

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年8月10日提出
【計算期間】	第10期(自 2021年11月11日至 2022年5月10日)
【ファンド名】	SMT 8資産インデックスバランス・オープン
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &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 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &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 ー バ ル  (日本を 含む)	ファミリ ー ファン ド  ファン ド・ オブ・ファ ンズ	あり ( )  なし	日経225  TOPIX  その他 ( )	ブル・ベア型  条件付運用型  ロ ン グ・ シ ョ ー ト型/ 絶 対 収 益 追 求 型  その他 ( )
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)  日々	日本  北米  欧州  アジア  オセアニ ア  中南米  アフリカ  中近東 (中東)				
不動産投信  その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信)資産配 分固定型))	その他 ( )					
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ン グ				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

## [ 独立した区分 ]

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

## [ 補足分類 ]

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

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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

る旨の記載があるものをいう。

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

#### [ 特殊型 ]

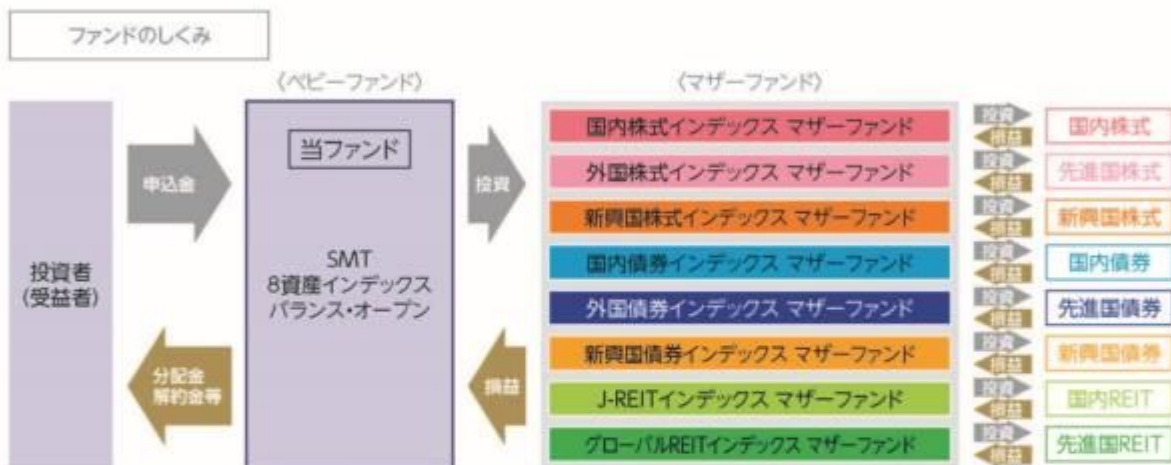
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特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

#### < ファンドの特色 >

## 特色1

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

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



### ? ファミリーファンド方式とは

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

### ? DR(預託証券)とは

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

### ? REITとは

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

## ポートフォリオ構築プロセス

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

ポートフォリオ構築

ファンドマネジャー

●基本配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分

リバランス実施

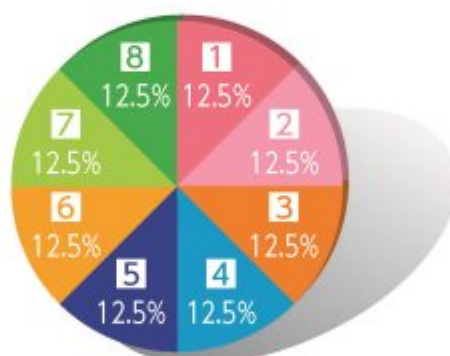
ファンドマネジャー

●資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

**特色2** 8つのマザーファンド受益証券への均等配分を基本配分比率とします。

基本配分比率



●配分比率には一定の変動許容幅を設けます。

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

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

詳しくは下記をご覧ください。



- ※1 「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。
- ※2 「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。
- ※3 「MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※4 「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- ※5 「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドの Sponsorではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又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。
- ※6 「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円換算ベース)」とは、新興国の現地通貨債市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。
- ※7 「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。
- ※8 「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「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SPDJI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>®</sup>及びS&P<sup>®</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>®</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又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任も負いません。

## 分配方針

- 年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。  
ただし、分配を行わないことがあります。
  - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## 主な投資制限

- 株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2017年 8月25日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



#### 委託会社の概況（2022年 5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。

### 投資対象

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

### 投資態度

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

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

- ニ．実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- ホ．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  1. 有価証券
  2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条、第23条及び第24条に定めるものに限りません。）
  3. 金銭債権
  4. 約束手形

## ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

## 1. 為替手形

## 有価証券の指図範囲

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

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

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

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

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### (参考) マザーファンドの概要

##### 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

###### 1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX(東証株価指数)と連動する投資成果を目標として運用を行います。

###### 2. 運用方法

###### (1) 投資対象

わが国の取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

###### (2) 投資態度

原則として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。

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

###### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。以下同じ。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

原則として、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

原則としてMSCIコクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件の

もとに交換する取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。

#### (2)投資態度

主として、取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。

株式（DR（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引ならびに委託会



社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、ならびに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

### 3. 運用制限

株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、ならびに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

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

### 3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内と

なるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

外貨建資産への投資は行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

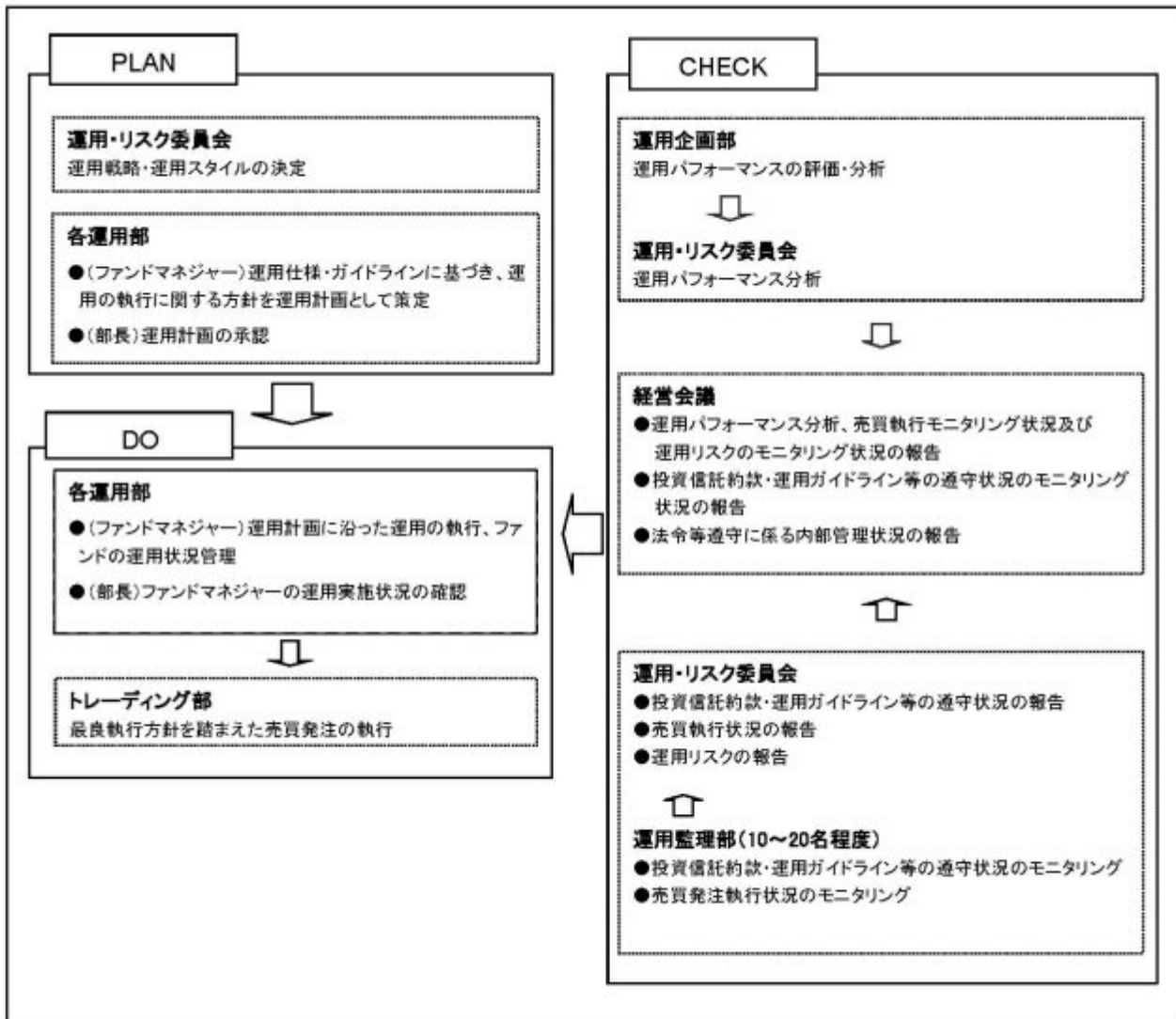
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## (3)【運用体制】

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

ることがあります。



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

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

#### (4) 【分配方針】

- ・年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

### <約款に定める投資制限>

#### イ．株式等への投資割合

株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

#### ロ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

#### ハ．外貨建資産への投資割合

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

#### ニ．投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

#### ホ．信用取引の指図範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

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

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

#### ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指

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

- (ロ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。
- (ハ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

#### ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことを指図することができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### チ．金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

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

#### リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

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



## ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公社債又は下記ル．の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をします。

## ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (ロ) 上記(イ)の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をします。
- (ニ) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

## ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

## ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

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

## カ．資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- (ハ) 収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

ヨ．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

タ．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様はに帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### リートの価格変動リスク

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

##### 為替変動リスク

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

##### 金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

##### 信用リスク

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

券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

#### カントリーリスク

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

#### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

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

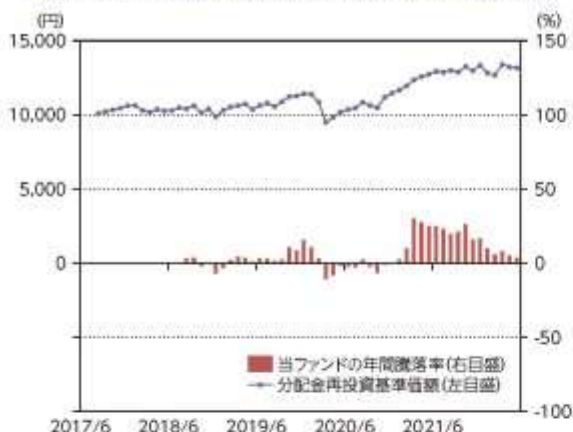
## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*当ファンドについては2018年8月～2022年5月の3年10ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2017年6月～2022年5月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

\*当ファンドの年間騰落率は、設定後のデータのみで算出しています。

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

## 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数、配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPMリサーチが算出、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、浮動価格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利又は債権は、株式会社JPMリサーチの関連会社(以下「JPM」といふ。)の知的財産であり、指数の算出、指数の公表、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利又は債権に関するすべての権利はJPMが有します。JPM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、JPMにより提供、保証又は取扱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JPMは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCI Emerging Markets Index (配当込み、円ベース)	MSCI Emerging Markets Indexとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関して一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、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及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は中断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の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JP Morgan Global Emerging Markets Index (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、JP Morganはその完全性、正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用されています。JP 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ません。Copyright 2014, JP Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

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

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

じ。 )。

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

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

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

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ: <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル: 0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

## ( 2 ) 【換金 ( 解約 ) 手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

## ( 3 ) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.55% ( 税抜 0.5% ) を乗じて得た額とします ( 信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率 )。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.22% ( 税抜 0.2% )	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.275% ( 税抜 0.25% )	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% ( 税抜 0.05% )	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

## ( 4 ) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」及び非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたてNISA（つみたてニーサ）」をご利用の場合



NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。つみたてNISAは一定の基準を満たした公募株式投資信託に係る非課税制度で、当ファンドはその適用対象です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、同一年中はNISAとつみたてNISAの同時利用はできません。また、ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### 個別元本について

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

#### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2022年5月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、2022年5月31日現在の状況について記載してあります。

## 【SMT 8資産インデックスバランス・オープン】

## (1) 【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	125,747,803	99.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,241,413	0.98
合計(純資産総額)		126,989,216	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	国内株式インデックス マザーファンド	8,692,237	1.8381	15,977,221	1.8888	16,417,897	12.93
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	7,478,508	2.1214	15,865,521	2.1786	16,292,677	12.83
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	9,129,839	1.7031	15,549,354	1.7589	16,058,473	12.65
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	4,481,914	3.4336	15,389,331	3.5600	15,955,613	12.56
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	5,147,278	3.0824	15,866,058	3.0959	15,935,457	12.55
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	3,693,184	4.0800	15,068,236	4.2448	15,676,827	12.35
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	10,714,655	1.3798	14,784,761	1.3825	14,813,010	11.66
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	5,660,714	2.5038	14,173,792	2.5788	14,597,849	11.50

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.02
合計	99.02

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。



## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2017年11月10日)	3,305,848	3,305,848	10,426	10,426
第2期計算期間末 (2018年 5月10日)	8,441,994	8,441,994	10,414	10,414
第3期計算期間末 (2018年11月12日)	14,205,908	14,205,908	10,346	10,346
第4期計算期間末 (2019年 5月10日)	23,476,764	23,476,764	10,471	10,471
第5期計算期間末 (2019年11月11日)	32,350,523	32,350,523	11,176	11,176
第6期計算期間末 (2020年 5月11日)	38,971,244	38,971,244	9,884	9,884
第7期計算期間末 (2020年11月10日)	58,213,200	58,213,200	11,058	11,058
第8期計算期間末 (2021年 5月10日)	83,447,901	83,447,901	12,622	12,622
第9期計算期間末 (2021年11月10日)	104,137,823	104,137,823	13,229	13,229
第10期計算期間末 (2022年 5月10日)	120,808,258	120,808,258	12,852	12,852
2021年 5月末日	86,465,192		12,725	
6月末日	91,266,563		12,935	
7月末日	94,175,465		12,867	
8月末日	98,199,280		12,992	
9月末日	100,137,969		12,878	
10月末日	104,185,252		13,253	
11月末日	104,770,644		12,974	
12月末日	111,172,127		13,341	
2022年 1月末日	110,689,691		12,823	
2月末日	111,864,504		12,679	
3月末日	122,279,991		13,389	
4月末日	123,597,489		13,230	
5月末日	126,989,216		13,166	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	0
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0

第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	0
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	0
第6期計算期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	0
第7期計算期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	0
第8期計算期間	2020年11月11日～2021年 5月10日	0
第9期計算期間	2021年 5月11日～2021年11月10日	0
第10期計算期間	2021年11月11日～2022年 5月10日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	4.3
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0.1
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0.7
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	1.2
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	6.7
第6期計算期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	11.6
第7期計算期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	11.9
第8期計算期間	2020年11月11日～2021年 5月10日	14.1
第9期計算期間	2021年 5月11日～2021年11月10日	4.8
第10期計算期間	2021年11月11日～2022年 5月10日	2.8

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	3,291,330	120,520	3,170,810
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	6,642,105	1,706,320	8,106,595
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	6,807,776	1,183,554	13,730,817
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	9,998,798	1,308,700	22,420,915
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	10,577,572	4,052,049	28,946,438
第6期計算期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	15,251,653	4,770,851	39,427,240
第7期計算期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	16,057,478	2,841,160	52,643,558
第8期計算期間	2020年11月11日～2021年 5月10日	17,379,718	3,908,644	66,114,632
第9期計算期間	2021年 5月11日～2021年11月10日	18,347,554	5,742,323	78,719,863
第10期計算期間	2021年11月11日～2022年 5月10日	18,905,302	3,627,643	93,997,522

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

（参考）

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	488,121,622,150	98.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,568,821,799	1.53
合計(純資産総額)		495,690,443,949	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	7,597,820,000	1.53

(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	9,187,700	2,126.48	19,537,486,850	2,122.50	19,500,893,250	3.93
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,217,300	11,995.51	14,602,137,500	12,115.00	14,747,589,500	2.98
日本	株式	キーエンス	電気機器	176,100	51,639.77	9,093,764,000	51,590.00	9,084,999,000	1.83
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,486,300	738.26	8,479,913,030	729.70	8,381,553,110	1.69
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,089,800	3,988.66	8,335,518,000	3,911.00	8,173,207,800	1.65
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	123,300	59,746.87	7,366,790,000	58,980.00	7,272,234,000	1.47
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,364,400	4,694.17	6,404,725,600	4,734.00	6,459,069,600	1.30
日本	株式	任天堂	その他製品	109,700	58,325.85	6,398,346,000	57,420.00	6,298,974,000	1.27
日本	株式	日立製作所	電気機器	934,700	6,779.76	6,337,046,000	6,725.00	6,285,857,500	1.27
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,390,200	4,549.72	6,325,032,400	4,486.00	6,236,437,200	1.26

日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,143,500	5,358.08	6,126,975,900	5,379.00	6,150,886,500	1.24
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,314,800	4,498.71	5,914,915,600	4,433.00	5,828,508,400	1.18
日本	株式	信越化学工業	化学	310,100	18,250.38	5,659,444,000	18,335.00	5,685,683,500	1.15
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,527,400	3,743.82	5,718,319,100	3,703.00	5,655,962,200	1.14
日本	株式	HOYA	精密機器	375,200	14,024.08	5,261,836,000	13,810.00	5,181,512,000	1.05
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,271,500	3,980.74	5,061,517,000	3,922.00	4,986,823,000	1.01
日本	株式	第一三共	医薬品	1,448,900	3,463.80	5,018,710,600	3,419.00	4,953,789,100	1.00
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,457,200	3,184.01	4,639,743,400	3,187.00	4,644,096,400	0.94
日本	株式	ダイキン工業	機械	224,000	20,640.18	4,623,400,500	20,685.00	4,633,440,000	0.93
日本	株式	三井物産	卸売業	1,420,300	3,188.18	4,528,184,800	3,232.00	4,590,409,600	0.93
日本	株式	村田製作所	電気機器	543,800	8,247.22	4,484,840,500	8,300.00	4,513,540,000	0.91
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,211,300	3,720.88	4,507,112,100	3,695.00	4,475,753,500	0.90
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,888,300	1,491.45	4,307,758,000	1,480.00	4,274,684,000	0.86
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	560,700	7,366.42	4,130,356,200	7,466.00	4,186,186,200	0.84
日本	株式	日本電産	電気機器	455,900	8,642.16	3,939,961,800	8,679.00	3,956,756,100	0.80
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	204,800	19,703.02	4,035,180,000	19,200.00	3,932,160,000	0.79
日本	株式	S M C	機械	56,900	66,420.66	3,779,336,000	66,610.00	3,790,109,000	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	677,500	5,410.99	3,665,949,600	5,410.00	3,665,275,000	0.74
日本	株式	ファナック	電気機器	170,500	21,314.13	3,634,060,500	21,105.00	3,598,402,500	0.73
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,349,200	1,530.94	3,596,504,000	1,519.00	3,568,434,800	0.72

(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	0.36
		建設業	2.09
		食料品	3.17
		繊維製品	0.43
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.29
		医薬品	5.10
		石油・石炭製品	0.52
		ゴム製品	0.70
		ガラス・土石製品	0.71
		鉄鋼	0.83
		非鉄金属	0.75
		金属製品	0.59
機械	5.32		

電気機器	18.04
輸送用機器	7.85
精密機器	2.69
その他製品	2.38
電気・ガス業	1.22
陸運業	2.90
海運業	0.68
空運業	0.42
倉庫・運輸関連業	0.19
情報・通信業	8.82
卸売業	5.63
小売業	4.03
銀行業	5.09
証券、商品先物取引業	0.73
保険業	2.23
その他金融業	1.14
不動産業	1.95
サービス業	5.32
小計	98.47
合計	98.47

(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	398	円	7,655,400,550	7,597,820,000	1.53

(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	348,121,484,761	65.59

	イギリス	22,843,709,803	4.30
	カナダ	20,291,739,526	3.82
	スイス	17,049,300,985	3.21
	フランス	15,874,926,271	2.99
	ドイツ	12,380,090,299	2.33
	オーストラリア	11,238,167,505	2.12
	オランダ	9,329,916,957	1.76
	アイルランド	9,220,640,830	1.74
	スウェーデン	4,983,326,741	0.94
	デンマーク	4,118,759,914	0.78
	スペイン	3,850,918,362	0.73
	香港	3,287,313,744	0.62
	イタリア	2,732,540,697	0.51
	フィンランド	1,843,519,150	0.35
	ジャージー	1,680,973,256	0.32
	シンガポール	1,643,432,894	0.31
	ベルギー	1,252,888,477	0.24
	ノルウェー	1,142,224,264	0.22
	ケイマン	1,064,651,325	0.20
	イスラエル	1,032,900,088	0.19
	バミューダ	787,796,876	0.15
	キュラソー	662,146,245	0.12
	ルクセンブルク	497,130,811	0.09
	ニュージーランド	406,173,712	0.08
	オーストリア	321,539,506	0.06
	ポルトガル	260,437,152	0.05
	リベリア	125,090,873	0.02
	マン島	117,291,254	0.02
	パナマ	111,230,501	0.02
	小計	498,272,262,779	93.88
投資信託受益証券	オーストラリア	152,350,981	0.03
	香港	63,839,440	0.01
	小計	216,190,421	0.04
投資証券	アメリカ	10,446,378,238	1.97
	オーストラリア	715,193,428	0.13
	イギリス	296,091,110	0.06
	フランス	241,434,366	0.05
	シンガポール	225,744,219	0.04
	香港	198,518,094	0.04
	カナダ	59,846,051	0.01
	小計	12,183,205,506	2.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		20,089,536,182	3.79

合計(純資産総額)	530,761,194,888	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	14,519,037,279	2.74
	買建	カナダ	1,353,935,244	0.26
	買建	ドイツ	3,130,130,947	0.59
	買建	イギリス	368,400,312	0.07
	買建	オーストラリア	620,467,106	0.12

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		2,168,337,545	0.41

(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	19,185.34	24,642,980,136	19,185.34	24,642,980,136	4.64
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	558,777	35,032.10	19,575,131,965	35,032.10	19,575,131,965	3.69
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	35,733	295,258.65	10,550,477,530	295,258.65	10,550,477,530	1.99
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	23,507	288,001.96	6,770,062,292	288,001.96	6,770,062,292	1.28
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	66,795	97,392.16	6,505,309,481	97,392.16	6,505,309,481	1.23
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	22,377	289,239.19	6,472,305,484	289,239.19	6,472,305,484	1.22

アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サー ビス	73,563	65,016.57	4,782,814,167	65,016.57	4,782,814,167	0.90
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	23,217.54	4,768,188,018	23,217.54	4,768,188,018	0.90
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半 導体製造装 置	196,119	24,117.58	4,729,916,280	24,117.58	4,729,916,280	0.89
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・ 娯楽	185,146	25,017.61	4,631,911,773	25,017.61	4,631,911,773	0.87
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	101,985	40,913.09	4,172,521,800	40,913.09	4,172,521,800	0.79
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	330,112	12,512.01	4,130,365,933	12,512.01	4,130,365,933	0.78
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	231,226	16,830.12	3,891,562,876	16,830.12	3,891,562,876	0.73
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・ パーソナル 用品	189,391	19,067.39	3,611,192,287	19,067.39	3,611,192,287	0.68
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェ ア・サービ ス	130,637	27,293.34	3,565,520,685	27,293.34	3,565,520,685	0.67
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	150,711	22,857.27	3,444,843,345	22,857.27	3,444,843,345	0.65
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲 料・タバコ	219,354	15,557.60	3,412,622,009	15,608.31	3,423,745,670	0.65
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	81,549	39,547.65	3,225,071,848	39,547.65	3,225,071,848	0.61
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェ ア・サービ ス	68,686	45,870.97	3,150,693,706	45,870.97	3,150,693,706	0.59
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	6,911.80	3,020,457,081	6,911.80	3,020,457,081	0.57
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	576,261	4,746.33	2,735,127,292	4,746.33	2,735,127,292	0.52
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲 料・タバコ	319,753	8,292.62	2,651,591,018	8,292.62	2,651,591,018	0.50
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	19,231.50	2,648,004,467	19,231.50	2,648,004,467	0.50
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	41,473.37	2,625,098,478	41,473.37	2,625,098,478	0.49
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半 導体製造装 置	32,248	74,569.48	2,404,716,849	76,608.33	2,470,465,619	0.47
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半 導体製造装 置	32,460	74,782.32	2,427,434,393	74,782.32	2,427,434,393	0.46
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	44,011.80	2,406,961,877	44,131.91	2,413,530,299	0.45
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲 料・タバコ	107,665	22,022.63	2,371,066,642	22,022.63	2,371,066,642	0.45
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	197,066	11,933.78	2,351,743,630	11,933.78	2,351,743,630	0.44
イギリス	株式	SHELL PLC-NEW	エネルギー	598,230	3,849.88	2,303,118,498	3,840.18	2,297,312,317	0.43

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。



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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.30
		素材	4.42
		資本財	5.85
		商業・専門サービス	1.13
		運輸	1.87
		自動車・自動車部品	2.04
		耐久消費財・アパレル	1.56
		消費者サービス	1.71
		メディア・娯楽	5.52
		小売	4.40
		食品・生活必需品小売り	1.43
		食品・飲料・タバコ	4.07
		家庭用品・パーソナル用品	1.65
		ヘルスケア機器・サービス	4.70
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.55
		銀行	5.88
		各種金融	4.57
		保険	3.08
		不動産	0.43
		ソフトウェア・サービス	10.36
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.07		
電気通信サービス	1.57		
公益事業	3.14		
半導体・半導体製造装置	4.56		
	小計	93.88	
投資信託受益証券			0.04
投資証券			2.30
合計			96.21

(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	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	545	アメリカドル	113,244,187.5	14,519,037,279	113,244,187.5	14,519,037,279	2.74
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	53	カナダドル	13,297,357	1,344,362,793	13,392,040	1,353,935,244	0.26
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	81	スイスフラン	9,434,331	1,259,011,471	9,502,110	1,268,056,579	0.24
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	352	ユーロ	13,392,771.5	1,844,988,202	13,516,800	1,862,074,368	0.35
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	37	オーストラリアドル	6,650,121	611,478,626	6,747,875	620,467,106	0.12
	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	30	イギリスポンド	2,274,677.5	367,951,832	2,277,450	368,400,312	0.07

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	12,335,000.00	1,567,655,665	1,581,404,575	0.30
	カナダドル	買建	700,000.00	69,903,120	70,766,990	0.01
	ユーロ	買建	1,010,000.00	137,656,132	139,138,610	0.03
	イギリスポンド	買建	860,000.00	137,927,058	139,108,440	0.03
	スイスフラン	買建	500,000.00	66,296,600	66,725,650	0.01
	デンマーククローネ	買建	1,300,000.00	23,816,780	24,076,000	0.00
	オーストラリアドル	買建	1,600,000.00	145,626,880	147,117,280	0.03

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

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

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	ケイマン	16,574,465,288	15.30
	台湾	15,441,716,005	14.25
	インド	13,003,572,732	12.00
	韓国	12,652,282,012	11.68

	中国	12,065,516,456	11.14
	ブラジル	5,409,938,721	4.99
	サウジアラビア	4,388,680,936	4.05
	南アフリカ	3,646,278,636	3.37
	メキシコ	2,251,534,033	2.08
	タイ	1,935,281,749	1.79
	インドネシア	1,826,782,531	1.69
	マレーシア	1,529,494,491	1.41
	アラブ首長国連邦	1,390,062,841	1.28
	香港	1,102,787,477	1.02
	カタール	995,747,692	0.92
	クウェート	777,586,154	0.72
	フィリピン	771,409,346	0.71
	ポーランド	653,875,551	0.60
	チリ	542,895,505	0.50
	バミューダ	511,131,437	0.47
	アメリカ	356,906,096	0.33
	トルコ	249,156,480	0.23
	コロンビア	242,459,412	0.22
	ギリシャ	232,236,730	0.21
	ハンガリー	199,691,023	0.18
	チェコ	168,795,700	0.16
	ルクセンブルク	74,925,588	0.07
	エジプト	48,899,449	0.05
	マン島	48,764,687	0.05
	シンガポール	24,815,558	0.02
	ペルー	19,622,182	0.02
	ロシア	168	0.00
	小計	99,137,312,666	91.51
投資信託受益証券	ブラジル	198,730,347	0.18
	メキシコ	44,596,433	0.04
	小計	243,326,780	0.22
投資証券	メキシコ	85,993,641	0.08
	南アフリカ	56,715,498	0.05
	小計	142,709,139	0.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,814,956,055	8.14

合計(純資産総額)	108,338,304,640	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	8,779,834,903	8.10

(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	買建		610,245,800	0.56

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,805,389	2,702.60	7,581,864,472	2,421.07	6,792,061,942	6.27
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	543,916	7,297.46	3,969,206,294	7,000.18	3,807,509,905	3.51
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	655,100	7,333.74	4,804,339,522	5,715.50	3,744,224,050	3.46
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	1,730,088	2,524.13	4,366,971,289	1,549.71	2,681,146,785	2.47
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	326,857	4,168.59	1,362,533,411	4,423.56	1,445,874,166	1.33

ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	466,200	4,331.66	2,019,423,546	2,859.38	1,333,044,355	1.23
ブラジル	株式	VALE SA	素材	467,987	1,825.59	854,356,940	2,336.75	1,093,569,186	1.01
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	10,797,620	85.64	924,789,280	95.20	1,027,975,535	0.95
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	385,346	2,890.58	1,113,873,923	2,534.48	976,654,813	0.90
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	198,623	4,830.48	959,444,930	3,929.63	780,515,893	0.72
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	221,156	3,160.89	699,051,767	3,429.84	758,531,022	0.70
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	小売	205,611	4,878.42	1,003,057,678	3,638.32	748,079,436	0.69
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	591,364	1,301.63	769,741,906	1,242.51	734,775,684	0.68
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,447,248	476.82	690,077,128	489.08	707,825,913	0.65
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	62,753	11,329.28	710,946,632	11,063.79	694,286,641	0.64
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	173,804	4,350.60	756,153,198	3,886.11	675,422,471	0.62
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	235,230	2,559.49	602,069,970	2,727.10	641,498,085	0.59
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	96,421	6,825.39	658,111,299	6,297.05	607,168,822	0.56
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	252,104	2,296.39	578,930,855	2,392.67	603,203,442	0.56
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	106,835	5,824.54	622,264,902	5,602.91	598,587,424	0.55
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	727,000	920.83	669,449,078	808.33	587,659,545	0.54
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	31,841	20,657.77	657,764,342	17,832.72	567,811,921	0.52
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	3,658,740	121.95	446,217,852	141.07	516,156,453	0.48
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,699,515	69.54	465,948,962	76.42	512,006,414	0.47
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	8,801,200	44.90	395,239,889	50.62	445,543,148	0.41
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	544,440	718.41	391,136,328	808.76	440,322,015	0.41
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	97,000	4,967.92	481,888,302	4,490.75	435,602,750	0.40
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	14,614	42,452.80	620,405,347	29,055.40	424,615,616	0.39
アラブ首長国連邦	株式	EMIRATES TELECOM GROUP CO	電気通信サービス	404,510	1,052.95	425,929,636	1,039.71	420,573,254	0.39
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	6,307,600	67.82	427,811,838	66.66	420,464,616	0.39

(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	4.71
		素材	8.42

資本財	3.07
商業・専門サービス	0.07
運輸	1.89
自動車・自動車部品	3.20
耐久消費財・アパレル	1.41
消費者サービス	0.87
メディア・娯楽	6.16
小売	6.05
食品・生活必需品小売り	1.16
食品・飲料・タバコ	3.52
家庭用品・パーソナル用品	0.79
ヘルスケア機器・サービス	0.85
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.50
銀行	15.39
各種金融	2.26
保険	2.51
不動産	1.74
ソフトウェア・サービス	2.41
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.83
電気通信サービス	3.11
公益事業	2.42
半導体・半導体製造装置	9.15
小計	91.51
投資信託受益証券	0.22
投資証券	0.13
合計	91.86

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	1,306	アメリカドル	68,725,949	8,811,353,921	68,480,110	8,779,834,903	8.10

(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。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	4,760,000.00	604,567,504	610,245,800	0.56

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

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

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	524,142,688,300	83.82
地方債証券	日本	33,482,118,855	5.35
特殊債券	日本	36,454,342,440	5.83
社債券	日本	27,615,165,120	4.42
	フランス	1,297,775,000	0.21
	オーストラリア	400,192,000	0.06
	スペイン	399,096,000	0.06
	小計	29,712,228,120	4.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,551,489,523	0.25
合計(純資産総額)		625,342,867,238	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	7,880,000,000	100.06	7,885,118,400	100.06	7,885,358,400	0.005	2026/12/20	1.26
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	7,750,000,000	100.36	7,778,597,500	100.38	7,779,450,000	0.100	2024/9/20	1.24
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	6,950,000,000	100.12	6,958,409,500	100.12	6,958,409,500	0.005	2026/6/20	1.11
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	6,890,000,000	100.28	6,909,292,000	100.27	6,909,223,100	0.100	2023/12/20	1.10
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	6,760,000,000	100.24	6,776,359,200	100.24	6,776,291,600	0.100	2023/9/20	1.08
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	6,770,000,000	98.87	6,693,905,200	98.83	6,690,791,000	0.100	2031/12/20	1.07
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,630,000,000	100.34	6,653,006,100	100.28	6,649,160,700	0.100	2028/3/20	1.06

日本	国債証券	第144回利付国債（5年）	6,310,000,000	100.45	6,338,899,800	100.45	6,338,899,800	0.100	2025/6/20	1.01
日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	5,900,000,000	100.51	5,930,503,000	100.51	5,930,444,000	0.100	2026/9/20	0.95
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	5,750,000,000	100.48	5,777,600,000	100.48	5,777,600,000	0.100	2027/3/20	0.92
日本	国債証券	第145回利付国債（5年）	5,750,000,000	100.48	5,777,600,000	100.47	5,777,542,500	0.100	2025/9/20	0.92
日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	5,590,000,000	100.30	5,607,105,400	100.31	5,607,608,500	0.100	2024/3/20	0.90
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	5,415,000,000	100.12	5,421,629,500	100.03	5,416,732,800	0.100	2028/12/20	0.87
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	5,340,000,000	101.21	5,404,614,000	101.20	5,404,560,600	0.300	2025/12/20	0.86
日本	国債証券	第363回利付国債（10年）	5,460,000,000	99.11	5,411,406,000	98.97	5,404,198,800	0.100	2031/6/20	0.86
日本	国債証券	第149回利付国債（5年）	5,130,000,000	100.10	5,135,489,100	100.10	5,135,489,100	0.005	2026/9/20	0.82
日本	国債証券	第364回利付国債（10年）	5,110,000,000	98.99	5,058,644,500	98.90	5,054,045,500	0.100	2031/9/20	0.81
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	5,000,000,000	100.41	5,020,800,000	100.36	5,018,000,000	0.100	2027/12/20	0.80
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	4,940,000,000	100.27	4,953,387,400	100.21	4,950,374,000	0.100	2028/6/20	0.79
日本	国債証券	第143回利付国債（5年）	4,910,000,000	100.43	4,931,358,500	100.43	4,931,309,400	0.100	2025/3/20	0.79
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	4,830,000,000	101.47	4,901,145,900	101.47	4,901,097,600	0.400	2025/9/20	0.78
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	4,890,000,000	99.46	4,863,936,300	99.30	4,855,965,600	0.100	2030/9/20	0.78
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	4,800,000,000	101.05	4,850,832,000	101.05	4,850,736,000	0.600	2023/12/20	0.78
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	4,750,000,000	101.37	4,815,360,000	101.37	4,815,312,500	0.400	2025/6/20	0.77
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	4,790,000,000	100.06	4,793,209,300	99.93	4,786,742,800	0.100	2029/3/20	0.77
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	100.49	4,783,514,400	100.49	4,783,514,400	0.100	2026/3/20	0.76
日本	国債証券	第140回利付国債（5年）	4,660,000,000	100.33	4,675,797,400	100.34	4,676,263,400	0.100	2024/6/20	0.75
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	4,560,000,000	101.27	4,618,231,200	101.27	4,618,140,000	0.400	2025/3/20	0.74
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	4,510,000,000	100.18	4,518,478,800	100.12	4,515,637,500	0.100	2028/9/20	0.72
日本	国債証券	第142回利付国債（5年）	4,370,000,000	100.40	4,387,873,300	100.42	4,388,441,400	0.100	2024/12/20	0.70

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.82
地方債証券	5.35
特殊債券	5.83
社債券	4.75
合計	99.75



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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	148,955,462,724	48.24
	フランス	27,610,535,955	8.94
	イタリア	24,931,955,193	8.07
	ドイツ	20,410,293,100	6.61
	スペイン	16,401,625,977	5.31
	イギリス	15,804,755,785	5.12
	カナダ	6,224,089,321	2.02
	ベルギー	6,191,111,323	2.01
	オランダ	5,292,381,711	1.71
	中国	5,177,743,927	1.68
	オーストラリア	4,663,083,309	1.51
	オーストリア	3,902,508,484	1.26
	メキシコ	2,328,239,086	0.75
	アイルランド	2,094,148,915	0.68
	フィンランド	1,621,033,409	0.52
	マレーシア	1,486,076,262	0.48
	シンガポール	1,314,110,644	0.43
	ポーランド	1,292,132,346	0.42
	イスラエル	1,224,295,000	0.40
	デンマーク	1,195,397,207	0.39
スウェーデン	827,013,945	0.27	
ノルウェー	761,328,212	0.25	
	小計	299,709,321,835	97.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,071,992,648	2.94
合計(純資産総額)		308,781,314,483	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	2,874,664,534	0.93
	買建	ドイツ	2,907,210,583	0.94

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		6,031,624,100	1.95

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

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	18,030,000	11,365.61	2,049,220,607	11,365.61	2,049,220,607	1.375	2031/11/15	0.66
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	16,120,000	11,277.47	1,817,928,462	11,277.47	1,817,928,462	1.250	2031/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	13,340,000	12,699.80	1,694,153,526	12,699.80	1,694,153,526	2.625	2029/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	14,500,000	11,682.63	1,693,982,142	11,682.63	1,693,982,142	1.250	2028/9/30	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	11,238.40	1,691,380,375	11,238.40	1,691,380,375	1.125	2031/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	12,345.22	1,604,878,700	12,345.22	1,604,878,700	0.250	2024/3/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/51	15,150,000	10,283.84	1,558,002,420	10,283.84	1,558,002,420	2.000	2051/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,900.85	1,537,020,552	10,900.85	1,537,020,552	0.625	2030/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/23	12,000,000	12,497.97	1,499,756,512	12,497.97	1,499,756,512	0.250	2023/9/30	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.75% 08/15/41	14,500,000	10,163.64	1,473,728,885	10,163.64	1,473,728,885	1.750	2041/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	11,830,000	11,803.83	1,396,393,551	11,803.83	1,396,393,551	0.750	2026/8/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.25% 11/15/23	11,000,000	12,456.90	1,370,259,396	12,456.90	1,370,259,396	0.250	2023/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.5% 02/28/26	11,500,000	11,810.84	1,358,247,228	11,810.84	1,358,247,228	0.500	2026/2/28	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	10,860,000	12,264.08	1,331,879,936	12,264.08	1,331,879,936	0.750	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	11,904.99	1,309,549,965	11,904.99	1,309,549,965	0.750	2026/3/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	11,695.15	1,304,009,886	11,695.15	1,304,009,886	1.625	2031/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	10,841.75	1,295,590,096	10,841.75	1,295,590,096	0.625	2030/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	12,717.33	1,290,809,010	12,717.33	1,290,809,010	2.250	2024/11/15	0.42

アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	12,416.33	1,268,949,661	12,416.33	1,268,949,661	2.000	2026/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	12,374.51	1,237,451,868	12,374.51	1,237,451,868	0.125	2024/1/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,039.08	1,230,857,575	11,039.08	1,230,857,575	0.875	2030/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	12,286.37	1,228,637,430	12,286.37	1,228,637,430	0.250	2024/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	10,210,000	11,605.50	1,184,922,475	11,605.50	1,184,922,475	1.125	2028/8/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	11,399.67	1,139,967,202	11,399.67	1,139,967,202	0.625	2027/12/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	12,540.03	1,122,333,565	12,540.03	1,122,333,565	2.250	2027/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,500,000	11,722.20	1,113,609,028	11,722.20	1,113,609,028	1.250	2028/6/30	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	12,263.58	1,104,949,190	12,263.58	1,104,949,190	0.375	2024/7/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	12,256.07	1,103,046,722	12,256.07	1,103,046,722	0.250	2024/6/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	13,072.41	1,098,082,596	13,072.41	1,098,082,596	3.125	2028/11/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	7,180,000	15,156.90	1,088,265,868	15,064.74	1,081,648,677	2.500	2030/5/25	0.35

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.06
合計	97.06

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	74	アメリカドル	8,385,702.94	1,075,130,974	8,385,702.94	1,075,130,974	0.35
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	57	アメリカドル	6,848,015.91	877,984,120	6,848,015.91	877,984,120	0.28
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	51	アメリカドル	7,187,812.5	921,549,440	7,187,812.5	921,549,440	0.30
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	33	ユーロ	3,642,210	501,750,849	3,637,095	501,046,207	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	45	ユーロ	5,736,150	790,212,024	5,712,300	786,926,448	0.25
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	77	ユーロ	11,837,980	1,630,800,125	11,754,050	1,619,237,928	0.52

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	25,220,000.00	3,201,620,994	3,231,564,700	1.05
	カナダドル	買建	2,380,000.00	237,530,902	240,463,300	0.08
	ユーロ	買建	16,020,000.00	2,183,779,116	2,207,155,500	0.71
	イギリスポンド	買建	2,180,000.00	349,481,468	352,440,600	0.11

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

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

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	メキシコ	8,256,228,662	10.15
	ブラジル	8,143,989,676	10.01
	マレーシア	7,990,912,984	9.82
	タイ	7,950,774,401	9.77
	中国	7,766,656,594	9.55
	インドネシア	7,737,913,207	9.51
	南アフリカ	7,581,178,398	9.32
	ポーランド	5,604,109,837	6.89
	チェコ	3,608,817,110	4.44
	コロンビア	3,415,457,461	4.20
	ルーマニア	2,527,475,390	3.11
	ハンガリー	2,385,774,803	2.93
	ペルー	1,902,863,812	2.34
	チリ	1,739,893,460	2.14
	ドミニカ共和国	123,368,502	0.15
	ウルグアイ	121,272,328	0.15
	フィリピン	72,972,421	0.09
	小計	76,929,659,046	94.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,431,900,218	5.45
合計(純資産総額)		81,361,559,264	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	64,500,000,000	3.85	2,487,708,341	3.28	2,115,895,552	9.850	2027/6/28	2.60
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	92,100,000	2,113.20	1,946,258,716	2,221.84	2,046,315,834	0.000	2024/1/1	2.52
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	155,400,000	913.18	1,419,083,368	898.37	1,396,075,527	10.500	2026/12/21	1.72
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	55,000,000	2,232.41	1,227,829,508	2,352.01	1,293,608,506	0.000	2023/7/1	1.59
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	198,300,000	619.88	1,229,234,571	591.44	1,172,827,611	5.750	2026/3/5	1.44
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	40,100,000	2,638.51	1,058,046,427	2,647.49	1,061,646,732	10.000	2023/1/1	1.30
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	41,200,000	2,546.99	1,049,360,189	2,470.69	1,017,928,290	10.000	2027/1/1	1.25
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	122,700,000	764.07	937,516,961	752.91	923,822,411	8.000	2030/1/31	1.14
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	134,200,000	694.81	932,447,904	676.10	907,331,568	8.750	2048/2/28	1.12
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	136,900,000	703.26	962,764,772	652.13	892,769,706	8.500	2029/5/31	1.10
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/24	41,850,000	2,023.18	846,703,769	2,103.46	880,300,987	0.000	2024/7/1	1.08
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	29,800,000	3,008.68	896,589,424	2,918.33	869,664,922	3.885	2029/8/15	1.07
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	33,600,000,000	3.14	1,058,065,278	2.50	840,028,775	7.250	2034/10/18	1.03
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	128,400,000	670.54	860,978,930	642.20	824,587,162	8.000	2024/9/5	1.01
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000	2,577.95	819,788,165	2,556.76	813,051,438	10.000	2025/1/1	1.00
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	124,600,000	674.06	839,889,312	625.02	778,780,012	7.750	2031/5/29	0.96
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000	3,039.79	790,346,231	2,967.53	771,557,863	3.955	2025/9/15	0.95
マレーシア	国債証券	MGS 3.733% 06/15/28	25,500,000	2,993.34	763,303,997	2,917.28	743,907,242	3.733	2028/6/15	0.91
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	100,000,000	744.01	744,018,851	731.26	731,263,500	8.250	2032/3/31	0.90
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	114,000,000	664.72	757,782,460	625.18	712,714,031	7.500	2027/6/3	0.88
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	175,500,000	433.27	760,396,288	400.41	702,726,131	3.650	2031/6/20	0.86
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	104,250,000	707.34	737,407,630	670.44	698,943,662	10.000	2024/12/5	0.86
タイ	国債証券	THAIGB 1.45% 12/17/24	184,000,000	381.65	702,236,219	372.70	685,770,300	1.450	2024/12/17	0.84
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	97,700,000	708.19	691,907,981	690.37	674,497,841	8.500	2037/1/31	0.83
タイ	国債証券	THAIGB 2.875% 12/17/28	168,200,000	404.30	680,034,301	383.49	645,036,488	2.875	2028/12/17	0.79
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000	702.36	690,423,475	649.42	638,382,336	8.500	2038/11/18	0.78
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000	2,967.28	715,114,766	2,557.22	616,291,719	2.500	2026/7/25	0.76
マレーシア	国債証券	MGS 3.899% 11/16/27	20,800,000	3,011.46	626,384,079	2,949.17	613,429,164	3.899	2027/11/16	0.75
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000	2,920.53	762,258,703	2,338.66	610,391,230	2.750	2029/10/25	0.75
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 01/31/44	86,000,000	696.84	599,288,945	678.36	583,393,470	8.750	2044/1/31	0.72

(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。

#### □ 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	94.55
合計	94.55

(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。

#### 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	113,599,942,400	96.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,156,341,183	3.53
合計(純資産総額)		117,756,283,583	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	4,148,408,000	3.52

(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	11,925	705,226.36	8,409,824,422	700,000	8,347,500,000	7.09
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	10,229	674,423.8	6,898,681,063	639,000	6,536,331,000	5.55
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	16,735	369,595.04	6,185,173,132	343,000	5,740,105,000	4.87
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	51,610	101,017.7	5,213,523,874	108,900	5,620,329,000	4.77
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	33,078	165,589.48	5,477,368,871	167,800	5,550,488,400	4.71
日本	投資証券	G L P 投資法人	33,129	183,645.41	6,083,988,985	165,700	5,489,475,300	4.66
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	15,359	324,964.33	4,991,127,177	318,500	4,891,841,500	4.15
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	20,381	180,318.95	3,675,080,614	186,200	3,794,942,200	3.22
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	10,227	358,678.77	3,668,207,878	360,500	3,686,833,500	3.13
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	23,027	141,747.48	3,264,019,297	143,800	3,311,282,600	2.81
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,989	409,957.39	2,865,192,244	410,500	2,868,984,500	2.44
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	14,521	204,848.12	2,974,599,627	190,400	2,764,798,400	2.35
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	31,049	84,525.56	2,624,434,285	79,500	2,468,395,500	2.10
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,532	633,124.91	2,236,197,201	670,000	2,366,440,000	2.01
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	12,522	189,183.19	2,368,951,907	183,100	2,292,778,200	1.95
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	4,029	584,054.1	2,353,153,982	556,000	2,240,124,000	1.90
日本	投資証券	アクティブア・プロパティーズ投資法人	5,452	448,823.55	2,446,986,035	410,500	2,238,046,000	1.90
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,897	328,385.43	2,264,874,352	324,000	2,234,628,000	1.90
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,164	706,513.95	2,235,410,152	662,000	2,094,568,000	1.78
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	31,337	65,965.22	2,067,152,389	66,800	2,093,311,600	1.78
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	45,021	42,945.8	1,933,462,992	42,800	1,926,898,800	1.64
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,586	507,315.77	1,819,234,356	531,000	1,904,166,000	1.62
日本	投資証券	イオンリート投資法人	12,029	153,847.12	1,850,627,032	154,100	1,853,668,900	1.57
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	12,028	154,277.03	1,855,644,206	152,200	1,830,661,600	1.55
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	13,822	112,867.43	1,560,053,641	118,000	1,630,996,000	1.39
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,758	323,247.31	1,538,010,705	339,000	1,612,962,000	1.37
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,319	213,656.61	1,563,752,795	214,100	1,566,997,900	1.33
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,543	170,068.46	1,622,963,322	162,100	1,546,920,300	1.31
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,163	728,789.05	1,576,370,736	695,000	1,503,285,000	1.28
日本	投資証券	N T T 都市開発リート投資法人	9,805	152,065.08	1,490,998,191	152,100	1,491,340,500	1.27

(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	96.47
合計	96.47

(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	4,148,408,000	3.52

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

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

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	76,405,011,240	75.94
	オーストラリア	6,684,184,831	6.64
	イギリス	5,205,518,908	5.17
	シンガポール	3,623,624,749	3.60
	カナダ	1,915,482,272	1.90
	フランス	1,799,791,644	1.79
	香港	1,485,243,864	1.48
	ベルギー	1,282,350,341	1.27
	スペイン	433,840,134	0.43
	ニュージーランド	343,870,872	0.34
	ガーンジー	288,893,705	0.29
	韓国	246,350,126	0.24
	オランダ	206,944,808	0.21
	アイルランド	121,987,403	0.12
	イスラエル	78,046,525	0.08
	ドイツ	58,310,226	0.06
	イタリア	34,956,008	0.03
	小計	100,214,407,656	99.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		395,752,052	0.39
合計(純資産総額)		100,610,159,708	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		112,370,670	0.11

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

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

## 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	392,499	19,030.34	7,469,389,759	16,316.00	6,404,015,489	6.37
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	47,631	101,405.18	4,830,030,445	88,936.71	4,236,144,567	4.21
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	81,010	42,080.38	3,408,932,229	43,049.07	3,487,405,298	3.47
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	150,799	19,967.30	3,011,049,343	18,142.99	2,735,945,820	2.72
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	231,305	10,967.05	2,536,734,122	11,560.69	2,674,046,719	2.66
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	300,633	8,814.78	2,650,016,015	8,891.36	2,673,037,283	2.66
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	174,670	21,050.26	3,676,849,425	14,581.32	2,546,919,741	2.53
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	74,086	30,731.53	2,276,776,753	27,040.77	2,003,342,568	1.99
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	181,231	10,970.58	1,988,210,777	10,017.04	1,815,399,499	1.80
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	448,821	3,757.03	1,686,236,843	3,957.84	1,776,362,918	1.77
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	897,829	2,155.27	1,935,071,489	1,873.94	1,682,478,574	1.67
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	77,219	26,300.23	2,030,878,154	21,614.92	1,669,082,809	1.66
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	71,039	25,338.34	1,800,010,405	23,081.64	1,639,697,072	1.63
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	316,727	5,185.21	1,642,298,790	4,941.21	1,565,015,697	1.56
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	211,810	6,791.16	1,438,437,105	7,359.25	1,558,763,590	1.55
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	60,817	26,001.66	1,581,343,055	23,567.56	1,433,308,430	1.42
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	200,836	7,252.21	1,456,505,153	6,848.97	1,375,521,386	1.37
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	61,174	24,641.37	1,507,411,260	21,304.65	1,303,291,008	1.30
香港	投資証券	LINK REIT	1,112,000	1,130.69	1,257,336,688	1,164.32	1,294,733,848	1.29
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	34,415	43,453.91	1,495,466,544	37,012.94	1,273,800,499	1.27
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	637,633	2,130.67	1,358,589,970	1,826.27	1,164,490,274	1.16
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	101,774	9,876.64	1,005,185,961	10,917.08	1,111,075,053	1.10
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	284,704	4,334.36	1,234,011,353	3,856.55	1,097,977,147	1.09
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	75,046	15,100.50	1,133,232,497	14,446.70	1,084,167,258	1.08
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	152,471	6,101.51	930,303,926	7,043.85	1,073,983,982	1.07
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	53,975	20,896.39	1,127,883,098	18,587.88	1,003,281,136	1.00
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	375,710	2,343.67	880,543,562	2,653.94	997,114,427	0.99

アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	324,627	2,989.85	970,588,373	3,043.70	988,068,953	0.98
アメリカ	投資証券	UDR INC	157,970	7,079.63	1,118,370,232	6,229.72	984,109,484	0.98
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	90,856	10,776.05	979,068,844	9,915.76	900,906,418	0.90

(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(%)
投資証券	99.61
合計	99.61

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	530,000.00	67,316,658	67,948,650	0.07
	イギリスポンド	買建	130,000.00	20,841,496	21,028,020	0.02
	シンガポールドル	買建	250,000.00	23,207,750	23,394,000	0.02

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

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

#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

# 運用実績

当初設定日：2017年8月25日  
作成基準日：2022年5月31日



SMT インテックスシリーズ

## 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	13,166円
純資産総額	1.27億円

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年5月	0円
2020年11月	0円
2021年5月	0円
2021年11月	0円
2022年5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

マザーファンド	投資比率	上位紹介銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内株式インデックスマザーファンド	12.9%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.5%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.4%
J-REITインデックスマザーファンド	12.8%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.9%
		ジャパソリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.7%
新興国債券インデックスマザーファンド	12.6%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.4%
		BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	国債	-	0.000%	2024/01/01	0.3%
新興国株式インデックスマザーファンド	12.6%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.8%
		SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.4%
外国債券インデックスマザーファンド	12.5%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.1%
		T 1.25% 08/15/31	アメリカ	国債	-	1.250%	2031/08/15	0.1%
外国株式インデックスマザーファンド	12.3%	APPLE INC	アメリカ	株式	ソフトウェア・ハードウェア	-	-	0.6%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.5%
国内債券インデックスマザーファンド	11.7%	第150回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/12/20	0.1%
		第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2024/09/20	0.1%
グローバルREITインデックスマザーファンド	11.5%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.7%
		EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.5%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2017年は当初設定日から年末までの収益率です。また、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、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### < 問い合わせ先 >

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

#### < 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<一部解約受付の中止等>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記<解約価額>の規定に準じて計算された価額とします。

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

(イ) 国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

(ロ) 外国上場株式、外国上場投資信託受益証券（海外REITを含みます。）、外国上場投資証券

（海外REITを含みます。）（上場には店頭登録を含みます。）

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

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。（2017年 8月25日設定）

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

(4) 【計算期間】

原則として、毎年5月11日から11月10日まで及び11月11日から翌年5月10日までとします。

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

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

## （５）【その他】

### <投資信託契約の終了（償還）と手続き>

#### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

#### (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

### <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

#### (1)投資信託約款の変更等

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

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき



・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

## (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当するものを除きます。）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であっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

## < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

## < 運用報告書 >

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

## < 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2021年11月11日から2022年5月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【SMT 8資産インデックスバランス・オープン】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (2021年11月10日現在)	第10期 (2022年5月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	947,570	1,638,565
親投資信託受益証券	103,075,165	119,564,931
未収入金	913,984	-
流動資産合計	104,936,719	121,203,496
資産合計	104,936,719	121,203,496
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	533,103	83,268
未払受託者報酬	26,330	30,900
未払委託者報酬	236,895	278,048
未払利息	2	-
その他未払費用	2,566	3,022
流動負債合計	798,896	395,238
負債合計	798,896	395,238
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	78,719,863	93,997,522
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	25,417,960	26,810,736
(分配準備積立金)	15,052,533	15,581,461
元本等合計	104,137,823	120,808,258
純資産合計	104,137,823	120,808,258
負債純資産合計	104,936,719	121,203,496

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期		第10期	
	自	2021年 5月11日	自	2021年11月11日
	至	2021年11月10日	至	2022年 5月10日
営業収益				
受取利息		1		2
有価証券売買等損益		4,712,842		2,913,855
営業収益合計		4,712,843		2,913,853
営業費用				
支払利息		148		138
受託者報酬		26,330		30,900
委託者報酬		236,895		278,048
その他費用		2,566		3,022
営業費用合計		265,939		312,108
営業利益又は営業損失（ ）		4,446,904		3,225,961
経常利益又は経常損失（ ）		4,446,904		3,225,961
当期純利益又は当期純損失（ ）		4,446,904		3,225,961
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（ ）		136,081		37,896
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		17,333,269		25,417,960
剰余金増加額又は欠損金減少額		5,291,130		5,740,740
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		5,291,130		5,740,740
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,517,262		1,159,899
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,517,262		1,159,899
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		25,417,960		26,810,736

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

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

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

	第9期 (2021年11月10日現在)	第10期 (2022年 5月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	78,719,863口	93,997,522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) 1.3229円 (13,229円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2852円 (12,852円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第9期 自 2021年 5月11日 至 2021年11月10日	第10期 自 2021年11月11日 至 2022年 5月10日																																																												
<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <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>1,130,937円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>3,179,886円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>10,682,944円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>10,741,710円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>25,735,477円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>78,719,863口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>3,269円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,130,937円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	3,179,886円	収益調整金額	C	10,682,944円	分配準備積立金額	D	10,741,710円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	25,735,477円	当ファンドの期末残存口数	F	78,719,863口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,269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	<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <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>1,138,465円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>16,318,471円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>14,442,996円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>31,899,932円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>93,997,522口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>3,393円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,138,465円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	16,318,471円	分配準備積立金額	D	14,442,996円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	31,899,932円	当ファンドの期末残存口数	F	93,997,522口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,393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
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,130,937円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	3,179,886円																																																											
収益調整金額	C	10,682,944円																																																											
分配準備積立金額	D	10,741,710円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	25,735,477円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	78,719,863口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,269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																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,138,465円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																																																											
収益調整金額	C	16,318,471円																																																											
分配準備積立金額	D	14,442,996円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	31,899,932円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	93,997,522口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,393円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円																																																											

## （ 金融商品に関する注記 ）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第10期 自 2021年11月11日 至 2022年 5月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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10期 (2022年 5月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )



該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第9期	第10期
	自 2021年 5月11日 至 2021年11月10日	自 2021年11月11日 至 2022年 5月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	66,114,632円	78,719,863円
期中追加設定元本額	18,347,554円	18,905,302円
期中一部解約元本額	5,742,323円	3,627,643円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第9期 (2021年11月10日現在)	第10期 (2022年 5月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	4,562,061	3,629,572
合計	4,562,061	3,629,572

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	J - R E I Tインデックス マザーファンド	7,293,318	15,472,774	
	グローバルR E I Tインデックス マザーファンド	5,501,844	13,781,018	
	新興国株式インデックス マザーファンド	4,367,407	14,996,802	

国内株式インデックス マザーファンド	8,477,731	15,584,612
外国株式インデックス マザーファンド	3,596,274	14,675,674
国内債券インデックス マザーファンド	10,453,400	14,423,601
外国債券インデックス マザーファンド	5,019,868	15,473,743
新興国債券インデックス マザーファンド	8,901,050	15,156,707
合計	53,610,892	119,564,931

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 国内株式インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

項目	2022年 5月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,099,869,039
株式	471,620,602,660
派生商品評価勘定	80,152,500
未収配当金	5,668,079,729
前払金	86,995,750
差入委託証拠金	328,665,000
流動資産合計	479,884,364,678
資産合計	479,884,364,678
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	167,213,150
未払解約金	318,107,132
未払利息	1,094
流動負債合計	485,321,376
負債合計	485,321,376
純資産の部	
元本等	
元本	260,787,797,765
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	218,611,245,537
元本等合計	479,399,043,302

	2022年 5月10日現在
項目	金額（円）
純資産合計	479,399,043,302
負債純資産合計	479,884,364,678

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	260,787,797,765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 1.8383円 (1万口当たり純資産額) (18,383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 5月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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 5月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月11日
期首元本額	251,362,690,536円
期中追加設定元本額	19,949,421,017円
期中一部解約元本額	10,524,313,788円
期末元本額	260,787,797,765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）	403,209,977円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,971,031,818円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,307,969円
S M T T O P I X インデックス・オープン	11,716,727,619円
世界経済インデックスファンド	3,788,572,478円
日本株式インデックス・オープン	3,349,913,580円
D C マイセレクション 2 5	6,238,840,654円
D C マイセレクション 5 0	18,906,418,060円
D C マイセレクション 7 5	19,247,639,681円
D C 日本株式インデックス・オープン	6,179,238,781円
D C マイセレクション S 2 5	3,069,560,990円
D C マイセレクション S 5 0	9,021,231,654円
D C マイセレクション S 7 5	6,910,945,824円
D C 日本株式インデックス・オープン S	8,208,532,311円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	196,203,587円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	699,067,941円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	511,238,392円
D C 世界経済インデックスファンド	3,562,556,561円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,790,380,469円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	3,350,367円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	19,058,334円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	22,371,205円

区分	2022年 5月10日現在
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	186,484,057円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,356,825円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	31,325,672円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	113,885,822円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	25,967,549円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	74,211,525円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	927,379,823円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	438,903,473円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,844,332,276円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	58,713,979円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	26,007,286円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	489,333,644円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	279,614,742円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	352,914,775円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	35,341,535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）	586,771,531円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,598,569,767円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,899,845,367円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,089,649,570円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,319,372,568円
分散投資コア戦略ファンドA	1,418,670,019円
分散投資コア戦略ファンドS	6,097,040,794円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	472,632,111円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	417,011,666円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,762,760,621円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	220,774,593円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,174,985円
SMT インデックスバランス・オープン	57,846,456円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	29,315,752,190円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	515,918,123円
SMT 世界経済インデックス・オープン	45,863,225円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	171,720,092円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	31,223,926円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,477,731円
グローバル経済コア	217,635,539円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	27,214,200円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	102,326,305円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	24,663,724円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,258,025,139円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	187,894,275円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	10,344,044円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	8,817,612円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	3,576,412円

区分	2022年 5月10日現在
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	4,490,231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)	43,679,259,324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)	940,180,820円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	288,270,181円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	52,413,389円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	18,070,754円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P(適格機関投資家専用)	46,935,709,542円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	12,812,475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)	257,847,229円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	15,277,649,112
合計	15,277,649,112

(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 5月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,779,035,750	-	7,692,040,000	86,995,750
合計		7,779,035,750	-	7,692,040,000	86,995,750

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	8,800	3,225.00	28,380,000	
日本水産	250,700	572.00	143,400,400	
マルハニチロ	38,100	2,428.00	92,506,800	
雪国まいたけ	18,700	1,025.00	19,167,500	
カネコ種苗	7,300	1,762.00	12,862,600	
サカタのタネ	29,700	4,355.00	129,343,500	
ホクト	20,900	2,010.00	42,009,000	
ホクリヨウ	3,500	667.00	2,334,500	
住石ホールディングス	44,900	173.00	7,767,700	
日鉄鉱業	5,600	6,020.00	33,712,000	
三井松島ホールディングス	10,700	1,947.00	20,832,900	
I N P E X	949,700	1,471.00	1,397,008,700	
石油資源開発	30,200	2,523.00	76,194,600	
K & O エナジーグループ	11,100	1,674.00	18,581,400	
ショーボンドホールディングス	34,400	5,410.00	186,104,000	
ミライト・ホールディングス	82,700	1,840.00	152,168,000	
タマホーム	15,600	2,645.00	41,262,000	
サンヨーホームズ	3,000	730.00	2,190,000	
日本アクア	10,200	596.00	6,079,200	
ファーストコーポレーション	6,300	806.00	5,077,800	
ベステラ	5,200	1,192.00	6,198,400	
R o b o t H o m e	42,800	195.00	8,346,000	
キャンディル	4,200	513.00	2,154,600	
ダイセキ環境ソリューション	4,900	999.00	4,895,100	
第一カッター興業	6,100	1,322.00	8,064,200	
安藤・間	124,000	893.00	110,732,000	
東急建設	73,100	595.00	43,494,500	
コムシスホールディングス	82,800	2,722.00	225,381,600	
ビーアールホールディングス	34,100	300.00	10,230,000	
高松コンストラクショングループ	15,000	2,205.00	33,075,000	
東建コーポレーション	7,100	8,630.00	61,273,000	
ソネック	2,600	1,004.00	2,610,400	
ヤマウラ	12,000	924.00	11,088,000	
オリエンタル白石	86,300	233.00	20,107,900	
大成建設	157,100	3,520.00	552,992,000	
大林組	578,800	901.00	521,498,800	
清水建設	540,000	693.00	374,220,000	
飛鳥建設	15,900	1,017.00	16,170,300	
長谷工コーポレーション	170,700	1,391.00	237,443,700	
松井建設	22,100	631.00	13,945,100	



銭高組	2,400	3,675.00	8,820,000
鹿島建設	424,100	1,438.00	609,855,800
不動テトラ	12,600	1,549.00	19,517,400
大末建設	6,200	1,329.00	8,239,800
鉄建建設	12,600	1,850.00	23,310,000
西松建設	35,900	3,800.00	136,420,000
三井住友建設	133,700	420.00	56,154,000
大豊建設	8,700	4,465.00	38,845,500
佐田建設	12,800	445.00	5,696,000
ナカノフード建設	14,200	307.00	4,359,400
奥村組	33,400	3,105.00	103,707,000
東鉄工業	26,100	2,222.00	57,994,200
イチケン	4,300	1,777.00	7,641,100
富士ピー・エス	7,600	475.00	3,610,000
浅沼組	6,600	5,070.00	33,462,000
戸田建設	239,900	743.00	178,245,700
熊谷組	29,300	2,703.00	79,197,900
北野建設	3,600	2,050.00	7,380,000
植木組	5,100	1,396.00	7,119,600
矢作建設工業	25,300	774.00	19,582,200
ピーエス三菱	19,500	562.00	10,959,000
日本ハウスホールディングス	40,300	411.00	16,563,300
大東建託	60,700	11,760.00	713,832,000
新日本建設	25,200	707.00	17,816,400
東亜道路工業	3,100	5,040.00	15,624,000
日本道路	5,200	7,150.00	37,180,000
東亜建設工業	14,100	2,857.00	40,283,700
日本国土開発	53,800	542.00	29,159,600
若築建設	9,600	1,939.00	18,614,400
東洋建設	66,500	894.00	59,451,000
五洋建設	229,500	618.00	141,831,000
世紀東急工業	28,500	739.00	21,061,500
福田組	6,300	4,615.00	29,074,500
住友林業	144,400	1,943.00	280,569,200
日本基礎技術	15,700	731.00	11,476,700
巴コーポレーション	24,700	465.00	11,485,500
大和ハウス工業	521,400	3,066.00	1,598,612,400
ライト工業	34,800	1,874.00	65,215,200
積水ハウス	616,300	2,223.00	1,370,034,900
日特建設	12,200	732.00	8,930,400
北陸電気工事	11,700	738.00	8,634,600
ユアテック	33,900	681.00	23,085,900

日本リーテック	12,000	1,063.00	12,756,000
四電工	6,200	1,723.00	10,682,600
中電工	26,200	2,115.00	55,413,000
関電工	96,400	834.00	80,397,600
きんでん	128,500	1,528.00	196,348,000
東京エネシス	19,000	927.00	17,613,000
トーエネック	6,000	3,345.00	20,070,000
住友電設	14,600	2,314.00	33,784,400
日本電設工業	30,100	1,625.00	48,912,500
エクシオグループ	86,900	2,187.00	190,050,300
新日本空調	14,700	1,813.00	26,651,100
九電工	43,000	2,874.00	123,582,000
三機工業	38,500	1,496.00	57,596,000
日揮ホールディングス	177,600	1,415.00	251,304,000
中外炉工業	5,800	1,477.00	8,566,600
ヤマト	16,300	731.00	11,915,300
太平電業	12,300	2,728.00	33,554,400
高砂熱学工業	50,900	1,683.00	85,664,700
三晃金属工業	2,300	2,602.00	5,984,600
朝日工業社	7,700	1,539.00	11,850,300
明星工業	34,200	672.00	22,982,400
大気社	27,500	3,165.00	87,037,500
ダイダン	12,500	2,075.00	25,937,500
日比谷総合設備	18,100	1,872.00	33,883,200
フィル・カンパニー	3,300	1,103.00	3,639,900
テスホールディングス	16,500	1,365.00	22,522,500
インフロニア・ホールディングス	241,400	965.00	232,951,000
東洋エンジニアリング	24,900	610.00	15,189,000
レイズネクスト	27,600	1,082.00	29,863,200
ニッポン	52,400	1,699.00	89,027,600
日清製粉グループ本社	202,500	1,730.00	350,325,000
日東富士製粉	2,800	4,005.00	11,214,000
昭和産業	17,000	2,609.00	44,353,000
鳥越製粉	15,800	641.00	10,127,800
中部飼料	20,800	991.00	20,612,800
フィード・ワン	24,100	645.00	15,544,500
東洋精糖	3,200	975.00	3,120,000
日本甜菜製糖	9,900	1,652.00	16,354,800
D M三井製糖ホールディングス	16,600	1,902.00	31,573,200
塩水港精糖	22,600	207.00	4,678,200
日新製糖	9,000	1,708.00	15,372,000
森永製菓	42,400	4,035.00	171,084,000

中村屋	4,300	3,120.00	13,416,000
江崎グリコ	49,600	3,630.00	180,048,000
名糖産業	7,900	1,622.00	12,813,800
井村屋グループ	10,200	2,285.00	23,307,000
不二家	10,600	2,380.00	25,228,000
山崎製パン	133,600	1,697.00	226,719,200
第一屋製パン	3,700	515.00	1,905,500
モロゾフ	5,900	3,065.00	18,083,500
亀田製菓	10,500	4,200.00	44,100,000
寿スピリッツ	17,700	6,330.00	112,041,000
カルビー	86,500	2,338.00	202,237,000
森永乳業	34,100	4,985.00	169,988,500
六甲バター	13,400	1,488.00	19,939,200
ヤクルト本社	133,900	6,730.00	901,147,000
明治ホールディングス	116,100	6,550.00	760,455,000
雪印メグミルク	44,300	1,911.00	84,657,300
プリマハム	23,700	2,159.00	51,168,300
日本ハム	70,500	4,050.00	285,525,000
林兼産業	5,800	499.00	2,894,200
丸大食品	18,200	1,497.00	27,245,400
S Foods	17,000	2,946.00	50,082,000
柿安本店	6,600	2,382.00	15,721,200
伊藤ハム米久ホールディングス	122,200	660.00	80,652,000
サッポロホールディングス	61,700	2,710.00	167,207,000
アサヒグループホールディングス	426,600	4,712.00	2,010,139,200
キリンホールディングス	697,400	1,917.00	1,336,915,800
宝ホールディングス	121,100	1,054.00	127,639,400
オエノンホールディングス	52,600	301.00	15,832,600
養命酒製造	5,600	1,720.00	9,632,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	129,200	1,474.00	190,440,800
サントリー食品インターナショナル	127,000	5,010.00	636,270,000
ダイドーグループホールディングス	9,700	5,020.00	48,694,000
伊藤園	57,600	5,470.00	315,072,000
キーコーヒー	18,200	2,026.00	36,873,200
ユニカフェ	5,700	915.00	5,215,500
ジャパンフーズ	2,700	1,140.00	3,078,000
日清オイリオグループ	23,100	3,075.00	71,032,500
不二製油グループ本社	41,100	1,860.00	76,446,000
かどや製油	1,900	3,535.00	6,716,500
J - オイルミルズ	17,700	1,603.00	28,373,100
キッコーマン	129,000	7,200.00	928,800,000
味の素	399,300	3,013.00	1,203,090,900

ブルドックソース	7,600	1,850.00	14,060,000
キューピー	94,100	2,238.00	210,595,800
ハウス食品グループ本社	67,000	3,000.00	201,000,000
カゴメ	72,000	3,210.00	231,120,000
焼津水産化学工業	8,700	914.00	7,951,800
アリアケジャパン	17,300	5,100.00	88,230,000
ピエトロ	2,500	1,751.00	4,377,500
エバラ食品工業	4,100	2,801.00	11,484,100
やまみ	1,600	1,637.00	2,619,200
ニチレイ	81,300	2,366.00	192,355,800
東洋水産	89,000	4,160.00	370,240,000
イトアンドホールディングス	7,200	2,182.00	15,710,400
大冷	2,100	1,878.00	3,943,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,800	517.00	5,066,600
日清食品ホールディングス	69,300	8,930.00	618,849,000
永谷園ホールディングス	8,400	1,952.00	16,396,800
一正蒲鉾	7,900	817.00	6,454,300
フジッコ	17,600	2,012.00	35,411,200
ロック・フィールド	19,900	1,398.00	27,820,200
日本たばこ産業	1,017,400	2,258.50	2,297,797,900
ケンコーマヨネーズ	10,300	1,398.00	14,399,400
わらべや日洋ホールディングス	12,100	1,686.00	20,400,600
なとり	10,600	1,995.00	21,147,000
イフジ産業	3,300	1,000.00	3,300,000
ピクルスコーポレーション	9,100	1,275.00	11,602,500
ファーマフーズ	23,900	1,629.00	38,933,100
ユーグレナ	97,100	805.00	78,165,500
紀文食品	14,700	1,039.00	15,273,300
ミヨシ油脂	7,100	1,122.00	7,966,200
理研ビタミン	18,500	1,660.00	30,710,000
片倉工業	19,500	2,461.00	47,989,500
ゲンゼ	11,600	3,785.00	43,906,000
東洋紡	73,700	1,103.00	81,291,100
ユニチカ	52,600	274.00	14,412,400
富士紡ホールディングス	8,200	3,195.00	26,199,000
倉敷紡績	15,300	1,839.00	28,136,700
シキボウ	9,700	883.00	8,565,100
日本毛織	53,000	965.00	51,145,000
トーア紡コーポレーション	6,800	385.00	2,618,000
帝国繊維	20,700	1,580.00	32,706,000
帝人	170,800	1,415.00	241,682,000
東レ	1,277,700	640.80	818,750,160

住江織物	3,500	1,945.00	6,807,500
日本フェルト	11,600	421.00	4,883,600
イチカワ	2,700	1,398.00	3,774,600
日東製網	2,000	1,339.00	2,678,000
アツギ	14,300	516.00	7,378,800
ダイニック	6,700	707.00	4,736,900
セーレン	36,900	2,073.00	76,493,700
ソトー	7,000	830.00	5,810,000
東海染工	2,300	1,128.00	2,594,400
小松マテーレ	29,700	1,420.00	42,174,000
ワコールホールディングス	43,800	1,832.00	80,241,600
ホギメディカル	24,400	3,190.00	77,836,000
T S Iホールディングス	60,700	310.00	18,817,000
マツオカコーポレーション	5,900	1,119.00	6,602,100
ワールド	24,400	1,350.00	32,940,000
三陽商会	8,600	821.00	7,060,600
ナイガイ	7,000	305.00	2,135,000
オンワードホールディングス	109,000	247.00	26,923,000
ルックホールディングス	6,000	1,501.00	9,006,000
ゴールドウイン	32,500	6,370.00	207,025,000
デサント	34,700	2,235.00	77,554,500
キング	9,100	509.00	4,631,900
ヤマトインターナショナル	16,200	283.00	4,584,600
特種東海製紙	10,800	3,510.00	37,908,000
王子ホールディングス	754,300	605.00	456,351,500
日本製紙	84,200	1,056.00	88,915,200
三菱製紙	25,400	298.00	7,569,200
北越コーポレーション	117,800	679.00	79,986,200
中越パルプ工業	7,100	938.00	6,659,800
巴川製紙所	5,500	759.00	4,174,500
大王製紙	86,000	1,564.00	134,504,000
阿波製紙	4,600	327.00	1,504,200
レンゴー	164,400	793.00	130,369,200
トーモク	10,600	1,554.00	16,472,400
ザ・パック	13,200	2,405.00	31,746,000
北の達人コーポレーション	66,200	179.00	11,849,800
クラレ	263,900	1,064.00	280,789,600
旭化成	1,200,100	1,062.00	1,274,506,200
共和レザー	11,000	666.00	7,326,000
昭和電工	161,300	2,464.00	397,443,200
住友化学	1,328,100	574.00	762,329,400
住友精化	7,900	3,075.00	24,292,500

日産化学	95,100	7,000.00	665,700,000
ラサ工業	6,500	1,648.00	10,712,000
クレハ	14,200	10,000.00	142,000,000
多木化学	6,800	4,955.00	33,694,000
テイカ	12,600	1,190.00	14,994,000
石原産業	31,600	1,028.00	32,484,800
片倉コープアグリ	4,200	1,262.00	5,300,400
日本曹達	22,500	3,455.00	77,737,500
東ソー	254,400	1,833.00	466,315,200
トクヤマ	57,800	1,813.00	104,791,400
セントラル硝子	29,400	2,429.00	71,412,600
東亜合成	98,000	1,044.00	102,312,000
大阪ソーダ	16,200	3,235.00	52,407,000
関東電化工業	38,300	958.00	36,691,400
デンカ	65,800	3,515.00	231,287,000
信越化学工業	309,800	17,855.00	5,531,479,000
日本カーバイド工業	6,600	1,371.00	9,048,600
堺化学工業	12,600	1,871.00	23,574,600
第一稀元素化学工業	16,700	965.00	16,115,500
エア・ウォーター	166,300	1,700.00	282,710,000
日本酸素ホールディングス	169,500	2,312.00	391,884,000
日本化学工業	5,600	2,325.00	13,020,000
東邦アセチレン	4,000	1,112.00	4,448,000
日本パーカラライジング	88,200	927.00	81,761,400
高压ガス工業	28,300	649.00	18,366,700
チタン工業	2,100	1,722.00	3,616,200
四国化成工業	23,000	1,251.00	28,773,000
戸田工業	3,900	2,440.00	9,516,000
ステラ ケミファ	9,300	2,496.00	23,212,800
保土谷化学工業	5,600	3,725.00	20,860,000
日本触媒	29,500	5,310.00	156,645,000
大日精化工業	14,600	1,935.00	28,251,000
カネカ	45,200	3,480.00	157,296,000
三菱瓦斯化学	163,400	2,015.00	329,251,000
三井化学	160,200	3,030.00	485,406,000
J S R	172,500	3,725.00	642,562,500
東京応化工業	29,200	6,940.00	202,648,000
大阪有機化学工業	14,900	2,630.00	39,187,000
三菱ケミカルホールディングス	1,208,500	810.80	979,851,800
K Hネオケム	29,800	2,573.00	76,675,400
ダイセル	260,800	793.00	206,814,400
住友ベークライト	28,100	4,285.00	120,408,500

積水化学工業	378,300	1,728.00	653,702,400
日本ゼオン	157,700	1,385.00	218,414,500
アイカ工業	48,900	3,035.00	148,411,500
U B E	87,300	2,066.00	180,361,800
積水樹脂	27,100	1,766.00	47,858,600
タキロンシーアイ	40,100	547.00	21,934,700
旭有機材	10,500	1,880.00	19,740,000
ニチバン	10,600	1,710.00	18,126,000
リケンテクノス	42,700	438.00	18,702,600
大倉工業	9,000	1,804.00	16,236,000
積水化成成品工業	23,900	424.00	10,133,600
群栄化学工業	4,100	2,688.00	11,020,800
タイガースポリマー	9,400	432.00	4,060,800
ミライアル	5,900	1,649.00	9,729,100
ダイキアクシス	7,200	720.00	5,184,000
ダイキョーニシカワ	39,000	514.00	20,046,000
竹本容器	6,600	788.00	5,200,800
森六ホールディングス	9,600	1,798.00	17,260,800
恵和	5,000	4,340.00	21,700,000
日本化薬	136,800	1,116.00	152,668,800
カーリットホールディングス	17,400	636.00	11,066,400
日本精化	13,900	1,934.00	26,882,600
扶桑化学工業	16,000	3,760.00	60,160,000
トリケミカル研究所	19,100	2,303.00	43,987,300
A D E K A	81,200	2,373.00	192,687,600
日油	60,000	4,830.00	289,800,000
新日本理化	29,200	266.00	7,767,200
ハリマ化成グループ	13,300	781.00	10,387,300
花王	409,000	5,290.00	2,163,610,000
第一工業製薬	6,700	2,556.00	17,125,200
石原ケミカル	9,100	1,265.00	11,511,500
日華化学	6,200	794.00	4,922,800
ニイタカ	3,700	2,418.00	8,946,600
三洋化成工業	11,100	5,060.00	56,166,000
有機合成薬品工業	12,900	268.00	3,457,200
大日本塗料	22,100	779.00	17,215,900
日本ペイントホールディングス	695,700	1,004.00	698,482,800
関西ペイント	181,400	1,790.00	324,706,000
神東塗料	14,600	154.00	2,248,400
中国塗料	42,500	956.00	40,630,000
日本特殊塗料	12,900	808.00	10,423,200
藤倉化成	23,000	463.00	10,649,000

太陽ホールディングス	27,300	3,125.00	85,312,500
D I C	74,500	2,513.00	187,218,500
サカティンクス	36,700	994.00	36,479,800
東洋インキＳＣホールディングス	38,000	1,980.00	75,240,000
T & K T O K A	14,900	815.00	12,143,500
富士フィルムホールディングス	332,300	7,098.00	2,358,665,400
資生堂	352,200	5,357.00	1,886,735,400
ライオン	211,800	1,396.00	295,672,800
高砂香料工業	12,200	2,613.00	31,878,600
マンダム	38,700	1,260.00	48,762,000
ミルボン	23,300	5,150.00	119,995,000
ファンケル	76,500	2,435.00	186,277,500
コーセー	35,600	11,860.00	422,216,000
コタ	13,200	1,415.00	18,678,000
シーボン	2,500	1,700.00	4,250,000
ポーラ・オルビスホールディングス	80,700	1,539.00	124,197,300
ノエビアホールディングス	15,400	5,130.00	79,002,000
アジュバンホールディングス	4,200	980.00	4,116,000
新日本製薬	6,400	1,360.00	8,704,000
エステー	12,200	1,462.00	17,836,400
アグロ カネショウ	6,300	1,149.00	7,238,700
コニシ	30,300	1,522.00	46,116,600
長谷川香料	32,600	2,597.00	84,662,200
星光P M C	10,700	565.00	6,045,500
小林製薬	53,000	8,980.00	475,940,000
荒川化学工業	15,000	1,023.00	15,345,000
メック	13,700	2,304.00	31,564,800
日本高純度化学	4,900	2,291.00	11,225,900
タカラバイオ	49,500	2,109.00	104,395,500
J C U	20,500	3,395.00	69,597,500
新田ゼラチン	11,500	620.00	7,130,000
O A T アグリオ	7,800	1,121.00	8,743,800
デクセリアルズ	49,200	2,818.00	138,645,600
アース製薬	15,600	5,530.00	86,268,000
北興化学工業	17,000	980.00	16,660,000
大成ラミック	5,500	2,567.00	14,118,500
クミアイ化学工業	70,400	901.00	63,430,400
日本農薬	33,700	615.00	20,725,500
アキレス	12,100	1,326.00	16,044,600
有沢製作所	27,000	916.00	24,732,000
日東電工	114,300	9,060.00	1,035,558,000
レック	23,900	868.00	20,745,200



三光合成	21,600	339.00	7,322,400
きもと	28,900	211.00	6,097,900
藤森工業	16,200	3,525.00	57,105,000
前澤化成工業	11,700	1,295.00	15,151,500
未来工業	6,800	1,449.00	9,853,200
ウェーブロックホールディングス	7,200	683.00	4,917,600
J S P	11,100	1,475.00	16,372,500
エフピコ	34,700	2,845.00	98,721,500
天馬	14,900	2,242.00	33,405,800
信越ポリマー	33,900	1,050.00	35,595,000
東リ	45,800	211.00	9,663,800
ニフコ	63,100	2,739.00	172,830,900
バルカー	15,400	2,606.00	40,132,400
ユニ・チャーム	364,400	4,275.00	1,557,810,000
ショーエイコーポレーション	5,100	580.00	2,958,000
協和キリン	211,400	2,629.00	555,770,600
武田薬品工業	1,486,000	3,774.00	5,608,164,000
アステラス製薬	1,616,400	1,952.00	3,155,212,800
住友ファーマ	116,800	1,273.00	148,686,400
塩野義製薬	231,700	7,089.00	1,642,521,300
わかもと製薬	21,100	267.00	5,633,700
日本新薬	46,700	8,690.00	405,823,000
中外製薬	591,300	3,717.00	2,197,862,100
科研製薬	28,800	3,935.00	113,328,000
エーザイ	220,500	5,592.00	1,233,036,000
ロート製薬	94,700	3,390.00	321,033,000
小野薬品工業	413,500	3,398.00	1,405,073,000
久光製薬	46,700	3,600.00	168,120,000
持田製薬	22,800	3,685.00	84,018,000
参天製薬	345,000	1,094.00	377,430,000
扶桑薬品工業	6,500	2,107.00	13,695,500
日本ケミファ	2,200	1,921.00	4,226,200
ツムラ	57,100	3,255.00	185,860,500
日医工	57,300	777.00	44,522,100
キッセイ薬品工業	31,400	2,547.00	79,975,800
生化学工業	33,300	842.00	28,038,600
栄研化学	31,500	1,655.00	52,132,500
日水製薬	6,900	977.00	6,741,300
鳥居薬品	10,100	3,115.00	31,461,500
J C R ファーマ	53,300	2,308.00	123,016,400
東和薬品	27,200	2,756.00	74,963,200
富士製薬工業	11,100	954.00	10,589,400

ゼリア新薬工業	32,200	1,980.00	63,756,000
第一三共	1,447,800	3,288.00	4,760,366,400
キョーリン製薬ホールディングス	36,700	1,857.00	68,151,900
大幸薬品	28,500	586.00	16,701,000
ダイト	12,200	2,665.00	32,513,000
大塚ホールディングス	382,000	4,441.00	1,696,462,000
大正製薬ホールディングス	41,600	5,180.00	215,488,000
ペプチドリーム	99,200	1,898.00	188,281,600
あすか製薬ホールディングス	20,300	1,153.00	23,405,900
サワイグループホールディングス	39,700	4,140.00	164,358,000
日本コークス工業	159,700	134.00	21,399,800
ニチレキ	22,900	1,233.00	28,235,700
ユシロ化学工業	9,500	1,023.00	9,718,500
ビーピー・カストロール	6,700	1,225.00	8,207,500
富士石油	47,400	265.00	12,561,000
MORESCO	6,300	1,185.00	7,465,500
出光興産	204,000	3,455.00	704,820,000
ENEOSホールディングス	2,844,100	469.90	1,336,442,590
コスモエネルギーホールディングス	61,400	3,125.00	191,875,000
横浜ゴム	102,800	1,717.00	176,507,600
TOYO TIRE	96,500	1,486.00	143,399,000
ブリヂストン	530,700	4,738.00	2,514,456,600
住友ゴム工業	164,700	1,163.00	191,546,100
藤倉コンポジット	15,100	671.00	10,132,100
オカモト	10,500	3,960.00	41,580,000
フコク	8,300	936.00	7,768,800
ニッタ	19,000	2,856.00	54,264,000
住友理工	36,600	568.00	20,788,800
三ツ星ベルト	23,000	2,018.00	46,414,000
バンドー化学	30,500	860.00	26,230,000
日東紡績	26,600	2,439.00	64,877,400
AGC	169,100	4,905.00	829,435,500
日本板硝子	89,000	389.00	34,621,000
石塚硝子	3,100	1,739.00	5,390,900
日本山村硝子	7,100	780.00	5,538,000
日本電気硝子	74,000	2,716.00	200,984,000
オハラ	7,600	1,098.00	8,344,800
住友大阪セメント	33,600	3,480.00	116,928,000
太平洋セメント	107,500	2,109.00	226,717,500
日本ヒューム	18,000	668.00	12,024,000
日本コンクリート工業	36,500	308.00	11,242,000
三谷セキサン	8,500	4,680.00	39,780,000

アジアパイルホールディングス	28,600	425.00	12,155,000
東海カーボン	154,200	1,056.00	162,835,200
日本カーボン	9,800	4,195.00	41,111,000
東洋炭素	12,000	2,803.00	33,636,000
ノリタケカンパニーリミテド	10,200	4,230.00	43,146,000
TOTO	128,200	4,435.00	568,567,000
日本碍子	198,700	1,788.00	355,275,600
日本特殊陶業	139,900	2,301.00	321,909,900
MARUWA	6,500	15,680.00	101,920,000
品川リフラクトリーズ	4,500	3,635.00	16,357,500
黒崎播磨	3,200	4,070.00	13,024,000
ヨータイ	12,100	1,336.00	16,165,600
東京窯業	22,600	280.00	6,328,000
ニッカトー	8,500	475.00	4,037,500
フジインコーポレーテッド	15,200	5,620.00	85,424,000
クニミネ工業	6,000	937.00	5,622,000
エーアンドエーマテリアル	3,200	850.00	2,720,000
ニチアス	42,500	2,257.00	95,922,500
ニチハ	25,600	2,334.00	59,750,400
日本製鉄	818,200	1,938.50	1,586,080,700
神戸製鋼所	341,400	559.00	190,842,600
中山製鋼所	28,600	421.00	12,040,600
合同製鐵	9,800	1,233.00	12,083,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	480,900	1,509.00	725,678,100
東京製鐵	60,700	1,381.00	83,826,700
共英製鋼	20,300	1,271.00	25,801,300
大和工業	33,100	4,140.00	137,034,000
東京鐵鋼	8,100	1,275.00	10,327,500
大阪製鐵	10,000	1,310.00	13,100,000
淀川製鋼所	23,200	2,359.00	54,728,800
丸一鋼管	57,600	2,739.00	157,766,400
モリ工業	5,200	2,484.00	12,916,800
大同特殊鋼	28,900	3,550.00	102,595,000
日本高周波鋼業	7,100	331.00	2,350,100
日本冶金工業	13,400	2,128.00	28,515,200
山陽特殊製鋼	18,200	1,957.00	35,617,400
愛知製鋼	10,500	2,123.00	22,291,500
日立金属	201,400	2,030.00	408,842,000
日本金属	4,700	1,147.00	5,390,900
大平洋金属	11,500	3,200.00	36,800,000
新日本電工	115,200	306.00	35,251,200
栗本鐵工所	8,200	1,592.00	13,054,400

虹技	2,600	907.00	2,358,200
三菱製鋼	12,100	1,035.00	12,523,500
日亜鋼業	23,600	258.00	6,088,800
日本精線	3,100	4,045.00	12,539,500
エンビプロ・ホールディングス	12,400	902.00	11,184,800
シンニッタン	22,900	213.00	4,877,700
新家工業	4,400	1,560.00	6,864,000
大紀アルミニウム工業所	26,600	1,315.00	34,979,000
日本軽金属ホールディングス	47,400	1,631.00	77,309,400
三井金属鉱業	50,500	3,185.00	160,842,500
東邦亜鉛	10,100	2,630.00	26,563,000
三菱マテリアル	118,400	1,992.00	235,852,800
住友金属鉱山	227,600	5,220.00	1,188,072,000
D O W Aホールディングス	48,500	5,200.00	252,200,000
古河機械金属	30,200	1,265.00	38,203,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	21,700	1,180.00	25,606,000
東邦チタニウム	33,600	1,353.00	45,460,800
U A C J	27,500	2,108.00	57,970,000
C Kサンエツ	3,800	3,900.00	14,820,000
古河電気工業	56,800	2,142.00	121,665,600
住友電気工業	683,600	1,424.50	973,788,200
フジクラ	208,600	613.00	127,871,800
昭和電線ホールディングス	16,400	1,685.00	27,634,000
東京特殊電線	2,700	2,672.00	7,214,400
タツタ電線	33,200	459.00	15,238,800
カナレ電気	2,900	1,681.00	4,874,900
平河ヒューテック	10,500	1,140.00	11,970,000
リョービ	21,800	1,064.00	23,195,200
アーレスティ	20,300	348.00	7,064,400
アサヒホールディングス	74,900	2,080.00	155,792,000
稲葉製作所	10,200	1,292.00	13,178,400
宮地エンジニアリンググループ	5,600	3,335.00	18,676,000
トーカロ	48,200	1,267.00	61,069,400
アルファC o	7,000	939.00	6,573,000
S U M C O	294,600	1,920.00	565,632,000
川田テクノロジーズ	3,700	3,605.00	13,338,500
R S Technologies	6,100	5,890.00	35,929,000
ジェイテックコーポレーション	2,400	1,655.00	3,972,000
信和	11,600	792.00	9,187,200
東洋製罐グループホールディングス	111,100	1,419.00	157,650,900
ホッカンホールディングス	9,800	1,250.00	12,250,000
コロナ	9,900	825.00	8,167,500

横河ブリッジホールディングス	30,300	1,893.00	57,357,900
駒井ハルテック	3,300	1,882.00	6,210,600
高田機工	1,700	2,713.00	4,612,100
三和ホールディングス	176,300	1,174.00	206,976,200
文化シャッター	57,900	958.00	55,468,200
三協立山	23,500	597.00	14,029,500
アルインコ	13,200	867.00	11,444,400
東洋シャッター	4,100	565.00	2,316,500
L I X I L	294,300	2,433.00	716,031,900
日本フィルコン	12,600	504.00	6,350,400
ノーリツ	33,800	1,500.00	50,700,000
長府製作所	19,000	1,874.00	35,606,000
リンナイ	34,300	8,740.00	299,782,000
ダイニチ工業	8,900	620.00	5,518,000
日東精工	22,700	496.00	11,259,200
三洋工業	2,300	1,741.00	4,004,300
岡部	32,800	651.00	21,352,800
ジーテクト	22,400	1,277.00	28,604,800
東プレ	32,800	1,097.00	35,981,600
高周波熱錬	30,400	580.00	17,632,000
東京製綱	11,500	832.00	9,568,000
サンコール	16,000	503.00	8,048,000
モリテック スチール	14,600	291.00	4,248,600
パイオラックス	26,100	1,452.00	37,897,200
エイチワン	17,800	592.00	10,537,600
日本発條	167,200	846.00	141,451,200
中央発條	9,000	685.00	6,165,000
アドバネクス	2,400	1,739.00	4,173,600
立川ブラインド工業	7,900	1,042.00	8,231,800
三益半導体工業	14,600	2,256.00	32,937,600
日本ドライケミカル	4,600	1,520.00	6,992,000
日本製鋼所	53,900	2,554.00	137,660,600
三浦工業	78,500	2,768.00	217,288,000
タクマ	60,300	1,454.00	87,676,200
ツガミ	40,300	1,188.00	47,876,400
オークマ	20,500	4,750.00	97,375,000
芝浦機械	21,200	2,829.00	59,974,800
アマダ	295,400	1,019.00	301,012,600
アイダエンジニアリング	46,500	968.00	45,012,000
滝澤鉄工所	5,500	1,270.00	6,985,000
F U J I	82,300	2,131.00	175,381,300
牧野フライス製作所	20,000	4,120.00	82,400,000

オーエスジー	85,500	1,633.00	139,621,500
ダイジェット工業	2,300	942.00	2,166,600
旭ダイヤモンド工業	48,400	573.00	27,733,200
D M G 森精機	108,600	1,631.00	177,126,600
ソディック	40,800	736.00	30,028,800
ディスコ	27,500	31,200.00	858,000,000
日東工器	9,900	1,511.00	14,958,900
日進工具	14,800	1,425.00	21,090,000
パンチ工業	15,900	463.00	7,361,700
富士ダイス	9,500	638.00	6,061,000
豊和工業	9,900	792.00	7,840,800
O K K	6,800	1,245.00	8,466,000
東洋機械金属	12,300	575.00	7,072,500
津田駒工業	3,500	571.00	1,998,500
エンシュウ	4,500	660.00	2,970,000
島精機製作所	27,500	1,793.00	49,307,500
オプトラン	23,500	1,809.00	42,511,500
N C ホールディングス	4,400	1,685.00	7,414,000
イワキポンプ	12,000	1,033.00	12,396,000
フリー	16,700	1,022.00	17,067,400
ヤマシンフィルタ	35,200	343.00	12,073,600
日阪製作所	21,900	752.00	16,468,800
やまびこ	34,600	1,379.00	47,713,400
野村マイクロ・サイエンス	6,400	3,675.00	23,520,000
平田機工	8,600	4,760.00	40,936,000
ペガサスミシン製造	19,100	592.00	11,307,200
マルマエ	7,700	2,083.00	16,039,100
タツモ	8,800	1,287.00	11,325,600
ナプテスコ	104,300	2,906.00	303,095,800
三井海洋開発	19,900	1,193.00	23,740,700
レオン自動機	20,100	1,103.00	22,170,300
S M C	55,400	61,550.00	3,409,870,000
ホソカワミクロン	12,900	2,440.00	31,476,000
ユニオンツール	7,000	3,730.00	26,110,000
オイレス工業	25,600	1,508.00	38,604,800
日精エー・エス・ビー機械	6,600	2,966.00	19,575,600
サトーホールディングス	24,700	1,830.00	45,201,000
技研製作所	16,600	3,535.00	58,681,000
日本エアーテック	8,700	1,030.00	8,961,000
カワタ	5,900	949.00	5,599,100
日精樹脂工業	12,900	942.00	12,151,800
オカダアイオン	6,000	1,494.00	8,964,000

ワイエイシイホールディングス	7,400	1,411.00	10,441,400
小松製作所	856,900	3,098.00	2,654,676,200
住友重機械工業	105,900	2,777.00	294,084,300
日立建機	75,800	3,030.00	229,674,000
日工	25,500	614.00	15,657,000
巴工業	7,300	2,316.00	16,906,800
井関農機	16,800	1,241.00	20,848,800
TOWA	16,200	1,948.00	31,557,600
丸山製作所	3,700	1,536.00	5,683,200
北川鉄工所	8,300	1,268.00	10,524,400
ローツェ	9,300	10,150.00	94,395,000
タカキタ	6,500	582.00	3,783,000
クボタ	916,000	2,287.50	2,095,350,000
荏原実業	8,800	2,341.00	20,600,800
三菱化工機	6,000	1,939.00	11,634,000
月島機械	33,300	1,039.00	34,598,700
帝国電機製作所	12,900	1,632.00	21,052,800
新東工業	39,900	676.00	26,972,400
澁谷工業	16,100	2,324.00	37,416,400
アイチ コーポレーション	27,200	891.00	24,235,200
小森コーポレーション	47,100	748.00	35,230,800
鶴見製作所	14,300	1,825.00	26,097,500
住友精密工業	2,900	2,210.00	6,409,000
日本ギア工業	7,100	257.00	1,824,700
酒井重工業	3,300	3,075.00	10,147,500
荏原製作所	75,700	5,830.00	441,331,000
石井鐵工所	2,600	2,864.00	7,446,400
西島製作所	16,700	1,264.00	21,108,800
北越工業	17,200	873.00	15,015,600
ダイキン工業	229,400	19,625.00	4,501,975,000
オルガノ	5,500	8,720.00	47,960,000
トーヨーカネツ	7,000	2,399.00	16,793,000
栗田工業	100,100	4,500.00	450,450,000
椿本チエイン	24,800	2,981.00	73,928,800
大同工業	8,400	904.00	7,593,600
木村化工機	15,600	772.00	12,043,200
アネスト岩田	29,500	804.00	23,718,000
ダイフク	99,100	7,520.00	745,232,000
サムコ	4,900	2,380.00	11,662,000
加藤製作所	9,300	772.00	7,179,600
油研工業	3,200	1,689.00	5,404,800
タダノ	96,600	919.00	88,775,400

フジテック	64,500	2,595.00	167,377,500
C K D	53,200	1,643.00	87,407,600
キトー	15,700	1,650.00	25,905,000
平和	52,800	1,903.00	100,478,400
理想科学工業	14,700	2,376.00	34,927,200
S A N K Y O	40,900	3,765.00	153,988,500
日本金銭機械	19,300	706.00	13,625,800
マースグループホールディングス	12,100	1,640.00	19,844,000
フクシマガリレイ	12,500	3,705.00	46,312,500
オーイズミ	6,800	457.00	3,107,600
ダイコク電機	8,800	1,235.00	10,868,000
竹内製作所	28,800	2,461.00	70,876,800
アマノ	49,500	2,502.00	123,849,000
J U K I	26,300	710.00	18,673,000
ジャノメ	16,200	691.00	11,194,200
マックス	24,200	1,607.00	38,889,400
グローリー	47,400	2,150.00	101,910,000
新晃工業	17,600	1,583.00	27,860,800
大和冷機工業	27,400	1,099.00	30,112,600
セガサミーホールディングス	187,600	2,220.00	416,472,000
日本ピストンリング	7,000	1,309.00	9,163,000
リケン	7,800	2,418.00	18,860,400
T P R	24,100	1,261.00	30,390,100
ツバキ・ナカシマ	41,600	886.00	36,857,600
ホシザキ	55,300	8,040.00	444,612,000
大豊工業	15,600	634.00	9,890,400
日本精工	345,300	727.00	251,033,100
N T N	385,500	213.00	82,111,500
ジェイテクト	174,800	933.00	163,088,400
不二越	15,100	3,690.00	55,719,000
日本トムソン	49,100	494.00	24,255,400
T H K	106,700	2,586.00	275,926,200
ユーシン精機	14,800	628.00	9,294,400
前澤給装工業	13,600	902.00	12,267,200
イーグル工業	22,500	1,036.00	23,310,000
前澤工業	12,300	628.00	7,724,400
日本ピラー工業	18,200	2,442.00	44,444,400
キッツ	60,300	665.00	40,099,500
マキタ	224,700	3,791.00	851,837,700
三井E & Sホールディングス	68,300	360.00	24,588,000
日立造船	156,900	698.00	109,516,200
三菱重工業	290,500	4,424.00	1,285,172,000



I H I	118,100	2,854.00	337,057,400
スター精密	27,300	1,477.00	40,322,100
日清紡ホールディングス	109,100	962.00	104,954,200
イビデン	96,700	4,570.00	441,919,000
コニカミノルタ	405,700	490.00	198,793,000
ブラザー工業	226,300	2,307.00	522,074,100
ミネベアミツミ	318,000	2,462.00	782,916,000
日立製作所	909,300	6,448.00	5,863,166,400
東芝	330,400	5,345.00	1,765,988,000
三菱電機	1,848,700	1,351.00	2,497,593,700
富士電機	111,000	5,690.00	631,590,000
東洋電機製造	6,700	936.00	6,271,200
安川電機	198,300	4,175.00	827,902,500
シンフォニアテクノロジー	21,600	1,255.00	27,108,000
明電舎	30,300	2,288.00	69,326,400
オリジン	4,600	1,309.00	6,021,400
山洋電気	8,100	5,450.00	44,145,000
デンヨー	15,200	1,594.00	24,228,800
P H C ホールディングス	29,800	1,580.00	47,084,000
東芝テック	20,300	4,390.00	89,117,000
芝浦メカトロニクス	3,500	6,920.00	24,220,000
マブチモーター	44,100	3,470.00	153,027,000
日本電産	466,800	8,315.00	3,881,442,000
トレックス・セミコンダクター	9,600	2,226.00	21,369,600
東光高岳	11,300	1,645.00	18,588,500
ダイヘン	19,600	3,680.00	72,128,000
ヤーマン	31,800	1,182.00	37,587,600
J V C ケンウッド	160,500	201.00	32,260,500
ミマキエンジニアリング	18,700	691.00	12,921,700
I - P E X	9,600	1,438.00	13,804,800
日新電機	44,300	1,355.00	60,026,500
大崎電気工業	33,700	499.00	16,816,300
オムロン	157,400	7,085.00	1,115,179,000
日東工業	23,700	1,542.00	36,545,400
I D E C	23,400	2,240.00	52,416,000
正興電機製作所	6,700	1,081.00	7,242,700
不二電機工業	4,600	1,134.00	5,216,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	60,500	2,258.00	136,609,000
サクサホールディングス	4,400	1,492.00	6,564,800
メルコホールディングス	4,900	3,870.00	18,963,000
テクノメディカ	5,000	1,548.00	7,740,000
日本電気	234,900	5,350.00	1,256,715,000

富士通	170,100	19,470.00	3,311,847,000
沖電気工業	75,100	864.00	64,886,400
岩崎通信機	7,700	802.00	6,175,400
電気興業	9,600	2,419.00	23,222,400
サンケン電気	17,200	4,780.00	82,216,000
ナカヨ	3,300	1,068.00	3,524,400
アイホン	10,000	1,738.00	17,380,000
ルネサスエレクトロニクス	1,027,800	1,354.00	1,391,641,200
セイコーエプソン	226,800	1,958.00	444,074,400
ワコム	147,900	954.00	141,096,600
アルバック	37,700	4,990.00	188,123,000
アクセル	8,900	841.00	7,484,900
E I Z O	14,200	3,445.00	48,919,000
日本信号	45,500	911.00	41,450,500
京三製作所	39,400	429.00	16,902,600
能美防災	24,400	1,951.00	47,604,400
ホーチキ	14,000	1,206.00	16,884,000
星和電機	10,600	511.00	5,416,600
エレコム	44,100	1,558.00	68,707,800
パナソニック ホールディングス	2,016,500	1,155.50	2,330,065,750
シャープ	203,600	1,085.00	220,906,000
アンリツ	121,800	1,487.00	181,116,600
富士通ゼネラル	51,300	2,166.00	111,115,800
ソニーグループ	1,184,300	10,500.00	12,435,150,000
T D K	274,100	4,065.00	1,114,216,500
帝国通信工業	9,200	1,390.00	12,788,000
タムラ製作所	71,300	544.00	38,787,200
アルプスアルパイン	164,100	1,326.00	217,596,600
池上通信機	5,600	602.00	3,371,200
日本電波工業	19,900	1,117.00	22,228,300
鈴木	10,900	758.00	8,262,200
メイコー	20,800	3,365.00	69,992,000
日本トリム	4,100	2,351.00	9,639,100
ローランド ディー . ジー .	11,500	3,210.00	36,915,000
フォスター電機	18,600	729.00	13,559,400
S M K	4,400	2,162.00	9,512,800
ヨコオ	14,000	2,534.00	35,476,000
ホシデン	45,300	1,300.00	58,890,000
ヒロセ電機	28,400	17,730.00	503,532,000
日本航空電子工業	41,500	1,884.00	78,186,000
T O A	20,300	792.00	16,077,600
マクセル	37,600	1,145.00	43,052,000

古野電気	23,700	973.00	23,060,100
ユニデンホールディングス	4,100	3,495.00	14,329,500
スミダコーポレーション	19,100	807.00	15,413,700
アイコム	6,700	2,463.00	16,502,100
リオン	7,500	2,394.00	17,955,000
本多通信工業	17,300	459.00	7,940,700
横河電機	184,000	2,007.00	369,288,000
新電元工業	7,100	2,849.00	20,227,900
アズビル	110,800	3,820.00	423,256,000
東亜ディーケーケー	10,700	912.00	9,758,400
日本光電工業	76,800	3,130.00	240,384,000
チノー	6,000	1,624.00	9,744,000
共和電業	18,100	341.00	6,172,100
日本電子材料	9,400	1,858.00	17,465,200
堀場製作所	34,100	6,240.00	212,784,000
アドバンテスト	140,600	8,380.00	1,178,228,000
小野測器	10,000	469.00	4,690,000
エスベック	15,600	1,724.00	26,894,400
キーエンス	171,300	50,400.00	8,633,520,000
日置電機	9,200	7,140.00	65,688,000
シスメックス	151,900	7,631.00	1,159,148,900
日本マイクロニクス	32,100	1,461.00	46,898,100
メガチップス	17,100	3,260.00	55,746,000
O B A R A G R O U P	8,600	2,861.00	24,604,600
澤藤電機	3,100	1,452.00	4,501,200
原田工業	10,300	921.00	9,486,300
コーセル	22,500	767.00	17,257,500
イリソ電子工業	16,300	3,110.00	50,693,000
オブテックスグループ	31,700	1,633.00	51,766,100
千代田インテグレ	8,200	2,079.00	17,047,800
レーザーテック	81,200	17,130.00	1,390,956,000
スタンレー電気	129,200	2,283.00	294,963,600
岩崎電気	7,100	2,309.00	16,393,900
ウシオ電機	95,100	1,685.00	160,243,500
岡谷電機産業	17,800	273.00	4,859,400
ヘリオス テクノ ホールディング	20,300	287.00	5,826,100
エノモト	6,000	1,530.00	9,180,000
日本セラミック	18,100	2,323.00	42,046,300
遠藤照明	10,000	807.00	8,070,000
古河電池	14,500	1,192.00	17,284,000
双信電機	11,100	531.00	5,894,100
山一電機	14,000	1,691.00	23,674,000

図研	12,700	2,542.00	32,283,400
日本電子	38,500	5,800.00	223,300,000
カシオ計算機	126,700	1,341.00	169,904,700
ファナック	165,900	19,460.00	3,228,414,000
日本シイエムケイ	38,100	520.00	19,812,000
エンプラス	5,100	3,475.00	17,722,500
大真空	25,800	1,106.00	28,534,800
ローム	82,800	9,290.00	769,212,000
浜松ホトニクス	132,600	5,690.00	754,494,000
三井ハイテック	17,900	10,980.00	196,542,000
新光電気工業	55,700	4,995.00	278,221,500
京セラ	266,200	6,921.00	1,842,370,200
太陽誘電	89,400	5,230.00	467,562,000
村田製作所	542,300	8,250.00	4,473,975,000
双葉電子工業	34,200	665.00	22,743,000
北陸電気工業	8,100	1,212.00	9,817,200
ニチコン	57,500	1,245.00	71,587,500
日本ケミコン	18,600	1,910.00	35,526,000
K O A	28,500	1,598.00	45,543,000
市光工業	25,800	372.00	9,597,600
小糸製作所	100,900	4,625.00	466,662,500
ミツバ	33,000	348.00	11,484,000
S C R E E Nホールディングス	31,800	10,490.00	333,582,000
キャノン電子	18,100	1,500.00	27,150,000
キャノン	939,500	3,130.00	2,940,635,000
リコー	499,700	990.00	494,703,000
象印マホービン	50,600	1,341.00	67,854,600
M U T O Hホールディングス	3,000	2,228.00	6,684,000
東京エレクトロン	120,000	53,450.00	6,414,000,000
トヨタ紡織	73,500	2,070.00	152,145,000
芦森工業	3,600	959.00	3,452,400
ユニプレス	29,100	762.00	22,174,200
豊田自動織機	146,700	8,260.00	1,211,742,000
モリタホールディングス	30,300	1,324.00	40,117,200
三櫻工業	26,100	703.00	18,348,300
デンソー	400,900	7,489.00	3,002,340,100
東海理化電機製作所	49,800	1,362.00	67,827,600
川崎重工業	134,700	2,253.00	303,479,100
名村造船所	54,100	345.00	18,664,500
日本車輛製造	6,600	2,062.00	13,609,200
三菱ロジスネクスト	25,000	771.00	19,275,000
近畿車輛	2,800	1,166.00	3,264,800

日産自動車	2,229,700	507.10	1,130,680,870
いすゞ自動車	578,100	1,517.00	876,977,700
トヨタ自動車	9,258,500	2,178.50	20,169,642,250
日野自動車	236,100	700.00	165,270,000
三菱自動車工業	699,800	333.00	233,033,400
エフテック	12,800	537.00	6,873,600
レシップホールディングス	7,500	558.00	4,185,000
G M B	3,400	709.00	2,410,600
ファルテック	3,300	633.00	2,088,900
武蔵精密工業	42,200	1,330.00	56,126,000
日産車体	27,700	570.00	15,789,000
新明和工業	52,100	968.00	50,432,800
極東開発工業	33,400	1,315.00	43,921,000
トピー工業	15,100	1,052.00	15,885,200
ティラド	4,600	2,249.00	10,345,400
曙ブレーキ工業	103,800	150.00	15,570,000
タチエス	32,400	1,026.00	33,242,400
N O K	84,700	1,152.00	97,574,400
フタバ産業	45,600	374.00	17,054,400
K Y B	18,600	2,856.00	53,121,600
大同メタル工業	36,300	556.00	20,182,800
プレス工業	89,100	391.00	34,838,100
ミクニ	23,300	378.00	8,807,400
太平洋工業	38,400	980.00	37,632,000
河西工業	23,200	272.00	6,310,400
アイシン	138,400	3,780.00	523,152,000
マツダ	581,000	955.00	554,855,000
今仙電機製作所	12,400	581.00	7,204,400
本田技研工業	1,453,300	3,349.00	4,867,101,700
スズキ	413,200	3,925.00	1,621,810,000
S U B A R U	526,800	1,959.00	1,032,001,200
安永	8,600	678.00	5,830,800
ヤマハ発動機	246,700	2,780.00	685,826,000
T B K	20,200	344.00	6,948,800
エクセディ	28,500	1,683.00	47,965,500
豊田合成	58,500	1,914.00	111,969,000
愛三工業	29,600	744.00	22,022,400
盟和産業	2,700	1,013.00	2,735,100
日本プラスト	14,400	491.00	7,070,400
ヨロズ	16,700	740.00	12,358,000
エフ・シー・シー	30,900	1,360.00	42,024,000
シマノ	73,800	22,345.00	1,649,061,000

テイ・エス テック	79,800	1,404.00	112,039,200
ジャムコ	11,000	781.00	8,591,000
テルモ	535,000	3,727.00	1,993,945,000
クリエートメディック	5,700	975.00	5,557,500
日機装	53,800	835.00	44,923,000
日本エム・ディ・エム	10,900	1,504.00	16,393,600
島津製作所	237,500	4,320.00	1,026,000,000
JMS	15,500	573.00	8,881,500
長野計器	13,300	1,112.00	14,789,600
ブイ・テクノロジー	8,300	3,060.00	25,398,000
東京計器	12,100	1,137.00	13,757,700
愛知時計電機	7,700	1,431.00	11,018,700
インターアクション	9,500	1,885.00	17,907,500
オーバル	17,000	307.00	5,219,000
東京精密	31,100	4,385.00	136,373,500
マニー	73,200	1,408.00	103,065,600
ニコン	281,300	1,440.00	405,072,000
トプコン	88,900	1,594.00	141,706,600
オリンパス	966,100	2,214.50	2,139,428,450
理研計器	14,400	3,835.00	55,224,000
タムロン	14,200	2,327.00	33,043,400
HOYA	368,900	12,510.00	4,614,939,000
シード	8,900	523.00	4,654,700
ノーリツ鋼機	17,000	2,078.00	35,326,000
A & Dホロンホールディングス	21,300	852.00	18,147,600
朝日インテック	207,300	2,374.00	492,130,200
シチズン時計	209,200	480.00	100,416,000
リズム	5,900	1,723.00	10,165,700
大研医器	15,000	505.00	7,575,000
メニコン	61,300	2,615.00	160,299,500
シンシア	2,100	424.00	890,400
松風	7,400	1,579.00	11,684,600
セイコーホールディングス	26,700	2,076.00	55,429,200
ニプロ	137,600	1,013.00	139,388,800
中本パックス	5,300	1,569.00	8,315,700
スノーピーク	24,600	2,155.00	53,013,000
パラマウントベッドホールディングス	36,200	2,115.00	76,563,000
トランザクション	10,900	984.00	10,725,600
粧美堂	5,200	422.00	2,194,400
ニホンフラッシュ	15,700	948.00	14,883,600
前田工織	19,600	2,642.00	51,783,200
永大産業	23,300	272.00	6,337,600

アートネイチャー	16,200	739.00	11,971,800
バンダイナムコホールディングス	165,100	8,239.00	1,360,258,900
アイフィスジャパン	4,800	626.00	3,004,800
共立印刷	29,700	132.00	3,920,400
S H O E I	17,300	4,695.00	81,223,500
フランスベッドホールディングス	24,300	874.00	21,238,200
パイロットコーポレーション	30,300	5,120.00	155,136,000
萩原工業	12,000	1,065.00	12,780,000
フジシールインターナショナル	43,600	1,750.00	76,300,000
タカラトミー	78,100	1,146.00	89,502,600
広済堂ホールディングス	11,700	780.00	9,126,000
エステールホールディングス	4,400	637.00	2,802,800
タカノ	6,500	795.00	5,167,500
プロネクサス	14,600	1,046.00	15,271,600
ホクシン	13,300	179.00	2,380,700
ウッドワン	5,800	1,284.00	7,447,200
大建工業	10,600	2,104.00	22,302,400
凸版印刷	273,700	2,182.00	597,213,400
大日本印刷	217,300	2,766.00	601,051,800
共同印刷	5,200	2,739.00	14,242,800
N I S S H A	36,800	1,491.00	54,868,800
光村印刷	1,600	1,301.00	2,081,600
T A K A R A & C O M P A N Y	11,300	1,927.00	21,775,100
アシックス	159,800	1,877.00	299,944,600
ツツミ	4,700	1,898.00	8,920,600
ローランド	13,200	4,235.00	55,902,000
小松ウオール工業	5,800	1,835.00	10,643,000
ヤマハ	109,900	4,995.00	548,950,500
河合楽器製作所	5,100	2,881.00	14,693,100
クリナップ	17,600	525.00	9,240,000
ビジョン	114,300	2,124.00	242,773,200
兼松サステック	1,200	1,739.00	2,086,800
キングジム	15,700	925.00	14,522,500
リンテック	39,000	2,416.00	94,224,000
イトーキ	34,800	358.00	12,458,400
任天堂	106,700	56,360.00	6,013,612,000
三菱鉛筆	29,200	1,334.00	38,952,800
タカラスタンダード	36,200	1,309.00	47,385,800
コクヨ	88,200	1,744.00	153,820,800
ナカバヤシ	16,300	488.00	7,954,400
グローブライド	16,000	2,424.00	38,784,000
オカムラ	61,000	1,196.00	72,956,000

美津濃	17,700	2,087.00	36,939,900
東京電力ホールディングス	1,414,900	519.00	734,333,100
中部電力	563,600	1,345.00	758,042,000
関西電力	698,000	1,269.00	885,762,000
中国電力	287,900	915.00	263,428,500
北陸電力	168,700	555.00	93,628,500
東北電力	433,000	775.00	335,575,000
四国電力	165,900	801.00	132,885,900
九州電力	380,400	881.00	335,132,400
北海道電力	164,300	515.00	84,614,500
沖縄電力	40,100	1,245.00	49,924,500
電源開発	154,000	1,830.00	281,820,000
エフオン	11,400	535.00	6,099,000
イーレックス	26,700	1,830.00	48,861,000
レノバ	37,100	1,516.00	56,243,600
東京瓦斯	353,800	2,547.00	901,128,600
大阪瓦斯	334,300	2,413.00	806,665,900
東邦瓦斯	82,400	3,160.00	260,384,000
北海道瓦斯	9,400	1,547.00	14,541,800
広島ガス	35,100	321.00	11,267,100
西部ガスホールディングス	20,200	2,056.00	41,531,200
静岡ガス	47,700	908.00	43,311,600
メタウォーター	19,600	2,043.00	40,042,800
SBSホールディングス	14,000	2,938.00	41,132,000
東武鉄道	180,600	2,973.00	536,923,800
相鉄ホールディングス	59,100	2,243.00	132,561,300
東急	464,600	1,579.00	733,603,400
京浜急行電鉄	232,000	1,296.00	300,672,000
小田急電鉄	266,800	1,882.00	502,117,600
京王電鉄	93,100	4,670.00	434,777,000
京成電鉄	124,800	3,250.00	405,600,000
富士急行	21,500	3,835.00	82,452,500
新京成電鉄	4,400	2,658.00	11,695,200
東日本旅客鉄道	318,000	6,610.00	2,101,980,000
西日本旅客鉄道	219,600	4,770.00	1,047,492,000
東海旅客鉄道	149,100	16,160.00	2,409,456,000
西武ホールディングス	240,500	1,287.00	309,523,500
鴻池運輸	29,000	1,146.00	33,234,000
西日本鉄道	50,100	2,576.00	129,057,600
ハマキョウレックス	13,000	2,946.00	38,298,000
サカイ引越センター	8,700	4,590.00	39,933,000
近鉄グループホールディングス	175,300	3,740.00	655,622,000



阪急阪神ホールディングス	218,900	3,430.00	750,827,000
南海電気鉄道	78,200	2,463.00	192,606,600
京阪ホールディングス	76,400	2,923.00	223,317,200
神戸電鉄	4,300	3,230.00	13,889,000
名古屋鉄道	188,600	2,149.00	405,301,400
山陽電気鉄道	13,400	2,063.00	27,644,200
アルプス物流	12,500	1,062.00	13,275,000
ヤマトホールディングス	250,900	2,429.00	609,436,100
山九	45,900	3,725.00	170,977,500
丸運	9,600	239.00	2,294,400
丸全昭和運輸	13,700	3,180.00	43,566,000
センコーグループホールディングス	89,100	889.00	79,209,900
トナミホールディングス	4,000	3,575.00	14,300,000
ニッコンホールディングス	58,800	1,994.00	117,247,200
日本石油輸送	2,000	2,554.00	5,108,000
福山通運	27,300	3,815.00	104,149,500
セイノーホールディングス	113,800	1,095.00	124,611,000
エスライン	5,200	872.00	4,534,400
神奈川中央交通	4,400	3,300.00	14,520,000
日立物流	34,600	8,510.00	294,446,000
丸和運輸機関	35,300	1,499.00	52,914,700
C & F ロジホールディングス	17,100	1,114.00	19,049,400
九州旅客鉄道	132,300	2,525.00	334,057,500
S Gホールディングス	325,800	2,329.00	758,788,200
NIPPON EXPRESSホールディングス	59,100	7,610.00	449,751,000
日本郵船	150,000	9,270.00	1,390,500,000
商船三井	291,300	3,150.00	917,595,000
川崎汽船	55,100	8,200.00	451,820,000
NSユニテッド海運	10,200	3,830.00	39,066,000
飯野海運	82,800	690.00	57,132,000
共栄タンカー	5,600	1,128.00	6,316,800
乾汽船	11,700	1,627.00	19,035,900
日本航空	402,000	2,134.00	857,868,000
ANAホールディングス	445,400	2,402.50	1,070,073,500
パスコ	3,400	1,299.00	4,416,600
ランコム	5,000	7,100.00	35,500,000
日新	13,900	1,620.00	22,518,000
三菱倉庫	53,400	3,085.00	164,739,000
三井倉庫ホールディングス	18,500	2,368.00	43,808,000
住友倉庫	59,000	2,027.00	119,593,000
澁澤倉庫	10,100	2,237.00	22,593,700
東陽倉庫	28,500	308.00	8,778,000

日本トランスシティ	36,800	583.00	21,454,400
ケイヒン	3,100	1,333.00	4,132,300
中央倉庫	10,400	948.00	9,859,200
川西倉庫	3,300	1,127.00	3,719,100
安田倉庫	13,800	961.00	13,261,800
ファイブホールディングス	3,800	679.00	2,580,200
東洋埠頭	5,300	1,417.00	7,510,100
上組	94,800	2,226.00	211,024,800
サンリツ	4,800	778.00	3,734,400
キムラユニティー	4,700	1,440.00	6,768,000
キューソー流通システム	8,900	1,075.00	9,567,500
近鉄エクスプレス	33,800	3,070.00	103,766,000
東海運	10,200	297.00	3,029,400
エーアイティー	11,200	1,518.00	17,001,600
内外トランスライン	6,900	1,899.00	13,103,100
日本コンセプト	5,700	1,332.00	7,592,400
NEC ネットエスアイ	61,500	1,801.00	110,761,500
クロスキャット	10,300	852.00	8,775,600
システナ	265,100	414.00	109,751,400
デジタルアーツ	10,000	6,770.00	67,700,000
日鉄ソリューションズ	28,700	3,715.00	106,620,500
キューブシステム	9,600	894.00	8,582,400
WOW WORLD	2,700	1,098.00	2,964,600
コア	8,000	1,380.00	11,040,000
手間いらず	2,700	4,750.00	12,825,000
ラクーンホールディングス	15,900	1,396.00	22,196,400
ソリトンシステムズ	9,400	1,292.00	12,144,800
ソフトクリエイトホールディングス	8,100	3,755.00	30,415,500
T I S	172,100	2,939.00	505,801,900
J N S ホールディングス	8,600	393.00	3,379,800
グリー	84,600	914.00	77,324,400
G M O ペパボ	2,000	1,894.00	3,788,000
コーエーテクモホールディングス	59,200	4,105.00	243,016,000
三菱総合研究所	9,700	4,305.00	41,758,500
電算	2,100	2,207.00	4,634,700
A G S	9,000	754.00	6,786,000
ファインデックス	15,900	595.00	9,460,500
ブレインパッド	15,900	1,136.00	18,062,400
K L a b	33,300	427.00	14,219,100
ポルトゥウィンホールディングス	27,100	1,005.00	27,235,500
ネクソン	420,100	2,944.00	1,236,774,400
アイスタイル	49,100	155.00	7,610,500

エムアップホールディングス	21,600	945.00	20,412,000
エイチーム	12,600	698.00	8,794,800
エニグモ	20,400	551.00	11,240,400
テクノスジャパン	14,800	445.00	6,586,000
コロプラ	61,300	616.00	37,760,800
ブロードリーフ	92,500	360.00	33,300,000
クロス・マーケティンググループ	7,200	858.00	6,177,600
デジタルハーツホールディングス	8,500	1,651.00	14,033,500
システム情報	14,100	909.00	12,816,900
メディアドゥ	6,600	1,686.00	11,127,600
じげん	53,100	289.00	15,345,900
ブイキューブ	19,100	1,055.00	20,150,500
エンカレッジ・テクノロジー	4,400	519.00	2,283,600
サイバーリンクス	6,400	1,025.00	6,560,000
フィックスターズ	19,300	742.00	14,320,600
CARTA HOLDINGS	7,600	2,292.00	17,419,200
オブティム	13,200	802.00	10,586,400
セレス	7,100	1,327.00	9,421,700
SHIFT	10,100	21,350.00	215,635,000
ティーガイア	16,600	1,711.00	28,402,600
セック	2,800	2,182.00	6,109,600
テクマトリックス	31,400	1,594.00	50,051,600
プロシップ	6,300	1,375.00	8,662,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	48,200	2,576.00	124,163,200
GMOペイメントゲートウェイ	36,000	9,750.00	351,000,000
ザッパラス	7,400	417.00	3,085,800
システムリサーチ	5,500	1,922.00	10,571,000
インターネットイニシアティブ	49,500	3,925.00	194,287,500
さくらインターネット	20,200	567.00	11,453,400
ヴァンクス	5,400	1,097.00	5,923,800
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,200	5,030.00	21,126,000
SRAホールディングス	9,000	2,798.00	25,182,000
システムインテグレータ	6,200	479.00	2,969,800
朝日ネット	17,200	572.00	9,838,400
eBASE	22,600	415.00	9,379,000
アバント	20,000	1,191.00	23,820,000
アドソル日進	6,700	1,542.00	10,331,400
ODKソリューションズ	4,200	602.00	2,528,400
フリービット	9,800	921.00	9,025,800
コムチュア	20,900	2,852.00	59,606,800
サイバーコム	3,000	1,121.00	3,363,000
アステリア	13,500	880.00	11,880,000

アイル	9,900	1,307.00	12,939,300
マークライنز	9,400	2,499.00	23,490,600
メディカル・データ・ビジョン	23,700	933.00	22,112,100
g u m i	26,000	518.00	13,468,000
ショーケース	4,400	429.00	1,887,600
モバイルファクトリー	4,400	986.00	4,338,400
テラスカイ	6,900	1,263.00	8,714,700
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,400	1,158.00	9,727,200
P C Iホールディングス	8,100	977.00	7,913,700
パイプドHD	3,500	2,650.00	9,275,000
アイビーシー	3,300	482.00	1,590,600
ネオジャパン	5,400	1,158.00	6,253,200
P R T I M E S	4,000	2,009.00	8,036,000
ラクス	85,200	1,333.00	113,571,600
ランドコンピュータ	4,400	900.00	3,960,000
ダブルスタンダード	5,700	1,762.00	10,043,400
オープンドア	11,100	1,644.00	18,248,400
マイネット	6,600	513.00	3,385,800
アカツキ	8,300	2,885.00	23,945,500
ベネフィットジャパン	1,500	2,005.00	3,007,500
U b i c o mホールディングス	4,900	2,599.00	12,735,100
カナミックネットワーク	21,100	489.00	10,317,900
ノムラシステムコーポレーション	10,400	227.00	2,360,800
チェンジ	35,800	1,724.00	61,719,200
シンクロ・フード	10,200	287.00	2,927,400
オークネット	10,000	1,467.00	14,670,000
キャピタル・アセット・プランニング	3,800	723.00	2,747,400
セグエグループ	5,100	550.00	2,805,000
エイトレッド	2,700	2,003.00	5,408,100
マクロミル	39,000	1,097.00	42,783,000
ビーグリー	4,500	1,341.00	6,034,500
オロ	5,900	1,832.00	10,808,800
ユーザーローカル	5,700	1,602.00	9,131,400
テモナ	4,300	368.00	1,582,400
ニーズウェル	4,900	678.00	3,322,200
マネーフォワード	37,700	3,465.00	130,630,500
サインポスト	6,000	843.00	5,058,000
電算システムホールディングス	7,700	2,562.00	19,727,400
ソルクシーズ	16,200	380.00	6,156,000
フェイス	5,100	723.00	3,687,300
プロトコーポレーション	19,900	1,032.00	20,536,800
ハイマックス	5,100	1,269.00	6,471,900

野村総合研究所	346,600	3,330.00	1,154,178,000
サイバネットシステム	13,400	797.00	10,679,800
C Eホールディングス	9,900	455.00	4,504,500
日本システム技術	3,600	2,400.00	8,640,000
インテージホールディングス	21,500	1,540.00	33,110,000
東邦システムサイエンス	5,100	895.00	4,564,500
ソースネクスト	81,000	173.00	14,013,000
インフォコム	20,400	2,089.00	42,615,600
シンプレクス・ホールディングス	29,400	1,787.00	52,537,800
HEROZ	5,500	881.00	4,845,500
ラクスル	21,000	2,320.00	48,720,000
I P S	5,200	2,185.00	11,362,000
F I G	20,800	284.00	5,907,200
システムサポート	6,900	1,022.00	7,051,800
イーソル	11,600	604.00	7,006,400
アルテリア・ネットワークス	21,700	1,365.00	29,620,500
東海ソフト	3,100	932.00	2,889,200
ウイングアーク1 s t	14,300	1,290.00	18,447,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,300	1,495.00	6,428,500
サーバーワークス	3,300	1,975.00	6,517,500
東名	1,800	747.00	1,344,600
ヴィッツ	1,900	1,172.00	2,226,800
トピラシステムズ	4,000	752.00	3,008,000
S a n s a n	63,700	1,120.00	71,344,000
L i n k - U	3,600	636.00	2,289,600
ギフティ	16,500	911.00	15,031,500
ベース	3,200	5,950.00	19,040,000
J M D C	23,200	5,310.00	123,192,000
フォーカスシステムズ	12,300	891.00	10,959,300
クレスコ	13,600	1,862.00	25,323,200
フジ・メディア・ホールディングス	174,300	1,137.00	198,179,100
オービック	58,500	18,240.00	1,067,040,000
ジャストシステム	26,400	5,350.00	141,240,000
T D C ソフト	15,900	1,135.00	18,046,500
Zホールディングス	2,675,600	436.40	1,167,631,840
トレンドマイクロ	96,400	7,200.00	694,080,000
I Dホールディングス	11,900	830.00	9,877,000
日本オラクル	30,100	8,460.00	254,646,000
アルファシステムズ	5,000	3,720.00	18,600,000
フューチャー	39,300	1,719.00	67,556,700
C A C H o l d i n g s	10,600	1,357.00	14,384,200
S Bテクノロジー	8,100	2,057.00	16,661,700

トーセ	5,100	715.00	3,646,500
オービックビジネスコンサルタント	17,700	4,360.00	77,172,000
伊藤忠テクノソリューションズ	84,600	3,005.00	254,223,000
アイティフォー	22,700	798.00	18,114,600
東計電算	2,200	5,710.00	12,562,000
エクスネット	3,100	998.00	3,093,800
大塚商会	100,400	4,135.00	415,154,000
サイボウズ	24,900	1,214.00	30,228,600
電通国際情報サービス	25,600	3,865.00	98,944,000
A C C E S S	21,300	562.00	11,970,600
デジタルガレージ	30,700	4,105.00	126,023,500
E Mシステムズ	30,800	945.00	29,106,000
ウェザーニューズ	6,100	6,360.00	38,796,000
C I J	14,600	748.00	10,920,800
ビジネスエンジニアリング	2,200	3,915.00	8,613,000
日本エンタープライズ	20,000	164.00	3,280,000
WOWOW	8,600	1,551.00	13,338,600
スカラ	15,800	749.00	11,834,200
インテリジェント ウェイブ	9,600	582.00	5,587,200
I M A G I C A G R O U P	15,200	648.00	9,849,600
ネットワンシステムズ	68,500	2,958.00	202,623,000
システムソフト	46,700	101.00	4,716,700
アルゴグラフィックス	14,500	2,984.00	43,268,000
マーベラス	29,500	753.00	22,213,500
エイベックス	32,100	1,354.00	43,463,400
B I P R O G Y	58,000	2,860.00	165,880,000
兼松エレクトロニクス	10,100	3,785.00	38,228,500
都築電気	9,200	1,466.00	13,487,200
T B S ホールディングス	104,200	1,761.00	183,496,200
日本テレビホールディングス	155,000	1,269.00	196,695,000
朝日放送グループホールディングス	17,500	709.00	12,407,500
テレビ朝日ホールディングス	44,700	1,509.00	67,452,300
スカパーJ S A Tホールディングス	157,600	468.00	73,756,800
テレビ東京ホールディングス	12,600	2,005.00	25,263,000
日本BS放送	6,500	1,018.00	6,617,000
ビジョン	30,900	1,229.00	37,976,100
スマートバリュー	4,600	555.00	2,553,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	16,600	2,046.00	33,963,600
ワイヤレスゲート	8,200	295.00	2,419,000
コネクシオ	13,300	1,448.00	19,258,400
クロップス	3,600	989.00	3,560,400
日本電信電話	1,986,900	3,851.00	7,651,551,900

K D D I	1,352,500	4,343.00	5,873,907,500
ソフトバンク	2,810,000	1,512.00	4,248,720,000
光通信	21,400	14,970.00	320,358,000
エムティーアイ	17,200	446.00	7,671,200
GMOインターネット	65,100	2,409.00	156,825,900
ファイバーゲート	8,600	1,182.00	10,165,200
アйдママーケティングコミュニケーション	4,600	284.00	1,306,400
K A D O K A W A	100,900	3,080.00	310,772,000
学研ホールディングス	26,400	868.00	22,915,200
ゼンリン	30,500	916.00	27,938,000
昭文社ホールディングス	7,900	404.00	3,191,600
インプレスホールディングス	15,400	225.00	3,465,000
アイネット	9,400	1,233.00	11,590,200
松竹	11,700	12,760.00	149,292,000
東宝	109,500	4,800.00	525,600,000
東映	5,800	17,120.00	99,296,000
エヌ・ティ・ティ・データ	494,000	2,265.00	1,118,910,000
ピー・シー・エー	11,000	1,280.00	14,080,000
ビジネスブレイン太田昭和	5,600	1,505.00	8,428,000
D T S	34,600	2,966.00	102,623,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	86,300	5,280.00	455,664,000
シーイーシー	20,000	1,210.00	24,200,000
カブコン	175,000	3,325.00	581,875,000
アイ・エス・ビー	8,800	1,010.00	8,888,000
ジャステック	10,900	1,130.00	12,317,000
S C S K	128,500	2,157.00	277,174,500
日本システムウエア	7,100	2,292.00	16,273,200
アイネス	17,400	1,470.00	25,578,000
T K C	30,400	3,560.00	108,224,000
富士ソフト	19,200	6,850.00	131,520,000
N S D	58,200	2,311.00	134,500,200
コナミホールディングス	67,400	7,570.00	510,218,000
福井コンピュータホールディングス	8,600	3,230.00	27,778,000
J B C Cホールディングス	12,600	1,491.00	18,786,600
ミロク情報サービス	16,500	1,284.00	21,186,000
ソフトバンクグループ	1,112,500	4,900.00	5,451,250,000
高千穂交易	7,000	1,512.00	10,584,000
オルバヘルスケアホールディングス	3,100	1,703.00	5,279,300
伊藤忠食品	4,200	4,815.00	20,223,000
エレマテック	14,900	1,180.00	17,582,000
あらた	14,500	3,705.00	53,722,500
トーメンデバイス	2,800	5,670.00	15,876,000

東京エレクトロン デバイス	5,500	5,580.00	30,690,000
フィールズ	16,300	856.00	13,952,800
双日	200,800	1,975.00	396,580,000
アルフレッサ ホールディングス	202,400	1,820.00	368,368,000
横浜冷凍	49,900	860.00	42,914,000
ラサ商事	9,000	977.00	8,793,000
アルコニックス	23,300	1,361.00	31,711,300
神戸物産	139,200	2,910.00	405,072,000
ハイパー	4,700	469.00	2,204,300
あい ホールディングス	26,600	1,662.00	44,209,200
ディーブイエックス	6,400	1,012.00	6,476,800
ダイワボウホールディングス	86,700	1,661.00	144,008,700
マクニカ・富士エレホールディングス	44,400	2,753.00	122,233,200
ラクト・ジャパン	6,400	2,008.00	12,851,200
グリムス	8,300	1,597.00	13,255,100
バイタルケーエスケー・ホールディングス	31,500	739.00	23,278,500
八洲電機	13,500	939.00	12,676,500
メディアスホールディングス	10,700	963.00	10,304,100
レスターホールディングス	17,700	2,028.00	35,895,600
ジューテックホールディングス	4,100	1,047.00	4,292,700
大光	8,000	713.00	5,704,000
OCHIホールディングス	5,000	1,227.00	6,135,000
TOKAIホールディングス	90,200	885.00	79,827,000
黒谷	5,100	576.00	2,937,600
Cominix	3,300	728.00	2,402,400
三洋貿易	18,200	964.00	17,544,800
ビューティガレージ	3,000	2,624.00	7,872,000
ウイン・パートナーズ	13,500	990.00	13,365,000
ミタチ産業	4,700	874.00	4,107,800
シップヘルスケアホールディングス	57,700	2,117.00	122,150,900
明治電機工業	6,000	1,029.00	6,174,000
デリカフーズホールディングス	7,300	526.00	3,839,800
スターティアホールディングス	4,300	530.00	2,279,000
コメダホールディングス	40,700	2,242.00	91,249,400
ピーバンドットコム	2,700	550.00	1,485,000
アセンテック	6,400	693.00	4,435,200
富士興産	4,700	896.00	4,211,200
協栄産業	1,900	1,293.00	2,456,700
フルサト・マルカホールディングス	17,400	3,470.00	60,378,000
ヤマエグループホールディングス	11,900	1,046.00	12,447,400
小野建	17,600	1,494.00	26,294,400
南陽	3,700	1,800.00	6,660,000



佐島電機	11,600	1,272.00	14,755,200
エコートレーディング	4,000	570.00	2,280,000
伯東	11,400	2,888.00	32,923,200
コンドーテック	14,000	1,090.00	15,260,000
中山福	9,900	346.00	3,425,400
ナガイレーベン	24,000	1,921.00	46,104,000
三菱食品	17,900	3,060.00	54,774,000
松田産業	13,600	2,210.00	30,056,000
第一興商	35,400	3,575.00	126,555,000
メディバルホールディングス	191,400	2,224.00	425,673,600
S P K	7,400	1,304.00	9,649,600
萩原電気ホールディングス	6,700	1,895.00	12,696,500
アズワン	26,700	6,400.00	170,880,000
スズデン	6,300	1,965.00	12,379,500
尾家産業	4,800	889.00	4,267,200
シモジマ	11,400	913.00	10,408,200
ドウシシャ	17,600	1,550.00	27,280,000
小津産業	4,100	2,001.00	8,204,100
高速	10,700	1,540.00	16,478,000
たけびし	6,800	1,445.00	9,826,000
リックス	4,100	1,584.00	6,494,400
丸文	16,000	677.00	10,832,000
ハピネット	15,100	1,512.00	22,831,200
橋本総業ホールディングス	3,600	1,979.00	7,124,400
日本ライフライン	55,200	1,051.00	58,015,200
タカショー	14,300	701.00	10,024,300
I D O M	56,500	664.00	37,516,000
進和	11,000	2,003.00	22,033,000
エスケイジャパン	4,600	432.00	1,987,200
ダイトロン	7,700	2,006.00	15,446,200
シークス	25,700	996.00	25,597,200
田中商事	5,800	601.00	3,485,800
オーハシテクニカ	9,700	1,268.00	12,299,600
白銅	6,000	2,426.00	14,556,000
ダイコー通産	2,200	1,283.00	2,822,600
伊藤忠商事	1,240,400	3,693.00	4,580,797,200
丸紅	1,768,800	1,285.00	2,272,908,000
高島	2,700	2,286.00	6,172,200
長瀬産業	94,700	1,881.00	178,130,700
蝶理	10,400	1,907.00	19,832,800
豊田通商	180,100	4,395.00	791,539,500
三共生興	23,900	537.00	12,834,300

兼松	67,800	1,352.00	91,665,600
ツカモトコーポレーション	3,100	1,213.00	3,760,300
三井物産	1,414,000	3,148.00	4,451,272,000
日本紙パルプ商事	9,400	3,810.00	35,814,000
カメイ	21,400	1,044.00	22,341,600
東都水産	1,000	4,465.00	4,465,000
OUGホールディングス	2,700	2,651.00	7,157,700
スターゼン	13,400	1,950.00	26,130,000
山善	74,600	956.00	71,317,600
椿本興業	3,600	3,675.00	13,230,000
住友商事	1,150,900	1,868.00	2,149,881,200
内田洋行	7,800	4,805.00	37,479,000
三菱商事	1,337,200	4,127.00	5,518,624,400
第一実業	8,000	3,645.00	29,160,000
キャノンマーケティングジャパン	46,200	3,045.00	140,679,000
西華産業	8,900	1,570.00	13,973,000
佐藤商事	14,500	1,146.00	16,617,000
菱洋エレクトロ	11,000	2,098.00	23,078,000
東京産業	16,300	697.00	11,361,100
ユアサ商事	16,800	2,840.00	47,712,000
神鋼商事	4,200	3,615.00	15,183,000
トルク	10,100	200.00	2,020,000
阪和興業	35,600	3,105.00	110,538,000
正栄食品工業	12,100	3,950.00	47,795,000
カナデン	15,200	924.00	14,044,800
菱電商事	14,800	1,680.00	24,864,000
岩谷産業	43,600	5,120.00	223,232,000
ナイス	6,200	1,886.00	11,693,200
ニチモウ	2,500	2,574.00	6,435,000
極東貿易	5,400	2,190.00	11,826,000
アステナホールディングス	25,600	437.00	11,187,200
三愛オブリ	44,500	947.00	42,141,500
稲畑産業	39,300	2,087.00	82,019,100
G S Iクレオス	8,900	1,214.00	10,804,600
明和産業	17,200	720.00	12,384,000
クワザワホールディングス	7,200	492.00	3,542,400
ワキタ	37,700	1,076.00	40,565,200
東邦ホールディングス	56,700	2,152.00	122,018,400
サンゲツ	47,500	1,567.00	74,432,500
ミツウロコグループホールディングス	25,000	983.00	24,575,000
シナネンホールディングス	6,700	3,205.00	21,473,500
伊藤忠エネクス	41,200	1,079.00	44,454,800

サンリオ	55,800	2,544.00	141,955,200
サンワテクノス	10,700	1,340.00	14,338,000
リョーサン	20,100	2,369.00	47,616,900
新光商事	26,800	938.00	25,138,400
トーホー	8,000	1,111.00	8,888,000
三信電気	8,300	1,510.00	12,533,000
東陽テクニカ	18,400	1,044.00	19,209,600
モスフードサービス	24,400	3,015.00	73,566,000
加賀電子	16,300	3,115.00	50,774,500
ソーダニッカ	17,400	638.00	11,101,200
立花エレテック	13,600	1,624.00	22,086,400
フォーバル	7,600	805.00	6,118,000
PALTAC	26,100	4,695.00	122,539,500
三谷産業	29,100	314.00	9,137,400
西本Wismettacホールディングス	4,200	2,562.00	10,760,400
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,700	2,041.00	3,469,700
コア商事ホールディングス	11,700	848.00	9,921,600
国際紙パルプ商事	37,400	295.00	11,033,000
ヤマタネ	8,500	1,659.00	14,101,500
丸紅建材リース	1,600	1,750.00	2,800,000
日鉄物産	12,700	5,150.00	65,405,000
泉州電業	4,900	4,820.00	23,618,000
トラスコ中山	38,800	1,950.00	75,660,000
オートバックスセブン	61,000	1,400.00	85,400,000
モリト	13,600	754.00	10,254,400
加藤産業	24,600	3,330.00	81,918,000
北恵	4,700	886.00	4,164,200
イノテック	11,300	1,358.00	15,345,400
イエローハット	31,300	1,667.00	52,177,100
JKホールディングス	14,400	1,022.00	14,716,800
日伝	14,500	2,137.00	30,986,500
北沢産業	12,000	221.00	2,652,000
杉本商事	8,700	2,131.00	18,539,700
因幡電機産業	48,600	2,580.00	125,388,000
東テク	6,000	2,605.00	15,630,000
ミスミグループ本社	233,800	2,847.00	665,628,600
アルテック	12,300	248.00	3,050,400
タキヒヨー	5,400	1,043.00	5,632,200
蔵王産業	3,600	1,939.00	6,980,400
スズケン	70,800	3,920.00	277,536,000
ジェコス	12,900	791.00	10,203,900
グローセル	21,300	408.00	8,690,400

ローソン	41,200	4,965.00	204,558,000
サンエー	13,700	4,095.00	56,101,500
カワチ薬品	14,600	2,067.00	30,178,200
エービーシー・マート	29,100	5,480.00	159,468,000
ハードオフコーポレーション	8,600	816.00	7,017,600
アスクル	42,300	1,518.00	64,211,400
ゲオホールディングス	24,300	1,283.00	31,176,900
アダストリア	20,200	2,217.00	44,783,400
くら寿司	19,500	3,090.00	60,255,000
キャンドウ	7,000	2,355.00	16,485,000
アイケイ	6,400	552.00	3,532,800
パルグループホールディングス	16,500	1,504.00	24,816,000
エディオン	85,800	1,222.00	104,847,600
サーラコーポレーション	38,300	621.00	23,784,300
ワッツ	9,400	720.00	6,768,000
ハローズ	8,600	3,140.00	27,004,000
フジオフードグループ本社	15,100	1,316.00	19,871,600
あみやき亭	4,500	2,905.00	13,072,500
大黒天物産	6,000	4,865.00	29,190,000
ハニーズホールディングス	16,100	1,087.00	17,500,700
ファーマライズホールディングス	4,800	724.00	3,475,200
アルペン	14,000	1,932.00	27,048,000
ハブ	6,600	482.00	3,181,200
クオールホールディングス	23,100	1,080.00	24,948,000
ジーンズホールディングス	11,800	4,210.00	49,678,000
ビックカメラ	110,700	1,128.00	124,869,600
D C Mホールディングス	115,200	1,097.00	126,374,400
Monotaro	235,500	2,019.00	475,474,500
東京一番フーズ	5,100	595.00	3,034,500
きちりホールディングス	5,000	369.00	1,845,000
アーランドサービスホールディングス	13,700	2,054.00	28,139,800
J.フロント リテイリング	217,400	990.00	215,226,000
ドトール・日レスホールディングス	31,500	1,506.00	47,439,000
マツキヨココカラ&カンパニー	112,800	4,260.00	480,528,000
broncoビリー	10,500	2,282.00	23,961,000
Zozo	128,200	2,684.00	344,088,800
トレジャー・ファクトリー	5,800	958.00	5,556,400
物語コーポレーション	9,300	5,160.00	47,988,000
三越伊勢丹ホールディングス	310,800	978.00	303,962,400
Hamee	7,000	1,050.00	7,350,000
マーケットエンタープライズ	2,300	737.00	1,695,100
ウエルシアホールディングス	98,600	2,594.00	255,768,400

クリエイトSDホールディングス	27,600	2,940.00	81,144,000
丸善CHIホールディングス	21,700	378.00	8,202,600
ミサワ	4,300	608.00	2,614,400
ティーライフ	2,700	1,413.00	3,815,100
チムニー	5,700	1,135.00	6,469,500
シュッピン	15,700	1,093.00	17,160,100
オイシックス・ラ・大地	26,900	2,467.00	66,362,300
ネクステージ	37,900	1,915.00	72,578,500
ジョイフル本田	56,200	1,588.00	89,245,600
鳥貴族ホールディングス	6,800	1,726.00	11,736,800
ホットランド	14,200	1,360.00	19,312,000
すかいらーくホールディングス	236,100	1,524.00	359,816,400
SFPホールディングス	9,100	1,379.00	12,548,900
綿半ホールディングス	13,900	1,321.00	18,361,900
ヨシックスホールディングス	3,800	2,002.00	7,607,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	54,400	1,092.00	59,404,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	10,000	945.00	9,450,000
B E E N O S	9,600	1,375.00	13,200,000
あさひ	15,700	1,330.00	20,881,000
日本調剤	11,600	1,191.00	13,815,600
コスモス薬品	18,800	11,870.00	223,156,000
トーエル	9,100	825.00	7,507,500
セブン&アイ・ホールディングス	693,800	5,705.00	3,958,129,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	107,700	805.00	86,698,500
ツルハホールディングス	40,700	6,730.00	273,911,000
サンマルクホールディングス	14,900	1,492.00	22,230,800
フェリシモ	4,400	1,184.00	5,209,600
トリドールホールディングス	46,400	2,239.00	103,889,600
T O K Y O B A S E	18,100	310.00	5,611,000
ウイルプラスホールディングス	3,800	921.00	3,499,800
J Mホールディングス	13,300	1,628.00	21,652,400
サツドラホールディングス	8,800	659.00	5,799,200
アレンザホールディングス	13,900	989.00	13,747,100
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,657.00	8,616,400
パロックジャパンリミテッド	13,300	783.00	10,413,900
クスリのアオキホールディングス	18,000	5,420.00	97,560,000
力の源ホールディングス	9,500	579.00	5,500,500
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	104,600	3,180.00	332,628,000
メディカルシステムネットワーク	18,000	432.00	7,776,000
はるやまホールディングス	9,400	453.00	4,258,200

ノジマ	30,200	2,936.00	88,667,200
カップ・クリエイト	26,100	1,327.00	34,634,700
ライトオン	13,900	701.00	9,743,900
良品計画	214,500	1,264.00	271,128,000
パリティホールディングス	24,300	262.00	6,366,600
アドヴァングループ	18,300	779.00	14,255,700
アルビス	5,900	2,229.00	13,151,100
コナカ	21,300	332.00	7,071,600
ハウス オブ ローゼ	2,500	1,662.00	4,155,000
G - 7ホールディングス	20,900	1,556.00	32,520,400
イオン北海道	30,200	1,023.00	30,894,600
コジマ	32,500	609.00	19,792,500
ヒマラヤ	6,600	915.00	6,039,000
コーナン商事	26,600	3,700.00	98,420,000
エコス	6,800	2,000.00	13,600,000
ワタミ	22,500	895.00	20,137,500
マルシェ	6,000	462.00	2,772,000
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	372,400	2,002.00	745,544,800
西松屋チェーン	39,700	1,553.00	61,654,100
ゼンショーホールディングス	91,000	2,938.00	267,358,000
幸楽苑ホールディングス	11,500	1,246.00	14,329,000
ハークスレイ	8,400	458.00	3,847,200
サイゼリヤ	27,800	2,310.00	64,218,000
V Tホールディングス	70,800	457.00	32,355,600
魚力	5,300	2,189.00	11,601,700
フジ・コーポレーション	10,100	1,130.00	11,413,000
ユナイテッドアローズ	19,700	1,843.00	36,307,100
ハイデイ日高	27,000	1,904.00	51,408,000
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	12,500	204.00	2,550,000
コロワイド	76,500	1,615.00	123,547,500
ピーシーデボコーポレーション	22,700	313.00	7,105,100
壱番屋	13,200	4,870.00	64,284,000
P L A N T	5,100	671.00	3,422,100
スギホールディングス	37,200	5,280.00	196,416,000
薬王堂ホールディングス	9,500	1,875.00	17,812,500
スクロール	29,100	844.00	24,560,400
ヨンドシーホールディングス	16,900	1,716.00	29,000,400
木曽路	25,400	2,079.00	52,806,600
S R Sホールディングス	26,700	813.00	21,707,100
千趣会	34,400	393.00	13,519,200
リテールパートナーズ	28,600	1,145.00	32,747,000

ケーヨー	34,600	958.00	33,146,800
上新電機	20,400	1,902.00	38,800,800
日本瓦斯	90,700	1,881.00	170,606,700
ロイヤルホールディングス	32,600	2,029.00	66,145,400
いなげや	21,700	1,324.00	28,730,800
チヨダ	17,900	706.00	12,637,400
ライフコーポレーション	16,500	2,866.00	47,289,000
リンガーハット	22,400	2,191.00	49,078,400
MrMaxHD	23,800	607.00	14,446,600
AOKIホールディングス	36,600	626.00	22,911,600
オークワ	28,500	883.00	25,165,500
コメリ	28,900	2,826.00	81,671,400
青山商事	38,000	705.00	26,790,000
しまむら	21,700	11,660.00	253,022,000
はせがわ	11,100	265.00	2,941,500
高島屋	132,300	1,218.00	161,141,400
松屋	35,700	776.00	27,703,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	86,000	873.00	75,078,000
近鉄百貨店	6,700	2,521.00	16,890,700
丸井グループ	143,000	2,234.00	319,462,000
アクシアル リテイリング	13,800	3,065.00	42,297,000
イオン	682,500	2,387.00	1,629,127,500
イズミ	32,300	2,816.00	90,956,800
平和堂	33,300	1,957.00	65,168,100
フジ	47,700	2,369.00	113,001,300
ヤオコー	21,200	6,860.00	145,432,000
ゼビオホールディングス	25,700	924.00	23,746,800
ケーズホールディングス	167,600	1,384.00	231,958,400
Olympicグループ	9,700	644.00	6,246,800
日産東京販売ホールディングス	28,900	220.00	6,358,000
シルバーライフ	4,000	1,351.00	5,404,000
Genky DrugStores	8,300	3,145.00	26,103,500
ナルミヤ・インターナショナル	4,500	846.00	3,807,000
ブックオフグループホールディングス	10,900	1,019.00	11,107,100
ギフトホールディングス	3,100	2,061.00	6,389,100
アインホールディングス	24,300	5,610.00	136,323,000
元気寿司	5,300	2,452.00	12,995,600
ヤマダホールディングス	697,480	480.00	334,790,400
アーランドサカモト	29,400	1,563.00	45,952,200
ニトリホールディングス	73,900	12,705.00	938,899,500
グルメ杵屋	15,100	1,000.00	15,100,000
愛眼	13,600	197.00	2,679,200

ケーユーホールディングス	10,000	1,064.00	10,640,000
吉野家ホールディングス	65,100	2,375.00	154,612,500
松屋フーズホールディングス	9,000	3,745.00	33,705,000
サガミホールディングス	28,200	1,111.00	31,330,200
関西フードマーケット	17,700	1,319.00	23,346,300
王将フードサービス	12,400	6,110.00	75,764,000
プレナス	21,000	1,940.00	40,740,000
ミニストップ	13,900	1,383.00	19,223,700
アークス	34,900	2,078.00	72,522,200
パローホールディングス	40,300	1,995.00	80,398,500
ベルク	8,300	5,440.00	45,152,000
大庄	10,300	1,025.00	10,557,500
ファーストリテイリング	24,900	58,020.00	1,444,698,000
サンドラッグ	70,200	2,955.00	207,441,000
サックスパー ホールディングス	18,200	516.00	9,391,200
ヤマザワ	4,400	1,500.00	6,600,000
やまや	3,800	2,480.00	9,424,000
ベルーナ	40,400	711.00	28,724,400
島根銀行	5,900	521.00	3,073,900
じもとホールディングス	13,000	620.00	8,060,000
めぶきフィナンシャルグループ	852,400	267.00	227,590,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,800	1,741.00	39,694,800
九州フィナンシャルグループ	362,700	402.00	145,805,400
ゆうちょ銀行	440,200	981.00	431,836,200
富山第一銀行	43,500	327.00	14,224,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,017,700	478.00	486,460,600
西日本フィナンシャルホールディングス	109,800	783.00	85,973,400
三十三フィナンシャルグループ	16,500	1,427.00	23,545,500
第四北越フィナンシャルグループ	29,000	2,507.00	72,703,000
ひろぎんホールディングス	262,800	633.00	166,352,400
おきなわフィナンシャルグループ	16,500	2,215.00	36,547,500
十六フィナンシャルグループ	23,900	2,229.00	53,273,100
北國フィナンシャルホールディングス	16,900	4,345.00	73,430,500
プロクレアホールディングス	19,600	1,828.00	35,828,800
新生銀行	121,600	2,217.00	269,587,200
あおぞら銀行	104,100	2,636.00	274,407,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,435,400	750.20	8,578,837,080
りそなホールディングス	2,067,200	545.90	1,128,484,480
三井住友トラスト・ホールディングス	337,800	4,097.00	1,383,966,600
三井住友フィナンシャルグループ	1,264,000	3,922.00	4,957,408,000
千葉銀行	590,400	748.00	441,619,200
群馬銀行	333,300	373.00	124,320,900



武蔵野銀行	26,500	1,780.00	47,170,000
千葉興業銀行	42,600	269.00	11,459,400
筑波銀行	72,700	199.00	14,467,300
七十七銀行	55,500	1,668.00	92,574,000
秋田銀行	11,700	1,664.00	19,468,800
山形銀行	19,100	882.00	16,846,200
岩手銀行	11,900	1,908.00	22,705,200
東邦銀行	148,200	205.00	30,381,000
東北銀行	8,700	990.00	8,613,000
ふくおかフィナンシャルグループ	149,600	2,349.00	351,410,400
静岡銀行	430,900	854.00	367,988,600
スルガ銀行	163,500	415.00	67,852,500
八十二銀行	400,000	455.00	182,000,000
山梨中央銀行	19,700	993.00	19,562,100
大垣共立銀行	35,200	1,912.00	67,302,400
福井銀行	15,600	1,354.00	21,122,400
清水銀行	7,300	1,506.00	10,993,800
富山銀行	3,200	1,893.00	6,057,600
滋賀銀行	33,500	2,494.00	83,549,000
南都銀行	27,800	2,037.00	56,628,600
百五銀行	171,500	340.00	58,310,000
京都銀行	63,800	5,640.00	359,832,000
紀陽銀行	60,600	1,422.00	86,173,200
ほくほくフィナンシャルグループ	110,900	888.00	98,479,200
山陰合同銀行	108,300	660.00	71,478,000
中国銀行	145,200	964.00	139,972,800
鳥取銀行	5,900	1,187.00	7,003,300
伊予銀行	234,400	632.00	148,140,800
百十四銀行	18,900	1,714.00	32,394,600
四国銀行	27,100	802.00	21,734,200
阿波銀行	27,300	2,152.00	58,749,600
大分銀行	10,500	1,873.00	19,666,500
宮崎銀行	11,100	2,070.00	22,977,000
佐賀銀行	10,300	1,462.00	15,058,600
琉球銀行	40,500	817.00	33,088,500
セブン銀行	553,800	249.00	137,896,200
みずほフィナンシャルグループ	2,335,300	1,585.00	3,701,450,500
高知銀行	6,500	745.00	4,842,500
山口フィナンシャルグループ	206,900	730.00	151,037,000
長野銀行	6,000	1,311.00	7,866,000
名古屋銀行	12,800	3,065.00	39,232,000
北洋銀行	265,500	241.00	63,985,500

愛知銀行	6,400	4,740.00	30,336,000
中京銀行	6,400	1,684.00	10,777,600
大光銀行	6,100	1,269.00	7,740,900
愛媛銀行	25,500	935.00	23,842,500
トマト銀行	6,300	1,021.00	6,432,300
京葉銀行	77,800	493.00	38,355,400
栃木銀行	87,900	249.00	21,887,100
北日本銀行	5,700	1,562.00	8,903,400
東和銀行	32,000	536.00	17,152,000
福島銀行	20,800	216.00	4,492,800
大東銀行	8,700	653.00	5,681,100
トモニホールディングス	141,000	326.00	45,966,000
フィデアホールディングス	17,000	1,288.00	21,896,000
池田泉州ホールディングス	209,000	187.00	39,083,000
F P G	63,000	801.00	50,463,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,600	1,137.00	16,600,200
マーキュリアホールディングス	8,700	583.00	5,072,100
S B Iホールディングス	230,300	2,859.00	658,427,700
ジャフコ グループ	71,400	1,537.00	109,741,800
大和証券グループ本社	1,363,700	624.60	851,767,020
野村ホールディングス	2,847,500	484.00	1,378,190,000
岡三証券グループ	143,300	358.00	51,301,400
丸三証券	55,900	511.00	28,564,900
東洋証券	61,200	179.00	10,954,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	204,600	386.00	78,975,600
光世証券	4,400	465.00	2,046,000
水戸証券	49,300	259.00	12,768,700
いちよし証券	34,500	568.00	19,596,000
松井証券	91,600	824.00	75,478,400
マネックスグループ	154,100	533.00	82,135,300
極東証券	24,100	699.00	16,845,900
岩井コスモホールディングス	17,800	1,261.00	22,445,800
アイザワ証券グループ	29,200	649.00	18,950,800
マネーパートナーズグループ	20,800	238.00	4,950,400
スパークス・グループ	87,000	248.00	21,576,000
かんぽ生命保険	187,700	2,147.00	402,991,900
S O M P Oホールディングス	292,500	5,229.00	1,529,482,500
アニコム ホールディングス	57,300	628.00	35,984,400
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	406,600	3,928.00	1,597,124,800
第一生命ホールディングス	867,600	2,597.00	2,253,157,200
東京海上ホールディングス	572,100	6,921.00	3,959,504,100
T & Dホールディングス	461,000	1,676.00	772,636,000

アドバンスクリエイト	8,900	930.00	8,277,000
全国保証	44,600	4,545.00	202,707,000
あんしん保証	8,700	292.00	2,540,400
イントラスト	8,600	519.00	4,463,400
日本モーゲージサービス	10,700	964.00	10,314,800
C a s a	7,000	803.00	5,621,000
アルヒ	27,900	996.00	27,788,400
プレミアグループ	9,500	3,710.00	35,245,000
ネットプロテクションズホールディングス	57,100	602.00	34,374,200
クレディセゾン	116,400	1,551.00	180,536,400
芙蓉総合リース	18,400	7,260.00	133,584,000
みずほリース	27,000	3,015.00	81,405,000
東京センチュリー	33,800	4,215.00	142,467,000
日本証券金融	73,700	950.00	70,015,000
アイフル	313,900	379.00	118,968,100
リコーリース	16,600	3,440.00	57,104,000
イオンフィナンシャルサービス	101,700	1,204.00	122,446,800
アコム	368,900	345.00	127,270,500
ジャックス	20,000	3,280.00	65,600,000
オリエントコーポレーション	507,400	128.00	64,947,200
オリックス	1,108,000	2,304.00	2,552,832,000
三菱HCキャピタル	660,900	585.00	386,626,500
九州リースサービス	9,400	579.00	5,442,600
日本取引所グループ	455,300	1,906.50	868,029,450
イー・ギャランティ	27,700	2,034.00	56,341,800
アサックス	10,300	582.00	5,994,600
NECキャピタルソリューション	7,800	1,966.00	15,334,800
いちご	212,700	277.00	58,917,900
日本駐車場開発	207,300	157.00	32,546,100
スター・マイカ・ホールディングス	11,000	1,443.00	15,873,000
SREホールディングス	5,200	2,318.00	12,053,600
ADワークスグループ	36,900	149.00	5,498,100
ヒューリック	433,500	1,040.00	450,840,000
三栄建築設計	8,400	1,646.00	13,826,400
野村不動産ホールディングス	96,900	3,120.00	302,328,000
三重交通グループホールディングス	41,000	466.00	19,106,000
サムティ	29,800	2,053.00	61,179,400
ディア・ライフ	26,500	518.00	13,727,000
地主	12,600	1,937.00	24,406,200
プレサンスコーポレーション	24,000	1,487.00	35,688,000
ハウスコム	4,500	1,130.00	5,085,000
日本管理センター	10,400	988.00	10,275,200

サンセイランディック	7,200	811.00	5,839,200
フージャースホールディングス	23,800	646.00	15,374,800
オープンハウスグループ	59,600	4,745.00	282,802,000
東急不動産ホールディングス	537,500	649.00	348,837,500
飯田グループホールディングス	156,300	2,111.00	329,949,300
イーランド	4,000	1,341.00	5,364,000
ムゲンエステート	14,400	502.00	7,228,800
A n d D oホールディングス	9,200	909.00	8,362,800
シーアールイー	6,700	1,489.00	9,976,300
ケイアイスター不動産	8,700	5,320.00	46,284,000
グッドコムアセット	9,400	1,093.00	10,274,200
ジェイ・エス・ビー	4,200	3,450.00	14,490,000
ロードスターキャピタル	5,700	1,416.00	8,071,200
テンポイノベーション	7,000	808.00	5,656,000
フェイスネットワーク	3,500	1,328.00	4,648,000
パーク24	111,200	1,816.00	201,939,200
パラカ	5,900	1,735.00	10,236,500
三井不動産	807,800	2,683.50	2,167,731,300
三菱地所	1,171,500	1,823.50	2,136,230,250
平和不動産	31,500	3,850.00	121,275,000
東京建物	176,800	1,780.00	314,704,000
京阪神ビルディング	28,400	1,328.00	37,715,200
住友不動産	373,100	3,335.00	1,244,288,500
テーオーシー	34,000	673.00	22,882,000
東京楽天地	3,300	3,955.00	13,051,500
スターツコーポレーション	26,000	2,316.00	60,216,000
フジ住宅	24,000	620.00	14,880,000
空港施設	21,500	548.00	11,782,000
明和地所	11,300	594.00	6,712,200
ゴールドクレスト	15,600	1,661.00	25,911,600
エスリード	8,200	1,665.00	13,653,000
日神グループホールディングス	33,600	446.00	14,985,600
日本エスコン	34,700	738.00	25,608,600
タカラレーベン	78,100	292.00	22,805,200
A V A N T I A	11,100	840.00	9,324,000
イオンモール	94,400	1,561.00	147,358,400
毎日コムネット	8,400	700.00	5,880,000
ファースト住建	8,300	1,104.00	9,163,200
カチタス	46,700	2,889.00	134,916,300
トーセイ	27,100	1,114.00	30,189,400
穴吹興産	4,700	2,222.00	10,443,400
サンフロンティア不動産	27,200	1,061.00	28,859,200

F Jネクストホールディングス	19,800	1,016.00	20,116,800
インテリックス	4,200	637.00	2,675,400
ランドビジネス	7,300	236.00	1,722,800
サンネクスタグループ	7,200	1,119.00	8,056,800
グランディハウス	15,500	521.00	8,075,500
日本空港ビルデング	67,700	5,180.00	350,686,000
明豊ファシリティワークス	8,700	680.00	5,916,000
日本工営	11,600	2,908.00	33,732,800
L I F U L L	56,600	215.00	12,169,000
ミクシィ	41,500	2,253.00	93,499,500
ジェイエイシーリクルートメント	14,800	1,744.00	25,811,200
日本M&Aセンターホールディングス	296,500	1,400.00	415,100,000
メンバーズ	5,300	2,873.00	15,226,900
中広	3,800	379.00	1,440,200
UTグループ	26,200	2,585.00	67,727,000
アイティメディア	8,800	1,660.00	14,608,000
E・Jホールディングス	10,700	1,139.00	12,187,300
夢真ビーネックスグループ	59,100	1,347.00	79,607,700
コシダカホールディングス	48,700	716.00	34,869,200
アルトナー	4,800	833.00	3,998,400
パソナグループ	19,700	1,930.00	38,021,000
C D S	4,700	1,790.00	8,413,000
リンクアンドモチベーション	39,800	435.00	17,313,000
エス・エム・エス	61,500	2,936.00	180,564,000
サニーサイドアップグループ	6,700	780.00	5,226,000
パーソルホールディングス	180,800	2,315.00	418,552,000
リニカル	10,600	791.00	8,384,600
クックパッド	57,900	249.00	14,417,100
アイ・ケイ・ケイホールディングス	9,400	566.00	5,320,400
学情	7,700	921.00	7,091,700
スタジオアリス	8,200	2,207.00	18,097,400
シミックホールディングス	9,900	1,457.00	14,424,300
エプコ	4,300	687.00	2,954,100
N J S	4,100	2,023.00	8,294,300
総合警備保障	70,000	3,705.00	259,350,000
カカクコム	132,700	2,625.00	348,337,500
アイロムグループ	6,500	2,013.00	13,084,500
セントケア・ホールディング	12,200	781.00	9,528,200
サイネックス	3,600	591.00	2,127,600
ルネサンス	12,900	855.00	11,029,500
ディップ	31,900	3,940.00	125,686,000
デジタルホールディングス	12,800	1,401.00	17,932,800

新日本科学	22,200	1,335.00	29,637,000
キャリアデザインセンター	4,600	1,032.00	4,747,200
ベネフィット・ワン	65,900	1,878.00	123,760,200
エムスリー	318,900	3,836.00	1,223,300,400
ツカダ・グローバルホールディング	11,500	305.00	3,507,500
アウトソーシング	103,700	1,169.00	121,225,300
ウェルネット	18,200	445.00	8,099,000
ワールドホールディングス	7,400	2,313.00	17,116,200
ディー・エヌ・エー	69,000	1,886.00	130,134,000
博報堂D Yホールディングス	244,200	1,511.00	368,986,200
ぐるなび	29,300	387.00	11,339,100
タカミヤ	22,800	333.00	7,592,400
ジャパンベストレスキューシステム	11,500	743.00	8,544,500
ファンコミュニケーションズ	44,400	419.00	18,603,600
ライク	6,200	2,094.00	12,982,800
ビジネス・ブレークスルー	7,500	408.00	3,060,000
エスプール	51,300	1,194.00	61,252,200
WDBホールディングス	8,400	2,584.00	21,705,600
ティア	11,300	431.00	4,870,300
C D G	2,200	1,300.00	2,860,000
アドウェイズ	27,400	779.00	21,344,600
バリューコマース	14,300	3,070.00	43,901,000
インフォマート	198,500	494.00	98,059,000
J Pホールディングス	48,000	208.00	9,984,000
エコナックホールディングス	35,900	88.00	3,159,200
C Lホールディングス	4,100	1,068.00	4,378,800
プレステージ・インターナショナル	68,300	604.00	41,253,200
アミューズ	10,000	1,939.00	19,390,000
ドリームインキュベータ	5,300	1,950.00	10,335,000
クイック	12,200	1,462.00	17,836,400
T A C	11,300	224.00	2,531,200
電通グループ	180,700	4,665.00	842,965,500
イオンファンタジー	7,100	2,057.00	14,604,700
シーティーエス	20,800	848.00	17,638,400
ネクシィーズグループ	6,700	512.00	3,430,400
H . U . グループホールディングス	47,300	2,958.00	139,913,400
アルプス技研	14,600	1,925.00	28,105,000
ダイオーズ	3,900	1,032.00	4,024,800
日本空調サービス	19,300	803.00	15,497,900
オリエンタルランド	206,400	17,200.00	3,550,080,000
ダスキン	41,000	2,796.00	114,636,000
明光ネットワークジャパン	21,800	573.00	12,491,400

ファルコホールディングス	8,600	2,103.00	18,085,800
ラウンドワン	50,700	1,270.00	64,389,000
リゾートトラスト	80,800	2,078.00	167,902,400
ビー・エム・エル	23,100	3,345.00	77,269,500
りらいあコミュニケーションズ	27,000	1,032.00	27,864,000
リソー教育	83,400	367.00	30,607,800
早稲田アカデミー	10,400	1,027.00	10,680,800
ユー・エス・エス	202,400	2,188.00	442,851,200
東京個別指導学院	16,500	581.00	9,586,500
サイバーエージェント	425,700	1,372.00	584,060,400
楽天グループ	899,100	854.00	767,831,400
クリーク・アンド・リバー社	9,600	1,965.00	18,864,000
モーニングスター	32,200	536.00	17,259,200
テー・オー・ダブリュー	35,500	319.00	11,324,500
山田コンサルティンググループ	9,600	1,162.00	11,155,200
セントラルスポーツ	6,900	2,308.00	15,925,200
フルキャストホールディングス	15,500	2,198.00	34,069,000
エン・ジャパン	30,300	3,090.00	93,627,000
リソルホールディングス	2,000	4,410.00	8,820,000
テクノプロ・ホールディングス	108,300	2,894.00	313,420,200
アトラグループ	4,000	253.00	1,012,000
インターワークス	6,100	376.00	2,293,600
アイ・アールジャパンホールディングス	8,500	3,865.00	32,852,500
K e e P e r 技研	11,700	2,320.00	27,144,000
ファーストロジック	3,700	769.00	2,845,300
三機サービス	3,400	1,182.00	4,018,800
G u n o s y	10,300	937.00	9,651,100
デザインワン・ジャパン	6,600	182.00	1,201,200
イー・ガーディアン	7,000	2,808.00	19,656,000
リブセンス	12,000	162.00	1,944,000
ジャパンマテリアル	55,700	1,859.00	103,546,300
ベクトル	25,600	1,182.00	30,259,200
ウチヤマホールディングス	10,000	306.00	3,060,000
チャーム・ケア・コーポレーション	13,700	1,072.00	14,686,400
キャリアリンク	6,900	1,428.00	9,853,200
I B J	15,300	665.00	10,174,500
アサンテ	8,200	1,464.00	12,004,800
バリューHR	15,100	1,291.00	19,494,100
M & A キャピタルパートナーズ	15,000	3,240.00	48,600,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,300	1,146.00	8,365,800
E R I ホールディングス	5,300	1,277.00	6,768,100
アピスト	2,900	2,753.00	7,983,700

シグマクシス・ホールディングス	22,100	1,039.00	22,961,900
ウィルグループ	13,700	1,071.00	14,672,700
エスクロー・エージェント・ジャパン	24,400	164.00	4,001,600
メドピア	13,600	2,599.00	35,346,400
レアジョブ	3,800	767.00	2,914,600
リクルートホールディングス	1,360,700	4,368.00	5,943,537,600
エラン	25,200	946.00	23,839,200
土木管理総合試験所	9,400	327.00	3,073,800
ネットマーケティング	9,300	672.00	6,249,600
日本郵政	2,261,300	911.90	2,062,079,470
ベルシステム24ホールディングス	26,200	1,444.00	37,832,800
鎌倉新書	21,100	550.00	11,605,000
S MN	4,500	590.00	2,655,000
グローバルキッズCOMPANY	3,600	698.00	2,512,800
エアトリ	11,400	2,861.00	32,615,400
アトラエ	12,800	1,580.00	20,224,000
ストライク	7,300	3,775.00	27,557,500
ソラスト	44,800	825.00	36,960,000
セラク	6,000	1,186.00	7,116,000
インソース	18,500	1,894.00	35,039,000
ベikalレント・コンサルティング	12,800	41,650.00	533,120,000
Orchestra Holdings	3,600	2,372.00	8,539,200
アイモバイル	6,700	1,309.00	8,770,300
キャリアインデックス	6,700	522.00	3,497,400
MS - Japan	7,700	813.00	6,260,100
船場	4,100	695.00	2,849,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	57,500	1,630.00	93,725,000
フルテック	2,800	1,335.00	3,738,000
GameWith	6,000	468.00	2,808,000
MS&Consulting	3,100	704.00	2,182,400
ウェルビー	12,200	898.00	10,955,600
エル・ティー・エス	2,400	2,706.00	6,494,400
ミダックホールディングス	8,300	1,967.00	16,326,100
日総工産	14,600	624.00	9,110,400
キュービーネットホールディングス	8,600	1,339.00	11,515,400
RPAホールディングス	26,400	402.00	10,612,800
スプリックス	5,800	1,175.00	6,815,000
マネジメントソリューションズ	8,900	4,495.00	40,005,500
プロレド・パートナーズ	4,600	556.00	2,557,600
テノ・ホールディングス	2,700	610.00	1,647,000
フロンティア・マネジメント	5,000	932.00	4,660,000
ピアラ	3,300	826.00	2,725,800



コプロ・ホールディングス	3,900	1,003.00	3,911,700
ギークス	3,400	1,131.00	3,845,400
カーブスホールディングス	50,000	672.00	33,600,000
フォーラムエンジニアリング	12,400	833.00	10,329,200
Fast Fitness Japan	3,500	1,813.00	6,345,500
ダイレクトマーケティングミックス	20,300	1,555.00	31,566,500
ポピンズ	4,300	1,938.00	8,333,400
LITALICO	14,700	2,340.00	34,398,000
アドバンテッジリスクマネジメント	9,800	490.00	4,802,000
リログループ	99,000	1,830.00	181,170,000
東祥	13,700	1,512.00	20,714,400
ビーウィズ	5,100	1,458.00	7,435,800
TREホールディングス	28,000	2,066.00	57,848,000
人・夢・技術グループ	7,300	2,218.00	16,191,400
エイチ・アイ・エス	39,400	2,012.00	79,272,800
ラックランド	5,600	2,942.00	16,475,200
共立メンテナンス	32,300	4,540.00	146,642,000
イチネンホールディングス	18,800	1,222.00	22,973,600
建設技術研究所	10,400	2,286.00	23,774,400
スペース	12,900	897.00	11,571,300
燦ホールディングス	8,100	1,570.00	12,717,000
スバル興業	1,100	8,370.00	9,207,000
東京テアトル	6,900	1,211.00	8,355,900
タナベ経営	7,400	640.00	4,736,000
ナガワ	5,600	8,950.00	50,120,000
東京都競馬	13,600	3,845.00	52,292,000
カナモト	31,300	1,951.00	61,066,300
西尾レントオール	16,200	2,750.00	44,550,000
トランス・コスモス	23,000	3,150.00	72,450,000
乃村工藝社	77,800	866.00	67,374,800
藤田観光	7,900	2,225.00	17,577,500
KNT-CTホールディングス	11,200	1,417.00	15,870,400
日本管財	19,500	2,756.00	53,742,000
トーカイ	15,500	1,706.00	26,443,000
セコム	178,100	9,308.00	1,657,754,800
セントラル警備保障	8,900	2,146.00	19,099,400
丹青社	36,400	778.00	28,319,200
メイテック	21,500	6,330.00	136,095,000
応用地質	19,500	1,882.00	36,699,000
船井総研ホールディングス	36,100	2,054.00	74,149,400
進学会ホールディングス	6,900	321.00	2,214,900
オオバ	12,400	771.00	9,560,400

いであ	4,900	1,786.00	8,751,400	
学究社	6,000	1,586.00	9,516,000	
ベネッセホールディングス	60,400	2,284.00	137,953,600	
イオンディライト	22,400	2,884.00	64,601,600	
ナック	8,900	949.00	8,446,100	
ダイセキ	33,000	4,475.00	147,675,000	
ステップ	6,800	1,758.00	11,954,400	
合 計	201,034,180		471,620,602,660	

## (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 5月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	9,013,723,727
コール・ローン	1,489,343,186
株式	480,038,355,349
投資信託受益証券	215,724,946
投資証券	11,725,056,636
派生商品評価勘定	700,641
未収入金	40,881,457
未収配当金	595,158,105
前払金	705,533,394
差入委託証拠金	1,211,729,750
流動資産合計	505,036,207,191
資産合計	505,036,207,191
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	711,111,455
未払解約金	588,709,687
未払利息	776
流動負債合計	1,299,821,918
負債合計	1,299,821,918
純資産の部	

	2022年 5月10日現在
項目	金額（円）
元本等	
元本	123,439,506,128
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	380,296,879,145
元本等合計	503,736,385,273
純資産合計	503,736,385,273
負債純資産合計	505,036,207,191

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 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 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 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>

2022年 5月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2022年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	123,439,506,128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 4.0808円 (1万口当たり純資産額) (40,808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 5月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2022年 5月10日現在	
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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	<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 5月10日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価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 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月11日
期首元本額	126,848,172,131円
期中追加設定元本額	7,509,382,388円
期中一部解約元本額	10,918,048,391円
期末元本額	123,439,506,128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）	1,883,678,610円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,439,733円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	31,392,580,628円
世界経済インデックスファンド	10,271,349,804円
外国株式インデックス・オープン	870,655,925円
D C マイセレクション 2 5	802,669,251円
D C マイセレクション 5 0	3,616,557,459円
D C マイセレクション 7 5	4,015,993,494円
D C 外国株式インデックス・オープン	11,852,901,405円
D C マイセレクション S 2 5	393,404,481円
D C マイセレクション S 5 0	1,806,901,714円
D C マイセレクション S 7 5	1,462,446,739円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	45,750,253円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	162,700,967円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	118,931,244円
D C 世界経済インデックスファンド	9,573,463,611円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,486,148,740円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	3,828,753円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	5,004,952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）	29,927,997円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	15,432,161円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	52,688,817円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	11,319,798円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	32,345,308円

区分	2022年 5月10日現在
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	286,175,381円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	176,305,325円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,293,284,462円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	125,096,346円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	33,352,178円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	166,222,459円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	56,515,180円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,070,240,865円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,131,684,373円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,137,007,530円
コア投資戦略ファンド（安定型）	581,693,447円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,345,785,667円
分散投資コア戦略ファンドA	1,421,677,202円
分散投資コア戦略ファンドS	8,037,948,513円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,272,339,033円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,076,922,108円
コア投資戦略ファンド（切替型）	530,929,433円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	595,405,872円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,262,210円
SMT インデックスバランス・オープン	156,482,916円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	383,790,568円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	15,741,252,776円
SMT 世界経済インデックス・オープン	188,527,218円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	715,581,162円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	135,308,413円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,596,274円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	163,224,573円
グローバル経済コア	641,701,183円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	13,085,867円
DCターゲット・イヤーフンド2055	5,685,293円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	444,599,492円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	66,705,541円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	28,495,824円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	24,249,522円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	9,775,879円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	12,504,775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）	266,018,338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）	195,518,788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）	963,574,039円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,184,416,206円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	212,666,118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）	121,952,881円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	54,069,270円

区分	2022年 5月10日現在
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	85,558,147円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	232,787,423円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	249,093,423円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	247,805,125円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	225,480,922円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	221,972,924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）	162,055,820円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	35,465,840,287
投資信託受益証券	10,171,836
投資証券	297,232,719
合計	35,752,901,170

(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 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	12,586,624,513	-	11,881,091,119	705,533,394
合計		12,586,624,513	-	11,881,091,119	705,533,394

## (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 5月10日現在）



区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,153,477,050	-	1,148,599,630	4,877,420
	アメリカドル	1,086,123,900	-	1,081,804,114	4,319,786
	スイスフラン	67,353,150	-	66,795,516	557,634
	合計	1,153,477,050	-	1,148,599,630	4,877,420

## (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	30.05	1,886,779.40	
	CHENIERE ENERGY INC	19,034	134.34	2,557,027.56	
	CHEVRON CORP	150,711	159.25	24,000,726.75	
	CONOCOPHILLIPS	104,031	97.20	10,111,813.20	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	29.32	1,876,480.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	51,677	62.02	3,205,007.54	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	129.49	1,717,943.83	
	EOG RESOURCES INC	46,119	117.94	5,439,274.86	
	EXXON MOBIL	330,112	84.46	27,881,259.52	
	HALLIBURTON CO	68,269	33.36	2,277,453.84	
	HESS CORP	22,781	106.73	2,431,416.13	
	KINDER MORGAN INC	159,310	18.60	2,963,166.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	48,069	90.86	4,367,549.34	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	69,966	57.84	4,046,833.44	
	ONEOK INC	33,279	61.71	2,053,647.09	
	PHILLIPS 66	35,503	89.48	3,176,808.44	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	18,224	244.39	4,453,763.36	
	SCHLUMBERGER	107,126	38.04	4,075,073.04	
	VALERO ENERGY CORP	30,763	118.45	3,643,877.35	
	WILLIAMS COS	98,553	34.74	3,423,731.22	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,541	233.22	4,090,912.02		

ALBEMARLE CORP	9,440	221.64	2,092,281.60
AMCOR PLC	111,485	12.61	1,405,825.85
AVERY DENNISON CORP	6,638	176.41	1,171,009.58
BALL CORP	25,605	69.49	1,779,291.45
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	142.92	1,226,539.44
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	14,951	90.88	1,358,746.88
CORTEVA INC	58,500	53.08	3,105,180.00
CROWN HOLDINGS INC	9,940	101.73	1,011,196.20
DOW INC	57,346	66.63	3,820,963.98
DUPONT DE NEMOURS INC	40,980	64.33	2,636,243.40
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	103.42	1,145,376.50
ECOLAB INC	19,895	163.81	3,258,999.95
FMC CORP	10,507	113.91	1,196,852.37
FREEMONT-MCMORAN INC	113,194	35.52	4,020,650.88
INT'L PAPER CO	30,800	47.81	1,472,548.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,494	119.49	2,329,338.06
LINDE PLC	40,161	300.27	12,059,143.47
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,803	106.60	2,110,999.80
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,631	332.79	1,541,150.49
MOSAIC CO/THE	27,732	55.86	1,549,109.52
NEWMONT CORPORATION	61,555	68.92	4,242,370.60
NUCOR CORP	22,299	130.03	2,899,538.97
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	160.78	1,235,915.86
PPG INDUSTRIES INC	19,278	127.14	2,451,004.92
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	84.94	888,132.64
SEALED AIR CORP	11,690	64.21	750,614.90
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,719	276.97	5,461,571.43
STEEL DYNAMICS INC	15,552	77.22	1,200,925.44
VULCAN MATERIALS CO	10,247	162.95	1,669,748.65
WESTROCK CO	21,356	51.31	1,095,776.36
3 M COMPANY	44,860	152.38	6,835,766.80
AERCAP HOLDINGS NV	11,005	41.79	459,898.95
ALLEGION PLC	7,601	113.85	865,373.85
AMETEK INC	18,006	121.84	2,193,851.04
BOEING CO	43,246	133.31	5,765,124.26
CARRIER GLOBAL CORP	63,164	38.13	2,408,443.32
CATERPILLAR	42,499	206.29	8,767,118.71
CUMMINS INC	11,214	202.71	2,273,189.94
DEERE&CO	23,252	364.53	8,476,051.56
DOVER CORP	10,672	132.10	1,409,771.20
EATON CORP	31,624	147.96	4,679,087.04
EMERSON ELECTRIC CO	46,305	84.41	3,908,605.05

FASTENAL CO	44,846	53.10	2,381,322.60
FORTIVE CORP	25,722	59.23	1,523,514.06
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	71.22	734,278.20
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	227.44	1,185,189.84
GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	229.37	4,351,148.90
GENERAL ELECTRIC CO	85,187	72.97	6,216,095.39
GRAINGER (WW) INC	3,236	476.82	1,542,989.52
HEICO CORP	3,640	133.00	484,120.00
HEICO CORP-CLASS A	6,449	108.65	700,683.85
HONEYWELL INTL INC	53,646	193.96	10,405,178.16
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	33.27	1,051,132.38
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	209.98	739,549.56
IDEX CORP	5,916	189.00	1,118,124.00
ILLINOIS TOOL WORKS	24,227	209.44	5,074,102.88
INGERSOLL-RAND INC	31,562	43.25	1,365,056.50
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	54.12	957,924.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	56,689	51.77	2,934,789.53
KORNIT DIGITAL LTD	2,776	56.79	157,649.04
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,684	239.25	3,752,397.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	215.83	545,186.58
LOCKHEED MARTIN CORP	19,332	438.84	8,483,654.88
MASCO CORP	19,462	53.76	1,046,277.12
NORDSON CORP	4,121	208.73	860,176.33
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,737	453.98	5,328,363.26
OTIS WORLDWIDE CORP	30,653	73.31	2,247,171.43
OWENS CORNING	8,642	91.65	792,039.30
PACCAR INC	28,106	85.35	2,398,847.10
PARKER HANNIFIN CORP	9,900	271.19	2,684,781.00
PENTAIR PLC	14,533	51.19	743,944.27
PLUG POWER INC	41,884	16.63	696,530.92
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	117,233	91.75	10,756,127.75
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,098	203.22	1,848,895.56
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,314	432.92	3,599,296.88
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	44.52	615,622.56
SMITH (A.O.) CORP	9,016	59.79	539,066.64
SNAP-ON INC	4,000	217.96	871,840.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	125.66	1,583,064.68
SUNRUN INC	13,917	21.09	293,509.53
TEXTRON	16,934	64.28	1,088,517.52
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	134.53	2,507,370.14
TRANSDIGM GROUP INC	4,075	545.69	2,223,686.75
UNITED RENTALS INC	5,393	286.82	1,546,820.26

WABTEC CORP	15,024	86.87	1,305,134.88
XYLEM INC	13,269	84.98	1,127,599.62
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	81.40	925,029.60
CINTAS CORP	7,423	374.23	2,777,909.29
CLARIVATE PLC	27,357	14.49	396,402.93
COPART INC	16,617	108.69	1,806,101.73
COSTAR GROUP INC	32,116	58.06	1,864,654.96
EQUIFAX INC	9,509	199.63	1,898,281.67
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,661	130.26	1,388,701.86
LEIDOS HOLDINGS	11,220	99.38	1,115,043.60
REPUBLIC SERVICES INC	16,942	130.95	2,218,554.90
ROBERT HALF INTL INC	9,566	95.18	910,491.88
ROLLINS INC	17,468	33.61	587,099.48
TRANSUNION	15,741	82.51	1,298,789.91
VERISK ANALYTICS INC	12,503	177.98	2,225,283.94
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	122.92	2,615,123.00
WASTE MANAGEMENT INC	32,770	159.24	5,218,294.80
AMERCO	734	529.02	388,300.68
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,292	107.95	1,218,971.40
CSX CORP	173,146	33.62	5,821,168.52
DELTA AIR LINES INC	14,609	38.25	558,794.25
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	109.76	1,566,494.72
FEDEX CORP	19,524	208.27	4,066,263.48
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	83,011	2.80	232,430.80
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	172.50	1,216,470.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	49.88	533,716.00
LYFT INC-A	21,288	18.61	396,169.68
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	249.50	4,762,206.50
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	271.20	2,170,413.60
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	43.83	593,151.39
UBER TECHNOLOGIES INC	113,645	23.05	2,619,517.25
UNION PACIFIC CORP	50,721	225.25	11,424,905.25
UNITED PARCEL SERVICE B	56,644	181.43	10,276,920.92
APTIV PLC	20,714	95.21	1,972,179.94
BORGWARNER INC	19,781	36.82	728,336.42
FORD MOTOR COMPANY	305,209	13.37	4,080,644.33
GENERAL MOTORS CO	103,796	38.26	3,971,234.96
LEAR CORP	5,287	128.00	676,736.00
LUCID GROUP INC	31,234	16.35	510,675.90
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	13,363	22.78	304,409.14
TESLA INC	66,795	787.11	52,575,012.45
DR HORTON INC	27,764	69.93	1,941,536.52

GARMIN LTD	12,854	102.70	1,320,105.80
HASBRO INC	10,572	88.50	935,622.00
LENNAR CORP-CL A	20,844	77.28	1,610,824.32
LULULEMON ATHLETICA INC	9,305	292.68	2,723,387.40
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	148.19	750,137.78
NEWELL BRANDS INC	31,461	24.26	763,243.86
NIKE B	99,467	111.21	11,061,725.07
NVR INC	247	4,370.16	1,079,429.52
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	14.13	307,129.68
PULTE GROUP INC	21,609	42.67	922,056.03
VF CORP	25,718	47.51	1,221,862.18
WHIRLPOOL CORP	5,220	193.34	1,009,234.80
AIRBNB INC-CLASS A	23,026	119.37	2,748,613.62
ARAMARK	20,955	34.27	718,127.85
BOOKING HOLDINGS INC	3,187	2,023.57	6,449,117.59
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	52.95	929,802.00
CARNIVAL CORPORATION	62,102	14.14	878,122.28
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,164	1,276.57	2,762,497.48
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	125.11	1,340,178.32
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	333.60	950,092.80
DRAFTKINGS INC	27,674	10.99	304,137.26
EXPEDIA GROUP INC	11,638	127.79	1,487,220.02
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,878	133.31	2,916,556.18
LAS VEGAS SANDS CORP	24,370	31.86	776,428.20
MARRIOTT INTL A	21,139	163.85	3,463,625.15
MCDONALD'S CORP	58,134	247.49	14,387,583.66
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	4.55	80,362.10
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,874	35.14	1,014,632.36
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,767	61.41	1,029,661.47
STARBUCKS CORP	91,531	73.49	6,726,613.19
VAIL RESORTS INC	3,014	235.73	710,490.22
WYNN RESORTS LTD	9,302	61.33	570,491.66
YUM BRANDS INC	22,637	110.10	2,492,333.70
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,643	77.17	4,756,990.31
ALPHABET INC-CL A	23,507	2,250.22	52,895,921.54
ALPHABET INC-CL C	22,377	2,261.68	50,609,613.36
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	38,290	12.52	479,390.80
CABLE ONE INC	445	1,113.64	495,569.80
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	9,809	463.67	4,548,139.03
COMCAST CORP-CL A	356,721	39.76	14,183,226.96
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	21.30	428,811.60
ELECTRONIC ARTS INC	21,814	112.04	2,444,040.56

FOX CORP - CLASS A	27,658	33.21	918,522.18
FOX CORP- CLASS B	10,345	30.57	316,246.65
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	72.63	488,146.23
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	32.47	1,098,589.98
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	109.99	283,664.21
LIBERTY BROADBAND-C	11,268	114.76	1,293,115.68
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	55.59	854,918.61
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	38.46	522,440.64
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	38.62	246,550.08
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,343	85.37	1,053,721.91
MATCH GROUP INC	20,191	70.71	1,427,705.61
META PLATFORMS INC-CLASS A	185,146	196.21	36,327,496.66
NETFLIX INC	34,441	173.10	5,961,737.10
NEWS CORP-CLASS A	33,479	17.50	585,882.50
OMNICOM GROUP	16,538	77.37	1,279,545.06
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	48,586	27.44	1,333,199.84
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	21.08	964,768.36
ROKU INC	9,122	87.77	800,637.94
SEA LTD-ADR	25,116	64.62	1,622,995.92
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	6.05	365,831.40
SNAP INC - A	83,375	23.39	1,950,141.25
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,973	106.15	952,483.95
THE WALT DISNEY CO	141,614	106.98	15,149,865.72
TWITTER INC	63,066	47.96	3,024,645.36
WARNER BROS DISCOVERY INC	175,398	17.10	2,999,305.80
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	21,935	42.34	928,727.90
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	202.64	1,078,855.36
AMAZON.COM	35,733	2,175.78	77,747,146.74
AUTOZONE INC	1,639	1,951.66	3,198,770.74
BATH & BODY WORKS INC	19,806	50.34	997,034.04
BEST BUY COMPANY INC	18,175	91.08	1,655,379.00
BURLINGTON STORES INC	5,108	188.62	963,470.96
CARMAX INC	12,051	92.81	1,118,453.31
CARVANA CO	5,700	38.77	220,989.00
CHEWY INC - CLASS A	6,878	26.33	181,097.74
DOLLAR GENERAL CORP	18,686	231.37	4,323,379.82
DOLLAR TREE INC	17,931	161.53	2,896,394.43
DOORDASH INC - A	8,334	64.18	534,876.12
EBAY	51,021	49.26	2,513,294.46
ETSY INC	10,294	86.40	889,401.60
FIVERR INTERNATIONAL LTD	1,486	42.87	63,704.82
GENUINE PARTS CO	10,119	131.94	1,335,100.86

HOME DEPOT	81,549	297.03	24,222,499.47
LKQ CORP	22,779	50.06	1,140,316.74
LOWES COMPANIES	52,191	196.07	10,233,089.37
MERCADOLIBRE INC	3,567	770.99	2,750,121.33
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,407	610.07	3,298,648.49
POOL CORP	3,304	399.84	1,321,071.36
ROSS STORES INC	28,076	93.41	2,622,579.16
TARGET (DAYTON HUDSON)	37,156	224.20	8,330,375.20
TJX COMPANIES INC	93,142	59.14	5,508,417.88
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	198.24	1,768,697.28
ULTA BEAUTY INC	3,990	381.09	1,520,549.10
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	62.35	374,100.00
COSTCO WHOLESALE CORP	34,433	498.83	17,176,213.39
KROGER CO	56,126	54.84	3,077,949.84
SYSCO CORP	40,288	81.08	3,266,551.04
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	43.85	2,620,782.95
WALMART INC	120,012	151.31	18,159,015.72
ALTRIA GROUP INC	142,972	55.26	7,900,632.72
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,967	84.36	3,624,696.12
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	64.84	1,556,549.04
BUNGE LIMITED	11,604	107.83	1,251,259.32
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	51.39	815,507.91
COCA-COLA CO	319,753	64.61	20,659,241.33
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	48.85	751,996.90
CONAGRA BRANDS INC	35,941	36.29	1,304,298.89
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	246.24	3,186,345.60
GENERAL MILLS INC	46,541	73.50	3,420,763.50
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,352	223.20	2,533,766.40
HORMEL FOODS CORP	23,338	52.55	1,226,411.90
JM SMUCKER CO	9,145	145.01	1,326,116.45
KELLOGG CO	21,630	74.53	1,612,083.90
KEURIG DR PEPPER INC	52,526	37.14	1,950,815.64
KRAFT HEINZ CO/THE	52,188	44.19	2,306,187.72
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,909	98.52	1,862,914.68
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	53.67	787,285.23
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	108,376	66.28	7,183,161.28
MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	83.57	2,696,553.19
PEPSICO INC	107,665	171.70	18,486,080.50
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	121,262	99.87	12,110,435.94
TYSON FOODS INC	21,804	92.84	2,024,283.36
CHURCH & DWIGHT CO INC	17,995	98.36	1,769,988.20
CLOROX COMPANY	9,570	157.43	1,506,605.10

COLGATE-PALMOLIVE CO	63,788	77.67	4,954,413.96
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,438	233.58	4,306,748.04
KIMBERLY-CLARK CORP	25,886	140.34	3,632,841.24
PROCTER & GAMBLE CO	189,391	155.61	29,471,133.51
ABBOTT LABORATORIES	138,079	107.39	14,828,303.81
ABIOMED INC	3,781	234.10	885,132.10
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	268.96	1,598,429.28
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	157.32	2,028,798.72
ANTHEM INC	18,926	490.88	9,290,394.88
BAXTER INTERNATIONAL	38,403	73.62	2,827,228.86
BECTON DICKINSON & CO	22,232	252.20	5,606,910.40
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,802	38.29	4,319,188.58
CARDINAL HEALTH	21,902	56.97	1,247,756.94
CENTENE CORP	44,550	79.19	3,527,914.50
CERNER CORP	22,894	93.67	2,144,480.98
CIGNA CORP	26,327	261.41	6,882,141.07
CVS HEALTH CORP	102,569	98.86	10,139,971.34
DAVITA INC	5,784	104.37	603,676.08
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	39.25	697,629.50
DEXCOM INC	7,647	330.02	2,523,662.94
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	48,336	94.69	4,576,935.84
HCA HEALTHCARE INC	19,440	224.10	4,356,504.00
HENRY SCHEIN INC	11,747	85.00	998,495.00
HOLOGIC INC	19,018	72.76	1,383,749.68
HUMANA INC	9,953	424.51	4,225,148.03
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	345.02	2,329,230.02
INMODE LTD	5,500	21.90	120,450.00
INSULET CORP	5,311	191.46	1,016,844.06
INTUITIVE SURGICAL INC	27,694	208.71	5,780,014.74
LABORATORY CRP OF AMER	7,595	241.26	1,832,369.70
MASIMO CORP	4,147	120.51	499,754.97
MCKESSON CORP	12,089	326.47	3,946,695.83
MEDTRONIC PLC	104,586	99.58	10,414,673.88
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	296.50	1,347,592.50
NOVOCURE LTD	7,933	62.84	498,509.72
QUEST DIAGNOSTICS	10,005	136.21	1,362,781.05
RESMED INC	11,440	192.74	2,204,945.60
STERIS PLC	8,018	213.16	1,709,116.88
STRYKER CORP	26,295	229.01	6,021,817.95
TELADOC HEALTH INC	11,375	30.52	347,165.00
TELEFLEX INC	3,934	259.70	1,021,659.80
THE COOPER COS INC	4,134	311.61	1,288,195.74



UNITEDHEALTH GROUP INC	73,563	486.42	35,782,514.46
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	125.33	764,763.66
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	166.12	1,869,680.60
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,281	115.00	1,872,315.00
10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	47.40	268,047.00
ABBVIE INC	137,691	150.96	20,785,833.36
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	113.11	2,690,321.35
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	122.52	1,181,460.36
AMGEN	44,045	239.24	10,537,325.80
AVANTOR INC	42,980	29.37	1,262,322.60
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	479.05	887,679.65
BIO-TECHNE CORP	3,245	347.06	1,126,209.70
BIOGEN INC	11,860	187.54	2,224,224.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	74.62	1,103,107.46
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	172,791	76.27	13,178,769.57
CATALENT INC	13,739	93.70	1,287,344.30
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	228.85	962,085.40
DANAHER CORP	50,501	239.37	12,088,424.37
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	21.84	787,572.24
EXACT SCIENCES CORP	14,756	50.27	741,784.12
GILEAD SCIENCES INC	97,060	61.68	5,986,660.80
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	83.26	1,492,518.76
ILLUMINA INC	11,258	220.68	2,484,415.44
INCYTE CORP	15,212	72.65	1,105,151.80
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	204.07	3,086,762.82
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	141.87	705,235.77
JOHNSON & JOHNSON	205,370	177.33	36,418,262.10
LILLY (ELI) & CO	63,296	289.23	18,307,102.08
MERCK & CO	197,066	87.64	17,270,864.24
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,196.07	2,162,494.56
MODERNA INC	27,309	135.80	3,708,562.20
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	75.79	642,244.46
NOVAVAX INC	5,754	53.26	306,458.04
PERKINELMER INC	9,372	142.45	1,335,041.40
PFIZER	437,000	48.64	21,255,680.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,116	599.77	4,867,733.32
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,128	37.53	980,583.84
SEAGEN INC	10,071	108.81	1,095,825.51
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	7.42	596,575.42
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,643	517.39	15,854,381.77
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,030	235.02	4,707,450.60
VIATRIS INC	90,748	10.48	951,039.04

WATERS CORP	4,749	316.29	1,502,061.21
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	296.82	1,711,760.94
ZOETIS INC	36,750	161.81	5,946,517.50
BANK OF AMERICA CORP	576,261	36.37	20,958,612.57
CITIGROUP	155,162	49.89	7,741,032.18
CITIZENS FINANCIAL GROUP	32,251	39.42	1,271,334.42
FIFTH THIRD BANCORP	52,803	36.80	1,943,150.40
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	640.14	608,133.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,787	144.23	1,988,499.01
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	13.16	1,501,713.92
JPMORGAN CHASE & CO	231,226	121.86	28,177,200.36
KEY CORP	71,472	19.18	1,370,832.96
M & T BANK CORP	14,037	168.03	2,358,637.11
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,936	163.67	5,390,635.12
REGIONS FINL CORP	70,814	20.57	1,456,643.98
SIGNATURE BANK	4,686	220.03	1,031,060.58
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	469.81	2,135,286.45
TRUIST FINANCIAL CORP	103,413	48.57	5,022,769.41
US BANCORP	109,092	49.44	5,393,508.48
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	47.18	673,400.14
WELLS FARGO & CO	311,895	43.96	13,710,904.20
ALLY FINANCIAL INC	27,761	40.60	1,127,096.60
AMERICAN EXPRESS	51,483	161.02	8,289,792.66
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	259.64	2,259,387.28
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	26,880	49.55	1,331,904.00
BANK NEW YORK CO	61,254	43.21	2,646,785.34
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	101,985	312.96	31,917,225.60
BLACKROCK INC	11,820	605.56	7,157,719.20
BLACKSTONE INC	54,507	96.66	5,268,646.62
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,256	123.22	4,097,804.32
CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	35.52	447,374.40
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	107.19	951,311.25
CME GROUP INC	27,828	201.60	5,610,124.80
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	2,868	83.51	239,506.68
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,403	107.27	2,510,439.81
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,355	28.32	774,693.60
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	363.84	1,145,368.32
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	24.84	647,578.80
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	28.35	122,358.60
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,636	308.89	8,227,594.04
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,703	96.99	4,335,743.97
INVESCO LTD	26,420	17.71	467,898.20

KKR & CO INC	39,913	49.86	1,990,062.18
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	257.01	824,231.07
MOODY'S CORP	13,365	285.63	3,817,444.95
MORGAN STANLEY	106,388	81.15	8,633,386.20
MSCI INC	6,518	379.08	2,470,843.44
NASDAQ INC	9,657	146.18	1,411,660.26
NORTHERN TRUST CORP	15,902	104.75	1,665,734.50
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	122.44	2,192,533.08
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	93.63	1,449,954.18
ROBINHOOD MARKETS INC - A	13,050	9.50	123,975.00
S&P GLOBAL INC	27,736	328.77	9,118,764.72
SCHWAB (CHARLES) CORP	112,432	64.13	7,210,264.16
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	54.86	523,913.00
SOFI TECHNOLOGIES INC	38,996	5.97	232,806.12
STATE STREET CORP	27,998	69.25	1,938,861.50
SYNCHRONY FINANCIAL	45,369	37.03	1,680,014.07
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	60.48	548,009.28
UPSTART HOLDINGS INC	3,148	77.13	242,805.24
AFLAC	50,591	57.56	2,912,017.96
ALLEGHANY CORP	906	830.57	752,496.42
ALLSTATE CORP	23,095	128.96	2,978,331.20
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	144.20	911,199.80
AMERICAN INT'L GROUP	65,898	59.61	3,928,179.78
AON PLC	17,508	275.09	4,816,275.72
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	45.22	1,344,209.72
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	160.19	2,620,548.21
ASSURANT INC	4,726	180.97	855,264.22
BROWN & BROWN INC	19,873	56.58	1,124,414.34
CHUBB LTD	33,670	205.11	6,906,053.70
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	125.02	1,599,130.82
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	165.81	359,144.46
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	280.56	922,481.28
FNF GROUP	20,461	40.37	826,010.57
GLOBE LIFE INC	8,106	98.54	798,765.24
HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,721	70.80	1,962,646.80
LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	55.77	752,002.68
LOEWS CORP	16,741	63.08	1,056,022.28
MARKEL CORP	1,156	1,287.07	1,487,852.92
MARSH & MCLENNAN COS	39,216	157.05	6,158,872.80
METLIFE INC	57,127	65.64	3,749,816.28
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,719	68.99	1,429,403.81
PROGRESSIVE CORP	45,110	108.75	4,905,712.50

PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,511	105.11	3,101,901.21
TRAVELERS COS INC/THE	19,772	171.92	3,399,202.24
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,061	207.77	2,090,373.97
MR BERKLEY CORP	17,572	67.23	1,181,365.56
CBRE GROUP INC-A	25,382	79.51	2,018,122.82
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.72	465,864.00
WEYERHAEUSER CO	58,295	39.22	2,286,329.90
ZILLOW GROUP INC-A	5,497	36.52	200,750.44
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	37.18	499,215.86
ACCENTURE PLC-CL A	49,381	287.49	14,196,543.69
ADOBE INC	37,107	376.91	13,985,999.37
AFFIRM HOLDINGS INC	12,816	20.59	263,881.44
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	95.50	1,305,771.50
ANSYS INC	6,794	249.17	1,692,860.98
ASANA INC - CL A	4,986	22.44	111,885.84
AUTODESK INC	17,467	186.32	3,254,451.44
AUTOMATIC DATA PROCESS	32,782	209.79	6,877,335.78
AVALARA INC	6,847	75.61	517,701.67
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	36.18	506,375.28
BILL.COM HOLDINGS INC	5,794	107.91	625,230.54
BLACK KNIGHT INC	11,543	70.08	808,933.44
BLOCK INC	39,674	83.86	3,327,061.64
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	137.71	1,341,570.82
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,922	137.18	3,007,259.96
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	52.43	559,323.24
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	119.29	969,111.96
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	100.02	1,044,608.88
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	56.56	1,147,206.48
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	40,421	76.27	3,082,909.67
COUPA SOFTWARE INC	6,059	68.55	415,344.45
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	14,479	143.69	2,080,487.51
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	112.86	349,866.00
DATADOG INC - CLASS A	17,059	97.53	1,663,764.27
DOCUSIGN INC	14,969	68.63	1,027,322.47
DROPBOX INC-CLASS A	28,845	20.48	590,745.60
DYNATRACE INC	14,790	31.92	472,096.80
EPAM SYSTEMS INC	4,403	317.89	1,399,669.67
FAIR ISAAC CORP	2,125	341.44	725,560.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	48,175	94.54	4,554,464.50
FISERV INC	46,421	93.63	4,346,398.23
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	216.61	1,300,093.22
FORTINET INC	10,645	245.22	2,610,366.90

GARTNER INC	6,340	239.32	1,517,288.80
GLOBAL PAYMENTS INC	22,567	118.38	2,671,481.46
GODADDY INC - CLASS A	13,798	69.89	964,342.22
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	74.08	468,037.44
HUBSPOT INC	3,646	332.91	1,213,789.86
INTL BUSINESS MACHINES CORP	69,612	134.44	9,358,637.28
INTUIT INC	21,247	367.01	7,797,861.47
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	177.33	1,115,583.03
MASTERCARD INC-CLASS A	68,686	327.99	22,528,321.14
MICROSOFT CORP	558,777	264.58	147,841,218.66
MONGODB INC	4,623	252.72	1,168,324.56
NORTONLIFELOCK INC	43,549	24.57	1,069,998.93
OKTA INC	11,505	88.83	1,021,989.15
ORACLE CORP	128,255	71.54	9,175,362.70
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	7.46	934,320.24
PALO ALTO NETWORKS INC	7,648	459.51	3,514,332.48
PAYCHEX INC	25,433	120.27	3,058,826.91
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	280.17	1,186,519.95
PAYPAL HOLDINGS INC	88,224	79.53	7,016,454.72
PTC INC	8,304	106.55	884,791.20
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	68.66	438,943.38
SALESFORCE INC	76,228	163.60	12,470,900.80
SERVICENOW INC	15,383	425.87	6,551,158.21
SNOWFLAKE INC-CLASS A	16,606	143.29	2,379,473.74
SPLUNK INC	13,355	90.04	1,202,484.20
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	60.37	1,167,253.95
SYNOPSYS INC	12,038	262.41	3,158,891.58
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,090	44.99	1,488,719.10
TWILIO INC - A	12,842	100.75	1,293,831.50
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	354.20	1,182,673.80
UNITY SOFTWARE INC	4,329	50.38	218,095.02
VERISIGN INC	7,790	164.86	1,284,259.40
VISA INC-CLASS A SHARES	130,637	193.00	25,212,941.00
VMWARE INC-CLASS A	16,717	99.19	1,658,159.23
WESTERN UNION CO	29,297	17.19	503,615.43
WIX.COM LTD	5,010	64.63	323,796.30
WORKDAY INC-CLASS A	14,681	176.21	2,586,939.01
ZENDESK INC	8,890	99.14	881,354.60
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,028	92.34	1,572,365.52
ZSCALER INC	6,234	153.09	954,363.06
AMPHENOL CORPORATION	45,988	69.09	3,177,310.92
APPLE INC	1,284,469	152.06	195,316,356.14

ARISTA NETWORKS INC	18,880	102.48	1,934,822.40
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	124.74	760,914.00
CDW CORP/DE	10,882	164.80	1,793,353.60
CISCO SYSTEMS	328,253	48.96	16,071,266.88
COGNEX CORP	14,352	49.12	704,970.24
CORNING	64,989	35.76	2,324,006.64
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	45.19	1,015,916.39
F5 INC	4,150	166.44	690,726.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	98,742	15.84	1,564,073.28
HP INC	92,346	37.01	3,417,725.46
IPG PHOTONICS CORP	3,207	100.78	323,201.46
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	30.70	777,354.70
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	132.20	1,981,545.80
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,961	202.08	2,619,158.88
NETAPP INC	18,303	71.32	1,305,369.96
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	15,060	80.36	1,210,221.60
TE CONNECTIVITY LTD	26,068	123.29	3,213,923.72
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	399.00	1,555,701.00
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	61.96	1,312,064.96
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	56.53	1,457,908.70
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	328.54	1,367,383.48
AT&T INC	555,579	19.55	10,861,569.45
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	21.85	339,024.60
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	22.76	625,604.12
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	11.15	822,524.35
T-MOBILE US INC	49,657	121.73	6,044,746.61
VERIZON COMMUNICATIONS	322,452	48.62	15,677,616.24
AES CORP	54,375	20.06	1,090,762.50
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	58.72	1,220,084.16
AMEREN CORPORATION	20,898	92.68	1,936,826.64
AMERICAN ELECTRIC POWER	38,104	99.69	3,798,587.76
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,174	145.79	2,066,427.46
ATMOS ENERGY CORP	9,688	113.63	1,100,847.44
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	30.38	1,463,161.56
CMS ENERGY CORP	23,697	69.18	1,639,358.46
CONSOLIDATED EDISON INC	27,507	94.38	2,596,110.66
CONSTELLATION ENERGY	25,732	57.62	1,482,677.84
DOMINION ENERGY INC	62,375	83.77	5,225,153.75
DTE ENERGY COMPANY	14,651	129.52	1,897,597.52
DUKE ENERGY CORP	59,845	110.80	6,630,826.00
EDISON INTL	28,027	70.06	1,963,571.62
ENTERGY CORP	15,166	119.26	1,808,697.16

ESSENTIAL UTILITIES INC	17,002	43.42	738,226.84		
EVERGY INC	18,475	67.90	1,254,452.50		
EVERSOURCE ENERGY	26,753	90.54	2,422,216.62		
EXELON CORP	77,196	46.73	3,607,369.08		
FIRSTENERGY CORP	41,156	42.17	1,735,548.52		
NEXTERA ENERGY INC	152,538	70.71	10,785,961.98		
NISOURCE INC	28,687	29.44	844,545.28		
NRG ENERGY INC	19,068	41.43	789,987.24		
PG&E CORP	118,132	12.09	1,428,215.88		
PPL CORPORATION	58,459	28.79	1,683,034.61		
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	69.06	2,725,660.08		
SEMPRA ENERGY	24,535	162.03	3,975,406.05		
SOUTHERN CO	84,113	74.23	6,243,707.99		
UGI CORP	18,019	37.60	677,514.40		
VISTRA CORP	37,797	24.13	912,041.61		
WEC ENERGY GROUP INC	24,561	101.94	2,503,748.34		
XCEL ENERGY INC	43,741	73.65	3,221,524.65		
ADVANCED MICRO DEVICES	127,867	86.36	11,042,594.12		
ANALOG DEVICES	41,625	152.25	6,337,406.25		
APPLIED MATERIALS	71,368	105.75	7,547,166.00		
BROADCOM INC	32,460	562.92	18,272,383.20		
ENPHASE ENERGY INC	10,113	150.51	1,522,107.63		
ENTEGRIS INC	10,491	105.50	1,106,800.50		
INTEL CORP	318,822	43.07	13,731,663.54		
KLA CORP	12,119	318.87	3,864,385.53		
LAM RESEARCH CORP	10,992	447.15	4,915,072.80		
MARVELL TECHNOLOGY INC	63,360	53.73	3,404,332.80		
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	42,031	64.31	2,703,013.61		
MICRON TECHNOLOGY	87,336	67.93	5,932,734.48		
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	406.74	1,436,198.94		
NVIDIA CORP	196,119	169.50	33,242,170.50		
NXP SEMICONDUCTORS NV	20,848	172.90	3,604,619.20		
ON SEMICONDUCTOR CORP	31,766	50.82	1,614,348.12		
QORVO INC	8,556	102.76	879,214.56		
QUALCOMM	87,800	134.92	11,845,976.00		
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	102.17	1,366,217.24		
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	3,750	225.36	845,100.00		
TERADYNE INC	12,318	100.22	1,234,509.96		
TEXAS INSTRUMENTS	71,796	164.94	11,842,032.24		
アメリカドル 小計	25,007,719		2,709,861,102.90 (352,363,239,210)		
カナダドル	CAMECO CORP	26,880	27.33	734,630.40	

CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,194	76.16	7,097,655.04
CENOVUS ENERGY INC	96,666	24.36	2,354,783.76
ENBRIDGE	156,497	56.45	8,834,255.65
IMPERIAL OIL	16,573	63.39	1,050,562.47
KEYERA CORP	18,607	31.53	586,678.71
PARKLAND CORP	14,075	34.09	479,816.75
PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	49.18	2,245,853.88
SUNCOR ENERGY	116,208	45.28	5,261,898.24
TC ENERGY CORP	77,328	69.67	5,387,441.76
TOURMALINE OIL CORP	22,173	68.75	1,524,393.75
AGNICO EAGLE MINES	36,354	70.33	2,556,776.82
BARRICK GOLD CORP	139,009	27.93	3,882,521.37
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	54.69	718,571.91
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	31.24	1,343,320.00
FRANCO-NEVADA CORP	15,363	184.09	2,828,174.67
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	9.18	475,955.46
KINROSS GOLD CORP	108,451	5.93	643,114.43
LUNDIN MINING CORP	62,243	10.47	651,684.21
NUTRIEN LTD	44,786	120.85	5,412,388.10
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	29.06	535,023.66
TECK RESOURCES LTD-CL B	34,747	47.64	1,655,347.08
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	117.31	915,018.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,238	55.31	1,893,703.78
BALLARD POWER SYSTEMS INC	19,724	8.97	176,924.28
CAE INC	25,999	29.06	755,530.94
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,585	107.84	602,286.40
WSP GLOBAL INC	8,602	138.50	1,191,377.00
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	36.54	493,472.70
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	66.31	679,345.95
THOMSON REUTERS CORP	13,293	122.57	1,629,323.01
AIR CANADA	13,805	20.63	284,797.15
CANADIAN NATL RAILWAY CO	55,489	144.31	8,007,617.59
CP RAILWAY LIMITED	73,737	89.99	6,635,592.63
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	104.19	608,157.03
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	74.95	1,744,985.90
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	38.87	663,860.73
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	66.11	1,525,356.03
QUEBECOR INC -CL B	15,200	28.57	434,264.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	34.87	1,235,165.14
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,579	170.04	608,573.16
DOLLARAMA INC	22,000	70.17	1,543,740.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	67,467	54.92	3,705,287.64



EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	42.36	646,117.08
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	116.18	1,500,232.34
METRO INC	18,840	69.14	1,302,597.60
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	158.84	830,097.84
SAPUTO INC	20,898	26.04	544,183.92
BAUSCH HEALTH COS INC	20,800	16.78	349,024.00
CANOPY GROWTH CORP	20,989	7.23	151,750.47
BANK MONTREAL	51,389	132.49	6,808,528.61
BANK NOVA SCOTIA	96,500	81.40	7,855,100.00
CANADIAN IMPERIAL BANK	34,494	139.31	4,805,359.14
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	89.40	2,439,636.60
ROYAL BANK OF CANADA	110,677	127.73	14,136,773.21
TORONTO-DOMINION BANK	141,487	92.49	13,086,132.63
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	110,505	60.27	6,660,136.35
IGM FINANCIAL INC	7,685	36.48	280,348.80
ONEX CORP	6,603	71.94	475,019.82
TMX GROUP LTD	4,685	132.32	619,919.20
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	667.79	1,424,396.07
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	33.74	802,607.12
IA FINANCIAL CORP INC	10,099	66.42	670,775.58
INTACT FINANCIAL CORP	13,312	177.31	2,360,350.72
MANULIFE FINANCIAL CORP	147,886	24.53	3,627,643.58
POWER CORP OF CANADA	43,577	36.46	1,588,817.42
SUN LIFE FINANCIAL INC	45,702	64.10	2,929,498.20
FIRSTSERVICE CORP	2,690	155.63	418,644.70
BLACKBERRY LIMITED	39,400	6.67	262,798.00
CGI INC - CL A	16,178	102.59	1,659,701.02
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,527	1,922.75	2,936,039.25
LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	23.51	195,038.96
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	58.22	250,404.22
OPEN TEXT CORP	20,463	47.96	981,405.48
SHOPIFY INC - CLASS A	8,756	442.39	3,873,566.84
BCE INC	6,203	69.97	434,023.91
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	26,167	64.19	1,679,659.73
TELUS CORP	32,908	31.81	1,046,803.48
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	17.66	915,105.88
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	28.40	692,818.00
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	45.35	512,228.25
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	39.57	408,520.68
EMERA INC	18,723	63.00	1,179,549.00
FORTIS INC	36,823	63.96	2,355,199.08
HYDRO ONE LTD	23,269	35.59	828,143.71

	NORTHLAND POWER INC	17,854	38.46	686,664.84
	カナダドル 小計	3,100,298		188,806,588.51 (18,858,002,060)
ユーロ	ENI	197,669	13.07	2,585,115.18
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	27,945	10.25	286,436.25
	NESTE OIL OYJ	32,126	38.93	1,250,665.18
	OMV AG	12,549	45.51	571,104.99
	REPSOL SA	111,112	13.57	1,507,789.84
	TENARIS SA	40,648	13.98	568,259.04
	TOTALENERGIES SE	194,564	48.13	9,365,338.14
	AIR LIQUIDE	36,913	156.86	5,790,173.18
	AKZO NOBEL	15,301	79.20	1,211,839.20
	ARCELORMITTAL	55,231	25.95	1,433,244.45
	ARKEMA	4,369	111.70	488,017.30
	BASF SE	71,168	47.08	3,350,589.44
	COVESTRO AG	14,454	37.54	542,603.16
	CRH PLC	59,653	36.27	2,163,912.57
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	24.70	396,113.90
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	27.90	160,759.80
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	53.74	700,823.34
	KONINKLIJKE DSM NV	13,707	142.00	1,946,394.00
	LANXESS	7,293	34.24	249,712.32
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	37.78	736,861.12
	SOLVAY SA	5,356	90.24	483,325.44
	STORA ENSO OYJ R	42,169	17.47	736,692.43
	SYMRISE AG	9,776	98.40	961,958.40
	UMICORE	17,605	38.40	676,032.00
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	31.22	1,321,355.28
	VOESTALPINE AG	7,152	23.34	166,927.68
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	21,143	23.64	499,820.52
	AIRBUS SE	45,872	103.72	4,757,843.84
	ALSTOM	24,388	22.76	555,070.88
	BOUYGUES ORD	16,606	30.63	508,641.78
	BRENTAG SE	12,514	65.82	823,671.48
	CNH INDUSTRIAL NV	81,026	12.90	1,045,235.40
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,388	25.76	860,074.88
	DASSAULT AVIATION SA	2,130	155.60	331,428.00
	EIFFAGE	5,924	92.70	549,154.80
	FERROVIAL SA	33,914	22.98	779,343.72
	GEA GROUP AG	13,382	33.92	453,917.44
	IMCD NV	4,641	125.25	581,285.25
	KINGSPAN GROUP PLC	12,398	76.90	953,406.20

KION GROUP AG	5,887	46.74	275,158.38
KNORR-BREMSE AG	5,022	66.66	334,766.52
KONE OYJ-B	26,311	42.32	1,113,481.52
LEGRAND SA	21,768	78.02	1,698,339.36
MTU AERO ENGINES AG	3,962	179.30	710,386.60
PRYSMIAN SPA	21,155	28.06	593,609.30
RATIONAL AG	483	509.50	246,088.50
SAFRAN SA	26,190	92.28	2,416,813.20
SAINT-GOBAIN	40,093	51.80	2,076,817.40
SCHNEIDER ELECTRIC SE	41,726	121.90	5,086,399.40
SIEMENS	59,486	111.70	6,644,586.20
SIEMENS ENERGY AG	26,851	16.68	447,874.68
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	13.08	293,561.97
THALES SA	7,437	118.20	879,053.40
VINCI S.A.	41,084	89.34	3,670,444.56
WARTSILA OYJ	41,917	7.02	294,257.34
BUREAU VERITAS SA	25,073	25.46	638,358.58
RANDSTAD NV	7,558	47.75	360,894.50
TELEPERFORMANCE	4,734	304.70	1,442,449.80
WOLTERS KLUWER	20,839	93.32	1,944,695.48
ADP	2,382	130.95	311,922.90
AENA SME SA	5,508	129.55	713,561.40
ATLANTIA SPA	35,937	22.89	822,597.93
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	6.76	306,881.42
DEUTSCHE POST AG-REG	78,714	36.26	2,854,169.64
GETLINK	29,362	17.17	504,145.54
INPOST SA	12,480	5.66	70,686.72
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	77.62	2,026,425.34
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	70.40	351,366.40
CONTINENTAL AG	8,168	60.42	493,510.56
FAURECIA	10,948	19.55	214,088.14
FERRARI NV	10,170	182.00	1,850,940.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	66,777	60.56	4,044,015.12
MICHELIN	13,839	113.60	1,572,110.40
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	74.56	875,707.20
RENAULT SA	17,362	22.45	389,863.71
STELLANTIS NV	159,744	12.70	2,028,748.80
VALEO SA	21,538	16.84	362,699.92
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,282	142.72	2,038,327.04
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	190.80	474,328.80
ADIDAS AG	14,703	173.54	2,551,558.62
ESSILORLUXOTTICA	22,072	151.85	3,351,633.20

HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,015.00	2,577,085.00
KERING	5,855	442.45	2,590,544.75
LVMH	21,584	542.60	11,711,478.40
MONCLER SPA	14,361	41.83	600,720.63
PUMA SE	9,220	63.30	583,626.00
SEB SA	2,282	105.30	240,294.60
ACCOR	14,436	28.91	417,344.76
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,048	93.02	1,213,724.96
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	32.04	259,780.32
SODEXO	6,027	67.50	406,822.50
BOLLORE SE	83,646	4.55	380,589.30
PUBLICIS GROUPE	17,077	52.60	898,250.20
SCOUT24 SE	7,492	58.08	435,135.36
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	44.01	311,194.71
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	61,243	19.75	1,210,039.19
VIVENDI SE	61,243	10.85	664,792.76
DELIVERY HERO SE	13,414	25.64	343,934.96
INDITEX	87,326	20.07	1,752,632.82
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	18.57	289,296.61
PROSUS	72,497	40.06	2,904,592.30
ZALANDO SE	17,664	31.90	563,481.60
CARREFOUR	52,544	20.60	1,082,406.40
COLRUYT SA	5,424	34.26	185,826.24
HELLOFRESH SE	13,805	34.48	475,996.40
JERONIMO MARTINS	24,901	19.20	478,099.20
KESKO OYJ-B SHS	20,083	23.77	477,372.91
KONINKLIJKE AHOLD NV	79,170	27.66	2,189,842.20
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	68,711	50.92	3,498,764.12
DANONE (GROUPE)	51,543	55.89	2,880,738.27
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	9.56	469,274.27
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	70.95	656,358.45
HEINEKEN NV	20,157	90.18	1,817,758.26
JDE PEET'S BV	7,000	27.52	192,640.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	95.22	1,242,621.00
PERNOD-RICARD	15,976	176.20	2,814,971.20
REMY COINTREAU	1,382	164.20	226,924.40
BEIERSDORF AG	7,430	89.04	661,567.20
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	60.35	529,873.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	61.42	886,843.38
LOREAL	19,839	304.40	6,038,991.60
AMPLIFON SPA	11,650	33.59	391,323.50
BIOMERIEUX	3,044	88.38	269,028.72

CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	105.45	361,693.50
DIASORIN SPA	2,070	114.15	236,290.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	14,472	57.56	833,008.32
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	34.03	1,146,436.67
KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	23.44	1,682,295.97
ORPEA	4,336	30.79	133,505.44
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	314.90	574,377.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	49.70	1,071,879.90
ARGENX SE	3,428	277.60	951,612.80
BAYER	76,002	58.72	4,462,837.44
EUROAPI SASU	3,828	13.80	52,834.05
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	84.80	866,656.00
GRIFOLS SA	27,685	17.35	480,334.75
IPSEN	3,532	92.35	326,180.20
MERCK KGAA	10,555	163.45	1,725,214.75
ORION OYJ-CLASS B	9,854	35.22	347,057.88
QIAGEN N.V.	17,038	42.87	730,419.06
RECORDATI SPA	9,859	41.44	408,556.96
SANOFI	88,048	96.46	8,493,110.08
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,939	286.50	555,523.50
UCB (GROUPE)	9,389	99.46	933,829.94
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	10.97	438,132.97
BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	4.57	2,449,151.41
BANCO SANTANDER SA	1,339,491	2.60	3,482,676.60
BNP PARIBAS	86,730	49.85	4,323,490.50
CAIXABANK	330,447	2.93	969,861.94
COMMERZBANK AG	81,889	6.04	495,264.67
CREDIT AGRICOLE SA	89,515	9.90	886,198.50
ERSTE GROUP BANK AG	23,905	27.58	659,299.90
FINECOBANK SPA	53,120	11.74	623,894.40
ING GROEP NV-CVA	301,618	8.70	2,624,679.83
INTESA SANPAOLO	1,251,055	1.83	2,289,430.65
KBC GROEP NV	18,608	61.78	1,149,602.24
MEDIOBANCA	53,990	9.62	519,383.80
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	10.84	135,391.60
SOCIETE GENERALE	63,329	22.00	1,393,238.00
UNICREDIT SPA	168,352	8.02	1,350,351.39
AMUNDI SA	4,626	53.35	246,797.10
DEUTSCHE BANK NAMEN	160,613	8.95	1,438,450.02
DEUTSCHE BOERSE	14,999	158.65	2,379,591.35
EURAZEO SA	3,357	66.40	222,904.80
EURONEXT NV	6,480	70.62	457,617.60

EXOR NV	7,825	61.68	482,646.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	82.44	701,976.60
SOFINA	1,238	269.40	333,517.20
WENDEL	2,023	86.00	173,978.00
AEGON	114,647	4.73	543,312.13
AGEAS	11,086	43.31	480,134.66
ALLIANZ SE-REG	32,037	191.66	6,140,211.42
ASSICURAZIONI GENERALI	85,637	17.44	1,493,509.28
AXA SA	148,584	22.24	3,304,508.16
CNP ASSURANCES	16,287	20.90	340,398.30
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	137.20	594,487.60
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,795	213.70	2,306,891.50
NN GROUP NV	22,611	45.24	1,022,921.64
POSTE ITALIANE SPA	46,035	8.76	403,634.88
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	43.21	1,670,282.55
AROUNDTOWN SA	64,068	4.44	284,718.19
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	92.18	486,249.50
VONOVIA SE	59,080	32.71	1,932,506.80
ADYEN NV	1,566	1,403.40	2,197,724.40
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	58.28	2,073,835.52
BECHTLE AG	7,659	39.79	304,751.61
CAPGEMINI SA	12,715	177.75	2,260,091.25
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	37.74	1,991,426.58
EDENRED	18,664	44.45	829,614.80
NEMETSCHKE SE	5,455	61.74	336,791.70
NEXI SPA	31,458	9.24	290,671.92
SAP SE	81,213	90.77	7,371,704.01
WORLDLINE SA	20,332	35.65	724,835.80
NOKIA OYJ	427,600	4.55	1,949,642.20
CELLNEX TELECOM SA	41,435	40.16	1,664,029.60
DEUTSCHE TELEKOM	258,113	17.14	4,424,573.04
ELISA A	10,227	53.60	548,167.20
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.89	300,469.50
KPN (KON.)	282,927	3.31	938,185.93
ORANGE	153,815	11.64	1,790,714.23
PROXIMUS	13,141	16.42	215,775.22
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.25	216,718.71
TELEFONICA	417,939	4.63	1,935,475.50
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.85	281,535.18
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	30.38	289,004.94
E.ON SE	170,377	9.76	1,663,220.27
EDP RENOVAVEIS SA	21,466	20.07	430,822.62

	ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	8.05	318,381.17
	ELIA GROUP SA/NV	2,925	144.70	423,247.50
	ENAGAS	15,690	20.48	321,331.20
	ENDESA	25,972	19.29	500,999.88
	ENEL	617,915	5.87	3,629,014.79
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.34	980,219.52
	ENGIE	141,564	11.00	1,558,053.38
	FORTUM OYJ	32,550	14.99	487,924.50
	IBERDROLA SA	449,446	10.61	4,768,622.06
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	27.70	277,277.00
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	18.75	575,365.89
	RWE STAMM	49,680	40.03	1,988,690.40
	SNAM SPA	147,559	5.11	754,026.49
	TERNA SPA	102,810	7.45	766,345.74
	UNIPER SE	7,335	21.44	157,262.40
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,027	25.27	1,289,452.29
	VERBUND AG	6,430	82.60	531,118.00
	ASM INTERNATIONAL NV	3,483	259.50	903,838.50
	ASML HOLDING NV	32,248	486.75	15,696,714.00
	INFINEON TECHNOLOGIES	101,861	25.64	2,612,225.34
	STMICROELECTRONICS	55,076	33.40	1,839,538.40
	ユーロ 小計	14,432,177		322,565,224.93 (44,278,528,426)
イギリスポンド	BP PLC	1,555,608	4.04	6,297,101.18
	SHELL PLC-NEW	598,230	22.25	13,310,617.50
	ANGLO AMERICAN PLC	102,156	33.00	3,371,148.00
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	13.62	488,358.72
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	66.92	731,034.08
	GLENCORE PLC	767,331	4.58	3,518,596.30
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	22.78	383,797.44
	MONDI PLC	36,710	15.62	573,410.20
	RIO TINTO PLC REG	87,100	51.88	4,518,748.00
	ASHTREAD GROUP PLC	34,104	38.00	1,295,952.00
	BAE SYSTEMS PLC	260,104	7.44	1,935,693.96
	BUNZL PLC	24,880	29.90	743,912.00
	DCC PLC	6,622	60.46	400,366.12
	FERGUSON PLC	17,761	91.10	1,618,027.10
	MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	1.07	344,080.05
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	0.78	499,188.56
	SMITHS GROUP PLC	26,476	14.48	383,504.86
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	108.55	598,544.70
	EXPERIAN PLC	74,115	26.30	1,949,224.50

INTERTEK GROUP PLC	13,890	48.96	680,054.40
RELX PLC	149,517	22.99	3,437,395.83
RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	5.17	726,562.56
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.59	336,070.38
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7,688	38.57	296,526.16
BURBERRY GROUP PLC	29,776	14.89	443,513.52
PERSIMMON PLC	25,686	20.32	521,939.52
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.20	317,585.06
COMPASS GROUP PLC	142,427	15.76	2,245,361.65
ENTAIN PLC	49,630	12.48	619,630.55
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,541	47.41	594,568.81
WHITBREAD PLC	17,434	25.61	446,484.74
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	5.60	406,077.04
INFORMA PLC	110,598	5.43	601,210.72
PEARSON	66,305	7.57	502,326.68
WPP PLC	95,821	9.52	912,407.56
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.17	243,122.78
KINGFISHER PLC	153,717	2.42	371,995.14
NEXT PLC	11,468	59.04	677,070.72
OCADO GROUP PLC	35,862	7.83	280,942.90
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.33	345,620.55
TESCO PLC	601,050	2.75	1,655,892.75
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	15.60	401,544.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO	168,277	33.02	5,556,506.54
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	15.67	281,433.20
DIAGEO	180,509	37.27	6,728,472.97
IMPERIAL BRANDS PLC	76,080	16.52	1,257,222.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	54,630	63.20	3,452,616.00
UNILEVER PLC	201,915	36.36	7,341,629.40
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	12.51	858,123.45
ASTRAZENECA	120,234	101.40	12,191,727.60
GLAXOSMITHKLINE	388,893	17.36	6,754,293.62
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	16.97	279,224.38
BARCLAYS	1,339,545	1.45	1,955,467.79
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,583,882	4.92	7,803,786.61
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,443,807	0.42	2,305,180.07
NATWEST GROUP PLC	443,701	2.04	905,593.74
STANDARD CHARTERED PLC	212,446	5.47	1,162,079.62
3I GROUP PLC	74,757	12.35	923,248.95
ABRDN PLC	153,430	1.79	274,716.41
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	8.54	282,494.66
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	24,732	70.50	1,743,606.00



	M&G PLC	229,107	2.06	471,960.42
	SCHRODERS PLC	11,794	27.52	324,570.88
	ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	11.81	483,635.21
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	23.00	373,865.00
	AVIVA PIC	296,550	4.02	1,192,427.55
	LEGAL & GENERAL GROUP	460,759	2.35	1,083,705.16
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.71	291,317.71
	PRUDENTIAL	210,968	8.81	1,858,628.08
	AVEVA GROUP PLC	10,917	20.77	226,746.09
	SAGE GROUP PLC	76,660	6.69	512,855.40
	HALMA PLC	31,069	21.92	681,032.48
	BT GROUP PLC	716,738	1.73	1,243,898.79
	VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	1.18	2,617,474.45
	NATIONAL GRID PLC	286,046	11.79	3,372,482.34
	SEVERN TRENT PLC	22,468	29.58	664,603.44
	SSE PLC	81,663	18.04	1,473,608.83
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.78	631,492.40
	イギリスポンド 小計	22,479,764		139,586,936.53 (22,385,557,011)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	16.78	291,938.44
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	800.00	459,200.00
	GIVAUDAN-REG	748	3,457.00	2,585,836.00
	HOLCIM LTD	40,627	44.92	1,824,964.84
	SIKA AG-BR	10,926	258.60	2,825,463.60
	ABB LTD	127,656	27.86	3,556,496.16
	GEBERIT AG-REG	2,964	498.20	1,476,664.80
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,375	177.40	243,925.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	178.40	551,612.80
	VAT GROUP AG	1,956	261.60	511,689.60
	ADECCO GROUP AG-REG	10,450	33.88	354,046.00
	SGS SA	506	2,372.00	1,200,232.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	243.90	1,116,330.30
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,341	100.65	4,160,971.65
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	228.70	567,862.10
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	43.82	172,563.16
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,170.00	607,600.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	102,400.00	819,200.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	9,750.00	799,500.00
	NESTLE SA - REGISTERED	219,354	120.38	26,405,834.52
	ALCON INC	39,333	65.10	2,560,578.30
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,007	322.20	1,291,055.40
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	103.75	886,025.00

	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	68.15	126,077.50	
	LONZA GROUP AG-REG	5,895	519.60	3,063,042.00	
	NOVARTIS	170,286	83.38	14,198,446.68	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,799	374.20	1,047,385.80	
	ROCHE HOLDING GENUSS	54,689	346.00	18,922,394.00	
	VIFOR PHARMA AG/NEW	3,360	176.50	593,040.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	6.27	1,338,940.66	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	45.52	860,191.44	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	987.20	1,809,537.60	
	UBS GROUP AG	271,096	16.36	4,435,130.56	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,174	157.50	499,905.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	532.80	1,288,843.20	
	SWISS RE LTD	22,836	77.96	1,780,294.56	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,660	436.80	5,093,088.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	93.40	530,418.60	
	TEMENOS AG - REG	5,150	95.72	492,958.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	57.20	840,039.20	
	SWISSCOM	2,187	575.20	1,257,962.40	
	スイスフラン 小計	1,354,054		113,447,284.87 (14,858,190,899)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	409.80	7,057,575.60	
	BOLIDEN AB	18,479	372.80	6,888,971.20	
	SCA SV CELLULOSA B	43,887	174.95	7,678,030.65	
	ALFA LAVAL AB	27,268	248.40	6,773,371.20	
	ASSA ABLOY AB-B	78,158	228.30	17,843,471.40	
	ATLAS COPCO A	51,320	421.20	21,615,984.00	
	ATLAS COPCO B	31,902	364.90	11,641,039.80	
	EPIROC AB-A	46,999	175.15	8,231,874.85	
	EPIROC AB-B	28,804	150.80	4,343,643.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	85.42	3,306,779.04	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	216.70	3,034,233.40	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	178.70	3,211,239.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	107,624	81.42	8,762,746.08	
	SANDVIK AB	87,644	176.15	15,438,490.60	
	SKANSKA B	25,507	162.00	4,132,134.00	
	SKF AB-B	24,865	161.35	4,011,967.75	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	157.20	2,124,400.80	
	VOLVO B	111,799	153.06	17,111,954.94	
	SECURITAS B	29,533	99.76	2,946,212.08	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	148.90	3,166,954.10	
	EVOLUTION AB	14,096	908.90	12,811,854.40	
	EMBRACER GROUP AB	37,510	66.93	2,510,544.30	

	HENNES & MAURITZ B	55,229	118.68	6,554,577.72	
	SWEDISH MATCH AB	127,270	76.06	9,680,156.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	254.40	12,586,185.60	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	282.70	5,030,929.20	
	NORDEA BANK ABP	253,851	93.23	23,666,528.73	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	120,740	104.30	12,593,182.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	110,736	95.74	10,601,864.64	
	SWEDBANK AB-A	72,526	146.75	10,643,190.50	
	EQT AB	23,207	235.20	5,458,286.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	236.30	2,792,593.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	233.90	2,612,195.20	
	INVESTOR AB-A SHS	38,925	180.85	7,039,586.25	
	INVESTOR AB-B SHS	142,777	168.46	24,052,213.42	
	KINNEVIK AB - B	18,792	160.75	3,020,814.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	425.40	3,096,912.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	9,450	402.90	3,807,405.00	
	SAGAX AB-B	12,402	203.40	2,522,566.80	
	SINCH AB	44,150	39.15	1,728,693.25	
	ERICSSON (LM) B	225,508	76.19	17,181,454.52	
	HEXAGON AB-B SHS	153,838	112.15	17,252,931.70	
	TELE2 AB-B SHS	32,829	129.10	4,238,223.90	
	TELIA CO AB	230,643	39.73	9,163,446.39	
	スウェーデンクローナ 小計	2,658,493		369,967,409.21 (4,761,480,556)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	6,114	343.00	2,097,102.00	
	EQUINOR ASA	76,370	321.85	24,579,684.50	
	NORSK HYDRO	96,800	69.64	6,741,152.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	465.80	5,821,568.40	
	ADEVINTA ASA	19,117	56.30	1,076,287.10	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	152.00	1,409,648.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	169.10	1,197,566.20	
	MOWI ASA	31,968	245.10	7,835,356.80	
	ORKLA	69,804	75.32	5,257,637.28	
	DNB BANK ASA	71,795	176.75	12,689,766.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	192.30	3,571,780.20	
	TELENOR ASA	51,193	127.40	6,521,988.20	
	ノルウェークローネ 小計	470,589		78,799,536.93 (1,055,913,794)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	514.00	4,360,262.00	
	NOVOZYMES A/S	17,111	433.20	7,412,485.20	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,758.00	1,327,290.00	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	81,654	153.68	12,548,586.72	

	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	18,960.00	4,152,240.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	19,610.00	8,510,740.00	
	DSV A/S	16,380	1,039.00	17,018,820.00	
	PANDORA A/S	8,163	515.80	4,210,475.40	
	CARLSBERG AS-B	7,077	850.80	6,021,111.60	
	AMBU A/S-B	13,555	80.84	1,095,786.20	
	COLOPLAST-B	9,208	850.60	7,832,324.80	
	DEMANT A/S	8,512	276.80	2,356,121.60	
	GN STORE NORD A/S	9,226	216.90	2,001,119.40	
	GENMAB A/S	5,250	2,089.00	10,967,250.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	132,369	755.80	100,044,490.20	
	DANSKE BANK A/S	56,132	103.70	5,820,888.40	
	TRYG A/S	29,772	154.30	4,593,819.60	
	ORSTED A/S	15,439	692.80	10,696,139.20	
	デンマーククローネ 小計	419,739		210,969,950.32 (3,892,395,583)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	33.24	685,707.96	
	SANTOS	236,159	8.08	1,908,164.72	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	27.14	347,744.82	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,404	31.58	2,349,678.32	
	BHP GROUP LTD	397,288	46.21	18,358,678.48	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	18.11	629,684.70	
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	3.67	448,305.18	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	127,366	19.63	2,500,194.58	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	38.47	1,421,389.56	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	53.73	774,195.57	
	NEWCREST MINING LIMITED	61,178	26.01	1,591,239.78	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	9.06	920,749.68	
	ORICA LTD	38,288	15.83	606,099.04	
	RIO TINTO LTD	28,818	106.80	3,077,762.40	
	SOUTH32 LTD	341,133	4.63	1,579,445.79	
	REECE LTD	16,814	16.51	277,599.14	
	BRAMBLES LTD	108,007	10.47	1,130,833.29	
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	4.01	479,559.91	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.38	457,300.00	
	TRANSURBAN GROUP	233,493	14.15	3,303,925.95	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	31.38	1,450,069.80	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	12.85	389,714.80	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	67.60	239,371.60	
	IDP EDUCATION LTD	17,793	24.29	432,191.97	
	TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	5.10	928,266.30	
	REA GROUP LTD	3,586	107.28	384,706.08	

	SEEK LTD	28,001	24.60	688,824.60
	WESFARMERS LTD	87,120	49.06	4,274,107.20
	COLES GROUP LTD	108,486	18.79	2,038,451.94
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	7.65	840,742.65
	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	38.36	3,832,202.36
	TREASURY WINE ESTATES LTD	45,808	11.15	510,759.20
	COCHLEAR LIMITED	4,783	216.48	1,035,423.84
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	78.75	1,279,530.00
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	35.61	1,326,508.11
	CSL LIMITED	37,659	270.40	10,182,993.60
	AUST AND NZ BANKING GROUP	225,511	26.03	5,870,051.33
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	134,082	102.66	13,764,858.12
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	253,530	31.68	8,031,830.40
	WESTPAC BANKING	283,793	24.60	6,981,307.80
	ASX LTD	14,549	83.51	1,214,986.99
	MACQUARIE GROUP LIMITED	27,074	182.00	4,927,468.00
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	168,725	4.62	779,509.50
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.22	747,629.26
	QBE INSURANCE GROUP	111,591	12.42	1,385,960.22
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	11.28	1,070,065.92
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	24.15	1,071,680.40
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	39.33	542,793.33
	XERO LTD	11,340	84.34	956,415.60
	TELSTRA CORP	308,467	3.98	1,227,698.66
	ORIGIN ENERGY LIMITED	119,082	6.94	826,429.08
	オーストラリアドル 小計	5,112,487		122,080,807.53 (10,995,818,334)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.36	867,530.56
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	21.50	859,570.00
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	8.31	301,794.27
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.86	842,219.07
	MERCURY NZ LTD	64,613	5.65	365,063.45
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.57	505,186.08
	ニュージーランドドル 小計	542,443		3,741,363.43 (306,193,183)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	193,996	55.05	10,679,479.80
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	94.65	10,127,550.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	17.48	3,006,560.00
	MTR CORP	125,000	42.75	5,343,750.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	26.90	3,228,000.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	43.10	7,499,400.00
	SANDS CHINA LTD	198,000	16.50	3,267,000.00

	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	12.50	2,152,500.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	19.40	2,830,460.00	
	WH GROUP LTD	474,801	5.32	2,525,941.32	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	29.70	8,360,550.00	
	HANG SENG BANK	59,400	140.10	8,321,940.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,800	327.60	31,384,080.00	
	AIA GROUP LTD	933,800	74.00	69,101,200.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	53.70	8,833,435.20	
	ESR CAYMAN LTD	157,000	23.90	3,752,300.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	14.68	2,539,640.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	31.80	3,982,250.40	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	29.25	3,988,968.75	
	SINO LAND CO	315,400	10.66	3,362,164.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	92.80	10,022,400.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	44.75	1,812,375.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	18.96	1,823,952.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	36.55	4,349,450.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	52.75	3,560,625.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	76.00	10,450,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	8.54	7,725,770.78	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	54.05	6,053,600.00	
	香港ドル 小計	5,910,253		240,085,342.25 (3,975,813,267)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	137,300	6.69	918,537.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	4.11	605,814.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.32	576,326.24	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.79	485,850.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.29	766,194.00	
	DBS GROUP	141,500	32.90	4,655,350.00	
	OCBC BANK	257,100	11.88	3,054,348.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	29.25	2,746,575.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	45,100	9.53	429,803.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.92	876,120.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	8.09	346,252.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.04	334,400.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	17.50	449,750.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	584,543	2.75	1,607,493.25	
	シンガポールドル 小計	2,648,275		17,852,812.49 (1,667,988,270)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	42,053	35.32	1,485,311.96	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	684.00	1,467,864.00	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	28.96	2,847,057.60	

	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	32.64	3,553,320.96	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	18.69	1,859,655.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	109.00	1,362,827.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	256.00	1,106,688.00	
	NICE LTD	4,991	644.10	3,214,703.10	
	イスラエルシェケル 小計	372,690		16,897,427.62 (639,234,756)	
	合 計	84,508,981		480,038,355,349 (480,038,355,349)	

## (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	918,719.23	
		LENLEASE GROUP	64,786	736,616.82	
	オーストラリアドル 小計		147,479	1,655,336.05 (149,096,118)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,711,080.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	205,000	2,312,400.00	
	香港ドル 小計		425,500	4,023,480.00 (66,628,828)	
投資信託受益証券合計			572,979	215,724,946 (215,724,946)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	567,147.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,971	1,835,119.17	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	35,326	8,163,485.34	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	95,067	626,491.53	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,308,555.04	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	1,283,638.59	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	1,110,974.13	
		CROWN CASTLE INTL CORP	33,199	5,822,440.62	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	22,174	2,957,568.12	
		DUKE REALTY CORP	27,540	1,313,933.40	
		EQUINIX INC	7,120	4,657,832.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	983,482.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	27,140	1,988,276.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST	4,770	1,411,776.90	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,841,365.24	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,358,855.30	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,084,932.03			
INVITATION HOMES INC	46,840	1,677,808.80			

	IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,236,511.26	
	KIMCO REALTY CORP	47,897	1,118,394.95	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	895,644.40	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,403	1,491,868.62	
	PROLOGIS INC	57,379	7,595,258.23	
	PUBLIC STORAGE	12,441	3,902,617.29	
	REALTY INCOME CORP	44,162	2,851,098.72	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	837,486.34	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,773,167.30	
	SIMON PROPERTY GROUP	25,518	3,015,972.42	
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,430,185.05	
	UDR INC	24,265	1,157,197.85	
	VENTAS INC	31,565	1,755,960.95	
	VICI PROPERTIES INC	75,321	2,053,250.46	
	VORNADO REALTY TRUST	11,390	403,889.40	
	WELLTOWER INC	32,739	2,850,257.34	
	WP CAREY INC	14,258	1,092,305.38	
	アメリカドル 小計	1,002,602	77,454,748.97 (10,071,441,008)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	226,707.93	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	338,146.70	
	カナダドル 小計	20,377	564,854.63 (56,417,680)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	320,049.00	
	GECINA SA	3,139	317,039.00	
	KLEPIERRE	17,225	372,232.25	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	703,098.75	
	ユーロ 小計	35,781	1,712,419.00 (235,063,756)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	380,790.13	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	46,289	323,467.53	
	SEGRO PLC	93,383	1,001,999.59	
	イギリスポンド 小計	219,086	1,706,257.25 (273,632,475)	
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	1,011,467.50	
	GOODMAN GROUP	133,807	2,563,742.12	
	GPT GROUP	167,884	794,091.32	
	MIRVAC GROUP	266,683	576,035.28	
	SCENTRE GROUP	382,183	1,039,537.76	
	STOCKLAND	207,412	798,536.20	
	VICINITY CENTERS	365,149	653,616.71	
	オーストラリアドル 小計	1,617,208	7,437,026.89 (669,853,011)	



香港ドル	LINK REIT	170,500	11,423,500.00	
香港ドル 小計		170,500	11,423,500.00	(189,173,160)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	792,745.02	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	340,429	769,369.54	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	6,805	9,050.65	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	409,200.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	475,757.52	
シンガポールドル 小計		1,134,561	2,456,122.73	(229,475,546)
投資証券合計		4,200,115	11,725,056,636	(11,725,056,636)
合計			11,940,781,582	(11,940,781,582)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 606銘柄	97.2%			71.6%
	投資証券 35銘柄			2.8%	2.0%
カナダドル	株式 86銘柄	99.7%			3.8%
	投資証券 2銘柄			0.3%	0.0%
ユーロ	株式 228銘柄	99.5%			9.0%
	投資証券 4銘柄			0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 78銘柄	98.8%			4.6%
	投資証券 3銘柄			1.2%	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%			1.0%
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 51銘柄	93.1%			2.2%
	投資信託受 益証券 2銘柄		1.3%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.7%	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	94.0%			0.8%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.6%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.5%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	87.9%			0.3%
	投資証券 5銘柄			12.1%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 5月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
<b>流動資産</b>	
預金	6,058,046,696
コール・ローン	233,434,703
株式	95,924,181,684
投資信託受益証券	218,554,568
投資証券	140,431,459
派生商品評価勘定	2,541
未収入金	73,652,708
未収配当金	171,056,316
前払金	467,515,713
差入委託証拠金	456,768,170
流動資産合計	103,743,644,558
<b>資産合計</b>	103,743,644,558
<b>負債の部</b>	
<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	468,633,272
未払金	17,561
未払解約金	28,438,134
未払利息	121
流動負債合計	497,089,088
<b>負債合計</b>	497,089,088
<b>純資産の部</b>	
<b>元本等</b>	
元本	30,068,082,545
剰余金	

	2022年 5月10日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	73,178,472,925
元本等合計	103,246,555,470
純資産合計	103,246,555,470
負債純資産合計	103,743,644,558

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 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 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 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>

2022年 5月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2022年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	30,068,082,545口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.4338円 (1万口当たり純資産額) (34,338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 5月10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>

2022年 5月10日現在	
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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	<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 5月10日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</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つた場合、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 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月11日
期首元本額	28,114,813,263円
期中追加設定元本額	2,478,500,480円
期中一部解約元本額	525,231,198円
期末元本額	30,068,082,545円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国株式インデックス・オープン	7,824,998,958円
世界経済インデックスファンド	5,712,823,751円
D C 新興国株式インデックス・オープン	5,239,907,412円
D C 世界経済インデックスファンド	5,278,329,401円
新興国株式インデックス・オープン（S M A専用）	164,818,473円
分散投資コア戦略ファンドA	223,488,884円
分散投資コア戦略ファンドS	1,291,777,359円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	725,887,188円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	596,758,089円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	336,478,580円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	16,838,222円
S M T インデックスバランス・オープン	83,279,002円
S M T 世界経済インデックス・オープン	155,102,058円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	607,090,686円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	105,131,848円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	4,367,407円
グローバル経済コア	352,360,328円
i - S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	43,792,314円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	16,236,738円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	13,932,756円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	5,572,097円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	7,092,897円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,021,924,252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）	183,179,440円

区分	2022年 5月10日現在
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	45,529,298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）	11,385,107円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	19,142,566,659
投資信託受益証券	24,752,570
投資証券	4,658,325
合計	19,162,660,904

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2022年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	7,421,602,682	-	6,954,086,969	467,515,713
	合計	7,421,602,682	-	6,954,086,969	467,515,713

## (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 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	215,764,630	-	214,647,311	1,117,319
	アメリカドル	215,764,630	-	214,647,311	1,117,319
	売建	106,630	-	104,329	2,301

	ブラジルリアル	106,630	-	104,329	2,301
	合計	215,871,260	-	214,751,640	1,115,018

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	655,305	0.29	190,366.10	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	44,089	0.36	15,872.04	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	10,590	0.32	3,442.80	
	ROSNEFT OJSC-GDR	134,073	0.30	40,342.56	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	123,206	0.23	28,953.41	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	29,910	1.17	35,144.25	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	7.66	129,683.80	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	72,204	0.94	68,232.78	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	19,598	0.15	3,098.44	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,818	0.02	699.94	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,938	1.95	15,479.10	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.03	1,165.12	
	SOUTHERN COPPER CORP	9,585	58.38	559,572.30	
	DIDI GLOBAL INC	34,321	1.56	53,540.76	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	53,727	23.81	1,279,239.87	
	LI AUTO INC - ADR	60,121	18.90	1,136,286.90	
	NIO INC - ADR	147,534	13.55	1,999,085.70	
	XPENG INC - ADR	43,999	20.04	881,739.96	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	19,163	25.36	485,973.68	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	15,618	10.20	159,303.60	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	41,058	3.32	136,312.56	
	TRIP.COM GROUP LTD	55,661	19.71	1,097,078.31	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	50,479	38.21	1,928,802.59	
	AUTOHOME INC-ADR	6,571	25.35	166,574.85	
BAIDU INC - SPON ADR	31,841	106.62	3,394,887.42		
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	18,268	18.80	343,438.40		



HELLO GROUP INC -SPN ADR	15,529	4.80	74,539.20
IQIYI INC-ADR	28,984	2.86	82,894.24
JOYY INC	6,185	35.68	220,711.72
KANZHUN LTD	6,900	17.53	120,957.00
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	3.80	431,478.60
VK CO LTD	19,368	0.42	8,289.50
WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	20.01	105,032.49
YANDEX NV-A	32,725	9.47	309,905.75
DADA NEXUS LTD-ADR	7,696	5.99	46,099.04
OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	5.80	43,633.40
PINDUODUO INC-ADR	53,748	34.95	1,878,492.60
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	52,765	6.97	367,772.05
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	39,926	0.00	247.54
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	68,136	1.71	116,512.56
BEIGENE LTD-ADR	4,929	134.22	661,570.38
HUTCHMED CHINA-ADR	7,243	9.95	72,067.85
I-MAB-SPONSORED ADR	2,944	10.77	31,706.88
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	3,311	33.54	111,050.94
ZAI LAB LTD-ADR	12,825	25.56	327,807.00
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	189,281	2.27	430,614.27
CREDICORP LTD	7,637	125.87	961,269.19
SBERBANK-SPONSORED ADR	285,355	0.02	6,463.29
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	1.59	22,421.24
VTB BANK PJSC -GDR-REG S	378,037	0.50	189,018.50
360 DIGITECH INC	8,061	12.22	98,505.42
LUFAX HOLDING LTD-ADR	75,232	4.72	355,095.04
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	16.47	33,285.87
KE HOLDINGS INC	49,295	11.37	560,484.15
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	0.90	48,988.80
CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	12,493	5.74	71,709.82
GDS HOLDINGS LTD - ADR	15,167	25.85	392,066.95
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	5,558	3.03	16,840.74
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	36,600	3.72	136,335.00
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT-SP ADR	39,854	2.75	109,598.50
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	38.04	298,043.40
アメリカドル 小計	3,437,815		22,895,826.16 (2,977,144,275)
メキシコペソ			
CEMEX SAB-SPONS	2,052,361	8.13	16,685,694.93
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	377,892	94.13	35,570,973.96
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	201.43	2,920,735.00
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	48.59	4,706,038.68
ALFA S.A.B. -A	313,500	13.41	4,204,035.00

	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	65.22	2,445,750.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	415.00	9,671,575.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	43,680	277.22	12,108,969.60	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	143.39	6,120,602.15	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	288,490	32.66	9,422,083.40	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	58.70	1,843,180.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	567,680	69.48	39,442,406.40	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	128.99	6,510,770.25	
	BEACLE SAB DE CV	48,100	48.81	2,347,761.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	207,440	141.15	29,280,156.00	
	GRUMA S.A.B.-B	25,960	246.31	6,394,207.60	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	60.33	10,967,994.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	27.55	5,008,590.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	282,600	133.15	37,628,190.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	252,500	34.23	8,643,075.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,658,740	18.91	69,186,773.40	
	メキシコペソ 小計	8,779,260		321,109,561.37 (2,043,541,248)	
ブラジルリアル	COSAN SA	118,300	17.63	2,085,629.00	
	PETRO RIO SA	84,700	24.22	2,051,434.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	435,900	34.26	14,933,934.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	544,440	32.16	17,509,190.40	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	11.99	906,444.00	
	BRASKEM SA-PREF A	19,300	40.49	781,457.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	19.07	1,201,410.00	
	GERDAU SA-PREF	141,800	27.54	3,905,172.00	
	SUZANO SA	90,079	50.37	4,537,279.23	
	VALE SA	467,987	76.49	35,796,325.63	
	WEG SA	217,544	26.66	5,799,723.04	
	CCR SA	125,600	11.76	1,477,056.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	61,952	51.71	3,203,537.92	
	RUMO SA	159,700	15.45	2,467,365.00	
	ALPARGATAS SA - PREF	28,600	20.94	598,884.00	
	AMERICANAS SA	39,740	20.86	828,976.40	
	LOJAS RENNER S.A.	115,947	23.89	2,769,973.83	
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	3.91	1,194,505.00	
	VIBRA ENERGIA SA	134,600	19.41	2,612,586.00	
	ATACADA0 DISTRIBUICAO COMERC	41,500	19.07	791,405.00	
	RAIA DROGASIL SA	122,500	18.93	2,318,925.00	
	AMBEV SA	534,900	13.69	7,322,781.00	
	BRF SA	52,500	12.32	646,800.00	
	JBS SA	110,000	36.11	3,972,100.00	

	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	15.24	1,528,693.92	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	510,254	8.12	4,143,262.48	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	45,600	34.43	1,570,008.00	
	HYPERA SA	35,300	35.46	1,251,738.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	261,323	15.07	3,938,137.61	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	584,982	18.37	10,746,119.34	
	BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	33.94	2,996,902.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	575,881	23.45	13,504,409.45	
	ITAUSA SA	528,325	8.78	4,638,693.50	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	715,509	11.74	8,400,075.66	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	25.38	1,751,220.00	
	TOTVS SA	57,900	25.00	1,447,500.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	50.91	2,662,593.00	
	TIM SA	96,100	13.20	1,268,520.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	38.53	1,425,610.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,600	38.95	1,308,720.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	148,027	10.33	1,529,118.91	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	34,700	45.24	1,569,828.00	
	ENGIE BRASIL SA	29,250	42.69	1,248,682.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	133,600	24.32	3,249,152.00	
	ブラジルリアル 小計	8,228,948		189,891,877.82	(4,783,262,467)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	5,989.00	267,887,970.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,255.00	170,636,075.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	15,220	64,520.00	981,994,400.00	
	FALABELLA SA	70,837	2,260.00	160,091,620.00	
	CENCOSUD SA	137,988	1,319.00	182,006,172.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	5,642.00	41,666,170.00	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	84.20	409,434,288.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,718	26,000.00	148,668,000.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	40.10	251,820,822.10	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	91.80	320,502,717.00	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	22.85	58,525,202.30	
	チリペソ 小計	17,612,897		2,993,233,436.40	(448,003,234)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	3,095.00	1,513,390,005.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	39,150.00	1,150,070,400.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	37,000.00	2,277,905,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	41,200.00	857,784,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	21,000.00	1,060,731,000.00	
	コロンビアペソ 小計	651,251		6,859,880,405.00	(218,089,317)

ユーロ	OPAP SA	18,496	13.25	245,072.00	
	JUMBO SA	19,341	13.99	270,580.59	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	0.98	258,394.64	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	282,775	0.89	254,214.72	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	17.84	467,532.88	
	PUBLIC POWER CORP	20,834	6.66	138,754.44	
ユーロ 小計		631,321		1,634,549.27	(224,374,578)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	245.30	2,846,215.90	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	33.52	3,913,627.60	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	23.74	2,363,696.84	
	KOC HOLDING AS	89,884	40.14	3,607,943.76	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	19.26	5,753,886.48	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	295.90	1,923,645.90	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	82.50	3,532,980.00	
	AKBANK T.A.S.	276,321	8.66	2,392,939.86	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	14.99	3,597,480.08	
	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	10.82	1,871,989.84	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	20.64	2,953,398.24	
トルコリラ 小計		1,498,297		34,757,804.50	(299,160,423)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	750.00	5,597,250.00	
	MONETA MONEY BANK AS	62,031	84.60	5,247,822.60	
	CEZ AS	18,145	1,010.00	18,326,450.00	
チェココルナ 小計		87,639		29,171,522.60	(159,970,795)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	75,582	2,878.00	217,524,996.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	6,805.00	103,286,290.00	
	OTP BANK NYRT	31,101	10,325.00	321,117,825.00	
ハンガリーフォリント 小計		121,861		641,929,111.00	(231,602,887)
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	75.42	2,316,374.46	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	200,051	6.10	1,220,711.20	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	120.15	2,425,347.90	
	LPP SA	124	8,650.00	1,072,600.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	115.06	771,362.24	
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	22.88	825,922.24	
	ALLEGRO.EU SA	39,203	22.29	874,030.88	
	DINO POLSKA SA	5,945	267.30	1,589,098.50	
	BANK PEKAO SA	23,647	87.14	2,060,599.58	
	M BANK SA	1,423	260.40	370,549.20	
	PKO BANK POLSKI SA	93,312	30.02	2,801,226.24	

	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	237.00	856,755.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	94,203	29.67	2,795,003.01	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	6.19	344,856.96	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	9.29	589,877.84	
	ポーランドズロチ 小計	674,378		20,914,315.25	(611,235,503)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	6.40	2,105,600.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	7.96	1,528,320.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,915,400	3.91	11,399,214.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	411,500	24.45	10,061,175.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	236,000	4.07	960,520.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,648,000	3.95	10,459,600.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	142,000	21.45	3,045,900.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	3.18	1,081,200.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	144,500	42.00	6,069,000.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	219,000	8.98	1,966,620.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	468,000	3.79	1,773,720.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	10.18	4,194,160.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	6.04	1,739,520.00	
	DONGYUE GROUP	147,000	9.15	1,345,050.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	26,200	86.20	2,258,440.00	
	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	101,000	4.01	405,010.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	11.56	959,480.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	3.59	595,940.00	
	MMG LIMITED	304,000	3.00	912,000.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	6.67	860,430.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	50,750	13.54	687,155.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	10.54	7,683,660.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	4.03	1,108,250.00	
	BOC AVIATION LTD	23,800	61.05	1,452,990.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.56	697,760.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	20.30	3,237,850.00	
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	9.08	1,162,240.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	474,000	5.58	2,644,920.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	10.06	1,710,200.00	
	CITIC LTD	617,000	8.04	4,960,680.00	
	CRRC CORP LTD-H	409,000	2.88	1,177,920.00	
	FOSUN INTERNATIONAL	288,000	7.56	2,177,280.00	
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	19.92	1,553,760.00	
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	7.11	1,137,600.00	
	SINOTRUK HONG KONG LTD	54,500	8.61	469,245.00	
	WEICHAO POWER CO LTD-H	211,800	10.38	2,198,484.00	

XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	141,216	11.00	1,553,376.00
ZHUZHOU CRRR TIMES ELECTRIC	62,300	29.40	1,831,620.00
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	4.56	529,872.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	4.63	1,782,892.62
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	4.93	1,055,020.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	4.10	1,016,800.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	13.48	2,231,573.56
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.04	711,040.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	12.38	6,413,459.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	5.45	1,366,718.30
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	156,000	7.61	1,187,160.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	8.49	1,086,057.78
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	6.43	565,840.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	5.47	2,014,800.00
BYD CO LTD-H	97,000	228.60	22,174,200.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	5.57	1,481,620.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	31.45	1,836,680.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	630,000	11.60	7,308,000.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	9.72	3,428,730.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	6.41	2,296,985.04
MINTH GROUP LTD	64,000	18.00	1,152,000.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	108,000	11.66	1,259,280.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	121,000	83.50	10,103,500.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	3.84	1,681,920.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	244,600	26.90	6,579,740.00
LI NING CO LTD	264,000	55.00	14,520,000.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	99,600	97.50	9,711,000.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	70,000	6.25	437,500.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	116,000	13.58	1,575,280.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	57,000	15.44	880,080.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	68,400	13.38	915,192.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	0.62	899,000.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	30.45	1,571,220.00
KINGSOFT CORP LTD	92,000	23.20	2,134,400.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	52,300	60.10	3,143,230.00
NETEASE INC	235,230	141.30	33,237,999.00
TENCENT HOLDINGS LTD	655,100	349.20	228,760,920.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,730,088	90.35	156,313,450.80
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	422,000	3.79	1,599,380.00
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	54,000	23.75	1,282,500.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	268,000	1.93	517,240.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,206,958	0.37	446,574.46

JD HEALTH INTERNATIONAL INC	47,300	41.05	1,941,665.00
JD.COM INC - CL A	205,611	226.60	46,591,452.60
MEITUAN-CLASS B	466,200	157.00	73,193,400.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	17.08	917,196.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	5.55	632,700.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	68,000	49.75	3,383,000.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	259,000	2.28	590,520.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	104.71	1,591,592.00
CHINA FEIHE LTD	346,000	7.03	2,432,380.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	370,000	38.60	14,282,000.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	182,000	40.90	7,443,800.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	3.96	974,160.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	193,000	39.95	7,710,350.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	15.56	3,034,200.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	14.46	3,296,880.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	68,000	58.70	3,991,600.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	6.63	530,400.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	6.95	3,892,000.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	20.15	967,200.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	36.45	3,189,375.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	19.04	476,000.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	35,200	33.90	1,193,280.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	124,000	4.51	559,240.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	13.20	871,200.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	7.84	1,912,960.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	11.78	1,512,552.00
SINOPHARM GROUP CO-H	125,200	17.68	2,213,536.00
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	20,500	11.12	227,960.00
3SBIO INC	119,000	5.22	621,180.00
AKESO INC	25,000	12.18	304,500.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	10,000	73.20	732,000.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	10.62	2,623,140.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	956,160	7.71	7,371,993.60
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	3.74	620,840.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	18.66	2,463,120.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	70.75	360,825.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	12.28	1,498,160.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	139,000	19.64	2,729,960.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	22,300	84.80	1,891,040.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	32.55	2,376,150.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,113,000	3.76	4,184,880.00

WUXI APPTTEC CO LTD-H	42,288	96.05	4,061,762.40
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	423,000	50.40	21,319,200.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,825,000	2.93	8,277,250.00
BANK OF CHINA LTD-H	8,801,200	3.04	26,755,648.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	5.21	5,723,054.75
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	366,500	1.22	447,130.00
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.66	3,481,392.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	10,797,620	5.50	59,386,910.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.73	1,023,750.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	429,923	44.05	18,938,108.15
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	2.87	1,935,528.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,699,515	4.58	30,683,778.70
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,059,000	6.04	6,396,360.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.27	1,056,640.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.08	1,970,640.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	203,600	13.50	2,748,600.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	16.18	4,623,839.50
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	6.27	1,504,800.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	9.47	839,042.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	5.28	1,886,016.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	135,600	9.99	1,354,644.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	918,000	11.28	10,355,040.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	16.74	6,471,684.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	8.41	1,547,641.84
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	18.92	1,823,888.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.48	2,328,720.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	7.75	5,341,982.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	727,000	48.65	35,368,550.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	25.25	1,153,925.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	2.38	1,375,640.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	415,540	23.55	9,785,967.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	80,000	8.87	709,600.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	367,111	34.20	12,555,196.20
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	67,600	36.65	2,477,540.00
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	17.70	3,157,680.00
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	64,000	9.04	578,560.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	564,000	3.33	1,878,120.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,016,654	4.86	4,940,938.44
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	232,000	28.55	6,623,600.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	13.14	952,650.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	7.07	1,272,600.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	66,000	14.28	942,480.00



	KWG GROUP HOLDINGS LTD	152,500	2.87	437,675.00	
	LONGFOR PROPERTIES	197,000	37.40	7,367,800.00	
	SEAZEN GROUP LTD	204,000	3.13	638,520.00	
	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	4.42	585,650.00	
	SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	75,000	4.20	315,000.00	
	SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	163,000	3.65	594,950.00	
	WHARF HOLDINGS	154,000	22.00	3,388,000.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	115,600	7.84	906,304.00	
	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	6.19	1,708,440.00	
	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	311,000	15.14	4,708,540.00	
	MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	88,000	9.78	860,640.00	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	11.44	903,760.00	
	WEIMOB INC	149,000	4.30	640,700.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	16.64	1,189,760.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	60,500	13.98	845,790.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	35.05	2,348,350.00	
	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	12.08	833,520.00	
	LENOVO GROUP LTD	732,000	7.84	5,738,880.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	76,800	100.10	7,687,680.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	1,405,800	11.10	15,604,380.00	
	ZTE CORP-H	82,908	15.24	1,263,517.92	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	0.88	4,018,080.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	26.15	1,555,925.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	2.50	1,525,000.00	
	CGN POWER CO LTD-H	791,000	2.07	1,637,370.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	9.03	4,211,592.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	339,000	14.66	4,969,740.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	3.49	2,324,340.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,000	28.85	3,058,100.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	13.50	2,367,900.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	83,300	105.70	8,804,810.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	320,000	9.80	3,136,000.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	3.72	1,376,400.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	360,000	6.39	2,300,400.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	28.10	1,798,400.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	28.30	1,273,500.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	531,987	11.50	6,117,850.50	
	香港ドル 小計	94,441,182		1,280,804,491.16 (21,210,122,373)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.42	1,001,076.56	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	21.64	543,164.00	

	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	10.00	2,699,000.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	288,600	5.20	1,500,720.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	7.35	280,770.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.30	773,595.80	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	6.57	700,322.58	
	MISC BHD	125,040	7.72	965,308.80	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.96	277,200.00	
	GENTING BHD	426,900	4.57	1,950,933.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	3.08	1,138,676.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	5,800	21.90	127,020.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	4.39	1,186,792.60	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	78,646	27.30	2,147,035.80	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	131.40	946,080.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	16.38	1,203,602.40	
	QL RESOURCES BHD	124,800	4.80	599,040.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.92	1,215,466.32	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	181,300	4.28	775,964.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	6.36	1,458,348.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	1.58	797,742.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	3.64	1,094,548.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	849,475	5.10	4,332,322.50	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	20.50	1,256,486.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	19.18	319,020.94	
	MALAYAN BANKING BHD	571,105	9.00	5,139,945.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	1,675,000	4.56	7,638,000.00	
	RHB BANK BHD	210,820	6.04	1,273,352.80	
	INARI AMERTRON BHD	274,700	2.65	727,955.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	3.36	958,571.04	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	3.46	1,078,482.00	
	MAXIS BHD	267,900	3.69	988,551.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	4.82	1,308,880.64	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	16.88	1,274,440.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	305,275	8.96	2,735,264.00	
	マレーシアリングット 小計	9,669,801		52,413,676.78 (1,554,762,618)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	154.50	31,023,600.00	
	PTT PCL-NVDR	1,197,400	37.00	44,303,800.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	58.75	7,055,875.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	43.75	9,030,000.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	49.00	11,021,766.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	100,600	52.00	5,231,200.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	102,600	362.00	37,141,200.00	

	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	527,000	66.25	34,913,750.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	7.95	6,495,150.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	8.65	7,002,175.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	4.84	3,921,852.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	33.75	12,242,407.50	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	38.50	7,014,700.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	471,035	14.40	6,782,904.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	289,000	25.25	7,297,250.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	35.25	6,260,400.00	
	CP ALL PCL-NVDR	691,700	64.00	44,268,800.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	101.50	4,699,450.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	23.30	12,964,120.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	33.00	2,178,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	184,900	16.60	3,069,340.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,176,900	24.70	29,069,430.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	162.50	13,438,750.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	73,600	19.30	1,420,480.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	14.60	6,404,290.00	
	SCB X PCL-NVDR	88,700	110.50	9,801,350.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	18.10	2,988,310.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	57.25	5,810,875.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	42.50	3,816,500.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	49.25	3,757,775.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	60.75	13,747,725.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	8.70	7,586,400.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	38,900	332.00	12,914,800.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	205.00	24,538,500.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	70.50	8,590,425.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	4.28	4,114,830.52	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	29.75	1,588,650.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	16,900	161.00	2,720,900.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	83.00	18,251,700.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	59.75	4,074,950.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	288,200	45.75	13,185,150.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	40.75	2,212,725.00	
	タイパーツ 小計	13,478,816		493,952,255.02 (1,857,260,478)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	50.50	12,015,970.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	730.00	20,644,400.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	506.00	3,470,148.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	303,513	53.80	16,328,999.40	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	845.50	19,281,627.50	

	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	96,110	220.20	21,163,422.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	217.40	13,263,574.00	
	MONDE NISSIN CORP	490,500	13.38	6,562,890.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	109.00	10,416,040.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	212,515	94.40	20,061,416.00	
	BDO UNIBANK INC	219,911	128.00	28,148,608.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	52.85	8,524,017.95	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	3.79	8,928,103.00	
	AYALA LAND INC	794,100	32.50	25,808,250.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,348,750	35.20	47,476,000.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	2,464.00	11,556,160.00	
	PLDT INC	10,460	1,890.00	19,769,400.00	
	AC ENERGY CORP	737,000	7.60	5,601,200.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	344.00	10,013,840.00	
	フィリピンペソ 小計	7,216,099		309,034,065.85 (762,850,591)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	1,439,300	3,160.00	4,548,188,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	29,225.00	5,871,302,500.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	2,530.00	2,494,074,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	820.00	2,363,650,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	7,325.00	1,788,765,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	10,000.00	1,900,000,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	4,950.00	8,035,320,150.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	6,125.00	2,116,800,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,218,400	7,050.00	15,639,720,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	792,300	4,930.00	3,906,039,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	30,300.00	1,805,880,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	7,400.00	1,191,400,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,125.00	2,628,237,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	4,010.00	2,993,064,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,530.00	4,216,527,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	6,307,600	7,600.00	47,937,760,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	474,900	10,850.00	5,152,665,000.00	
	BANK MANDIRI	2,163,796	8,325.00	18,013,601,700.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	8,825.00	7,150,015,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	8,237,202	4,530.00	37,314,525,060.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	970.00	2,755,382,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,601,300	4,310.00	24,141,603,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,076,100	3,010.00	3,239,061,000.00	
	インドネシアルピア 小計	42,585,995		207,203,579,910.00 (1,844,111,861)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	6,593	48,450.00	319,430,850.00	

HD HYUNDAI	5,180	59,200.00	306,656,000.00
S-OIL CORPORATION	4,447	111,500.00	495,840,500.00
SK INNOVATION CO LTD	5,647	204,500.00	1,154,811,500.00
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	12,381	31,450.00	389,382,450.00
HYUNDAI STEEL CO	11,189	42,000.00	469,938,000.00
KOREA ZINC CO LTD	783	552,000.00	432,216,000.00
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	145,000.00	275,210,000.00
LG CHEM LTD	5,403	504,000.00	2,723,112,000.00
LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	255,000.00	223,635,000.00
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	192,000.00	370,560,000.00
POSCO CHEMICAL CO LTD	3,350	127,000.00	425,450,000.00
POSCO HOLDINGS INC	9,290	281,000.00	2,610,490,000.00
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	1,122	122,500.00	137,445,000.00
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	4,038	115,500.00	466,389,000.00
SKC CO LTD	1,734	147,000.00	254,898,000.00
CJ CORP	1,230	83,700.00	102,951,000.00
DOOSAN BOBCAT INC	4,308	41,300.00	177,920,400.00
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	42,494	20,950.00	890,249,300.00
ECOPRO BM CO LTD	1,170	481,000.00	562,770,000.00
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	40,300.00	272,428,000.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	43,400.00	423,931,200.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,139	48,800.00	348,383,200.00
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	88,500.00	385,329,000.00
LG CORP	9,026	71,800.00	648,066,800.00
LG ENERGY SOLUTION	2,553	394,000.00	1,005,882,000.00
SAMSUNG C&T CORP	11,910	113,000.00	1,345,830,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	26,650.00	493,451,400.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	59,306	5,720.00	339,230,320.00
SK INC	4,545	248,500.00	1,129,432,500.00
S-1 CORPORATION	840	67,900.00	57,036,000.00
CJ LOGISTICS	862	118,500.00	102,147,000.00
HMM CO LTD	35,545	29,400.00	1,045,023,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,586	207,500.00	329,095,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	23,739	29,600.00	702,674,400.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	7,030.00	209,044,080.00
HANKOOK TIRE & TECHONLOGY CO	7,066	33,150.00	234,237,900.00
HANON SYSTEMS	19,000	10,850.00	206,150,000.00
HYUNDAI MOBIS	7,116	201,000.00	1,430,316,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	14,897	181,500.00	2,703,805,500.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,051	92,500.00	282,217,500.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	91,300.00	314,893,700.00
KIA CORP	29,259	82,600.00	2,416,793,400.00

COWAY CO LTD	5,058	70,400.00	356,083,200.00
F&F CO LTD / NEW	1,600	125,000.00	200,000,000.00
HLB INC	10,012	29,500.00	295,354,000.00
LG ELECTRONICS INC	13,527	113,000.00	1,528,551,000.00
KANGWON LAND INC	7,703	25,750.00	198,352,250.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	25,400.00	128,778,000.00
CJ ENM CO LTD	830	120,900.00	100,347,000.00
HYBE CO LTD	1,547	235,500.00	364,318,500.00
KAKAO CORP	34,497	84,100.00	2,901,197,700.00
KAKAO GAMES CORP	3,021	56,900.00	171,894,900.00
KRAFTON INC	2,345	251,500.00	589,767,500.00
NAVER CORP	14,614	275,000.00	4,018,850,000.00
NCSOFT CORPORATION	1,939	411,000.00	796,929,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	88,700.00	218,645,500.00
PEARL ABYSS CORP	4,605	60,700.00	279,523,500.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	76,600.00	233,706,600.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	94,300.00	97,506,200.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	187,000.00	102,663,000.00
EMART	1,864	126,000.00	234,864,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	377,500.00	292,562,500.00
KT&G CORP	13,223	82,700.00	1,093,542,100.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	88,900.00	279,323,800.00
AMOREPACIFIC CORP	3,762	164,000.00	616,968,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	956	800,000.00	764,800,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	389	468,000.00	182,052,000.00
PACIFIC CORP	3,393	45,500.00	154,381,500.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,851	59,000.00	522,209,000.00
SD BIOSENSOR INC	3,909	45,850.00	179,227,650.00
ALTEOGEN INC	2,841	51,300.00	145,743,300.00
CELLTRION INC	10,890	165,000.00	1,796,850,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,968	84,200.00	165,705,600.00
GREEN CROSS CORP	564	174,500.00	98,418,000.00
HANMI PHARM CO LTD	508	290,000.00	147,320,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,993	798,000.00	1,590,414,000.00
SEEGENE INC	3,838	39,150.00	150,257,700.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	87,300.00	279,098,100.00
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	123,000.00	258,300,000.00
YUHAN CORPORATION	6,107	58,400.00	356,648,800.00
HANA FINANCIAL GROUP	33,962	47,500.00	1,613,195,000.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	11,300.00	320,129,000.00
KAKAObANK CORP	10,063	40,900.00	411,576,700.00
KB FINANCIAL GROUP INC	42,887	58,900.00	2,526,044,300.00

	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	50,883	42,400.00	2,157,439,200.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	15,300.00	908,911,800.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	69,900.00	321,679,800.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	7,939	34,850.00	276,674,150.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	6,390.00	306,106,560.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	7,770.00	240,986,550.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	10,400.00	125,912,800.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	38,350.00	221,509,600.00	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	64,900.00	273,164,100.00	
	MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	7,329	42,500.00	311,482,500.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	203,000.00	630,924,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	63,800.00	473,204,600.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	145,000.00	540,125,000.00	
	ILJIN MATERIALS CO LTD	2,166	83,400.00	180,644,400.00	
	L&F CO LTD	2,281	216,700.00	494,292,700.00	
	LG DISPLAY CO LTD	24,071	16,950.00	408,003,450.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	332,000.00	469,780,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	6,845	160,500.00	1,098,622,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	543,916	66,100.00	35,952,847,600.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	96,421	59,100.00	5,698,481,100.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	6,526	591,000.00	3,856,866,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	13,800.00	305,325,000.00	
	SK TELECOM	9,599	58,100.00	557,701,900.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,459	22,600.00	597,973,400.00	
	SK HYNIX INC	62,753	107,500.00	6,745,947,500.00	
	SK SQUARE CO LTD	11,660	45,850.00	534,611,000.00	
	韓国ウォン 小計	1,799,723		119,666,069,010.00 (12,193,972,432)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	90.40	10,146,496.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	46.30	10,842,348.80	
	CHINA STEEL	1,266,261	35.00	44,319,135.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	420,061	78.60	33,016,794.60	
	FORMOSA PLASTICS CORP	441,824	103.50	45,728,784.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	647,752	84.70	54,864,594.40	
	TAIWAN CEMENT	589,511	44.25	26,085,861.75	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,557	815.00	10,233,955.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	29.80	10,371,234.40	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	50,207	234.00	11,748,438.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	6,000	1,285.00	7,710,000.00	
	EVERGREEN MARINE	266,039	147.00	39,107,733.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	27.25	12,862,000.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	64,900	148.00	9,605,200.00	

YANG MING MARINE TRANSPORT	180,000	126.00	22,680,000.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	33.45	5,922,690.45
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	473.00	9,430,201.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	43,448	175.50	7,625,124.00
GIANT MANUFACTURING	34,464	237.00	8,167,968.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	306.00	4,896,000.00
POU CHEN	273,780	30.00	8,213,400.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	42,000	553.00	23,226,000.00
MOMO.COM INC	5,000	723.00	3,615,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,544	267.00	15,898,248.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	645,395	66.50	42,918,767.50
ONENESS BIOTECH CO LTD	20,000	190.00	3,800,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	587,664	17.70	10,401,652.80
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,011,237	27.30	54,906,770.10
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,397,452	30.70	42,901,776.40
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,248,238	26.10	32,579,011.80
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,059,344	22.20	23,517,436.80
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,211,339	38.00	46,030,882.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	17.20	19,898,490.80
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,009,432	17.85	18,018,361.20
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,078,434	26.40	28,470,657.60
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	451,861	47.00	21,237,467.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	144,167	225.00	32,437,575.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,056,159	25.00	26,403,975.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	888,123	58.70	52,132,820.10
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,896,226	16.85	31,951,408.10
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	909,435	67.80	61,659,693.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,262,866	9.09	11,479,451.94
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	206,724	74.00	15,297,576.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	218.50	10,488,000.00
ACER INC	255,803	27.45	7,021,792.35
ADVANTECH CO LTD	43,336	341.00	14,777,576.00
ASUSTEK COMPUTER INC	72,092	356.50	25,700,798.00
AU OPTRONICS CORP	945,090	17.30	16,350,057.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	150.00	17,805,000.00
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	1,049,000	13.65	14,318,850.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	22.65	9,779,364.00
DELTA ELECTRONICS INC	217,903	230.00	50,117,690.00
E INK HOLDINGS INC	94,000	170.00	15,980,000.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	60.50	5,617,425.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,447,248	104.00	150,513,792.00
INVENTEC CO LTD	280,511	25.85	7,251,209.35



	LARGAN PRECISION CO LTD	11,040	1,565.00	17,277,600.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	63.80	14,383,837.60	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	128.50	7,710,000.00	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	395.00	8,295,000.00	
	PEGATRON CORP	200,474	69.40	13,912,895.60	
	QUANTA COMPUTER INC	286,270	84.90	24,304,323.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	75.10	9,620,310.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	141,000	211.00	29,751,000.00	
	WIWYNN CORP	8,000	963.00	7,704,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	143,692	53.00	7,615,676.00	
	YAGEO CORPORATION	54,764	398.50	21,823,454.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	102.50	14,137,005.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	410,315	125.00	51,289,375.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	79.40	12,465,800.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	192,200	105.50	20,277,100.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	359,315	94.10	33,811,541.50	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	3,000	1,300.00	3,900,000.00	
	EEMORY TECHNOLOGY INC	6,000	1,195.00	7,170,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	528.00	12,672,000.00	
	MEDIATEK INC	173,804	813.00	141,302,652.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	115,000	65.10	7,486,500.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	74,045	378.00	27,989,010.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	1,370.00	10,960,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50,944	408.00	20,785,152.00	
	SILERGY CORP	9,000	2,435.00	21,915,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,805,389	520.00	1,458,802,280.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,316,000	47.90	63,036,400.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	99.50	8,855,500.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	193.50	6,192,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	27.20	9,492,800.00	
	新台湾ドル 小計	36,711,794		3,453,020,744.94 (15,068,637,228)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	96,221	353.40	34,004,501.40	
	COAL INDIA LTD	180,326	183.05	33,008,674.30	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	268.40	15,949,670.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	193,765	124.00	24,026,860.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	164.75	41,633,807.75	
	PETRONET LNG LTD	83,779	216.35	18,125,586.65	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	326,857	2,518.30	823,123,983.10	
	ACC LTD	5,315	2,232.90	11,867,863.50	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	366.75	26,968,227.75	
	ASIAN PAINTS LTD	42,204	3,005.25	126,833,571.00	

BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	664.30	19,562,970.70
GRASIM INDUSTRIES LTD	31,529	1,551.75	48,925,125.75
HINDALCO INDUSTRIES LTD	180,501	444.10	80,160,494.10
JSW STEEL LTD	99,332	678.35	67,381,862.20
PI INDUSTRIES LTD	8,147	2,560.90	20,863,652.30
PIDILITE INDUSTRIES LTD	18,199	2,199.45	40,027,790.55
SHREE CEMENT LTD	1,387	24,058.30	33,368,862.10
SRF LTD	14,609	2,224.30	32,494,798.70
TATA STEEL LTD	77,326	1,252.25	96,831,483.50
ULTRATECH CEMENT LTD	11,556	6,224.60	71,931,477.60
UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	777.60	42,149,030.40
VEDANTA LTD	147,245	350.15	51,557,836.75
ADANI ENTERPRISES LTD	26,979	2,197.65	59,290,399.35
BHARAT ELECTRONICS LTD	116,287	225.50	26,222,718.50
HAVELLS INDIA LTD	23,476	1,215.50	28,535,078.00
LARSEN & TOUBRO LTD	82,638	1,616.15	133,555,403.70
SIEMENS INDIA LTD	5,926	2,198.45	13,028,014.70
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	690.75	15,882,414.75
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	64,743	792.60	51,315,301.80
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	624.60	16,523,793.00
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,717.30	14,356,628.00
BAJAJ AUTO LTD	9,644	3,568.75	34,417,025.00
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	1,985.80	17,536,599.80
BHARAT FORGE LTD	30,322	637.30	19,324,210.60
EICHER MOTORS LTD	14,685	2,344.30	34,426,045.50
HERO MOTOCORP LTD	12,238	2,492.75	30,506,274.50
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	101,669	895.30	91,024,255.70
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	15,707	7,360.30	115,608,232.10
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	124,426	118.35	14,725,817.10
MRF LTD	432	68,578.00	29,625,696.00
TATA MOTORS LTD	190,082	403.95	76,783,623.90
PAGE INDUSTRIES LTD	601	42,619.95	25,614,589.95
TITAN INDUSTRIES LTD	40,781	2,183.20	89,033,079.20
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	489.55	21,505,931.50
INFO EDGE INDIA LTD	7,855	3,820.70	30,011,598.50
TRENT LTD	19,255	1,103.85	21,254,631.75
ZOMATO LTD	170,264	56.75	9,662,482.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	17,524	3,520.30	61,689,737.20
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	11,474	3,252.05	37,314,021.70
ITC LTD	345,135	262.95	90,753,248.25
MARICO LTD	81,711	489.45	39,993,448.95
NESTLE INDIA LIMITED	3,906	16,504.35	64,465,991.10

TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	61,013	758.25	46,263,107.25
UNITED SPIRITS LTD	32,483	800.70	26,009,138.10
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	9,566	1,581.20	15,125,759.20
DABUR INDIA LTD	58,111	504.55	29,319,905.05
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	38,464	757.35	29,130,710.40
HINDUSTAN UNILEVER LTD	97,997	2,116.65	207,425,350.05
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	10,114	3,766.35	38,092,863.90
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	614.30	21,755,434.50
BIOCON LTD	58,256	338.55	19,722,568.80
CIPLA LTD	49,816	938.30	46,742,352.80
DIVI'S LABORATORIES LTD	14,782	4,231.10	62,544,120.20
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	3,905.80	49,384,935.20
LUPIN LTD	26,552	733.05	19,463,943.60
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	97,015	885.40	85,897,081.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	6,110	2,597.20	15,868,892.00
AXIS BANK LTD	273,120	663.70	181,269,744.00
BANDHAN BANK LTD	74,811	313.15	23,427,064.65
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	198,623	2,168.30	430,674,250.90
ICICI BANK LTD	591,364	710.35	420,075,417.40
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	62,523	1,767.50	110,509,402.50
STATE BANK OF INDIA	226,932	475.90	107,996,938.80
YES BANK LTD	1,020,164	12.95	13,211,123.80
BAJAJ FINANCE LTD	30,037	6,036.95	181,331,867.15
BAJAJ FINSERV LTD	3,888	13,783.85	53,591,608.80
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	38,543	635.40	24,490,222.20
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	13,102	1,932.55	25,320,270.10
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,201.65	14,928,097.95
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	1,965.45	23,039,004.90
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	31,013	761.50	23,616,399.50
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	21,216	1,157.00	24,546,912.00
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	129,053	563.85	72,766,534.05
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	23,540	1,264.35	29,762,799.00
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	504.85	16,019,900.20
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	53,770	1,064.45	57,235,476.50
DLF LTD	56,420	327.20	18,460,624.00
GODREJ PROPERTIES LTD	12,724	1,395.95	17,762,067.80
HCL TECHNOLOGIES LTD	123,161	1,076.10	132,533,552.10
INFOSYS LTD	385,346	1,570.35	605,128,091.10
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	5,756	4,448.90	25,607,868.40
MINDTREE LTD	6,247	3,195.10	19,959,789.70
MPHASIS LTD	7,796	2,641.55	20,593,523.80
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	106,835	3,445.10	368,057,258.50

	TECH MAHINDRA LTD	72,109	1,261.15	90,940,265.35	
	WIPRO LTD	179,580	483.15	86,764,077.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	294,891	711.50	209,814,946.50	
	INDUS TOWERS LTD	90,578	205.90	18,650,010.20	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	2,706.40	115,238,512.00	
	ADANI TOTAL GAS LTD	26,949	2,375.25	64,010,612.25	
	ADANI TRANSMISSION LTD	27,228	2,703.45	73,609,536.60	
	GAIL INDIA LTD	174,768	156.10	27,281,284.80	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	354.35	9,469,649.40	
	NTPC LTD	664,141	159.00	105,598,419.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	327,337	245.15	80,246,665.55	
	TATA POWER CO LTD	145,582	230.00	33,483,860.00	
	インドルピー 小計	9,848,613		7,744,554,232.70 (13,088,296,653)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	60,443	18.37	1,110,337.91	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	296,777	3.44	1,023,583.87	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.56	1,136,448.00	
	INDUSTRIES QATAR	196,788	17.89	3,520,537.32	
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	7.51	1,531,964.90	
	MASRAF AL RAYAN	599,719	5.60	3,358,426.40	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	11.55	1,138,356.45	
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	24.57	2,806,631.10	
	QATAR NATIONAL BANK	530,405	23.09	12,247,051.45	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.36	698,203.85	
	OOREDOO QSC	72,800	7.40	538,720.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	62,421	17.30	1,079,883.30	
	カタールリアル 小計	2,887,547		30,190,144.55 (1,075,372,948)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	22,520	193.82	4,364,826.40	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	242.82	3,562,169.40	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	6,119	1,571.76	9,617,599.44	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	51,324	291.48	14,959,919.52	
	GOLD FIELDS LTD	97,102	193.00	18,740,686.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	56,301	59.02	3,322,885.02	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	91,758	186.65	17,126,630.70	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	467.65	2,512,215.80	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	33,950	168.77	5,729,741.50	
	SASOL LTD	69,301	369.16	25,583,157.16	
	SIBANYE STILLWATER LTD	313,727	47.45	14,886,346.15	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	204.18	5,656,194.36	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	126.61	5,131,376.69	
MR PRICE GROUP LTD	28,510	196.51	5,602,500.10		

	NASPERS LTD-N SHS	25,573	1,427.19	36,497,529.87
	PEPKOR HOLDINGS LTD	144,533	19.50	2,818,393.50
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	54.10	5,977,779.50
	BID CORP LTD	35,017	297.70	10,424,560.90
	CLICKS GROUP LTD	26,921	280.26	7,544,879.46
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	60,003	214.88	12,893,444.64
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	155.46	3,618,176.04
	TIGER BRANDS LTD	13,023	145.18	1,890,679.14
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	152.00	8,539,664.00
	ABSA GROUP LTD	95,814	157.99	15,137,653.86
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	8,544	1,982.57	16,939,078.08
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	204.61	12,913,141.71
	STANDARD BANK GROUP LTD	150,257	157.77	23,706,046.89
	FIRSTRAND LTD	560,323	64.94	36,387,375.62
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	304.90	5,240,316.30
	REMGRO LTD	55,441	135.00	7,484,535.00
	DISCOVERY LIMITED	59,544	140.17	8,346,282.48
	OLD MUTUAL LTD	489,612	11.64	5,699,083.68
	SANLAM LTD	214,053	60.67	12,986,595.51
	NEPI ROCKCASTLE PLC	60,556	90.43	5,476,079.08
	MTN GROUP LTD	194,516	163.64	31,830,598.24
	VODACOM GROUP	62,331	147.41	9,188,212.71
	南アフリカランド 小計	3,385,195		418,336,354.45 (3,350,874,199)
アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	271,405	4.10	1,112,760.50
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	327,038	10.22	3,342,328.36
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	8.70	1,616,294.70
	DUBAI ISLAMIC BANK	335,455	6.37	2,136,848.35
	EMIRATES NBD PJSC	334,478	14.70	4,916,826.60
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	492,228	21.80	10,730,570.40
	ALDAR PROPERTIES PJSC	367,539	5.64	2,072,919.96
	EMAAR PROPERTIES PJSC	576,832	6.15	3,547,516.80
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	404,510	33.98	13,745,249.80
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	3,295,266		43,221,315.47 (1,528,305,715)
クウェートディ ナール	AGILITY	142,931	1.24	177,949.09
	BOUBYAN BANK K.S.C	136,519	0.91	124,914.88
	KUWAIT FINANCE HOUSE	565,723	0.98	557,237.15
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	838,738	1.06	895,772.18
	MABANEE CO KPSC	71,023	0.82	58,238.86
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	215,000	0.66	142,545.00
		1,969,934		1,956,657.16

クウェートディナール 小計				(830,640,097)
オフショア人民 元	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20,000	29.61	592,200.00
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	5.34	534,000.00
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	16.56	634,248.00
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	14.09	1,237,102.00
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	34.02	952,560.00
	YANZHOU COAL MINING CO-A	61,200	32.50	1,989,000.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	4.51	740,993.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	38.73	1,140,211.20
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	6.06	234,522.00
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	43.91	904,546.00
	CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	78,847	15.91	1,254,455.77
	CHINA JUSHI CO LTD -A	96,700	15.98	1,545,266.00
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	32.01	665,808.00
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	8,000	103.03	824,240.00
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	12,413	73.63	913,969.19
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	23.96	888,916.00
	HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	11,900	77.50	922,250.00
	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	21.80	218,000.00
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.84	848,240.00
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.16	249,600.00
	JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	12.58	280,534.00
	KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	30,400	8.49	258,096.00
	LB GROUP CO LTD-A	15,300	18.14	277,542.00
	NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	14.20	1,124,640.00
	PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	3.07	675,707.00
	RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	14.22	688,959.00
	SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	28,320	34.14	966,844.80
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	18.33	132,929.16
	SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	30.40	545,376.00
	SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.12	894,192.00
	SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	5,600	119.25	667,800.00
	SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	5.58	766,692.00
	SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	17.23	849,439.00
	SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	6,000	70.00	420,000.00
	TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	15.27	149,646.00
	TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	5.94	547,668.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	78.80	1,379,000.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	50.97	469,943.40	
YINTAI GOLD CO LTD-A	111,300	9.01	1,002,813.00	
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	11,400	97.68	1,113,552.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	10,400	192.03	1,997,112.00	

ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	5,700	77.17	439,869.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	10.40	245,440.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	105,600	9.80	1,034,880.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	39.85	454,290.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	39.69	615,195.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	29.84	250,656.00
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	9.13	584,320.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	15.89	877,366.35
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.33	1,405,223.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	5.91	1,246,419.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	15,100	368.50	5,564,350.00
CRRC CORP LTD-A	185,800	4.93	915,994.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	102,600	12.40	1,272,240.00
EVE ENERGY CO LTD-A	7,573	64.34	487,246.82
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	6.66	151,848.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	6,800	188.46	1,281,528.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	27.43	159,094.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	84.36	531,468.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	13,600	24.05	327,080.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	18,800	46.23	869,124.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	46.32	530,641.92
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	14.91	717,171.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.48	1,151,532.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	22.00	796,400.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	58,320	31.91	1,860,991.20
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	7.33	1,196,256.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	15.94	667,886.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	10,650	55.16	587,454.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	17,900	10.23	183,117.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	63.81	638,100.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	2,560	323.60	828,416.00
TBEA CO LTD-A	22,519	18.82	423,807.58
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	10.63	459,216.00
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	2,760	42.89	118,376.40
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	3,800	117.68	447,184.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	4.89	975,066.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	11.12	223,634.32
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	28,280	17.81	503,666.80
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	32.75	1,034,900.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	44.70	369,222.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	47,190	16.60	783,354.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	5.75	460,575.00

BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	4.67	376,402.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	45.50	500,500.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	8.46	219,114.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	106,700	4.42	471,614.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.52	180,800.00
S F HOLDING CO LTD-A	20,300	49.86	1,012,158.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	47.25	251,322.75
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	6.17	273,948.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	15.21	332,186.40
BYD CO LTD -A	9,700	232.73	2,257,481.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	33,348	11.38	379,500.24
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	35.02	647,870.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	19.15	656,845.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	10.52	308,236.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	28,300	51.60	1,460,280.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	15.96	679,896.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	17.35	681,056.90
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	1,031	542.14	558,946.34
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	91.70	256,760.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	33.37	1,451,595.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	28.68	796,156.80
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	6,102	57.01	347,875.02
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	114.10	878,570.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	25.24	656,240.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	102,000	4.07	415,140.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	52.84	422,720.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	48.30	1,265,460.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	5.74	455,182.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	11.29	377,989.20
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	22.40	548,800.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	6.84	366,624.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	5.72	797,368.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	318.30	923,070.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	34.18	557,134.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	14.10	321,480.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	4.56	280,440.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	12,200	160.00	1,952,000.00
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	2.92	133,736.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	15,480	28.39	439,477.20
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	8,600	34.25	294,550.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	10,140	41.03	416,044.20
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	4.76	192,780.00



ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	43.22	462,454.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	193.81	310,096.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	47.86	105,292.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	128.05	384,150.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	7.23	430,185.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	19.87	204,661.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	57.87	578,700.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	111.20	878,480.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	4,600	36.83	169,418.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	20,248	76.65	1,552,009.20
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	17.08	467,992.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	60.96	1,036,320.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	32.04	38,448.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	37.84	1,297,987.68
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	42.48	734,904.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	150.81	1,372,371.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	27,700	5.72	158,444.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	137.21	768,376.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	24.79	285,085.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	41.90	293,300.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	8,500	1,752.00	14,892,000.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	194.08	1,901,984.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	51.50	1,728,237.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	14.10	377,880.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	245.37	2,301,570.60
TONGWEI CO LTD-A	31,600	39.52	1,248,832.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	18.86	719,697.60
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	21,200	154.78	3,281,336.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	43.85	442,885.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	16.84	89,252.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	19.68	584,496.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	23,226	32.31	750,432.06
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	6,500	46.63	303,095.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	33,700	31.11	1,048,407.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	84.49	239,782.62
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	32.86	319,399.20
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	7,875	28.00	220,500.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	41.54	513,019.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	18,000	23.45	422,100.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	12.90	134,160.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	18.52	274,096.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	4.96	123,206.40

OVCTEK CHINA INC-A	7,209	36.40	262,407.60
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	8,400	306.01	2,570,484.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	124.71	249,420.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	37,830	8.09	306,044.70
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	258.00	51,600.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	23,400	20.70	484,380.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	7,491	159.52	1,194,964.32
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	43.32	697,452.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	66.69	366,795.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	152.16	334,752.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	39.46	402,492.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	97.83	968,517.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	30.78	683,100.54
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	29.50	472,000.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	79.55	636,400.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	16.90	318,565.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	448.15	932,152.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	38,102	29.30	1,116,388.60
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	7,940	93.45	741,993.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	21,294	25.33	539,377.02
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	5.75	368,575.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,800	65.03	442,204.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	23.21	162,470.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	59,640	27.66	1,649,642.40
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	17.77	199,592.64
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	50.77	863,090.00
WUXI APPTTEC CO LTD-A	16,464	93.63	1,541,524.32
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	54.49	541,630.60
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	3,900	297.99	1,162,161.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	17.30	156,046.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	29,040	26.24	762,009.60
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	43.26	419,622.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.07	1,085,552.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.46	258,680.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	113,400	16.42	1,862,028.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	4.87	481,643.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	14.24	1,604,848.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	75,140	6.71	504,189.40
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	10.83	546,915.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	26,400	35.10	926,640.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	6.38	290,290.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	5.98	746,902.00

CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	3.11	400,879.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	137,700	36.47	5,021,919.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.64	995,904.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	308,600	3.30	1,018,380.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.27	629,238.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	4.76	1,243,312.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	19.62	1,867,824.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	14.55	1,737,270.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.34	755,610.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	7.82	1,081,506.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.41	417,725.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	12.24	971,856.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	7.00	401,310.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.40	107,460.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	7.78	363,326.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	12.83	367,707.80
CITIC SECURITIES CO-A	49,680	18.73	930,506.40
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	21.66	522,006.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	50,256	21.50	1,080,504.00
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	11.06	39,816.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	5.43	326,886.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	6.06	501,768.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	15.16	918,696.00
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	127,170	7.22	918,167.40
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	14.04	1,015,092.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	5.74	872,767.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	78.50	423,900.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	12.87	405,405.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	6.13	538,827.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	42,700	7.25	309,575.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	8.57	347,736.32
SDIC CAPITAL CO LTD-A	69,616	6.10	424,657.60
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	3.96	820,512.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.54	403,560.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	94,600	2.90	274,340.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	8.91	389,367.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	20.59	374,738.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	44.35	2,962,580.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	13.85	757,595.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	18.48	992,376.00
GEMDALE CORP-A	45,500	13.07	594,685.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	123,480	4.36	538,372.80

POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	16.27	1,330,886.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	24.26	310,528.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	11.11	94,435.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	8.19	220,311.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	189.01	911,595.23
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	18,900	17.72	334,908.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	9.66	278,208.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	78,400	8.46	663,264.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	5.73	319,161.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	12,740	36.37	463,353.80
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	35.86	387,288.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	12.08	401,056.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	86.00	258,000.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	6,110	48.88	298,656.80
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	91.13	501,215.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	18.02	237,323.40
ADDSINO CO LTD -A	5,800	9.22	53,476.00
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	27.54	1,043,766.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	3.68	421,728.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	27.28	763,840.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	9.79	340,692.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	13.11	272,688.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	9.21	415,371.00
GOERTEK INC -A	26,900	34.06	916,214.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	4.26	213,000.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	72.72	509,040.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	25.12	495,165.44
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	9.54	160,272.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	28.29	1,314,070.50
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,080	168.78	182,282.40
NINESTAR CORP-A	18,543	40.02	742,090.86
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	5.44	170,272.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	16.45	399,735.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	91.50	435,540.00
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	23,500	10.05	236,175.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	13,400	14.90	199,660.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	79.34	510,552.90
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	16.24	462,840.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	8.75	411,250.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	17.82	326,818.80
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	2,800	12.89	36,092.00
WESTONE INFORMATION INDUST-A	20,100	30.95	622,095.00

WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	60.29	253,218.00		
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	29,512	15.93	470,126.16		
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	140.60	660,820.00		
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	73.96	832,050.00		
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	15.06	456,318.00		
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	32.44	282,228.00		
ZTE CORP-A	12,600	23.16	291,816.00		
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	6.97	1,211,386.00		
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	5.70	1,375,410.00		
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	134,000	22.34	2,993,560.00		
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	15.81	879,036.00		
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	10.04	678,704.00		
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	101.36	719,351.92		
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	2.79	230,175.00		
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	6,272	117.13	734,639.36		
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	10,800	97.26	1,050,408.00		
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	40.83	306,225.00		
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	72.15	541,125.00		
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	17,450	86.13	1,502,968.50		
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	22.96	684,208.00		
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	33,600	69.33	2,329,488.00		
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	59.46	1,251,930.30		
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	210.30	651,930.00		
SG MICRO CORP-A	2,100	265.73	558,033.00		
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2,600	56.68	147,368.00		
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	29,500	37.96	1,119,820.00		
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	8.25	270,187.50		
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	13.00	292,058.00		
TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	52.99	1,346,899.82		
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	4,900	189.96	930,804.00		
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	5,400	137.16	740,664.00		
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	49.58	843,950.76		
オフショア人民元 小計	15,059,365		245,682,623.83 (4,723,739,808)		
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	30.05	707,947.95	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	262,490	45.95	12,061,415.50	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	66.20	779,505.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	20.30	648,138.40	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	24,254	160.80	3,900,043.20	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	55.50	1,791,706.50	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	44,984	132.20	5,946,884.80	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	106,249	126.80	13,472,373.20	

SAUDI IND INVESTMENT GROUP	38,414	33.05	1,269,582.70	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	18.44	1,907,267.64	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	59.00	1,566,804.00	
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	264.00	1,110,648.00	
JARIR MARKETING CO	7,199	185.20	1,333,254.80	
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	12,480	114.00	1,422,720.00	
ALMARAI CO	30,130	53.50	1,611,955.00	
SAVOLA	25,336	35.35	895,627.60	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	6,923	201.60	1,395,676.80	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	4,029	246.00	991,134.00	
AL RAJHI BANK	221,156	112.60	24,902,165.60	
ALINMA BANK	109,956	41.80	4,596,160.80	
ARAB NATIONAL BANK	86,031	33.70	2,899,244.70	
BANK AL-JAZIRA	35,813	31.05	1,111,993.65	
BANK ALBILAD	61,145	51.40	3,142,853.00	
BANQUE SAUDI FRANSI	67,536	55.40	3,741,494.40	
RIYAD BANK	166,012	42.20	7,005,706.40	
SAUDI BRITISH BANK	94,400	46.30	4,370,720.00	
THE SAUDI NATIONAL BANK	252,104	79.30	19,991,847.20	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	167.00	1,012,521.00	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,613	68.80	454,974.40	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	47,092	11.14	524,604.88	
EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	11.06	510,828.22	
ETIHAD ETISALAT CO	34,414	43.30	1,490,126.20	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	26,891	14.06	378,087.46	
SAUDI TELECOM CO	66,310	119.20	7,904,152.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	27.30	2,517,633.30	
サウジアラビアリアル 小計	2,216,171		139,367,798.30 (4,838,849,956)	
合 計	286,289,168		95,924,181,684 (95,924,181,684)	

## (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	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	58,400	6,422,248.00	
		メキシコペソ 小計	58,400	6,422,248.00 (40,871,186)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	131,500	2,983,735.00	
BANCO INTER SA-UNITS		31,500	382,725.00		
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT		45,900	1,527,093.00		

		ENERGISA SA-UNITS	16,500	766,920.00	
		KLABIN SA-UNIT	64,600	1,393,422.00	
		ブラジルリアル 小計	290,000	7,053,895.00	(177,683,382)
		投資信託受益証券合計	348,400	218,554,568	(218,554,568)
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	547,200	12,251,808.00	
		OPERADORA DE SITES MEX-A-1	74,800	1,861,024.00	
		メキシコペソ 小計	622,000	14,112,832.00	(89,814,062)
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	6,319,275.60	
		南アフリカランド 小計	478,733	6,319,275.60	(50,617,397)
		投資証券合計	1,100,733	140,431,459	(140,431,459)
		合計		358,986,027	(358,986,027)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 61銘柄	100.0%			3.1%
メキシコペソ	株式 21銘柄	94.0%			2.1%
	投資信託受 益証券 1銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券 2銘柄			4.1%	0.1%
ブラジルリアル	株式 44銘柄	96.4%			5.0%
	投資信託受 益証券 5銘柄		3.6%		0.2%
チリペソ	株式 11銘柄	100.0%			0.5%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	100.0%			0.2%
ユーロ	株式 6銘柄	100.0%			0.2%
トルコリラ	株式 11銘柄	100.0%			0.3%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%			0.2%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.2%
ポーランドズロチ	株式 15銘柄	100.0%			0.6%

香港ドル	株式	200銘柄	100.0%			22.0%
マレーシアリングギット	株式	35銘柄	100.0%			1.6%
タイバーツ	株式	42銘柄	100.0%			1.9%
フィリピンペソ	株式	19銘柄	100.0%			0.8%
インドネシアルピア	株式	23銘柄	100.0%			1.9%
韓国ウォン	株式	111銘柄	100.0%			12.7%
新台湾ドル	株式	86銘柄	100.0%			15.7%
インドルピー	株式	106銘柄	100.0%			13.6%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%			1.1%
南アフリカランド	株式	36銘柄	98.5%			3.5%
	投資証券	1銘柄			1.5%	0.1%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式	9銘柄	100.0%			1.6%
クウェートディナール	株式	6銘柄	100.0%			0.9%
オフショア人民元	株式	325銘柄	100.0%			4.9%
サウジアラビアリアル	株式	35銘柄	100.0%			5.0%

(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。

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 5月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	677,109,109
国債証券	522,045,299,300
地方債証券	33,429,716,111
特殊債券	36,348,012,167
社債券	29,525,342,420
未収入金	598,515,800
未収利息	1,042,666,082
前払費用	19,669,793
流動資産合計	623,686,330,782
資産合計	623,686,330,782
負債の部	



	2022年 5月10日現在
項目	金額（円）
<b>流動負債</b>	
未払解約金	869,392,888
未払利息	352
流動負債合計	869,393,240
<b>負債合計</b>	869,393,240
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	451,375,915,149
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	171,441,022,393
元本等合計	622,816,937,542
<b>純資産合計</b>	622,816,937,542
<b>負債純資産合計</b>	623,686,330,782

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>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 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	451,375,915,149口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 100,116,000円</p>
3. 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 1.3798円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,798円)</p>

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

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2022年 5月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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 5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月11日
期首元本額	459,359,027,915円
期中追加設定元本額	22,184,388,785円
期中一部解約元本額	30,167,501,551円
期末元本額	451,375,915,149円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,023,957,143円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,462,539円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,597,483,025円
世界経済インデックスファンド	3,648,871,652円
D C マイセレクション 2 5	25,787,744,103円
D C マイセレクション 5 0	29,360,378,983円
D C マイセレクション 7 5	8,951,503,340円
D C 日本債券インデックス・オープン	445,296,649円
D C 日本債券インデックス・オープン S	92,522,810,467円
D C 日本債券インデックス・オープン P	66,931,332,424円
D C マイセレクション S 2 5	12,633,167,164円
D C マイセレクション S 5 0	14,118,407,803円
D C マイセレクション S 7 5	3,213,801,210円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	792,115,416円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	2,186,760,141円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	814,381,052円
D C 世界経済インデックスファンド	3,311,531,202円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,435,383円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	28,573,508円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	10,510,019円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	972,063円

区分	2022年 5月10日現在
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	92,634,852円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	128,536,453円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	33,130,779円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	27,610,659円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,980,349,256円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	767,727,027円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,215,032,958円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	93,558,671円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	76,010,188円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,011,642,796円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,154,717,498円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,443,362,902円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	139,768,274円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,042,863,910円
日本債券ファンド・シリーズ1	15,922,437,141円
分散投資コア戦略ファンドA	19,869,312,536円
分散投資コア戦略ファンドS	25,440,115,400円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	157,934,126円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,348,347,656円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	66,309,024円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	37,579,792円
SMT インデックスバランス・オープン	61,201,912円
SMT 世界経済インデックス・オープン	35,897,362円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	70,395,689円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	112,826,864円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,453,400円
グローバル経済コア	229,446,594円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	29,974,545円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	18,877,507円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	16,781,175円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	9,296,960円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	2,425,629円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	1,844,524円
My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)	362,803円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	80,818,430,644円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	87,936,511円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	11,823,886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)	410,234,720円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年 5月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		14,912,860,850
地方債証券		601,638,507
特殊債券		589,945,215
社債券		444,131,740
合計		16,548,576,312

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第4 2 5 回利付国債(2年)	2,810,000,000	2,812,360,400	
	第4 2 6 回利付国債(2年)	620,000,000	620,564,200	
	第4 2 7 回利付国債(2年)	3,260,000,000	3,262,966,600	
	第4 2 8 回利付国債(2年)	230,000,000	230,225,400	
	第4 2 9 回利付国債(2年)	950,000,000	950,988,000	
	第4 3 0 回利付国債(2年)	2,010,000,000	2,012,211,000	
	第4 3 4 回利付国債(2年)	1,915,000,000	1,917,240,550	
	第4 3 5 回利付国債(2年)	780,000,000	780,959,400	
	第4 3 6 回利付国債(2年)	230,000,000	230,248,400	
	第1 3 6 回利付国債(5年)	4,330,000,000	4,338,400,200	
	第1 3 7 回利付国債(5年)	6,760,000,000	6,775,615,600	
	第1 3 8 回利付国債(5年)	6,890,000,000	6,908,327,400	
	第1 3 9 回利付国債(5年)	5,590,000,000	5,606,099,200	
	第1 4 0 回利付国債(5年)	5,120,000,000	5,135,667,200	
	第1 4 1 回利付国債(5年)	7,960,000,000	7,986,268,000	
	第1 4 2 回利付国債(5年)	4,370,000,000	4,385,950,500	
	第1 4 3 回利付国債(5年)	4,910,000,000	4,929,640,000	

第144回利付国債(5年)	6,310,000,000	6,336,502,000	
第145回利付国債(5年)	5,820,000,000	5,845,433,400	
第146回利付国債(5年)	3,150,000,000	3,164,206,500	
第147回利付国債(5年)	4,170,000,000	4,173,210,900	
第148回利付国債(5年)	6,950,000,000	6,954,239,500	
第149回利付国債(5年)	5,130,000,000	5,131,077,300	
第150回利付国債(5年)	5,880,000,000	5,880,000,000	
第151回利付国債(5年)	920,000,000	919,549,200	
第1回利付国債(40年)	400,000,000	533,692,000	
第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,458,773,500	
第3回利付国債(40年)	550,000,000	712,426,000	
第4回利付国債(40年)	950,000,000	1,232,910,000	
第5回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,337,542,800	
第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,549,321,200	
第7回利付国債(40年)	1,240,000,000	1,463,857,200	
第8回利付国債(40年)	1,230,000,000	1,353,344,400	
第9回利付国債(40年)	2,050,000,000	1,675,321,500	
第10回利付国債(40年)	2,100,000,000	2,009,343,000	
第11回利付国債(40年)	1,790,000,000	1,656,161,700	
第12回利付国債(40年)	1,290,000,000	1,072,944,600	
第13回利付国債(40年)	2,140,000,000	1,770,785,800	
第14回利付国債(40年)	2,020,000,000	1,785,457,800	
第329回利付国債(10年)	4,410,000,000	4,452,821,100	
第330回利付国債(10年)	3,910,000,000	3,956,333,500	
第331回利付国債(10年)	900,000,000	908,217,000	
第332回利付国債(10年)	4,800,000,000	4,851,456,000	
第333回利付国債(10年)	3,030,000,000	3,066,875,100	
第334回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,317,978,600	
第335回利付国債(10年)	2,310,000,000	2,339,475,600	
第336回利付国債(10年)	1,110,000,000	1,125,662,100	
第337回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,824,864,000	
第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	4,617,364,800	
第339回利付国債(10年)	4,750,000,000	4,814,315,000	
第340回利付国債(10年)	4,830,000,000	4,899,841,800	
第341回利付国債(10年)	5,340,000,000	5,402,691,600	
第342回利付国債(10年)	4,840,000,000	4,861,441,200	
第343回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,682,068,400	
第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	5,925,724,000	
第345回利付国債(10年)	3,780,000,000	3,796,518,600	
第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	5,773,690,000	
第347回利付国債(10年)	4,050,000,000	4,063,405,500	
第348回利付国債(10年)	4,340,000,000	4,351,587,800	

第349回利付国債(10年)	5,000,000,000	5,009,750,000	
第350回利付国債(10年)	6,630,000,000	6,637,690,800	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	5,030,000,000	5,030,000,000	
第352回利付国債(10年)	4,510,000,000	4,505,715,500	
第353回利付国債(10年)	5,150,000,000	5,139,854,500	
第354回利付国債(10年)	4,790,000,000	4,775,342,600	
第355回利付国債(10年)	3,710,000,000	3,693,045,300	
第356回利付国債(10年)	4,080,000,000	4,054,785,600	
第357回利付国債(10年)	2,770,000,000	2,749,225,000	
第358回利付国債(10年)	3,560,000,000	3,529,704,400	
第359回利付国債(10年)	3,420,000,000	3,387,270,600	
第360回利付国債(10年)	4,890,000,000	4,837,823,700	
第361回利付国債(10年)	3,940,000,000	3,895,084,000	
第362回利付国債(10年)	3,850,000,000	3,803,222,500	
第363回利付国債(10年)	5,560,000,000	5,488,109,200	
第364回利付国債(10年)	5,110,000,000	5,042,139,200	
第365回利付国債(10年)	6,970,000,000	6,875,068,600	
第366回利付国債(10年)	540,000,000	537,656,400	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	131,033,100	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	187,112,000	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	139,902,000	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	134,791,800	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	58,734,000	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	421,015,000	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	216,190,800	
第8回利付国債(30年)	350,000,000	404,229,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	267,146,400	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	173,185,600	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	298,490,400	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	226,827,700	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	473,904,000	
第14回利付国債(30年)	800,000,000	986,712,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	424,425,400	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	250,356,000	
第17回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,428,691,000	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	425,416,050	
第19回利付国債(30年)	530,000,000	655,027,000	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	606,696,000	
第21回利付国債(30年)	500,000,000	620,620,000	
第22回利付国債(30年)	540,000,000	685,735,200	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	547,312,600	
第24回利付国債(30年)	780,000,000	994,359,600	

第25回利付国債(30年)	350,000,000	437,269,000
第26回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,442,544,600
第27回利付国債(30年)	1,920,000,000	2,467,795,200
第28回利付国債(30年)	2,140,000,000	2,756,683,800
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,132,155,800
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,235,775,500
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,374,571,000
第32回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,724,561,600
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,217,579,000
第34回利付国債(30年)	1,795,000,000	2,254,789,250
第35回利付国債(30年)	2,300,000,000	2,814,602,000
第36回利付国債(30年)	2,130,000,000	2,608,185,000
第37回利付国債(30年)	2,255,000,000	2,722,687,000
第38回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,677,011,700
第39回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,788,535,600
第40回利付国債(30年)	1,420,000,000	1,689,842,600
第41回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,346,903,000
第42回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,312,404,800
第43回利付国債(30年)	1,290,000,000	1,512,370,200
第44回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,348,869,500
第45回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,629,878,400
第46回利付国債(30年)	1,650,000,000	1,867,767,000
第47回利付国債(30年)	1,560,000,000	1,798,134,000
第48回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,898,852,400
第49回利付国債(30年)	1,700,000,000	1,887,561,000
第50回利付国債(30年)	1,590,000,000	1,560,298,800
第51回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,490,487,300
第52回利付国債(30年)	1,680,000,000	1,533,470,400
第53回利付国債(30年)	1,320,000,000	1,231,520,400
第54回利付国債(30年)	1,680,000,000	1,637,546,400
第55回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,401,883,200
第56回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,439,033,600
第57回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,367,841,000
第58回利付国債(30年)	2,350,000,000	2,274,447,500
第59回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,329,291,600
第60回利付国債(30年)	1,530,000,000	1,509,084,900
第61回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,369,377,800
第62回利付国債(30年)	240,000,000	213,463,200
第63回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,088,312,400
第64回利付国債(30年)	1,830,000,000	1,575,483,600
第65回利付国債(30年)	1,590,000,000	1,367,304,600
第66回利付国債(30年)	1,030,000,000	883,791,500
第67回利付国債(30年)	1,885,000,000	1,704,586,650



第68回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,344,933,600	
第69回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,240,907,000	
第70回利付国債(30年)	1,740,000,000	1,606,890,000	
第71回利付国債(30年)	1,430,000,000	1,319,875,700	
第72回利付国債(30年)	1,070,000,000	985,951,500	
第73回利付国債(30年)	1,920,000,000	1,766,208,000	
第74回利付国債(30年)	720,000,000	715,060,800	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	323,107,200	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	204,164,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	328,588,800	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	226,969,600	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	339,923,100	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	134,725,500	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	197,966,700	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	405,627,300	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	420,648,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	209,480,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	661,865,400	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	379,191,600	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	211,186,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	137,958,600	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	284,982,300	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	306,924,400	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	180,239,100	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	287,101,800	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	234,621,200	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	416,640,900	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	643,002,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	312,272,000	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	504,394,600	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	313,672,700	
第86回利付国債(20年)	510,000,000	555,568,500	
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,986,446,700	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	459,887,400	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	381,797,500	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	690,448,500	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	495,139,500	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	964,981,600	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	449,503,500	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	671,732,000	
第95回利付国債(20年)	610,000,000	680,467,200	
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,757,458,800	

第97回利付国債(20年)	400,000,000	445,984,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	488,228,400
第99回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,436,750,400
第100回利付国債(20年)	480,000,000	539,481,600
第101回利付国債(20年)	715,000,000	811,946,850
第102回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,436,412,600
第103回利付国債(20年)	400,000,000	453,572,000
第104回利付国債(20年)	160,000,000	179,486,400
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,328,337,800
第106回利付国債(20年)	380,000,000	430,171,400
第107回利付国債(20年)	260,000,000	293,667,400
第108回利付国債(20年)	660,000,000	736,810,800
第109回利付国債(20年)	520,000,000	582,358,400
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,246,861,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,109,486,000
第112回利付国債(20年)	790,000,000	898,048,300
第113回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,302,598,000
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,663,865,700
第115回利付国債(20年)	700,000,000	805,553,000
第116回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,721,188,400
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,239,213,600
第118回利付国債(20年)	660,000,000	754,498,800
第119回利付国債(20年)	530,000,000	597,431,900
第120回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,744,693,900
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,707,600,000
第122回利付国債(20年)	940,000,000	1,062,378,600
第123回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,167,086,900
第124回利付国債(20年)	610,000,000	701,756,200
第125回利付国債(20年)	1,820,000,000	2,132,148,200
第126回利付国債(20年)	730,000,000	842,522,200
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,168,369,200
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,114,530,000
第129回利付国債(20年)	740,000,000	843,659,200
第130回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,469,872,950
第131回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,134,710,000
第132回利付国債(20年)	1,160,000,000	1,319,720,400
第133回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,410,908,400
第134回利付国債(20年)	830,000,000	954,682,600
第135回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,174,807,700
第136回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,639,892,000
第137回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,210,350,400
第138回利付国債(20年)	620,000,000	695,726,800
第139回利付国債(20年)	830,000,000	939,551,700

第140回利付国債(20年)	2,470,000,000	2,823,160,600	
第141回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,831,280,000	
第142回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,177,936,800	
第143回利付国債(20年)	1,920,000,000	2,180,160,000	
第144回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,293,738,500	
第145回利付国債(20年)	2,635,000,000	3,025,085,400	
第146回利付国債(20年)	2,700,000,000	3,103,380,000	
第147回利付国債(20年)	2,380,000,000	2,711,914,800	
第148回利付国債(20年)	2,000,000,000	2,257,980,000	
第149回利付国債(20年)	2,600,000,000	2,938,806,000	
第150回利付国債(20年)	2,730,000,000	3,055,170,300	
第151回利付国債(20年)	2,125,000,000	2,327,682,500	
第152回利付国債(20年)	2,860,000,000	3,134,016,600	
第153回利付国債(20年)	2,440,000,000	2,705,106,000	
第154回利付国債(20年)	2,810,000,000	3,079,479,000	
第155回利付国債(20年)	2,800,000,000	2,995,580,000	
第156回利付国債(20年)	2,710,000,000	2,680,081,600	
第157回利付国債(20年)	2,950,000,000	2,831,469,000	
第158回利付国債(20年)	2,530,000,000	2,526,609,800	
第159回利付国債(20年)	2,400,000,000	2,426,064,000	
第160回利付国債(20年)	1,890,000,000	1,934,244,900	
第161回利付国債(20年)	1,990,000,000	2,005,263,300	
第162回利付国債(20年)	630,000,000	633,559,500	
第163回利付国債(20年)	1,980,000,000	1,987,088,400	
第164回利付国債(20年)	1,320,000,000	1,301,823,600	
第165回利付国債(20年)	2,180,000,000	2,144,814,800	
第166回利付国債(20年)	1,620,000,000	1,640,460,600	
第167回利付国債(20年)	2,150,000,000	2,104,785,500	
第168回利付国債(20年)	1,410,000,000	1,354,375,500	
第169回利付国債(20年)	1,990,000,000	1,874,082,500	
第170回利付国債(20年)	2,390,000,000	2,243,732,000	
第171回利付国債(20年)	1,670,000,000	1,562,802,700	
第172回利付国債(20年)	2,500,000,000	2,375,275,000	
第173回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,225,943,500	
第174回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,341,789,600	
第175回利付国債(20年)	1,960,000,000	1,879,973,200	
第176回利付国債(20年)	2,910,000,000	2,785,190,100	
第177回利付国債(20年)	2,390,000,000	2,240,816,200	
第178回利付国債(20年)	1,690,000,000	1,611,753,000	
第179回利付国債(20年)	3,015,000,000	2,868,953,400	
第180回利付国債(20年)	540,000,000	542,322,000	
国債証券合計	503,880,000,000	522,045,299,300	

地方債証券	第2回東京都公募公債(東京ソーシャルボンド(5年))	100,000,000	100,114,000	
	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,150,000	
	第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	100,000,000	91,401,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,594,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	126,218,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	123,943,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	119,954,000	
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	118,185,000	
	第16回東京都公募公債(20年)	200,000,000	223,330,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,187,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	113,133,000	
	第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	91,595,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	228,138,000	
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	226,756,000	
	第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	199,674,000	
	第720回東京都公募公債	100,000,000	100,955,000	
	第726回東京都公募公債	200,000,000	202,302,000	
	第728回東京都公募公債	100,000,000	101,023,000	
	第751回東京都公募公債	100,000,000	101,135,000	
	第765回東京都公募公債	100,000,000	100,580,000	
	第770回東京都公募公債	100,000,000	100,329,000	
	第781回東京都公募公債	300,000,000	299,364,000	
	第800回東京都公募公債	200,000,000	196,798,000	
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,587,000	
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,079,000	
	平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,716,000	
	平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	199,412,000	
	第29回1号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	100,977,000	
	第4回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	258,824,000	
	第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	112,877,000	
	第15回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	226,928,000	
	第17回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,794,000	
	第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	113,736,000	
	第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	110,973,000	
	第78回神奈川県公募公債(5年)	200,000,000	199,872,000	
	第201回神奈川県公募公債	200,250,000	202,144,365	
	第210回神奈川県公募公債	200,000,000	202,148,000	
	第215回神奈川県公募公債	100,000,000	101,395,000	
	第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,504,000	
	第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,507,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,329,000		

第243回神奈川県公募公債	200,000,000	196,724,000	
第6回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	226,980,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	227,582,000	
第10回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	113,545,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,075,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,059,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,211,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	152,744,050	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,576,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,551,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	156,152,880	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,418,000	
第439回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,386,000	
第440回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	99,702,000	
第465回大阪府公募公債(10年)	160,000,000	156,926,400	
第468回大阪府公募公債(10年)	182,000,000	178,569,300	
第469回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	196,156,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	113,862,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	113,467,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	101,075,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	101,577,000	
平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	96,602,000	
平成29年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	100,136,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	138,032,820	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	111,882,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	101,509,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	107,025,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	105,843,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	105,760,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	400,000,000	458,092,000	
平成25年度第7回兵庫県公募公債	100,000,000	101,015,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,175,000	
第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	98,738,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	296,604,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	112,232,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	95,659,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	113,484,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	111,800,000	
平成26年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	101,316,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,380,000	

平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,482,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,424,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	306,729,500	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	114,181,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,251,000	
平成26年度第5回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	202,558,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,186,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,000,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	200,954,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債（20年）	300,000,000	298,779,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,029,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	94,411,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	196,812,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	98,593,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債（30年）	200,000,000	182,148,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	113,415,000	
平成21年度第1回広島県公募公債（20年）	200,000,000	227,224,000	
平成25年度第4回広島県公募公債	100,000,000	101,021,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	127,093,422	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,300,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	385,940,100	
第3回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	111,702,000	
第6回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	112,912,000	
第6回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	99,542,000	
第7回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	228,522,000	
第8回埼玉県公募公債（15年）	200,000,000	194,882,000	
第10回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	226,928,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	193,582,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	101,172,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	101,480,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,043,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,759,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,356,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	98,358,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	98,243,000	

令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	147,109,500	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	111,816,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	111,926,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	105,695,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	114,838,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	106,421,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	123,667,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	109,202,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	101,462,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	94,411,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	99,475,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	296,175,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	98,428,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	96,318,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	225,824,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	113,795,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	113,484,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	101,072,000	
平成25年度第8回千葉県公募公債	300,000,000	303,027,000	
平成25年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	101,113,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,087,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	101,527,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,043,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,534,000	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	294,972,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	98,573,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	296,316,000	
平成30年度第3回茨城県公募公債	350,000,000	350,087,500	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	225,090,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	100,325,000	
第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,092,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,969,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,993,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,530,000	
第131回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,136,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,540,000	
第134回共同発行市場公募地方債	112,000,000	113,457,120	

第135回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,325,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,259,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,202,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,340,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,132,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,080,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	127,417,686	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,559,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,135,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,059,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,000,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,832,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,740,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,886,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,445,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,740,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,664,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	194,350,518	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,379,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,000,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,317,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,384,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	228,116,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	90,667,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	291,105,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	100,774,000	
平成25年度第8回大阪市公募公債	100,000,000	101,290,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	196,960,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	124,982,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	128,139,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	112,056,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	117,144,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,630,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	296,061,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	200,892,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	132,172,800	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	226,234,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	114,675,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	113,684,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	90,464,000	



令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	90,964,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	106,604,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	339,930,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,421,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,625,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	100,088,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,502,000	
第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	221,436,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	296,073,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	98,478,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	106,677,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,019,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	112,537,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,390,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	98,209,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,078,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,544,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	100,058,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	113,492,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	112,052,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	202,462,000	
平成30年度第5回福岡市公募公債（5年）	200,000,000	200,048,000	
平成30年度第10回福岡市公募公債（5年）	100,000,000	100,006,000	
平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	151,731,000	
平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,093,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,410,550	
平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	170,634,100	
令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	542,250,500	
令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	200,000,000	199,754,000	
令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	196,648,000	
平成25年度第4回福井県公募公債	100,000,000	101,311,000	
平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	201,580,000	
第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	111,493,000	
地方債証券合計	32,361,680,000	33,429,716,111	
特殊債券			
第2回政府保証新関西国際空港債券	202,000,000	204,058,380	
第22回政府保証日本政策投資銀行債券	300,000,000	307,383,000	
第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,137,000	

第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,976,000	
第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	83,933,000	
第21回道路債券	100,000,000	124,803,000	
第27回道路債券	400,000,000	417,696,000	
第28回道路債券	200,000,000	252,814,000	
第33回道路債券	200,000,000	256,218,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,731,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	139,483,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,301,000	
第42回道路債券	100,000,000	106,204,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,624,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	132,109,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	226,994,000	
第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	228,928,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,766,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,266,000	
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,748,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,971,000	
第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,191,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,289,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,919,000	
第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,010,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,100,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,239,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	217,216,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,316,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	596,166,000	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,054,000	
	148,000,000	149,685,720	

第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第202回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,060,000	
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	265,800,000	268,649,376	
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,328,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,449,000	
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	533,000,000	540,014,280	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,224,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	223,768,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	103,355,580	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,364,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,314,000	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	222,332,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,297,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,188,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,496,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,268,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	217,864,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,158,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,417,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	87,833,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,756,040	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	205,481,750	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,340,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,594,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,258,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	120,379,200	
	200,000,000	199,820,000	

第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	297,795,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	214,464,380	
第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,417,000	
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,137,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	364,836,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	106,114,000	
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	100,000,000	100,401,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	379,128,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	104,027,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	253,406,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	41,648,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	124,824,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	227,208,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	222,882,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	600,000,000	599,874,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	177,356,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	110,285,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	228,292,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	113,209,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	565,020,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,079,000	
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	106,100,400	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,392,000	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,209,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,305,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,588,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,187,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,199,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,996,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,375,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,270,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,942,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,158,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,956,000	

第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,137,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	251,800,690	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,526,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,316,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,276,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,377,300	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,818,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	156,357,240	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,248,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,340,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,341,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,327,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,430,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,030,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,954,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,074,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,045,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	106,059,000	
第19回水資源債券(サステナビリティボンド)	200,000,000	199,746,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	113,687,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	115,834,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,926,920	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,318,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	209,775,300	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	187,396,440	
第54回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	219,951,600	
第87回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,856,000	
第88回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,924,000	
第89回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,943,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	207,520,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	153,956,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	84,619,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	180,724,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	105,650,000	
第16回政府保証民間都市開発債券	180,000,000	181,870,200	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,236,400	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	98,651,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,245,000	10,320,198	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,648,000	10,778,438	

第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,742,000	10,902,485	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	134,739,000	134,144,801	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	95,042,000	94,686,542	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,702,000	10,847,868	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,619,000	11,849,520	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	169,236,000	168,229,045	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,501,000	11,721,589	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	192,255,000	190,791,939	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	68,772,000	68,417,824	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	9,987,000	10,056,409	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,929,000	12,258,717	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	230,094,000	228,550,069	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	10,194,000	10,265,663	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	158,322,000	157,417,981	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,070,000	12,387,441	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,880,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,938,000	16,736,015	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,069,000	16,922,263	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,978,000	19,052,904	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,816,000	20,891,414	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,714,000	23,015,102	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,275,000	23,581,206	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,492,000	49,089,508	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,407,000	10,477,975	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,992,000	22,084,423	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,670,000	10,793,238	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,307,000	10,389,868	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,375,000	22,480,087	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,015,000	22,134,679	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,831,000	20,832,465	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,492,000	11,766,314	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,464,000	44,373,181	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,311,000	23,339,760	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,196,000	11,413,090	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,588,000	30,915,613	

第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,330,000	29,583,035
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,630,000	29,920,354
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,376,000	67,121,636
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,318,000	79,043,315
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,271,000	40,628,205
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,842,000	41,558,393
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,092,000	41,868,476
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,047,000	36,481,123
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,329,000	35,471,812
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,865,000	41,669,289
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	172,765,500
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	104,565,000	108,044,923
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	142,232,000	146,944,146
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,575,000	41,829,984
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,885,000	43,204,377
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,880,000	44,103,795
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,000,000
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	134,922,000	138,707,911
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,395,000	47,505,232
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,682,000	99,325,011
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,295,000	55,377,642
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,033,000	59,005,052
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,478,000	58,728,146
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,620,000	183,178,382
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	120,492,000	123,403,086
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,204,000	59,493,218
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,181,000	64,586,145
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,494,000	68,838,671
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,109,000	74,576,477
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,747,000	74,039,145
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,046,000	74,656,511
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,502,000	75,432,538
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,026,000	75,823,010
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,872,000	77,597,111
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,273,000	78,074,969
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,125,000	77,709,375

第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,131,000	77,709,873	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,840,000	78,442,646	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,830,000	158,656,847	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,103,000	78,648,157	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,548,000	160,958,349	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,142,000	79,670,765	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,908,000	159,659,353	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,458,000	80,953,774	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	163,600,000	162,287,928	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,636,000	163,281,045	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	121,909,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,408,000	83,131,085	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,925,000	82,827,977	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,194,000	82,398,665	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,234,000	168,829,874	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,907,000	84,601,213	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,264,000	84,089,062	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	172,908,000	170,246,945	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,589,000	85,612,992	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	264,483,000	257,146,241	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,290,000	172,329,425	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,165,000	88,875,640	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,795,000	89,241,497	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,272,000	183,874,679	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,267,000	92,924,637	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,800,000	186,049,184	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,028,000	186,894,438	



第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,657,000	93,337,481	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,498,000	188,596,829	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,824,000	189,959,470	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,517,000	95,473,651	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,503,000	95,912,726	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	292,386,000	287,567,478	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,777,000	96,289,811	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,349,000	99,256,605	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	94,200,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	91,199,000	
第64回日本学生支援債券	300,000,000	299,898,000	
第65回日本学生支援債券	200,000,000	199,908,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	106,184,000	
第24回沖縄振興開発金融公庫債券	600,000,000	600,504,000	
い第823号商工債	200,000,000	200,322,000	
い第829号商工債	200,000,000	200,126,000	
い第832号商工債	200,000,000	199,786,000	
い第833号商工債	100,000,000	99,840,000	
い第843号商工債	200,000,000	199,928,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,855,000	
い第850号商工債	200,000,000	199,536,000	
第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,033,000	
第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,620,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,729,000	
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,650,000	
第385回信金中金債（5年）	100,000,000	99,540,000	
第254号商工債（3年）	300,000,000	299,772,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	101,394,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	113,943,000	
第53回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,108,000	
第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,599,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	198,192,000	
第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	494,205,000	
第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,633,000	
第60回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,880,000	
第63回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,888,000	
第57回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	400,000,000	403,596,000	

	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,899,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,914,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	194,936,000	
	特殊債券合計	35,352,796,000	36,348,012,167	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,888,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	300,000,000	298,692,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	99,670,000	
	第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	400,000,000	400,900,000	
	第8回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,616,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,169,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,893,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,531,000	
	第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債	400,000,000	398,636,000	
	第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	400,000,000	400,152,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,604,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,624,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,736,000	
	第15回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	200,000,000	199,562,000	
	第11回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,051,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	298,803,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,358,000	
	第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,160,000	
	第9回明治ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,674,000	
	第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,208,000	
	第13回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,770,000	
	第10回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,215,000	
	第19回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,840,000	
	第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,053,000	
	第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,572,000	
	第10回J・フロント リテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	99,138,000	

第18回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,926,000	
第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,793,000	
第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	200,000,000	199,936,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,752,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,887,000	
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	100,051,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,523,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,038,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	199,346,000	
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	200,100,000	
第40回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,561,000	
第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	94,758,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,867,000	
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,686,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,972,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	198,944,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	293,910,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,061,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	97,429,000	
第15回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,667,000	
第19回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	95,460,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	101,754,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,297,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,882,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,965,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,479,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,903,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,012,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,689,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	106,237,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,677,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,705,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,972,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	98,732,000	

第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,209,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,732,000	
第20回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,885,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,860,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	98,090,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,685,000	
第19回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,496,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,065,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,759,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,064,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,726,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	197,326,000	
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	100,000,000	99,977,000	
第8回楽天カード株式会社無担保社債	100,000,000	97,102,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,795,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	92,995,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,290,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,056,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	114,549,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	197,626,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,903,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,890,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債(劣後特)	100,000,000	99,084,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	115,822,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	110,316,000	
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	100,000,000	101,050,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,012,000	
第1回みずほFG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	300,000,000	303,108,000	
第3回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,956,000	
第4回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,886,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,091,000	
第16回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,008,000	
第18回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	198,744,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	98,241,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,821,000	
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,686,000	

第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,920,000	
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,825,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,911,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,401,000	
第16回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,618,000	
第17回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,507,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,784,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,462,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,307,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,835,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,151,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	97,912,000	
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,778,000	
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,198,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,056,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	200,062,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,231,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,852,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,696,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	800,000,000	800,136,000	
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,452,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	199,472,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,580,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,656,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	94,720,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,176,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,385,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,400,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	98,120,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,065,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,150,000	
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,737,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	93,006,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	95,994,000	

第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,644,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,518,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	95,229,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	88,947,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	96,445,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,705,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,813,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	226,464,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,456,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,149,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,301,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,919,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	92,248,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	94,767,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	88,917,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	112,425,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	92,749,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,049,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	499,695,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	94,460,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	124,106,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,149,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,895,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	97,320,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	83,939,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	80,212,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	91,119,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	97,378,000	
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	178,884,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,431,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,123,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,824,000	
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	397,780,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	195,880,000	

第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	97,660,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	97,065,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,378,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,771,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,658,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	93,189,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,389,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	201,038,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,078,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,245,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,609,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,141,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,681,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,392,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,894,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	198,366,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,708,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	103,245,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,102,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	198,028,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	128,100,420	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,856,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,815,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,799,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	198,146,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,702,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,472,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	98,993,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,691,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	200,778,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,529,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,839,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	197,468,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,920,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,402,000	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,919,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,510,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	97,759,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,679,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,272,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,491,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,350,000	
	200,000,000	201,710,000	

第3 1回東京電力パワーグリッド株式会社社債			
第3 8回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	301,425,000	
第3 9回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,313,000	
第4 1回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	301,437,000	
第4 2回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,252,000	
第4 4回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,617,000	
第4 5回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,854,000	
第4 8回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	287,514,000	
第6 4回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	91,454,000	
第6 5回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	197,096,000	
第4 1回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	196,522,000	
第4 2回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	94,106,000	
第2 7回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	100,887,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	200,142,000	
社債券合計	29,626,000,000	29,525,342,420	
合計		621,348,369,998	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 5月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	875,096,024
コール・ローン	15,604,284,647
国債証券	294,922,986,192
派生商品評価勘定	3,843,289



	2022年 5月10日現在
項目	金額（円）
未収入金	80,151,868
未収利息	1,877,975,458
前払金	24,875,325
前払費用	102,417,404
差入委託証拠金	666,127,933
流動資産合計	314,157,758,140
資産合計	314,157,758,140
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	33,402,390
未払金	598,695,508
未払解約金	291,032,996
未払利息	8,131
流動負債合計	923,139,025
負債合計	923,139,025
純資産の部	
元本等	
元本	101,616,434,355
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	211,618,184,760
元本等合計	313,234,619,115
純資産合計	313,234,619,115
負債純資産合計	314,157,758,140

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <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>

2022年 5月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2022年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	101,616,434,355口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.0825円 (1万口当たり純資産額) (30,825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 5月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2022年 5月10日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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 5月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月11日
期首元本額	97,161,984,167円
期中追加設定元本額	7,967,283,939円
期中一部解約元本額	3,512,833,751円
期末元本額	101,616,434,355円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,325,694,178円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	573,403,020円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	387,700,518円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,163,457,603円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,653,367円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,158,471,655円
世界経済インデックスファンド	13,496,613,537円
DCマイセレクション25	1,951,687,787円
DCマイセレクション50	1,673,371,956円
DCマイセレクション75	1,154,332,537円
DC外国債券インデックス・オープン	2,295,643,558円
DCマイセレクションS25	925,247,860円
DCマイセレクションS50	732,085,523円
DCマイセレクションS75	414,437,730円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	30,275,780円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	91,673,396円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	47,019,824円
DC世界経済インデックスファンド	12,568,572,862円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	595,029,548円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,650,011円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,395,846円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	23,165,922円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	47,930,499円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	71,940,031円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	73,784,318円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	70,266,398円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,330,421,986円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	448,324,524円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,774,225,416円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	86,819,755円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	53,860,232円

区分	2022年 5月10日現在
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	453,490,427円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	170,008,549円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	212,422,323円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	747,594,702円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	2,037,953,800円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	744,152,939円
外国債券ファンド・シリーズ1	701,391,774円
コア投資戦略ファンド(安定型)	539,035,373円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,411,756,777円
分散投資コア戦略ファンドA	259,544,875円
分散投資コア戦略ファンドS	556,972,964円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	539,633,074円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,979,915,435円
コア投資戦略ファンド(切替型)	537,685,860円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	250,614,642円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	111,292,957円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,308,034,730円
SMT インデックスバランス・オープン	196,544,087円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	19,485,147,850円
SMT 世界経済インデックス・オープン	246,894,754円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	305,906,068円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	494,922,494円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,019,868円
グローバル経済コア	841,930,138円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	16,292,013円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,744,201円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	193,600,906円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	28,394,173円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	10,674,689円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	11,274,149円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	5,078,311円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	7,088,489円
My SMT グローバル債券インデックス(ノーロード)	159,736円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	283,515,955円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	11,008,271,484円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	331,764,704円
外国債券インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	305,231,105円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	360,436,892円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	164,843,298円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	72,507,626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)	100,532,987円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 5月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		34,130,895,038
合計		34,130,895,038

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2022年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	債券先物取引 買建	2,970,959,220	-		2,946,083,895	24,875,325
	合計	2,970,959,220	-		2,946,083,895	24,875,325

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2022年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	2,724,378,213	-		2,718,480,761	5,897,452
	アメリカドル	1,472,480,766	-		1,470,354,288	2,126,478
	カナダドル	120,336,819	-		118,831,853	1,504,966
	ユーロ	950,307,540	-		951,321,294	1,013,754
	イギリスポンド	181,251,826	-		177,972,072	3,279,754
	イスラエルシェケル	1,262	-		1,254	8
	売建	217,398,864	-		216,185,188	1,213,676
	アメリカドル	83,982,128	-		83,504,194	477,934

	ユーロ	48,136,054	-	48,012,935	123,119
	シンガポールドル	1,142,811	-	1,134,548	8,263
	マレーシアリン ギット	84,137,871	-	83,533,511	604,360
	合計	2,941,777,077	-	2,934,665,949	4,683,776

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	10,000,000.00	9,609,375.00	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,514,884.57	
		T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,356,005.85	
		T 0.125% 05/31/23	6,800,000.00	6,658,953.10	
		T 0.125% 07/31/23	5,000,000.00	4,870,996.10	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	7,824,811.69	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,746,875.04	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,130,981.45	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,459,687.50	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,539,062.50	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	7,838,125.04	
		T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,562,656.25	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	922,578.13	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,785,015.61	
		T 0.25% 09/30/23	12,000,000.00	11,656,171.92	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	6,868,945.35	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,290,343.76	
		T 0.25% 11/15/23	11,000,000.00	10,645,507.84	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,291,875.04	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,709,335.92	

T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,445,937.52	
T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,576,041.81	
T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,815,937.50	
T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,746,289.05	
T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,249,117.20	
T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	6,967,812.48	
T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,747,226.57	
T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,656,406.24	
T 0.5% 02/28/26	11,500,000.00	10,510,820.37	
T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,761,417.22	
T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,609,824.21	
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,096,542.96	
T 0.5% 06/30/27	3,100,000.00	2,737,445.32	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,095,703.12	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,562,500.00	
T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	11,712,914.13	
T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,270,625.04	
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,871,820.31	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,198,242.20	
T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	8,773,046.90	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,495,273.48	
T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	10,132,460.91	
T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,758,593.75	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,669,687.52	
T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	10,790,716.04	
T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,332,271.87	
T 0.75% 12/31/23	3,370,000.00	3,274,823.81	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,364,062.48	
T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,492,812.50	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,372,968.75	
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,509,671.89	
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	12,879,507.81	
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,121,816.38	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,206,562.48	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,192,858.60	
T 1.125% 08/15/40	7,300,000.00	5,060,953.12	
T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	9,096,073.07	
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	4,662,158.21	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,229,687.52	
T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	5,492,750.00	
T 1.25% 05/31/28	8,000,000.00	7,218,750.00	
T 1.25% 06/30/28	9,500,000.00	8,555,937.50	



T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,495,879.88
T 1.25% 08/15/31	12,680,000.00	10,875,081.25
T 1.25% 09/30/28	14,500,000.00	12,999,023.51
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,500,976.58
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,609,175.81
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,852,343.76
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,956,054.70
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	6,504,609.37
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,470,068.35
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	3,946,953.12
T 1.375% 11/15/31	18,030,000.00	15,579,046.87
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	4,342,031.28
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,415,359.37
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,620,312.50
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,798,737.50
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	7,068,750.00
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,261,933.61
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,815,625.00
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,732,652.36
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,159,869.54
T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	9,933,082.08
T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	994,843.75
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,144,609.37
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,472,265.62
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,646,656.26
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,853,179.72
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,516,166.41
T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,678,612.88
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,355,093.74
T 1.75% 08/15/41	14,500,000.00	11,110,625.00
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,749,218.75
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	6,245,320.35
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,956,703.15
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,810,937.52
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,977,534.37
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,888,671.86
T 1.875% 11/15/51	9,300,000.00	6,996,070.35
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,196,367.17
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,648,750.00
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,062,746.08
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,340,453.16
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,351,625.00
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,492,281.26

T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,744,500.00	
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,932,421.90	
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,667,332.81	
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	3,981,328.12	
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,670,312.50	
T 2.25% 02/15/52	2,300,000.00	1,896,601.57	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,320,703.12	
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	6,954,609.41	
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	5,421,857.83	
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	8,247,410.19	
T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	3,394,554.68	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	4,502,265.62	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,226,417.95	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,023,521.45	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,308,562.50	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,365,216.81	
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,482,246.10	
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,327,648.42	
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,743,350.02	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,549,117.19	
T 2.375% 05/15/27	2,690,000.00	2,617,391.00	
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,681,464.88	
T 2.375% 05/15/51	2,750,000.00	2,321,816.42	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,964,453.15	
T 2.375% 11/15/49	6,100,000.00	5,142,109.37	
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,467,627.94	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,962,890.65	
T 2.5% 02/15/45	1,710,000.00	1,456,973.43	
T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	3,408,437.52	
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	7,884,261.69	
T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	4,301,574.24	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,563,774.39	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,646,031.25	
T 2.625% 02/15/29	13,340,000.00	13,007,542.25	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,214,599.62	
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	4,924,308.60	
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,508,681.64	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,771,121.07	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,010,078.14	
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,462,496.12	
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	3,905,159.39	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,487,753.92	

T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,006,015.63
T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,173,148.44
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,631,078.12
T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,508,496.09
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,876,011.73
T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,331,373.42
T 2.75% 11/15/42	3,920,000.00	3,530,756.26
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,736,421.87
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,007,500.00
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	7,203,564.82
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	3,808,273.43
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	5,181,840.62
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,825,670.33
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,465,545.33
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,885,240.61
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	2,098,750.00
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,784,418.92
T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,516,357.42
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	2,287,695.32
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,045,988.65
T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	7,498,828.12
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,282,538.30
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	3,859,375.00
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,160,034.17
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,269,271.47
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,426,953.12
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	6,706,446.12
T 2% 08/15/51	15,150,000.00	11,738,882.81
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	9,811,599.19
T 2% 11/15/41	5,700,000.00	4,562,226.58
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,011,527.34
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,913,437.50
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	5,742,371.12
T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	3,941,732.83
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	8,444,625.00
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	1,686,015.62
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,986,719.54
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	5,388,609.37
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	800,980.47
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,475,375.00
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,065,156.26
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,108,281.26
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	3,155,625.00

T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,563,281.25	
T 3% 02/15/47	800,000.00	748,500.00	
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	4,200,730.49	
T 3% 02/15/49	5,000,000.00	4,759,375.00	
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,528,115.62	
T 3% 05/15/45	2,500,000.00	2,329,882.82	
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	3,007,368.75	
T 3% 08/15/48	5,450,000.00	5,148,972.68	
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,218,703.14	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,020,703.15	
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,606,843.76	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,024,945.31	
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	2,650,910.16	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,157,656.25	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,188,859.37	
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,231,378.91	
T 4.375% 11/15/39	2,960,000.00	3,413,481.26	
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,278,280.47	
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	645,132.81	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,992,718.75	
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,640,475.00	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	901,406.25	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,353,601.56	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,470,929.69	
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,302,980.47	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,888,128.90	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,679,734.37	
T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,292,156.25	
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,732,854.48	
アメリカドル 小計	1,219,330,000.00	1,131,413,943.70 (147,117,755,099)	
カナダドル			
CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,075,712.00	
CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,296,272.00	
CAN 0.25% 05/01/23	2,600,000.00	2,546,284.00	
CAN 0.25% 08/01/23	1,360,000.00	1,323,456.80	
CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,306,697.60	
CAN 0.5% 12/01/30	2,590,000.00	2,101,085.70	
CAN 0.75% 02/01/24	1,300,000.00	1,259,622.00	
CAN 0.75% 10/01/24	450,000.00	430,168.50	
CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,384,387.20	
CAN 1.25% 03/01/27	2,980,000.00	2,774,976.00	
CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,174,414.20	

	CAN 1.5% 05/01/24	490,000.00	479,269.00	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,059,396.30	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,296,284.00	
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,497,609.70	
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,169,208.00	
	CAN 1.5% 12/01/31	4,170,000.00	3,649,041.90	
	CAN 1.75% 12/01/53	1,830,000.00	1,376,050.20	
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	742,907.70	
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,421,002.80	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,286,476.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,776,978.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,207,546.20	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,330,000.00	1,326,262.70	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,650,000.00	1,577,482.50	
	CAN 2.75% 12/01/64	760,000.00	713,792.00	
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,249,766.20	
	CAN 2% 06/01/32	700,000.00	637,770.00	
	CAN 2% 09/01/23	3,460,000.00	3,437,856.00	
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	3,816,701.40	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,300,000.00	1,399,918.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,187,403.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,380,752.10	
	CAN 5.75% 06/01/33	960,000.00	1,199,836.80	
	CAN 5% 06/01/37	420,000.00	515,772.60	
	<b>カナダドル 小計</b>	<b>64,110,000.00</b>	<b>60,078,159.10</b>	<b>(6,000,606,530)</b>
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,056,844.00	
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	31,304,136.00	
	MBONO 5.5% 03/04/27	8,390,000.00	7,256,930.50	
	MBONO 5.75% 03/05/26	47,710,000.00	42,820,202.10	
	MBONO 5% 03/06/25	3,700,000.00	3,337,215.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	36,649,718.10	
	MBONO 7.75% 05/29/31	35,980,000.00	32,922,059.80	
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,040,000.00	20,495,302.00	
	MBONO 7.75% 11/23/34	10,600,000.00	9,433,364.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	38,660,000.00	37,567,081.80	
	MBONO 8.5% 11/18/38	25,720,000.00	24,058,745.20	
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	33,799,558.50	
	MBONO 8% 11/07/47	28,400,000.00	24,627,060.00	
	MBONO 8% 12/07/23	29,070,000.00	28,718,253.00	
	<b>メキシコペソ 小計</b>	<b>364,760,000.00</b>	<b>342,046,470.00</b>	<b>(2,176,783,735)</b>
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,233,205.50	

BGB 0.2% 10/22/23	1,030,000.00	1,033,265.10
BGB 0.35% 06/22/32	480,000.00	420,811.20
BGB 0.4% 06/22/40	1,240,000.00	936,237.20
BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,621,166.40
BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	349,132.80
BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,693,507.20
BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,672,305.70
BGB 0.8% 06/22/28	1,260,000.00	1,235,505.60
BGB 0.9% 06/22/29	1,560,000.00	1,520,391.60
BGB 0% 10/22/27	430,000.00	406,160.80
BGB 0% 10/22/31	1,020,000.00	877,077.60
BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,446,495.00
BGB 1.4% 06/22/53	610,000.00	506,641.60
BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	747,720.00
BGB 1.6% 06/22/47	1,240,000.00	1,122,547.20
BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	1,189,227.00
BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,043,164.50
BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,296,142.40
BGB 1% 06/22/31	2,770,000.00	2,647,427.50
BGB 2.15% 06/22/66	780,000.00	781,926.60
BGB 2.25% 06/22/23	1,180,000.00	1,211,659.40
BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	795,078.90
BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,242,227.80
BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	1,567,704.00
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,166,402.90
BGB 4.25% 03/28/41	1,870,000.00	2,507,539.10
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,304,878.20
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,316,066.40
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,490,178.80
BGB 5% 03/28/35	2,290,000.00	3,111,148.20
BKO 0% 06/16/23	1,090,000.00	1,091,744.00
BKO 0% 09/15/23	3,150,000.00	3,152,268.00
BKO 0% 12/15/23	1,880,000.00	1,877,875.60
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,478,904.00
BTPS 0.3% 08/15/23	2,900,000.00	2,892,576.00
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	560,720.80
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,788,231.60
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,811,997.90
BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	2,018,803.20
BTPS 0.6% 06/15/23	1,110,000.00	1,114,218.00
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,539,755.20
BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	669,417.10
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,118,217.50

BTPS 0.9% 04/01/31	2,230,000.00	1,865,774.10	
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	747,741.60	
BTPS 0.95% 06/01/32	2,550,000.00	2,076,439.50	
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,914,700.30	
BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,217,898.20	
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,765,200.40	
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	983,200.00	
BTPS 0% 04/01/26	1,460,000.00	1,349,113.00	
BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	2,929,770.00	
BTPS 0% 08/01/26	2,580,000.00	2,361,577.20	
BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,453,395.00	
BTPS 0% 12/15/24	2,900,000.00	2,779,998.00	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,876,660.50	
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	1,740,645.60	
BTPS 1.45% 03/01/36	1,700,000.00	1,370,642.00	
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,279,507.00	
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,392,128.00	
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	885,262.50	
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,394,720.60	
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	2,784,493.60	
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	2,659,335.00	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,290,800.60	
BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	1,165,063.20	
BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	1,008,080.00	
BTPS 1.8% 03/01/41	2,260,000.00	1,774,732.80	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,479,620.50	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,702,538.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,704,928.00	
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,206,272.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	515,613.60	
BTPS 2.15% 09/01/52	920,000.00	698,261.60	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,275,622.40	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,840,000.00	1,638,170.40	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	2,471,092.80	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	1,498,861.00	
BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	2,981,906.10	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,011,714.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,022,953.50	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	1,982,281.60	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,130,000.00	966,319.50	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	1,920,353.40	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,550,000.00	1,486,992.50	

BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,213,579.60
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,098,067.40
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,378,749.00
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	1,926,912.00
BTPS 3.35% 03/01/35	1,820,000.00	1,848,519.40
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,152,881.20
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,179,186.00
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,266,100.00
BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	2,008,502.40
BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	3,426,729.60
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	2,919,730.00
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,281,323.20
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,729,250.20
BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	3,841,515.50
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,972,320.80
BTPS 4.75% 09/01/44	2,100,000.00	2,567,166.00
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	3,871,346.00
BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	3,671,220.00
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,197,453.60
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,833,675.20
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,002,832.20
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	3,541,101.30
BTPS 5% 09/01/40	2,240,000.00	2,761,449.60
BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,386,456.00
BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	3,662,505.00
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,712,368.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	896,624.00
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	3,805,742.60
DBR 0.25% 02/15/29	3,080,000.00	2,950,948.00
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,532,216.60
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	3,086,129.20
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,988,540.00
DBR 0.5% 02/15/28	3,680,000.00	3,612,104.00
DBR 0.5% 08/15/27	1,940,000.00	1,912,316.20
DBR 0% 02/15/30	2,470,000.00	2,293,864.30
DBR 0% 02/15/31	3,120,000.00	2,856,703.20
DBR 0% 02/15/32	2,390,000.00	2,150,020.10
DBR 0% 05/15/35	2,260,000.00	1,932,571.20
DBR 0% 05/15/36	3,380,000.00	2,849,678.00
DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,229,113.50
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,273,200.00
DBR 0% 08/15/30	4,190,000.00	3,865,694.00
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	619,401.60



DBR 0% 08/15/31	3,450,000.00	3,131,185.50	
DBR 0% 08/15/50	4,420,000.00	3,149,736.20	
DBR 0% 08/15/52	1,260,000.00	870,307.20	
DBR 0% 11/15/27	2,960,000.00	2,832,453.60	
DBR 0% 11/15/28	2,500,000.00	2,363,250.00	
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	3,632,160.60	
DBR 1.5% 05/15/23	3,020,000.00	3,071,702.40	
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,346,700.40	
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,695,952.50	
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,029,660.00	
DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,761,779.20	
DBR 2.5% 07/04/44	3,160,000.00	3,981,284.00	
DBR 2.5% 08/15/46	3,810,000.00	4,895,202.30	
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	2,936,905.40	
DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	3,052,847.70	
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,039,122.20	
DBR 4.25% 07/04/39	1,960,000.00	2,883,316.80	
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,148,663.50	
DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	4,224,092.60	
DBR 4.75% 07/04/40	2,480,000.00	3,908,678.40	
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	3,901,535.20	
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,989,931.20	
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,560,009.10	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,741,450.00	
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,263,386.60	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,533,141.60	
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,560,932.00	
FRTR 0.5% 05/25/26	6,690,000.00	6,590,519.70	
FRTR 0.5% 05/25/29	5,350,000.00	5,077,845.50	
FRTR 0.5% 05/25/40	2,760,000.00	2,157,795.60	
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	511,889.40	
FRTR 0.5% 06/25/44	1,530,000.00	1,132,582.50	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	6,149,104.00	
FRTR 0.75% 05/25/52	3,350,000.00	2,386,975.50	
FRTR 0.75% 05/25/53	2,060,000.00	1,440,990.60	
FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,689,066.50	
FRTR 0% 02/25/24	4,850,000.00	4,828,854.00	
FRTR 0% 02/25/25	1,000,000.00	981,960.00	
FRTR 0% 02/25/26	5,210,000.00	5,049,011.00	
FRTR 0% 02/25/27	3,560,000.00	3,392,074.80	
FRTR 0% 03/25/24	3,750,000.00	3,727,575.00	
FRTR 0% 03/25/25	6,390,000.00	6,273,765.90	

FRTR 0% 05/25/32	1,970,000.00	1,674,736.40
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	4,759,090.20
FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	5,335,373.60
FRTR 0% 11/25/31	4,990,000.00	4,299,733.30
FRTR 1.25% 05/25/34	4,090,000.00	3,863,209.50
FRTR 1.25% 05/25/36	5,130,000.00	4,756,125.60
FRTR 1.5% 05/25/31	6,770,000.00	6,787,331.20
FRTR 1.5% 05/25/50	3,590,000.00	3,201,418.40
FRTR 1.75% 05/25/23	5,380,000.00	5,484,748.60
FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	1,634,289.20
FRTR 1.75% 06/25/39	3,320,000.00	3,280,326.00
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,285,632.00
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,646,094.00
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,322,028.80
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,256,579.00
FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000.00	6,941,376.20
FRTR 2.75% 10/25/27	5,110,000.00	5,570,257.70
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	3,573,243.20
FRTR 3.25% 05/25/45	3,400,000.00	4,207,330.00
FRTR 3.5% 04/25/26	5,050,000.00	5,572,826.50
FRTR 4.25% 10/25/23	5,650,000.00	5,994,593.50
FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	6,338,441.20
FRTR 4.75% 04/25/35	3,630,000.00	4,886,088.90
FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	3,555,948.00
FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	3,075,571.80
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	4,396,299.80
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	6,647,120.70
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	6,068,708.80
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,240,955.00
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	892,567.50
IRISH 0.2% 10/18/30	1,090,000.00	972,094.70
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	404,388.00
IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	504,433.40
IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	385,980.00
IRISH 0.9% 05/15/28	690,000.00	674,516.40
IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	724,633.50
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,178,988.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	633,210.30
IRISH 1.35% 03/18/31	620,000.00	610,811.60
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	698,520.00
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	796,605.40
IRISH 1% 05/15/26	1,640,000.00	1,663,435.60
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,297,168.40

IRISH 2% 02/18/45	1,150,000.00	1,143,732.50	
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,024,805.00	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,314,628.00	
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,283,596.70	
NETHER 0.25% 07/15/29	1,570,000.00	1,475,156.30	
NETHER 0.5% 01/15/40	1,040,000.00	881,649.60	
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,294,665.60	
NETHER 0.5% 07/15/32	700,000.00	642,131.00	
NETHER 0.75% 07/15/27	1,560,000.00	1,546,771.20	
NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,593,448.20	
NETHER 0% 01/15/24	2,230,000.00	2,224,447.30	
NETHER 0% 01/15/26	790,000.00	768,093.30	
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,767,522.40	
NETHER 0% 01/15/29	1,390,000.00	1,289,822.70	
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	757,795.20	
NETHER 0% 01/15/52	1,490,000.00	992,816.80	
NETHER 0% 07/15/30	1,500,000.00	1,359,075.00	
NETHER 0% 07/15/31	1,370,000.00	1,220,478.20	
NETHER 1.75% 07/15/23	1,540,000.00	1,574,573.00	
NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,240,826.40	
NETHER 2.75% 01/15/47	2,330,000.00	3,002,391.40	
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,061,162.40	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	3,113,392.50	
NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	2,894,211.60	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,162,897.90	
OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,316,347.00	
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,996,381.40	
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,699,487.50	
OBL 0% 04/16/27	1,100,000.00	1,059,454.00	
OBL 0% 10/09/26	2,900,000.00	2,811,521.00	
OBL 0% 10/10/25	3,500,000.00	3,435,215.00	
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,511,510.00	
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,388,261.80	
RAGB 0.25% 10/20/36	390,000.00	316,914.00	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,770,000.00	1,680,597.30	
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	867,545.30	
RAGB 0.7% 04/20/71	440,000.00	276,012.00	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,210,000.00	1,184,723.10	
RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	604,320.60	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,059,616.00	
RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	173,718.60	
RAGB 0.9% 02/20/32	510,000.00	477,064.20	

RAGB 0% 02/20/30	1,450,000.00	1,300,389.00
RAGB 0% 02/20/31	1,640,000.00	1,439,165.60
RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	911,465.10
RAGB 0% 07/15/23	1,120,000.00	1,121,265.60
RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,429,502.40
RAGB 0% 10/20/40	670,000.00	483,009.70
RAGB 1.2% 10/20/25	1,070,000.00	1,085,343.80
RAGB 1.5% 02/20/47	1,030,000.00	988,532.20
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	223,497.90
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,019,412.90
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,363,875.10
RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	807,788.70
RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,174,230.00
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,059,644.40
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	652,965.60
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,420,017.60
RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,585,048.90
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,493,962.60
RFGB 0.125% 04/15/36	330,000.00	266,385.90
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	294,390.80
RFGB 0.125% 09/15/31	540,000.00	474,967.80
RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	384,735.00
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	611,599.00
RFGB 0.5% 04/15/43	380,000.00	298,178.40
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	846,327.30
RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	622,765.00
RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	718,534.40
RFGB 0.75% 04/15/31	800,000.00	754,752.00
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	693,705.30
RFGB 0% 09/15/23	570,000.00	569,994.30
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	415,854.60
RFGB 0% 09/15/26	200,000.00	191,798.00
RFGB 0% 09/15/30	630,000.00	560,882.70
RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	529,172.00
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	467,293.40
RFGB 2.625% 07/04/42	640,000.00	740,083.20
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	604,114.50
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	754,681.30
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	917,830.60
SPGB 0.1% 04/30/31	3,180,000.00	2,675,016.00
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,265,657.30
SPGB 0.35% 07/30/23	3,590,000.00	3,601,631.60
SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,611,711.00

SPGB 0.5% 10/31/31	1,960,000.00	1,687,638.40	
SPGB 0.6% 10/31/29	2,950,000.00	2,708,188.50	
SPGB 0.7% 04/30/32	1,650,000.00	1,429,032.00	
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,355,673.60	
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,151,560.40	
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,224,573.20	
SPGB 0% 01/31/26	2,720,000.00	2,598,388.80	
SPGB 0% 01/31/27	1,560,000.00	1,457,773.20	
SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,765,737.70	
SPGB 0% 04/30/23	1,630,000.00	1,630,815.00	
SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,081,050.80	
SPGB 1.2% 10/31/40	2,260,000.00	1,799,886.60	
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	2,886,794.50	
SPGB 1.3% 10/31/26	2,750,000.00	2,749,175.00	
SPGB 1.4% 04/30/28	2,490,000.00	2,465,199.60	
SPGB 1.4% 07/30/28	3,570,000.00	3,525,767.70	
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,642,521.50	
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,030,515.20	
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	406,903.20	
SPGB 1.5% 04/30/27	2,650,000.00	2,657,287.50	
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,105,571.00	
SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	2,582,635.00	
SPGB 1.9% 10/31/52	900,000.00	735,669.00	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	2,886,544.40	
SPGB 1.95% 07/30/30	1,990,000.00	1,997,701.30	
SPGB 1% 07/30/42	650,000.00	491,452.00	
SPGB 1% 10/31/50	2,470,000.00	1,653,763.80	
SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	2,911,665.80	
SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,467,059.60	
SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	1,872,385.00	
SPGB 2.75% 10/31/24	3,050,000.00	3,197,925.00	
SPGB 2.9% 10/31/46	2,200,000.00	2,319,944.00	
SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	1,983,489.60	
SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,676,592.80	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,097,757.30	
SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,855,085.30	
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,161,658.40	
SPGB 4.7% 07/30/41	2,240,000.00	2,988,361.60	
SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,580,336.00	
SPGB 4.9% 07/30/40	2,250,000.00	3,055,410.00	
SPGB 5.15% 10/31/28	3,490,000.00	4,239,931.20	
SPGB 5.15% 10/31/44	1,740,000.00	2,511,568.20	

	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,814,124.60
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,453,254.00
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,341,564.00
	ユーロ 小計	761,530,000.00	776,687,971.30 (106,615,957,820)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,444,988.00
	UKT 0.125% 01/31/24	3,300,000.00	3,227,466.00
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,071,809.80
	UKT 0.25% 01/31/25	1,110,000.00	1,072,670.70
	UKT 0.25% 07/31/31	3,270,000.00	2,808,897.30
	UKT 0.375% 10/22/26	1,910,000.00	1,809,629.50
	UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,147,653.20
	UKT 0.5% 01/31/29	1,020,000.00	937,992.00
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	794,325.20
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,658,792.00
	UKT 0.625% 07/31/35	2,360,000.00	1,946,433.60
	UKT 0.625% 10/22/50	880,000.00	598,954.40
	UKT 0.75% 07/22/23	2,360,000.00	2,344,966.80
	UKT 0.875% 01/31/46	1,170,000.00	885,140.10
	UKT 0.875% 07/31/33	510,000.00	451,727.40
	UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,595,994.00
	UKT 1.125% 01/31/39	500,000.00	424,545.00
	UKT 1.125% 10/22/73	520,000.00	390,863.20
	UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	934,762.00
	UKT 1.25% 07/31/51	830,000.00	668,208.10
	UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,375,716.00
	UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,599,424.00
	UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	2,054,387.10
	UKT 1.5% 07/31/53	200,000.00	172,498.00
	UKT 1.625% 10/22/28	1,620,000.00	1,617,586.20
	UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	1,649,187.60
	UKT 1.625% 10/22/71	1,320,000.00	1,195,075.20
	UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,189,110.00
	UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	2,037,354.80
	UKT 1.75% 09/07/37	2,630,000.00	2,476,618.40
	UKT 1% 01/31/32	400,000.00	365,480.00
	UKT 1% 04/22/24	800,000.00	794,248.00
UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,529,375.00	
UKT 2.5% 07/22/65	1,510,000.00	1,735,337.30	
UKT 2.75% 09/07/24	1,690,000.00	1,740,953.50	
UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,810,847.40	
UKT 3.25% 01/22/44	2,180,000.00	2,566,688.40	
UKT 3.5% 01/22/45	2,290,000.00	2,812,898.60	

	UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	2,813,264.50	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,170,672.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	1,640,000.00	2,050,000.00	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,539,614.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	2,100,605.40	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,560,347.80	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	2,293,882.50	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,920,000.00	2,661,926.40	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	2,156,280.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	2,902,130.40	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,860,000.00	2,347,785.00	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,210,000.00	3,046,286.10	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,800,223.80	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,242,762.50	
	UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	2,334,547.60	
	UKT 5% 03/07/25	1,800,000.00	1,972,674.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,584,537.50	
	イギリスポンド 小計	91,810,000.00	97,516,143.30	(15,638,663,901)
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	5,505,711.20	
	SGB 0.75% 05/12/28	7,800,000.00	7,300,722.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,560,000.00	6,941,440.80	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,531,250.00	
	SGB 1% 11/12/26	8,440,000.00	8,147,638.40	
	SGB 2.25% 06/01/32	4,980,000.00	5,113,165.20	
	SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	9,521,154.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,310,000.00	6,408,957.60	
	スウェーデンクローナ 小計	62,360,000.00	61,470,039.20	(791,119,404)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,590,000.00	3,092,892.70	
	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	5,746,723.20	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,670,000.00	4,463,305.80	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,680,000.00	4,461,958.80	
	NGB 1.75% 03/13/25	5,720,000.00	5,579,230.80	
	NGB 1.75% 09/06/29	6,340,000.00	5,859,554.80	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,220,000.00	2,986,678.80	
	NGB 2% 04/26/28	5,020,000.00	4,785,365.20	
	NGB 2% 05/24/23	10,660,000.00	10,678,441.80	
	NGB 3% 03/14/24	7,760,000.00	7,844,040.80	
	ノルウェークローネ 小計	58,140,000.00	55,498,192.70	(743,675,782)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	6,050,000.00	4,210,679.00	

	DGB 0.5% 11/15/27	8,850,000.00	8,566,180.50	
	DGB 0.5% 11/15/29	12,410,000.00	11,727,077.70	
	DGB 0% 11/15/24	2,130,000.00	2,097,432.30	
	DGB 0% 11/15/31	5,830,000.00	5,099,326.10	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,550,000.00	7,709,758.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	5,510,000.00	5,683,675.20	
	DGB 4.5% 11/15/39	12,840,000.00	18,660,115.20	
	デンマーククローネ 小計	61,170,000.00	63,754,244.00	(1,176,265,801)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,850,000.00	2,112,306.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	2,980,004.80	
	POLGB 0% 07/25/24	2,160,000.00	1,857,211.20	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	2,694,927.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	650,000.00	412,548.50	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,521,555.10	
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,550,000.00	3,284,495.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	5,044,344.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	3,026,419.20	
	POLGB 2.75% 04/25/28	5,750,000.00	4,569,525.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	4,721,726.40	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	4,422,338.80	
	POLGB 4% 10/25/23	2,410,000.00	2,324,396.80	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	561,612.00	
		ポーランドズロチ 小計	50,580,000.00	41,533,410.30
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	3,430,000.00	3,212,503.70	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,121,210.00	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,040,000.00	1,820,659.20	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,216,249.00	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	2,693,986.90	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,760,000.00	1,111,404.80	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,910,000.00	2,453,071.80	
	ACGB 1% 11/21/31	3,250,000.00	2,591,777.50	
	ACGB 1% 12/21/30	2,360,000.00	1,926,137.60	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,140,000.00	1,074,187.80	
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,830,000.00	2,643,220.00	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,381,159.20	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,389,868.40	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,050,000.00	952,938.00	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,880,785.00	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,602,165.60	
ACGB 2.75% 11/21/29	1,410,000.00	1,348,129.20		
ACGB 3.25% 04/21/25	2,560,000.00	2,580,761.60		



	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,182,950.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	1,044,915.20	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	1,626,852.60	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,445,052.00	
	ACGB 3% 11/21/33	1,000,000.00	945,980.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,890,000.00	1,970,570.70	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,310,000.00	2,508,221.10	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,484,534.40	
	オーストラリアドル 小計	53,750,000.00	49,209,291.30 (4,432,280,867)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	700,140.00	
	SIGB 1.25% 11/01/26	530,000.00	498,449.10	
	SIGB 1.625% 07/01/31	650,000.00	583,537.50	
	SIGB 1.875% 03/01/50	810,000.00	658,554.30	
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	258,070.40	
	SIGB 2.125% 06/01/26	1,080,000.00	1,059,501.60	
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	811,955.90	
	SIGB 2.375% 06/01/25	730,000.00	728,204.20	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	391,515.00	
	SIGB 2.625% 05/01/28	530,000.00	526,030.30	
	SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	729,805.20	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	603,792.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	620,000.00	625,059.20	
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	651,807.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	1,020,000.00	1,018,551.60	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	408,442.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	863,498.80	
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	911,662.40	
	SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,611,910.20	
	シンガポールドル 小計	14,110,000.00	13,640,486.70 (1,274,430,672)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	790,000.00	675,197.20	
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,909,382.40	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,459,762.30	
	MGS 3.733% 06/15/28	2,870,000.00	2,776,753.70	
	MGS 3.757% 05/22/40	1,520,000.00	1,303,734.40	
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	940,341.60	
	MGS 3.828% 07/05/34	1,180,000.00	1,068,419.20	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,546,319.80	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,035,788.60	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,438,080.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,116,553.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,934,067.20	

	MGS 3.9% 11/30/26	2,120,000.00	2,103,739.60
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	596,838.00
	MGS 3.955% 09/15/25	3,120,000.00	3,122,246.40
	MGS 4.059% 09/30/24	1,780,000.00	1,794,489.20
	MGS 4.065% 06/15/50	2,340,000.00	1,979,499.60
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,292,185.60
	MGS 4.232% 06/30/31	3,000,000.00	2,900,160.00
	MGS 4.254% 05/31/35	2,030,000.00	1,902,028.80
	MGS 4.392% 04/15/26	2,500,000.00	2,526,775.00
	MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	2,838,693.00
	MGS 4.642% 11/07/33	1,770,000.00	1,742,175.60
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,406,976.80
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,268,052.80
	MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,291,820.30
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,627,684.80
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,008,823.20
	マレーシアリングット 小計	50,200,000.00	48,606,588.10 (1,441,831,804)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	840,000.00	830,115.63
	ILGOV 0.4% 10/31/24	1,050,000.00	1,014,622.14
	ILGOV 0.5% 02/27/26	860,000.00	812,078.56
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,324,529.30
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	1,806,668.97
	ILGOV 1.5% 11/30/23	2,230,000.00	2,245,684.92
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,243,122.06
	ILGOV 1% 03/31/30	2,830,000.00	2,536,116.10
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,010,000.00	2,002,191.35
	ILGOV 2% 03/31/27	2,750,000.00	2,731,735.05
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,247,444.83
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	3,406,192.45
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,030,000.00	2,733,561.86
ILGOV 6.25% 10/30/26	3,060,000.00	3,602,215.17	
	イスラエルシェケル 小計	30,720,000.00	31,536,278.39 (1,193,026,872)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	29,520,000.00	29,137,716.00
	CGB 2.28% 03/17/24	9,700,000.00	9,699,321.00
	CGB 2.47% 09/02/24	18,980,000.00	19,033,523.60
	CGB 2.48% 04/15/27	9,000,000.00	8,952,930.00
	CGB 2.56% 10/21/23	30,440,000.00	30,586,112.00
	CGB 2.68% 05/21/30	22,480,000.00	22,172,024.00
	CGB 2.69% 08/12/26	17,240,000.00	17,318,786.80
	CGB 2.8% 03/24/29	7,900,000.00	7,890,283.00

	CGB 2.84% 04/08/24	11,650,000.00	11,771,975.50	
	CGB 2.85% 06/04/27	12,330,000.00	12,439,243.80	
	CGB 2.89% 11/18/31	5,510,000.00	5,532,921.60	
	CGB 2.91% 10/14/28	10,280,000.00	10,343,736.00	
	CGB 3.01% 05/13/28	3,950,000.00	4,007,551.50	
	CGB 3.02% 05/27/31	6,850,000.00	6,932,131.50	
	CGB 3.03% 03/11/26	26,760,000.00	27,245,158.80	
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,079,543.50	
	CGB 3.28% 12/03/27	5,410,000.00	5,580,739.60	
	CGB 3.39% 03/16/50	5,520,000.00	5,536,946.40	
	CGB 3.53% 10/18/51	2,950,000.00	3,059,032.00	
	CGB 3.72% 04/12/51	2,390,000.00	2,544,585.20	
	CGB 3.81% 09/14/50	7,460,000.00	8,055,382.60	
	CGB 3.86% 07/22/49	5,580,000.00	6,062,112.00	
	CGB 4.08% 10/22/48	4,110,000.00	4,621,037.40	
	オフショア人民元 小計	262,860,000.00	265,602,793.80 (5,106,744,916)	
	合計		294,922,986,192 (294,922,986,192)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 219銘柄	100.0%	49.9%
カナダドル	国債証券 35銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 344銘柄	100.0%	36.2%
イギリスポンド	国債証券 55銘柄	100.0%	5.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券 23銘柄	100.0%	1.7%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

### 新興国債券インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

項目	2022年 5月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	311,888,540
コール・ローン	841,005,505
国債証券	74,615,942,279
派生商品評価勘定	263,080
未収入金	3,025,958,441
未収利息	1,442,863,384
前払費用	103,801,960
流動資産合計	80,341,723,189
資産合計	
80,341,723,189	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	252,410
未払金	465,566,438
未払解約金	33,694,351
未払利息	438
流動負債合計	499,513,637
負債合計	
499,513,637	
純資産の部	
元本等	
元本	46,889,081,206
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	32,953,128,346
元本等合計	79,842,209,552
純資産合計	
79,842,209,552	
負債純資産合計	
80,341,723,189	

#### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2022年 5月10日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

2022年 5月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <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>

## (貸借対照表に関する注記)

2022年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	46,889,081,206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 1.7028円 (1万口当たり純資産額) (17,028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 5月10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>

	2022年 5月10日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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 5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価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 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月11日
期首元本額	44,796,605,697円
期中追加設定元本額	5,200,596,376円
期中一部解約元本額	3,108,120,867円
期末元本額	46,889,081,206円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	5,215,504,710円
世界経済インデックスファンド	11,896,384,696円
DC 新興国債券インデックス・オープン	5,095,315,067円
DC 世界経済インデックスファンド	10,716,797,587円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	4,013,904円
コア投資戦略ファンド（安定型）	104,373,835円
コア投資戦略ファンド（成長型）	273,391,462円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	57,176,951円
分散投資コア戦略ファンドA	227,137,108円
分散投資コア戦略ファンドS	487,361,674円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	448,843,286円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,390,411,173円
コア投資戦略ファンド（切替型）	107,708,778円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	207,380,872円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	96,097,215円
SMT インデックスバランス・オープン	168,245,132円
外国債券SMT Bセレクション（SMA専用）	4,115,346,630円
SMT 世界経済インデックス・オープン	323,180,845円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	399,373,532円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	646,343,033円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,901,050円
グローバル経済コア	734,980,458円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	37,677,189円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	5,548,851円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	17,190,179円

区分	2022年 5月10日現在
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	13,610,179円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	5,187,253円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	6,335,841円
My SMT 新興国債券インデックス(ノーロード)	285,016円
FOFs用 新興国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	73,584,221円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	465,778,266円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	94,847,481円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	19,683,284円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	292,262,934円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	286,262,653円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	284,802,944円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	283,079,813円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	278,676,104円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	5,623,421,425
合計	5,623,421,425

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 通貨関連

(2022年 5月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	80,050,000	-	80,074,000	24,000
	南アフリカランド	80,050,000	-	80,074,000	24,000
	売建	1,387,272,080	-	1,387,285,410	13,330
	メキシコペソ	381,660,000	-	381,654,000	6,000
	チェココルナ	127,112,800	-	127,180,080	67,280
	ハンガリーフォリント	104,487,000	-	104,589,080	102,080
	ルーマニアレイ	111,059,680	-	110,985,200	74,480
	マレーシアリングット	163,037,600	-	163,120,650	83,050
	オフショア人民元	499,915,000	-	499,756,400	158,600



合計	1,467,322,080	-	1,467,359,410	10,670
----	---------------	---	---------------	--------

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	31,800,000.00	33,685,104.00		
		MBONO 10% 12/05/24	104,250,000.00	106,788,487.50		
		MBONO 5.75% 03/05/26	198,300,000.00	177,976,233.00		
		MBONO 6.75% 03/09/23	69,600,000.00	68,672,232.00		
		MBONO 7.5% 06/03/27	114,000,000.00	107,377,740.00		
		MBONO 7.75% 05/29/31	124,600,000.00	114,010,246.00		
		MBONO 7.75% 11/13/42	84,500,000.00	72,040,475.00		
		MBONO 7.75% 11/23/34	34,600,000.00	30,791,924.00		
		MBONO 8.5% 05/31/29	136,900,000.00	133,029,837.00		
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	91,950,803.00		
		MBONO 8% 09/05/24	128,400,000.00	125,902,620.00		
		MBONO 8% 11/07/47	93,100,000.00	80,731,665.00		
		MBONO 8% 12/07/23	88,000,000.00	86,935,200.00		
			メキシコペソ 小計		1,306,350,000.00	1,229,892,566.50 (7,827,036,293)
		ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/24	92,100,000.00	75,276,406.14	
	BLTN 0% 07/01/23		55,000,000.00	47,659,364.49		
	BLTN 0% 07/01/24		41,850,000.00	32,335,101.18		
	BLTN 0% 07/01/25		4,500,000.00	3,106,345.50		
	BNTNF 10% 01/01/23		40,100,000.00	39,313,020.73		
	BNTNF 10% 01/01/25		31,800,000.00	30,049,937.30		
	BNTNF 10% 01/01/27		41,200,000.00	37,727,358.37		
	BNTNF 10% 01/01/29		21,700,000.00	19,374,484.38		
	BNTNF 10% 01/01/31	13,850,000.00	12,055,549.42			

	BNTNF 10% 01/01/33	600,000.00	511,164.94	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,311,625.00	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,786,000.00	
ブラジルレアル 小計		346,000,000.00	300,506,357.45 (7,569,574,840)	
チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	495,000,000.00	381,369,020.67	
	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,685,000,000.00	2,384,375,263.80	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,820,000,000.00	1,665,554,550.66	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,940,000,000.00	1,685,775,223.94	
	BTPCL 4% 03/01/23	1,010,000,000.00	979,335,154.67	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,040,000,000.00	1,757,686,356.36	
	BTPCL 5% 10/01/28	660,000,000.00	596,526,172.44	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,650,000,000.00	1,552,673,959.65	
チリペソ 小計		12,300,000,000.00	11,003,295,702.19 (1,646,885,274)	
コロンビア ペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	64,500,000,000.00	64,429,695,000.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	4,400,000,000.00	3,907,816,000.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	33,600,000,000.00	25,252,080,000.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	14,900,000,000.00	9,858,883,000.00	
コロンビアペソ 小計		117,400,000,000.00	103,448,474,000.00 (3,288,833,885)	
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,500,000.00	3,159,045.00	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	6,350,000.00	4,879,149.50	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,636,471.00	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	8,200,000.00	7,278,484.00	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,000,000.00	5,947,970.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	7,700,000.00	7,076,454.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	7,450,000.00	6,399,103.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	7,650,000.00	7,014,208.50	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	6,050,000.00	6,220,670.50	
ペルーソル 小計		58,600,000.00	51,611,555.50 (1,755,035,461)	
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	22,234,750.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	15,819,520.00	
ウルグアイペソ 小計		42,000,000.00	38,054,270.00 (118,592,327)	
ドミニカペ ソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	20,821,668.00	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	33,000,000.00	33,230,010.00	
ドミニカペソ 小計		53,400,000.00	54,051,678.00 (127,405,210)	
チェココル ナ	CZGB 0.05% 11/29/29	26,100,000.00	18,243,639.00	
	CZGB 0.25% 02/10/27	53,700,000.00	42,648,540.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	47,000,000.00	43,366,900.00	

	CZGB 0.95% 05/15/30	64,900,000.00	48,271,322.00	
	CZGB 0% 12/12/24	12,000,000.00	10,418,880.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	57,000,000.00	42,317,370.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25	58,500,000.00	52,100,685.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	22,700,000.00	14,033,821.00	
	CZGB 1.75% 06/23/32	47,000,000.00	35,734,570.00	
	CZGB 1% 06/26/26	54,800,000.00	46,160,780.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	62,700,000.00	56,810,589.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	63,300,000.00	54,760,197.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	58,500,000.00	50,677,380.00	
	CZGB 2% 10/13/33	60,000,000.00	45,490,200.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	34,500,000.00	32,436,900.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	45,200,000.00	45,140,336.00	
	チェココルナ 小計	767,900,000.00	638,612,109.00 (3,502,021,083)	
ハンガリー フォロント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	489,944,565.00	
	HGB 1.5% 08/23/23	222,500,000.00	208,471,375.00	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	404,374,080.00	
	HGB 1% 11/26/25	525,000,000.00	425,696,250.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	542,000,000.00	340,441,040.00	
	HGB 2.25% 06/22/34	256,000,000.00	154,344,960.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	492,701,320.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	470,500,000.00	385,725,310.00	
	HGB 2% 05/23/29	403,000,000.00	286,944,060.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	692,000,000.00	505,685,920.00	
	HGB 3% 04/25/41	321,000,000.00	184,581,420.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	371,781,200.00	
	HGB 3% 08/21/30	555,000,000.00	409,773,150.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	476,412,000.00	
	HGB 3% 10/27/38	380,000,000.00	227,848,000.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	629,831,400.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	396,000,000.00	391,089,600.00	
HGB 6.75% 10/22/28	382,000,000.00	369,607,920.00		
	ハンガリーフォロント 小計	8,472,000,000.00	6,755,253,570.00 (2,437,241,446)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	18,500,000.00	13,711,460.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	14,300,000.00	11,970,244.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	15,200,000.00	9,870,576.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	6,200,000.00	3,935,078.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	17,950,000.00	16,084,456.50	
	POLGB 2.5% 01/25/23	16,500,000.00	16,095,420.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	15,350,000.00	14,201,973.50	

	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000.00	20,060,840.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	14,400,000.00	11,529,216.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	17,600,000.00	13,986,720.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000.00	19,813,032.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	17,350,000.00	15,626,798.00	
	POLGB 3.75% 05/25/27	4,800,000.00	4,097,520.00	
	POLGB 4% 10/25/23	12,700,000.00	12,248,896.00	
	ポーランドズロチ 小計	221,050,000.00	183,232,230.00 (5,355,090,184)	
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	3,000,000.00	2,342,460.00	
	ROMGB 3.25% 04/29/24	1,200,000.00	1,118,472.00	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	3,300,000.00	2,822,787.00	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	12,600,000.00	11,314,422.00	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	6,000,000.00	4,379,100.00	
	ROMGB 3.7% 11/25/24	10,000,000.00	9,224,800.00	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	10,500,000.00	8,853,285.00	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	5,400,000.00	4,210,866.00	
	ROMGB 4.25% 06/28/23	18,400,000.00	17,922,704.00	
	ROMGB 4.5% 06/17/24	2,200,000.00	2,090,704.00	
	ROMGB 4.75% 02/24/25	3,200,000.00	3,004,384.00	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	3,800,000.00	2,859,538.00	
	ROMGB 4% 10/25/23	13,800,000.00	13,240,134.00	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	3,000,000.00	2,790,150.00	
	ROMGB 5% 02/12/29	6,000,000.00	5,188,860.00	
	ルーマニアレイ 小計	102,400,000.00	91,362,666.00 (2,536,474,287)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	12,200,000.00	10,427,096.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,121,520.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	17,600,000.00	17,721,968.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	5,950,000.00	5,752,043.50	
	MGS 3.733% 06/15/28	25,500,000.00	24,671,505.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	4,902,913.50	
	MGS 3.757% 05/22/40	18,350,000.00	15,739,162.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	7,100,000.00	7,178,952.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	7,424,608.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	29,800,000.00	28,569,856.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	20,800,000.00	20,420,608.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	14,450,000.00	14,339,168.50	
	MGS 3.906% 07/15/26	8,700,000.00	8,654,151.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000.00	26,018,720.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	19,550,000.00	19,709,137.00	
MGS 4.065% 06/15/50	13,950,000.00	11,800,863.00		
MGS 4.181% 07/15/24	9,100,000.00	9,186,632.00		

	MGS 4.254% 05/31/35	20,050,000.00	18,786,048.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	9,550,000.00	9,499,958.00	
マレーシアリングット 小計		276,850,000.00	265,924,910.00 (7,888,210,382)	
タイバーツ	THA1GB 0.75% 06/17/24	90,500,000.00	88,798,600.00	
	THA1GB 0.95% 06/17/25	116,700,000.00	112,508,136.00	
	THA1GB 1.45% 12/17/24	184,000,000.00	181,249,200.00	
	THA1GB 1.585% 12/17/35	56,800,000.00	43,053,264.00	
	THA1GB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	51,217,425.00	
	THA1GB 1.6% 12/17/29	111,100,000.00	99,547,822.00	
	THA1GB 2.125% 12/17/26	113,600,000.00	111,011,056.00	
	THA1GB 2.4% 12/17/23	152,000,000.00	154,775,520.00	
	THA1GB 2.875% 06/17/46	90,100,000.00	69,611,260.00	
	THA1GB 2.875% 12/17/28	168,200,000.00	166,795,530.00	
	THA1GB 2% 06/17/42	65,600,000.00	45,412,256.00	
	THA1GB 2% 12/17/22	65,000,000.00	65,575,250.00	
	THA1GB 3.3% 06/17/38	122,700,000.00	110,886,444.00	
	THA1GB 3.4% 06/17/36	129,200,000.00	122,236,120.00	
	THA1GB 3.625% 06/16/23	99,000,000.00	101,988,810.00	
	THA1GB 3.65% 06/20/31	175,500,000.00	180,347,310.00	
	THA1GB 3.775% 06/25/32	98,000,000.00	101,798,480.00	
	THA1GB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	110,425,472.00	
	THA1GB 4.875% 06/22/29	119,500,000.00	133,085,955.00	
タイバーツ 小計		2,128,000,000.00	2,050,323,910.00 (7,709,217,901)	
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	14,726,850.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	30,706,500.00	
フィリピンペソ 小計		45,000,000.00	45,433,350.00 (112,152,224)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,808,399,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	18,487,440,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	26,000,000,000.00	24,461,580,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	36,500,000,000.00	35,219,215,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	50,300,000,000.00	50,947,864,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	34,000,000,000.00	32,601,920,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	16,494,192,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	41,000,000,000.00	38,505,150,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	62,500,000,000.00	59,333,750,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	14,300,000,000.00	14,430,130,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	11,000,000,000.00	10,348,250,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	22,300,000,000.00	21,688,088,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	34,595,000,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	21,000,000,000.00	21,251,160,000.00	

	INDOGB 7.5% 06/15/35	34,700,000,000.00	35,158,040,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	18,712,064,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	40,800,000,000.00	41,152,104,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	43,000,000,000.00	42,852,080,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	45,600,000,000.00	47,823,912,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	31,200,000,000.00	33,195,552,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	31,800,000,000.00	33,834,882,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,368,016,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	53,600,000,000.00	56,609,104,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	44,000,000,000.00	46,766,720,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	22,989,704,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	43,034,117,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	14,700,000,000.00	16,053,723,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,145,796,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	19,700,000,000.00	21,723,190,000.00	
	<b>インドネシアルピア 小計</b>	<b>857,800,000,000.00</b>	<b>874,591,142,000.00</b>	<b>(7,783,861,163)</b>
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	155,400,000.00	166,377,456.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	54,800,000.00	36,909,992.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	46,100,000.00	29,482,794.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	32,000,000.00	32,545,600.00	
	SAGB 7% 02/28/31	64,700,000.00	52,141,083.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	100,000,000.00	86,031,000.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	97,700,000.00	80,023,139.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	86,000,000.00	69,346,960.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	134,200,000.00	107,813,596.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	78,000,000.00	67,359,240.00	
	SAGB 8% 01/31/30	122,700,000.00	108,633,672.00	
	SAGB 9% 01/31/40	74,300,000.00	62,261,171.00	
		<b>南アフリカランド 小計</b>	<b>1,045,900,000.00</b>	<b>898,925,703.00</b>
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,423,880.00	
	CGB 2.36% 07/02/23	8,000,000.00	8,017,840.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	26,925,990.00	
	CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,045,700.00	
	CGB 2.75% 02/17/32	2,400,000.00	2,387,376.00	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,700,000.00	11,822,499.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	18,400,000.00	18,563,024.00	
	CGB 2.88% 11/05/23	16,900,000.00	17,072,887.00	
	CGB 2.89% 11/18/31	5,000,000.00	5,020,800.00	
	CGB 2.91% 10/14/28	6,000,000.00	6,037,200.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,335,570.00	

	CGB 3.01% 05/13/28	15,000,000.00	15,218,550.00	
	CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,601,915.00	
	CGB 3.02% 10/22/25	12,900,000.00	13,123,170.00	
	CGB 3.03% 03/11/26	17,500,000.00	17,817,275.00	
	CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,452,200.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	15,300,000.00	15,620,688.00	
	CGB 3.19% 04/11/24	24,100,000.00	24,535,728.00	
	CGB 3.22% 12/06/25	12,000,000.00	12,297,720.00	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,591,140.00	
	CGB 3.25% 11/22/28	14,900,000.00	15,350,278.00	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,737,220.00	
	CGB 3.28% 12/03/27	15,200,000.00	15,679,712.00	
	CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	14,689,190.00	
	CGB 3.29% 10/18/23	10,000,000.00	10,165,800.00	
	CGB 3.53% 10/18/51	5,100,000.00	5,288,496.00	
	CGB 3.72% 04/12/51	7,300,000.00	7,772,164.00	
	CGB 3.81% 09/14/50	17,500,000.00	18,896,675.00	
	オフショア人民元 小計	395,800,000.00	403,490,687.00 (7,757,915,438)	
	合計		74,615,942,279 (74,615,942,279)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	100.0%	10.5%
ブラジルリアル	国債証券 12銘柄	100.0%	10.1%
チリペソ	国債証券 8銘柄	100.0%	2.2%
コロンビアペソ	国債証券 4銘柄	100.0%	4.4%
ペルーソル	国債証券 9銘柄	100.0%	2.4%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
チェココルナ	国債証券 16銘柄	100.0%	4.7%
ハンガリーフォリント	国債証券 18銘柄	100.0%	3.3%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	7.2%
ルーマニアレイ	国債証券 15銘柄	100.0%	3.4%
マレーシアリンギット	国債証券 19銘柄	100.0%	10.6%
タイバーツ	国債証券 19銘柄	100.0%	10.3%

フィリピンペソ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.2%
インドネシアルピア	国債証券	29銘柄	100.0%	10.4%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.0%	9.6%
オフショア人民元	国債証券	28銘柄	100.0%	10.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## J-REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 5月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	3,133,646,742
投資証券	109,651,439,550
派生商品評価勘定	128,629,600
未収配当金	1,065,961,225
差入委託証拠金	206,800,000
流動資産合計	114,186,477,117
資産合計	114,186,477,117
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受金	128,629,600
未払金	342,378,155
未払解約金	15,243,792
未払利息	1,632
流動負債合計	486,253,179
負債合計	486,253,179
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	53,594,140,102
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	60,106,083,836
元本等合計	113,700,223,938
純資産合計	113,700,223,938
負債純資産合計	114,186,477,117

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)



2022年 5月10日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

2022年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	53,594,140,102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 2.1215円 (1万口当たり純資産額) (21,215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 5月10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>

2022年 5月10日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、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。</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 5月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価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 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月11日
期首元本額	50,752,359,768円
期中追加設定元本額	5,610,338,657円
期中一部解約元本額	2,768,558,323円
期末元本額	53,594,140,102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）	1,689,682,398円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,248,422円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	16,592,177,006円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	25,446,898,197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）	822,252,995円
S M T インデックスバランス・オープン	26,329,022円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	253,602,124円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	7,293,318円
グローバル経済コア	241,384,045円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	11,802,592円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	472,620,333円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	69,373,515円
M y S M T J - R E I T インデックス（ノーロード）	228,802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）	482,421,981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）	19,843,519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）	186,830,875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）	90,580,139円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 05（適格機関投資家専用）	862,717,717円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 11（適格機関投資家専用）	260,498,840円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2019 - 03（適格機関投資家専用）	297,017,822円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 5月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		4,886,281,442
合計		4,886,281,442

(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 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	3,911,208,400	-		4,039,838,000	128,629,600
	合計	3,911,208,400	-		4,039,838,000	128,629,600

## (注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,037	269,291,400	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,203	300,441,400	
	S O S i L A 物流リート投資法人	4,705	719,865,000	
	東海道リート投資法人	775	88,815,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,492	2,238,372,000	

森ヒルズリート投資法人	11,893	1,755,406,800	
産業ファンド投資法人	14,358	2,641,872,000	
アドバンス・レジデンス投資法人	10,113	3,514,267,500	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,237	1,506,019,700	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,390	2,228,765,000	
G L P 投資法人	32,757	5,562,138,600	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,705	1,543,240,000	
日本プロロジスリート投資法人	16,548	5,659,416,000	
星野リゾート・リート投資法人	1,695	1,117,005,000	
O n e リート投資法人	1,755	478,588,500	
イオンリート投資法人	11,894	1,779,342,400	
ヒューリックリート投資法人	9,435	1,495,447,500	
日本リート投資法人	3,121	1,143,846,500	
積水ハウス・リート投資法人	30,701	2,373,187,300	
トーセイ・リート投資法人	2,113	278,493,400	
ケネディクス商業リート投資法人	4,038	1,087,029,600	
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,478	393,010,800	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,291	303,099,300	
野村不動産マスターファンド投資法人	32,707	5,373,760,100	
いちごホテルリート投資法人	1,676	150,002,000	
ラサールロジポート投資法人	12,381	2,160,484,500	
スターアジア不動産投資法人	10,452	604,125,600	
マリモ地方創生リート投資法人	1,184	158,892,800	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,984	2,143,392,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,632	116,035,200	
投資法人みらい	12,251	605,811,950	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,373	300,421,800	
三菱地所物流リート投資法人	2,938	1,319,162,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	3,917	760,289,700	
ザイマックス・リート投資法人	1,632	200,083,200	
タカラレーベン不動産投資法人	3,988	480,554,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,944	614,475,200	
日本ビルファンド投資法人	11,791	7,994,298,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	10,114	6,321,250,000	
日本都市ファンド投資法人	51,031	5,281,708,500	
オリックス不動産投資法人	20,152	3,714,013,600	
日本プライムリアルティ投資法人	6,911	2,719,478,500	
N T T 都市開発リート投資法人	9,695	1,430,012,500	
東急リアル・エステート投資法人	6,781	1,242,279,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	6,929	755,261,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	22,768	3,239,886,400	
森トラスト総合リート投資法人	7,228	1,006,860,400	

インヴィンシブル投資法人	44,516	1,887,478,400	
フロンティア不動産投資法人	3,546	1,794,276,000	
平和不動産リート投資法人	6,552	978,868,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,820	2,127,840,000	
福岡リート投資法人	5,231	844,806,500	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,129	2,096,430,000	
いちごオフィスリート投資法人	8,287	690,307,100	
大和証券オフィス投資法人	2,138	1,537,222,000	
阪急阪神リート投資法人	4,568	673,780,000	
スターツプロシード投資法人	1,575	371,070,000	
大和ハウスリート投資法人	15,186	4,730,439,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	30,985	2,032,616,000	
大和証券リビング投資法人	13,666	1,563,390,400	
ジャパンエクセレント投資法人	9,385	1,153,416,500	
合計	590,777	109,651,439,550	

(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 5月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	283,830,120
コール・ローン	311,268,392
投資証券	95,962,990,964
派生商品評価勘定	3,176
未収入金	4,932,599
未収配当金	119,146,183
流動資産合計	96,682,171,434
資産合計	96,682,171,434
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	512,269
未払株式払込金	6,314,066
未払解約金	211,858,453
未払利息	162

	2022年 5月10日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	218,684,950
負債合計	218,684,950
純資産の部	
元本等	
元本	38,512,077,705
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	57,951,408,779
元本等合計	96,463,486,484
純資産合計	96,463,486,484
負債純資産合計	96,682,171,434

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>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) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2022年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		38,512,077,705口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5048円 (25,048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 5月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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 5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引



	2022年 5月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価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 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月11日
期首元本額	41,344,855,558円
期中追加設定元本額	3,936,037,464円
期中一部解約元本額	6,768,815,317円
期末元本額	38,512,077,705円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	58,177,468円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	92,933,067円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,670,619,232円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,178,218円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	12,144,066,051円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	16,461,304,677円

区分	2022年 5月10日現在
コア投資戦略ファンド（安定型）	691,010,554円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,572,384,701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）	574,452,616円
SMT インデックスバランス・オープン	132,369,799円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	193,215,417円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,501,844円
グローバル経済コア	233,946,661円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	11,397,968円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	367,041,762円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	54,358,377円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	183,324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）	1,003,098,639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）	305,879,938円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	158,276,395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）	85,677,129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）	54,217,511円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	92,875,637円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	105,412,664円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	104,862,254円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	89,958,325円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	88,558,498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）	113,853,667円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	12,740,388,667
合計	12,740,388,667

(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 5月10日現在）

--	--	--	--

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	279,446,410	-	278,937,317	509,093
	アメリカドル	243,001,050	-	242,493,161	507,889
	イギリスポンド	11,223,800	-	11,225,088	1,288
	オーストラリアドル	25,221,560	-	25,219,068	2,492
	合計	279,446,410	-	278,937,317	509,093

## (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	907,350.20	
		AGREE REALTY CORP	38,205	2,558,970.90	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	37,122	760,258.56	
		ALEXANDER'S INC	1,190	285,028.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	75,508	12,630,223.16	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	103,968.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	27,081	897,735.15	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	73,032	4,701,800.16	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	155,315	5,523,001.40	
		AMERICOLD REALTY TRUST	139,990	3,520,748.50	
		APARTMENT INCOME REIT CO	82,424	3,553,298.64	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	79,751	457,770.74	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	107,773	1,713,590.70	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	38,600	490,606.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	102,510.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	72,577	14,785,386.44	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	387,436.50	

BOSTON PROPERTIES	73,522	8,382,243.22	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	160,146.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	1,038,245.80	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	156,266	3,658,187.06	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	86,966	1,703,663.94	
BRT APARTMENTS CORP	5,000	97,850.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	52,836	7,575,097.32	
CARETRUST REIT INC	52,477	872,692.51	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	13,620	332,600.40	
CEDAR REALTY TRUST INC	6,800	185,912.00	
CENTERSPACE	7,659	618,311.07	
CHATHAM LODGING TRUST	25,360	302,291.20	
CITY OFFICE REIT INC	25,050	337,674.00	
CLIPPER REALTY INC	7,300	61,831.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	12,543	467,226.75	
CORPORATE OFFICE PPTYS	56,595	1,454,491.50	
COUSINS PROPERTIES INC	77,846	2,649,099.38	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	5,000	31,500.00	
CTO REALTY GROWTH INC	2,800	168,924.00	
CUBESMART	115,075	4,788,270.75	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	1,090,992.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	147,498	19,673,283.24	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	260,439	1,513,150.59	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	246,448.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	91,858	2,573,861.16	
DUKE REALTY CORP	197,360	9,416,045.60	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	47,668	890,914.92	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	21,355	3,484,708.90	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	666,789.96	
EPR PROPERTIES	38,069	1,918,677.60	
EQUINIX INC	46,854	30,651,418.26	
EQUITY COMMONWEALTH	58,772	1,539,238.68	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	90,856	6,341,748.80	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	177,352	12,992,807.52	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	61,290	1,352,057.40	
ESSEX PROPERTY TRUST	33,809	10,006,449.73	
EXTRA SPACE STORAGE INC	69,461	11,768,777.23	
FARMLAND PARTNERS INC	12,200	178,364.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	37,153	4,142,931.03	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	68,397	3,460,204.23	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	39,881	1,026,138.13	

FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	216,073.10
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	123,467	5,251,051.51
GETTY REALTY CORP	21,985	564,354.95
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	386,275.50
GLADSTONE LAND CORP	15,500	488,250.00
GLOBAL MEDICAL REIT INC	33,930	437,018.40
GLOBAL NET LEASE INC	57,012	758,259.60
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	76,980	2,360,976.60
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	115,803	3,346,706.70
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	279,047	8,376,990.94
HERSHA HOSPITALITY TRUST	13,650	132,814.50
HIGHWOODS PROPERTIES INC	54,799	2,100,445.67
HOST HOTELS AND RESORTS INC	375,710	7,179,818.10
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	79,230	1,682,052.90
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	115,571	2,559,897.65
INDUS REALTY TRUST INC	3,840	257,856.00
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	476,927.08
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	14,225	1,854,655.50
INVENTRUST PROPERTIES CORP	35,960	1,016,229.60
INVITATION HOMES INC	309,438	11,084,069.16
IRON MOUNTAIN INC	152,471	8,082,487.71
JBG SMITH PROPERTIES	59,353	1,439,903.78
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	338,400.00
KILROY REALTY CORPORATION	55,124	3,438,083.88
KIMCO REALTY CORP	324,627	7,580,040.45
KITE REALTY GROUP TRUST	114,476	2,391,403.64
LIFE STORAGE INC	43,142	4,814,647.20
LTC PROPERTIES INC	20,624	726,583.52
LXP INDUSTRIAL TRUST	143,452	1,613,835.00
MACERICH CO/THE	110,615	1,453,481.10
MANULIFE US REAL ESTATE INV	957,964	574,778.40
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	313,989	5,620,403.10
MID-AMERICA APARTMENT COMM	59,782	10,613,696.28
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	92,186	3,904,077.10
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	42,860	2,131,856.40
NATL HEALTH INVESTORS INC	25,030	1,344,861.90
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	71,590	507,573.10
NETSTREIT CORP	20,992	426,137.60
NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	890,892.99
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	557,434.90
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	125,306	3,511,074.12

ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	214,889.01
ORION OFFICE REIT INC	30,374	388,787.20
PARAMOUNT GROUP INC	89,726	793,177.84
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	120,811	2,170,973.67
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	66,260	1,456,394.80
PENN REAL ESTATE INVEST TST	35,000	14,710.50
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	60,769	1,946,431.07
PHYSICIANS REALTY TRUST	118,562	2,100,918.64
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	1,024,973.16
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	16,890	351,818.70
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	111,720.00
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	29,639	735,639.98
PRIME US REIT	295,000	209,450.00
PROLOGIS INC	385,483	51,026,384.71
PS BUSINESS PARKS INC	10,163	1,889,708.22
PUBLIC STORAGE	79,372	24,898,202.68
REALTY INCOME CORP	294,014	18,981,543.84
REGENCY CENTERS CORP	81,010	5,422,809.40
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	61,972	1,075,833.92
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	84,311	5,702,796.04
RLJ LODGING TRUST	82,657	1,019,160.81
RPT REALTY	43,950	540,585.00
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	28,793	2,419,187.86
SABRA HEALTH CARE REIT INC	118,863	1,545,219.00
SAFEHOLD INC	8,335	356,571.30
SAUL CENTERS INC	6,800	330,820.00
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	19,900	190,642.00
SERVICE PROPERTIES TRUST	84,169	513,430.90
SIMON PROPERTY GROUP	170,767	20,182,951.73
SITE CENTERS CORP	90,280	1,331,630.00
SL GREEN REALTY CORP	33,508	2,204,491.32
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	66,872	2,660,836.88
STAG INDUSTRIAL INC	92,435	3,153,882.20
STORE CAPITAL CORP	128,717	3,416,149.18
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	52,970	463,487.50
SUN COMMUNITIES INC	60,067	9,476,770.59
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	109,637	1,219,163.44
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	53,323	948,082.94
TERRENO REALTY CORP	39,525	2,546,595.75
UDR INC	154,632	7,374,400.08
UMH PROPERTIES INC	25,320	520,326.00

	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	343,768.90	
	URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	1,076,701.50	
	URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	255,699.50	
	VENTAS INC	206,874	11,508,400.62	
	VERIS RESIDENTIAL INC	42,236	609,887.84	
	VICI PROPERTIES INC	439,286	11,974,936.36	
	VORNADO REALTY TRUST	83,354	2,955,732.84	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	45,570	1,032,160.50	
	WELLTOWER INC	226,205	19,693,407.30	
	WHITESTONE REIT	23,074	267,427.66	
	WP CAREY INC	100,355	7,688,196.55	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	56,515	989,012.50	
	アメリカドル 小計	13,814,502	567,020,204.31 (73,729,637,166)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	30,942	1,195,598.88	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	367,599.60	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	153,960.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,260	555,118.00	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	79,400.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	44,074	2,044,592.86	
	CHOICE PROPERTIES REIT	86,170	1,252,050.10	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	429,484.32	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	466,418.60	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	60,960	819,912.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	310,397.20	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	112,808.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	863,150.05	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,545	1,402,685.10	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	72,239	855,309.76	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	67,512.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	34,090	421,011.50	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	548,344.50	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	196,581.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	221,063.50	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,000	99,630.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	60,470	755,875.00	
	PLAZA RETAIL REIT	25,000	112,750.00	
	PRIMARIS REIT	28,309	377,358.97	

	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	78,368	1,710,773.44	
	SLATE GROCERY REIT	17,300	251,715.00	
	SLATE OFFICE REI	17,000	82,790.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	36,116	1,035,084.56	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	859,160.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	158,670.00	
	カナダドル 小計	975,045	17,806,803.94 (1,778,543,577)	
ユーロ	AEDIFICA	19,087	2,049,943.80	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	7,200	94,896.00	
	ALTAREA	2,480	341,248.00	
	BEFIMMO S.C.A.	12,210	573,259.50	
	CARE PROPERTY INVEST	15,000	350,250.00	
	CARMILA	25,000	356,500.00	
	COFINIMMO	15,427	1,885,179.40	
	COIMA RES SPA	11,900	117,215.00	
	COVIVIO(FP)	24,411	1,574,509.50	
	CROMWELL REIT EUR	160,000	345,600.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,783	439,352.62	
	GECINA SA	28,422	2,870,622.00	
	HAMBORNER REIT AG	37,000	300,070.00	
	HIBERNIA REIT PLC	365,550	590,728.80	
	ICADE	16,740	919,863.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	129,922.55	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	135,462	1,017,996.93	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	301,290.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	302,400.00	
	KLEPIERRE	101,585	2,195,251.85	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	167,960.00	
	MERCIALYS	28,000	223,160.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	172,874	1,690,707.72	
	MONTEA NV	5,300	514,100.00	
	NSI NV	10,050	355,267.50	
	RETAIL ESTATES	6,400	438,400.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	59,921	4,029,687.25	
	VASTNED RETAIL	10,650	248,145.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	72,072	2,227,024.80	
	WERELDHAVE NV	22,670	330,982.00	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	10,440	499,554.00	
	ユーロ 小計	1,686,524	27,481,087.22 (3,772,328,842)	



イギリスボ ンド	AEW UK REIT PLC	68,000	81,872.00
	ASSURA PLC	1,492,040	948,191.42
	BIG YELLOW GROUP PLC	90,946	1,099,537.14
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	435,000	488,940.00
	BRITISH LAND CO PLC	485,911	2,329,943.24
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	447,878	689,732.12
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	277,256.28
	CUSTODIAN REIT PLC	234,276	234,744.55
	DERWENT LONDON PLC	58,772	1,640,914.24
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	256,428.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	128,780	837,070.00
	HAMMERSON PLC	1,784,000	467,586.40
	HOME REIT PLC	309,934	373,160.53
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	177,355	217,791.94
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	390,106	2,726,060.72
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	506,380	1,172,776.08
	LXI REIT PLC	486,008	680,411.20
	NEWRIVER REIT PL	126,000	110,502.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	255,404.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	685,888	944,467.77
	PRS REIT PLC/THE	269,000	282,988.00
	REGIONAL REIT LTD	222,000	182,040.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	110,637	1,174,964.94
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	192,500.00
	SEGRE PLC	623,633	6,691,582.09
	SHAFTESBURY PLC	155,193	869,080.80
	STANDARD LIFE INV PROP INC	260,756	211,212.36
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	494,000	602,680.00
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	179,704.82
TRITAX BIG BOX REIT PLC	966,516	1,898,237.42	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	490,000	424,340.00	
UNITE GROUP PLC	209,572	2,110,390.04	
WORKSPACE GROUP PLC	70,347	435,447.93	
イギリスボンド 小計	13,758,241	31,097,228.03 (4,987,062,459)	
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	197,716	585,239.36
	ARENA REIT	171,053	737,238.43
	BWP TRUST	262,160	1,069,612.80
	CENTURIA CAPITAL GROUP	356,300	826,616.00
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	269,606	938,228.88
	CENTURIA OFFICE REIT	240,945	484,299.45
	CHARTER HALL GROUP	244,969	3,270,336.15

	CHARTER HALL LONG WALE REIT	307,782	1,486,587.06	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	261,160	1,070,756.00	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	687,340.50	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	822,633	662,219.56	
	DEXUS	561,242	6,033,351.50	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	351,430.00	
	GDI PROPERTY GROUP	324,500	337,480.00	
	GOODMAN GROUP	883,329	16,924,583.64	
	GPT GROUP	997,142	4,716,481.66	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	633,688.00	
	HEALTHCO REIT	137,130	235,863.60	
	HOME CONSORTIUM LTD	90,500	524,900.00	
	HOMEEO DAILY NEEDS REIT	782,342	1,009,221.18	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	117,885	427,922.55	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	193,766	767,313.36	
	IRONGATE GROUP	272,000	523,600.00	
	MIRVAC GROUP	2,052,238	4,432,834.08	
	NATIONAL STORAGE REIT	546,840	1,252,263.60	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	179,201.60	
	RURAL FUNDS GROUP	191,095	557,997.40	
	SCENTRE GROUP	2,718,059	7,393,120.48	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	571,980	1,612,983.60	
	STOCKLAND	1,243,333	4,786,832.05	
	VICINITY CENTERS	2,002,663	3,584,766.77	
	WAYPOINT REIT LTD	390,099	944,039.58	
	オーストラリアドル 小計	17,870,217	69,048,348.84 (6,219,184,780)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	417,278	532,029.45	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	535,300	1,156,248.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	879,952.25	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	682,894	949,222.66	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	249,502	748,506.00	
	ニュージーランドドル 小計	2,743,464	4,265,958.36 (349,126,032)	
香港ドル	CHAMPION REIT	938,000	3,226,720.00	
	FORTUNE REIT	756,000	5,261,760.00	
	LINK REIT	1,095,000	73,365,000.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	2,060,480.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	2,114,970.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,315,660	4,131,172.40	
	香港ドル 小計	5,417,660	90,160,102.40 (1,493,051,295)	

シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	379,500.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,746,218	4,871,948.22	
	ASCOTT TRUST	991,877	1,160,496.09	
	CAPITALAND CHINA TRUST	557,721	630,224.73	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,651,644	5,992,715.44	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	554,876.00	
	EC WORLD REIT	180,000	112,500.00	
	ESR-LOGOS REIT	2,769,764	1,052,510.32	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	359,100.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	166,811.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	574,262	1,343,773.08	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,483,196	2,150,634.20	
	IREIT GLOBAL	405,985	253,740.62	
	KEPPEL DC REIT	709,903	1,419,806.00	
	KEPPEL REIT	1,051,400	1,251,166.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	845,950	685,219.50	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,116,473	2,076,639.78	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	995,763	2,489,407.50	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,647,285	2,767,438.80	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	1,077,100	1,292,520.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,273,644	522,194.04	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE TRUST	195,500	942,310.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	295,800	246,993.00	
SPH REIT	446,800	424,460.00		
STARHILL GLOBAL REIT	659,400	392,343.00		
SUNTEC REIT	1,105,200	1,945,152.00		
シンガポールドル 小計		24,551,185	35,484,479.32	(3,315,314,902)
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	150,236,800.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	81,340	554,738,800.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	67,743,060.00	
	JR REIT XXVII	64,338	367,369,980.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	25,433	171,927,080.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	418,209,600.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	208,737,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	26,380	201,279,400.00	
	SK REITS CO LTD	30,940	215,033,000.00	
韓国ウォン 小計		383,354	2,355,274,720.00	(240,002,493)
	REIT 1 LTD	103,500	2,081,385.00	

	イスラエル シェケル			
	イスラエルシェケル 小計	103,500	2,081,385.00 (78,739,418)	
	合計	81,303,692	95,962,990,964 (95,962,990,964)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 153銘柄	100.0%	76.8%
カナダドル	投資証券 30銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 31銘柄	100.0%	3.9%
イギリスポンド	投資証券 34銘柄	100.0%	5.2%
オーストラリアドル	投資証券 32銘柄	100.0%	6.5%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	投資証券 26銘柄	100.0%	3.5%
韓国ウォン	投資証券 9銘柄	100.0%	0.3%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

(注) 時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 2【ファンドの現況】

## 【SMT 8資産インデックスバランス・オープン】

## 【純資産額計算書】

(2022年 5月31日現在)

資産総額	127,045,277円
負債総額	56,061円
純資産総額（ - ）	126,989,216円
発行済口数	96,450,990口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3166円
（1万口当たり純資産額）	（13,166円）

(参考)

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 5月31日現在)

資産総額	503,031,691,989円
負債総額	7,341,248,040円
純資産総額（ - ）	495,690,443,949円
発行済口数	262,442,463,772口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8888円
（1万口当たり純資産額）	（18,888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 5月31日現在)

資産総額	531,173,514,401円
負債総額	412,319,513円
純資産総額（ - ）	530,761,194,888円
発行済口数	125,038,360,296口
1口当たり純資産額（ / ）	4.2448円
（1万口当たり純資産額）	（42,448円）

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 5月31日現在)

資産総額	108,469,119,198円
負債総額	130,814,558円
純資産総額（ - ）	108,338,304,640円
発行済口数	30,432,080,020口
1口当たり純資産額（ / ）	3.5600円
（1万口当たり純資産額）	（35,600円）

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 5月31日現在)

資産総額	640,621,120,580円
負債総額	15,278,253,342円
純資産総額（ - ）	625,342,867,238円
発行済口数	452,331,451,543口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3825円
（1万口当たり純資産額）	（13,825円）

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 5月31日現在)

資産総額	308,837,425,207円
負債総額	56,110,724円
純資産総額（ - ）	308,781,314,483円
発行済口数	99,739,041,935口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0959円
（1万口当たり純資産額）	（30,959円）

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2022年 5月31日現在）

資産総額	81,362,368,104円
負債総額	808,840円
純資産総額（ - ）	81,361,559,264円
発行済口数	46,255,797,147口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7589円
（1万口当たり純資産額）	（17,589円）

## J - R E I Tインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2022年 5月31日現在）

資産総額	118,374,200,305円
負債総額	617,916,722円
純資産総額（ - ）	117,756,283,583円
発行済口数	54,051,737,441口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1786円
（1万口当たり純資産額）	（21,786円）

## グローバルR E I Tインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2022年 5月31日現在）

資産総額	100,929,662,873円
負債総額	319,503,165円
純資産総額（ - ）	100,610,159,708円
発行済口数	39,013,697,948口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5788円
（1万口当たり純資産額）	（25,788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します。）に支払います。

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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



## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2022年 5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 8月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2022年5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	545	13,924,777
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	71	232,122
単位型公社債投資信託	51	228,981
合計	667	14,385,879

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

		(単位: 百万円)	
		前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部			
流動資産			
現金及び預金		21,589	21,675
金銭の信託		10,857	14,913
前払費用		397	166
未収委託者報酬		8,471	9,067
未収運用受託報酬		6,151	6,252
未収収益		177	179
その他		3,428	4,891
流動資産合計		51,072	57,146
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	301	289
器具備品	1	692	687
その他	1	0	-
有形固定資産合計		993	976
無形固定資産			
ソフトウェア		4,104	6,292
その他		41	31
無形固定資産合計		4,145	6,324
投資その他の資産			
投資有価証券		9,950	6,607
関係会社株式		5,636	5,636
繰延税金資産		311	907
その他		39	31
投資その他の資産合計		15,937	13,182
固定資産合計		21,077	20,482
資産合計		72,149	77,629

(単位: 百万円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	44	47
未払金	7,572	8,285
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,154	4,561
その他未払金	3,417	3,723
未払費用	1,046	1,049
未払法人税等	517	504
賞与引当金	556	578
その他	818	1,958
流動負債合計	10,555	12,423
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	626	820
資産除去債務	133	153
その他	8	12
固定負債合計	768	986
負債合計	11,324	13,410
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
<b>資本剰余金</b>		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	500	500
<b>その他利益剰余金</b>		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	38,258	41,948
利益剰余金合計	40,858	44,548
株主資本合計	60,098	63,788
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	791	941
繰延ヘッジ損益	65	509
評価・換算差額等合計	726	431
純資産合計	60,824	64,219
負債・純資産合計	72,149	77,629

## (2) 【損益計算書】

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	37,224	41,730
運用受託報酬	10,982	11,883
その他営業収益	403	390
営業収益合計	48,611	54,004
営業費用		
支払手数料	17,936	20,567
広告宣伝費	203	286
調査費	5,064	5,567
調査費	898	1,062
委託調査費	4,154	4,487
図書費	11	17
営業雑経費	4,492	5,201
通信費	56	68
印刷費	449	454
協会費	58	55
諸会費	18	35
情報機器関連費	3,815	4,473
その他営業雑経費	93	112
営業費用合計	27,696	31,622
一般管理費		
給料	5,976	6,295
役員報酬	214	249
給料・手当	4,861	5,072
賞与	901	972
退職給付費用	170	254
福利費	608	632
交際費	1	3
旅費交通費	13	20
租税公課	315	327
不動産賃借料	276	323
寄付金	3	5
減価償却費	748	989
業務委託費	966	1,081
諸経費	848	1,301
一般管理費合計	9,929	11,234
営業利益	10,984	11,147

（単位：百万円）

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

営業外収益		
受取利息	2	2
収益分配金	101	16
金銭の信託運用益	3,038	-
投資有価証券売却益	1	0
投資有価証券償還益	54	219
その他	45	8
営業外収益合計	3,243	247
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	332
投資有価証券売却損	0	0
投資有価証券償還損	0	-
為替差損	158	291
デリバティブ費用	3,782	1,191
その他	5	33
営業外費用合計	3,946	1,848
経常利益	10,281	9,545
特別損失		
退職給付費用	-	120
システム統合費用	110	-
特別損失合計	110	120
税引前当期純利益	10,170	9,425
法人税、住民税及び事業税	3,242	3,403
法人税等調整額	65	465
法人税等合計	3,177	2,937
当期純利益	6,993	6,487

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		

当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	-	3,136	3,330	3,330
当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	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

当期首残高	791	65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	444	295	295
当期変動額合計	149	444	295	3,394
当期末残高	941	509	431	64,219

## 注記事項

### （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

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

#### 2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

#### 3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

#### 4．固定資産の減価償却の方法

##### （1）有形固定資産

定額法によっております。

##### （2）無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づ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

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

##### （2）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、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事業年度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、退職給付に係る当事業年度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」という。）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。

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

当社は、翌事業年度より、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「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。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月21日）を適用する予定であります。

(会計方針の変更)

1. 「収益認識に関する会計基準」等の適用

「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）等を当事業年度の期首から適用し、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」等の適用

「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。）等を当事業年度の期首から適用し、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。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日）第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載しておりません。

(未適用の会計基準等)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日)

(1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

(2) 適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

(追加情報)

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、退職給付に係る事業年度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、当事業年度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。

(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 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
	金額	単位	金額	単位
建 物	106	百万円	146	百万円
器具備品	391	"	535	"
その 他	4	"	-	"
計	503	"	681	"

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

#### 1. 発行済株式の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
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

#### 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

2022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
2022年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,641	利益剰余金	880,447	2022年3月31日	2022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 8 . 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. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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、「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。以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した投資信託、市場価格のない株式等及び、時価算定適用指針第27項に従い経過措置を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）\*2、\*3及び（注2）参照）。

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) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）（*1）
金銭の信託	10,857
投資有価証券 その他有価証券	9,950
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)
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)
デリバティブ取引計	(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。

当事業年度（2022年3月31日）

区 分	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)	-	196	-	196
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	(1,333)	(80)	-	(1,413)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(71)	-	(71)
デリバティブ取引計	(1,333)	(151)	-	(1,485)

(\*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) 投資有価証券のうち、投資信託（貸借対照表計上額6,474百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額133百万円）は上記に含めておりません。

(\*3) 金銭の信託の信託財産のうち、投資信託（貸借対照表計上額13,876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額840百万円）は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,913百万円であります。

(\*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) 時価をもって貸借対照表計上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、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) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

(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（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

当事業年度（2022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	21,675	-	-	-
未収委託者報酬	9,067	-	-	-
未収運用受託報酬	6,252	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	108	1,712	0

（有価証券関係）

## 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）

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636

## 2．その他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（2022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	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,585	1,711	126
小計	1,585	1,711	126
合計	6,474	5,115	1,358

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりません。

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
非上場株式	0	0
組合出資金等		133

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	109	1	0

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（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）上記取引の評価損益は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	13,711	-	315	315
合計		13,711	-	315	315

（注）上記取引の評価損益は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	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 関係会社株式				
	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	

当事業年度(2022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	5,498	-	54	
	英ポンド	277	-	1	
	カナダドル	111	-	1	
	スイスフラン	139	-	2	
	香港ドル	190	-	1	
	ユーロ	676	-	18	
	買建				
	ユーロ	21	-	0	
	合計	6,915	-	80	80

(注) 上記取引の評価損益は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	17,197	-	1,333
合計	17,197	-	1,333	1,333

(注) 上記取引の評価損益は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	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 関係会社株式			
	米ドル		4,422	-	43
	英ポンド		3,297	-	21
	スイスフラン		79	-	1
	香港ドル		119	-	1
	ユーロ		125	-	3
	人民元		13	-	0
	合計		8,057	-	71

## (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従来簡便法により、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したが、当事業年度より原則法と簡便法の併用により、これら計算を行っておりません。

## 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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
退職給付債務の期首残高	600		626	
勤務費用	-		124	
利息費用	-		2	
転籍者受入	18		-	
退職給付の支払額	69		81	
簡便法で計算した退職給付費用	77		8	
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-		120	
その他	-		18	
退職給付債務の期末残高	626		820	

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

## (3) 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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
非積立型制度の退職給付債務	626		820	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626		820	
退職給付引当金	626		820	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626		820	

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
勤務費用	-		124	
利息費用	-		2	
簡便法で計算した退職給付費用	77		8	

簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	120
その他	-	18
確定給付制度に係る退職給付費用	77	274

## (5) 年金資産に関する事項

該当事項はありません。

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
割引率	-	0.4%

## 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92百万円、当事業年度100百万円であります。

## (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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	107 百万円	112 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	170 "	177 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	191 "	251 "
税務上の収益認識差額	71 "	74 "
税務上の費用認識差額	-	439
繰延ヘッジ損益	28 "	224 "
その他	123 "	76 "
繰延税金資産 合計	693 "	1,357 "
繰延税金負債		
有価証券評価差額	349 "	415 "
その他	32 "	34 "
繰延税金負債 合計	382 "	450 "
繰延税金資産の純額	311 "	907 "

## 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。

## (収益認識関係)

## 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事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降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〕

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 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(*)	6,372百万円

(\*)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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	10,395百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395百万円

(\*)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〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

## （関連当事者情報）

## 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 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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	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	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

(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（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）

当事業年度（2022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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1株当たり純資産額	20,274,967円09銭	21,406,512円22銭
1株当たり当期純利益金額	2,331,221円85銭	2,162,405円20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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

##### (1)自己又はその役員との取引

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

##### (2)運用財産相互間の取引

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

##### (3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

##### (4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

##### (5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

## 5【その他】

## (1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

## (2)訴訟事件その他の重要事項

2022年 8月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2022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） （2022年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	17,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
SMB C日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社三十三銀行	37,461	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

## 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（2022年3月末日現在）

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

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

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2022年 2月10日	有価証券届出書
2022年 2月10日	有価証券報告書

**独立監査人の監査報告書**

2022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 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

**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2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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7月21日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT 8資産インデックスバランス・オープンの2021年11月11日から2022年5月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT 8資産インデックスバランス・オープンの2022年5月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファン드는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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。