資産総額（ - ）	22,815,041,519円
発行済口数	20,458,808,533口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1152円
（1万口当たり純資産額）	（11,152円）

## 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

## 純資産額計算書

（2022年 3月31日現在）

資産総額	8,501,433,772円
負債総額	100円
純資産総額（ - ）	8,501,433,672円
発行済口数	10,743,469,562口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7913円
（1万口当たり純資産額）	（7,913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ます。
- ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。
- ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### 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ます。

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（2022年 3月31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年間ににおける資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ D0（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2022年 5月17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。

2022年3月31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	543	15,476,512
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	72	244,647
単位型公社債投資信託	51	245,101
合計	666	15,966,260

## 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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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
<b>評価・換算差額等</b>		
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	当事業年度
	（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）	（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）
営業外収益		
受取利息	15	2
収益分配金	119	101
金銭の信託運用益	-	3,038
投資有価証券売却益	483	1
投資有価証券償還益	316	54
為替差益	273	-
デリバティブ利益	666	-
その他	30	45
営業外収益合計	1,906	3,243
営業外費用		
金銭の信託運用損	1,076	-
投資有価証券売却損	4	0
投資有価証券償還損	19	0
為替差損	-	158
デリバティブ費用	-	3,782
その他	19	5
営業外費用合計	1,118	3,946
経常利益	13,377	10,281
特別損失		
システム統合費用	149	110
特別損失合計	149	110
税引前当期純利益	13,227	10,170
法人税、住民税及び事業税	4,263	3,242
法人税等調整額	193	65
法人税等合計	4,070	3,177
当期純利益	9,157	6,993

## （3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当期変動額				
剰余金の配当				2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	980	151	829	829
当期変動額合計	980	151	829	6,022
当期末残高	587	284	302	56,464

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金				
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					

剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	-	3,136	3,330	3,330
当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	587	284	302	56,464
当期変動額				
剰余金の配当				3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,379	349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	349	1,029	4,360
当期末残高	791	65	726	60,824

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### (2) その他有価証券

##### 時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法によっております。（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

### 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 6. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (2) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。

### 7. ヘッジ会計の会計処理

#### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

#### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
建物	77	百万円	106	百万円
器具備品	285	"	391	"
その他	4	"	4	"
計	367	"	503	"

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	利益剰余金	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

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

2021年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

（リ・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)
<p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>有価証券</p> <p>  子会社株式     移動平均法による原価法によっております。</p> <p>  その他有価証券     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。）</p> <p>  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。</p> <p>2. デリバティブの評価基準及び評価方法 時価法によっております。</p> <p>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。</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産 定額法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法</p>

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441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)通常の見積条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の見積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5月17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。
野村證券株式会社	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。

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【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。

また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

2021年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明 印

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第35期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じ

て、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. 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4月15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」に掲げられているサテライト投資戦略ファンド（株式型）の2021年2月18日から2022年2月17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、サテライト投資戦略ファンド（株式型）の2022年2月17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。