

**【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7月20日提出
【計算期間】	第15期(自 2021年10月21日至 2022年4月20日)
【ファンド名】	SMT 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。

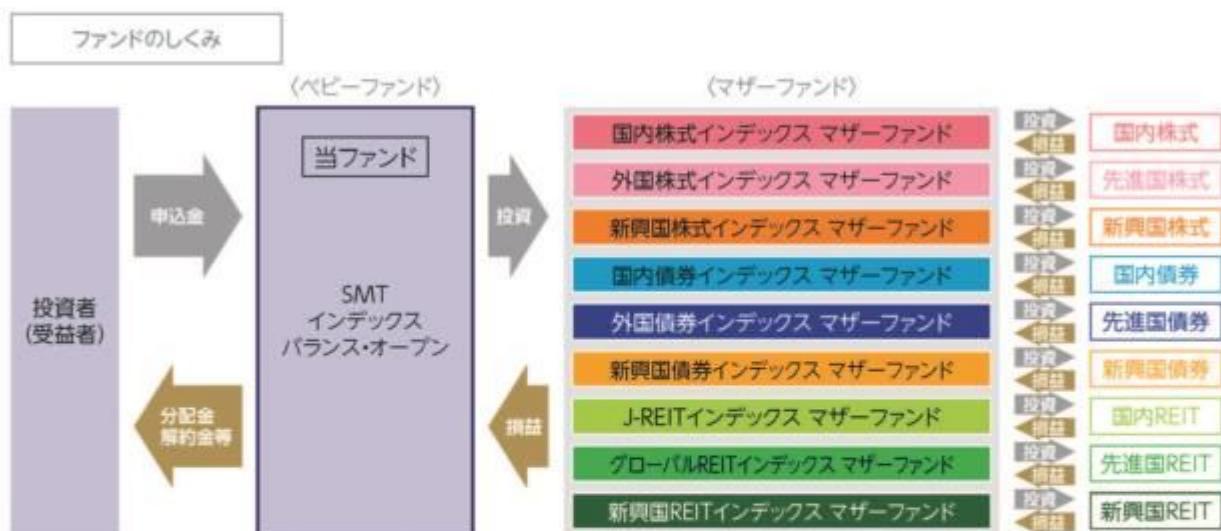
#### [ 特殊型 ]

- (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 世界の株式(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。

- 世界の株式、債券及び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資産配分比率に基づき、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

●基本資産配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分

リバランス実施

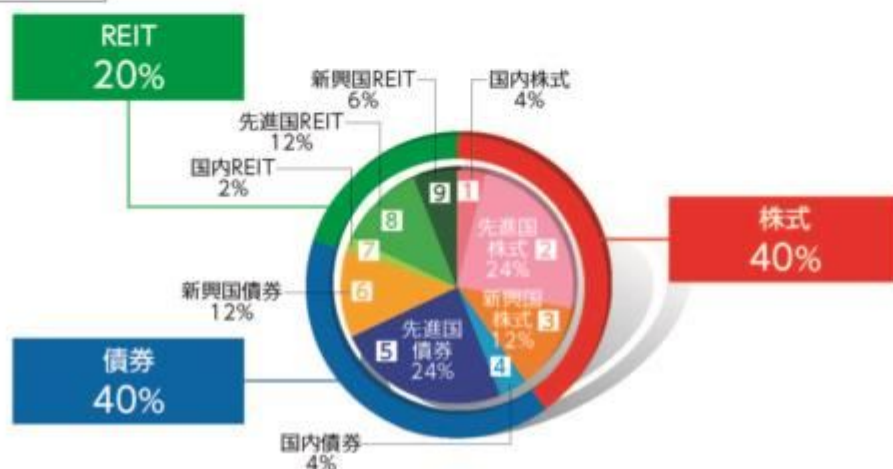
ファンドマネジャー

●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 株式、債券及びREITの基本資産配分比率は、原則として株式40%、債券40%、REIT20%とします。

基本資産配分比率  
(2022年5月末現在)



●市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で資産配分比率を調整します。

資産	インデックス
1 国内株式	TOPIX(東証株価指数) ※1
2 先進国株式	MSCIコクサイ・インデックス(円ベース) ※2
3 新興国株式	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	NOMURA-BPI総合※4
5 先進国債券	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	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円換算ベース) ※6
7 国内REIT	東証REIT指数(配当込み) ※7
8 先進国REIT	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース) ※8
9 新興国REIT	S&P新興国REIT指数(配当込み、円換算ベース) ※9

\* 資産ごとの運用においては、十分な銘柄分散を行い、上記のインデックスに連動する運用収益の獲得を目指します。

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ロクサイ・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、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、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。
- ※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&PJ」)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。
- ※9 「S&P新興国REIT指数(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、新興国に上場する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新興国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&PJ」)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。

### 特色3 世界経済全体の発展を享受します。

- 地域別の基本組入比率は、地域別(国内、先進国及び新興国)のGDP(国内総生産)総額の比率を参考に決定するものとします。また、基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
  - 地域別の基本組入比率は世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回見直しを行う予定です。
- ※地域別の基本組入比率は市場動向等を勘案して調整を行うことがあります。



(出所) IMF「世界経済見通し2021年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。

※GDP地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。

※当ファンドの地域別構成比は、2022年5月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。

#### 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60%以下とします。
- 投資信託証券(REIT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には制限を設けません。

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

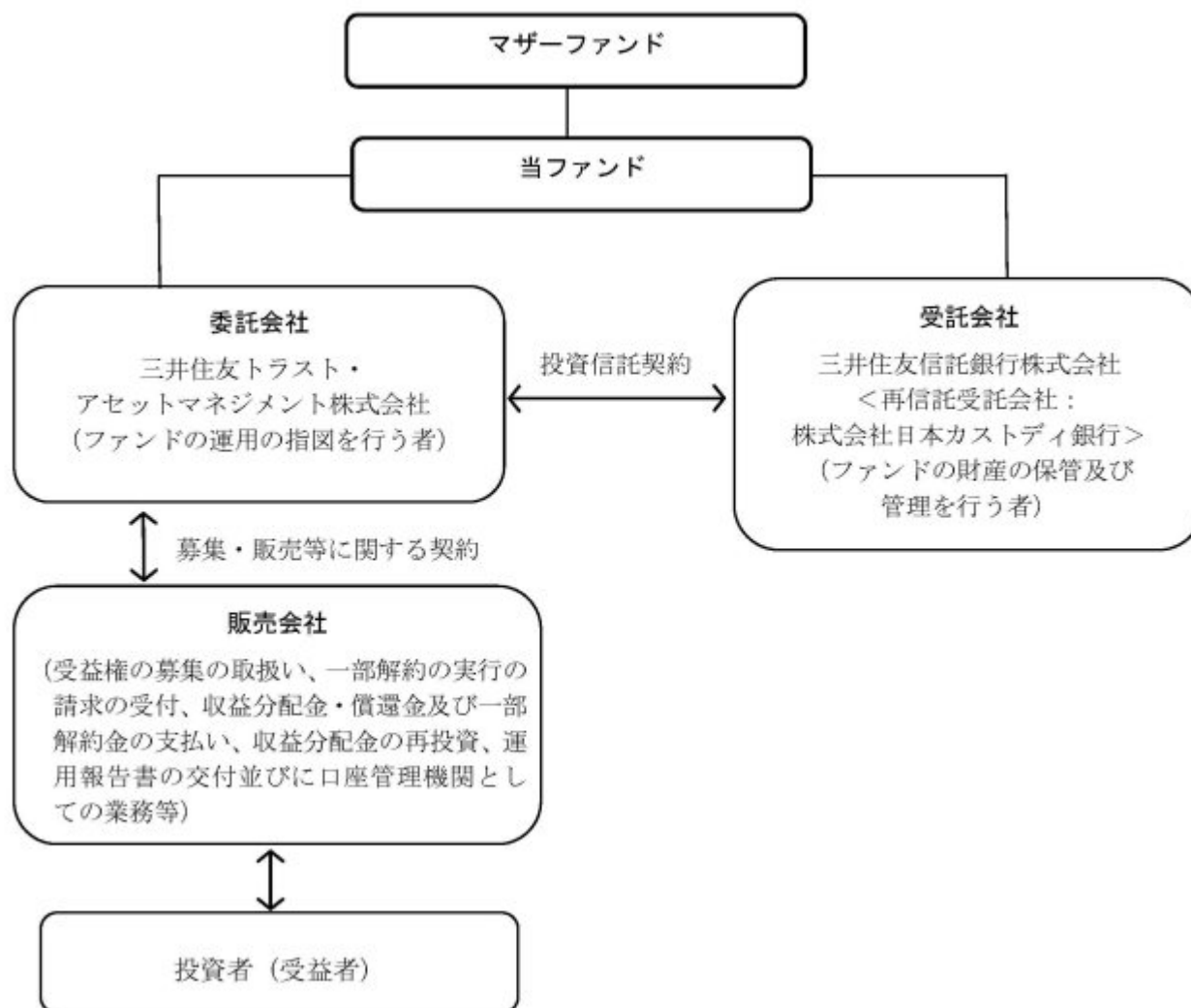
#### (2) 【ファンドの沿革】

2014年11月28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」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス 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」、「グローバルREITインデックス マザーファンド」及び「新興国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」という場合があります。）の各受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」という場合があります。）を主要投資対象とします。

### 投資態度

- イ．主として、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。以下同じ。）、債券及び不動産投資信託証券（以下「REIT」という場合があります。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかります。
- ロ．株式、債券及びREITの基本資産配分比率は、原則として株式40%、債券40%、REIT20%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整します。
- ハ．マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別（国内、先進国及び新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定するものとします。また、マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- ニ．マザーファンド受益証券の基本組入比率は世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回見直しを行う予定です。
- ホ．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。
- ヘ．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - 1. 有価証券
  - 2. 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」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファン

ド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス 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」、「グローバルREITインデックス マザーファンド」及び「新興国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書
  2. 国債証券
  3. 地方債証券
  4. 特別の法律により法人の発行する債券
  5. 社債券(新株引受権証券と社債券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せん。)
  17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
  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及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

### 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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。

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。

## 「新興国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、新興国の金融商品取引所等（これに準ずるものを含みます。）に上場しているREITに投資し、S&P新興国REIT指数（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

新興国の金融商品取引所等（これに準ずるものを含みます。）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

主として、新興国のREITに投資し、S&P新興国REIT指数（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。

REITへの投資割合は、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。

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。

## 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。

株式への投資は行いません。

同一銘柄のREIT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新興国REIT指数（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新興国REIT指数（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。

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、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。

### (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60%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（REIT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には制限を設けません。

#### 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8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に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効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、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効率的な運用に資するため、並びに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効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、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効率的な運用に資するため、並びに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効率的な運用に資するため、並びに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、投資信託財産の効率的な運用に資するため、並びに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)の予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、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にする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

(ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をします。

(ニ) 上記(ロ)においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約の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の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約の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。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

（ハ）収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 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生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

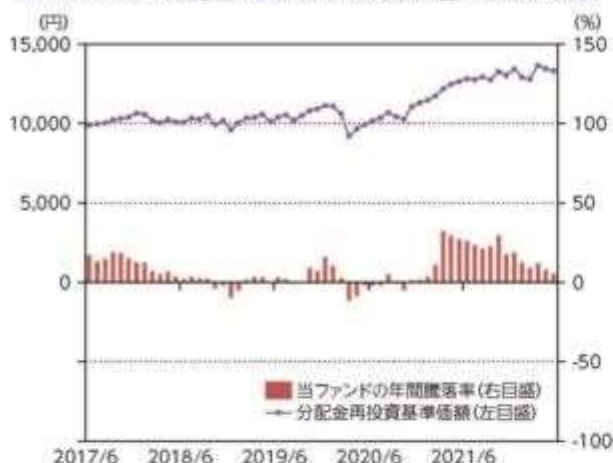
## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*2017年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、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

## 各資産クラスの指数について

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JPX総研が算出・公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての可能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。(配当込み)指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る権利又は商標は、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権利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採算、運営又は中断に対し、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。
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・サービスに限り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、本ファンドの推薦、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。
新興国債 JPMorgan Global Bond Index-Emerging Markets (円ベース)	本指数は、信頼性が低いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は、権利を受け付けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

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おりません。

#### （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ます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。

ハ．損益通算について

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



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

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

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

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- 二．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 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	2,634,572,818	99.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		25,804,110	0.97
合計（純資産総額）		2,660,376,928	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## （２）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	156,573,846	4.5533	712,935,984	4.2448	664,624,661	24.98
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	196,667,376	3.1506	619,635,604	3.0959	608,862,529	22.89
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	132,447,434	2.8964	383,627,025	2.5788	341,555,442	12.84
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	83,333,283	3.6954	307,951,982	3.5600	296,666,487	11.15
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	168,331,420	1.8021	303,363,616	1.7589	296,078,134	11.13
日本	親投資信託受益証券	新興国REITインデックス マザーファンド	240,086,932	0.7540	181,047,040	0.7306	175,407,512	6.59
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	57,871,349	1.8891	109,326,514	1.8888	109,307,403	4.11
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	61,244,971	1.3814	84,604,292	1.3825	84,671,172	3.18
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	26,346,956	2.1328	56,193,973	2.1786	57,399,478	2.16

(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	99.03
合計	99.03

(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 (2015年 4月20日)	1,069,183,722	1,069,183,722	10,012	10,012
第2期計算期間末 (2015年10月20日)	1,758,605,423	1,758,605,423	9,509	9,509
第3期計算期間末 (2016年 4月20日)	2,345,268,549	2,345,268,549	9,025	9,025
第4期計算期間末 (2016年10月20日)	2,640,506,750	2,640,506,750	8,729	8,729
第5期計算期間末 (2017年 4月20日)	3,071,863,389	3,071,863,389	9,344	9,344
第6期計算期間末 (2017年10月20日)	3,210,063,471	3,210,063,471	10,386	10,386
第7期計算期間末 (2018年 4月20日)	3,051,290,712	3,051,290,712	10,234	10,234
第8期計算期間末 (2018年10月22日)	2,916,459,886	2,916,459,886	10,043	10,043
第9期計算期間末 (2019年 4月22日)	2,897,788,604	2,897,788,604	10,631	10,631
第10期計算期間末 (2019年10月21日)	2,862,769,922	2,862,769,922	10,703	10,703
第11期計算期間末 (2020年 4月20日)	2,311,876,858	2,311,876,858	9,578	9,578
第12期計算期間末 (2020年10月20日)	2,413,136,341	2,413,136,341	10,586	10,586
第13期計算期間末 (2021年 4月20日)	2,520,767,080	2,520,767,080	12,311	12,311
第14期計算期間末 (2021年10月20日)	2,749,895,621	2,749,895,621	13,320	13,320
第15期計算期間末 (2022年 4月20日)	2,792,857,082	2,792,857,082	13,960	13,960
2021年 5月末日	2,593,871,550		12,644	
6月末日	2,638,989,143		12,816	
7月末日	2,633,007,997		12,772	
8月末日	2,672,350,988		12,930	
9月末日	2,637,514,511		12,761	
10月末日	2,734,505,167		13,275	
11月末日	2,671,528,037		13,031	
12月末日	2,715,159,998		13,432	
2022年 1月末日	2,588,383,969		12,914	
2月末日	2,571,635,683		12,806	
3月末日	2,736,324,253		13,662	
4月末日	2,680,464,525		13,448	
5月末日	2,660,376,928		13,325	

## 【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	2014年11月28日～2015年 4月20日	0
第2期計算期間	2015年 4月21日～2015年10月20日	0
第3期計算期間	2015年10月21日～2016年 4月20日	0
第4期計算期間	2016年 4月21日～2016年10月20日	0
第5期計算期間	2016年10月21日～2017年 4月20日	0
第6期計算期間	2017年 4月21日～2017年10月20日	0
第7期計算期間	2017年10月21日～2018年 4月20日	0
第8期計算期間	2018年 4月21日～2018年10月22日	0
第9期計算期間	2018年10月23日～2019年 4月22日	0
第10期計算期間	2019年 4月23日～2019年10月21日	0
第11期計算期間	2019年10月22日～2020年 4月20日	0
第12期計算期間	2020年 4月21日～2020年10月20日	0
第13期計算期間	2020年10月21日～2021年 4月20日	0
第14期計算期間	2021年 4月21日～2021年10月20日	0
第15期計算期間	2021年10月21日～2022年 4月20日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2014年11月28日～2015年 4月20日	0.1
第2期計算期間	2015年 4月21日～2015年10月20日	5.0
第3期計算期間	2015年10月21日～2016年 4月20日	5.1
第4期計算期間	2016年 4月21日～2016年10月20日	3.3
第5期計算期間	2016年10月21日～2017年 4月20日	7.0
第6期計算期間	2017年 4月21日～2017年10月20日	11.2
第7期計算期間	2017年10月21日～2018年 4月20日	1.5
第8期計算期間	2018年 4月21日～2018年10月22日	1.9
第9期計算期間	2018年10月23日～2019年 4月22日	5.9
第10期計算期間	2019年 4月23日～2019年10月21日	0.7
第11期計算期間	2019年10月22日～2020年 4月20日	10.5
第12期計算期間	2020年 4月21日～2020年10月20日	10.5
第13期計算期間	2020年10月21日～2021年 4月20日	16.3
第14期計算期間	2021年 4月21日～2021年10月20日	8.2
第15期計算期間	2021年10月21日～2022年 4月20日	4.8

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2014年11月28日～2015年 4月20日	1,226,719,421	158,784,152	1,067,935,269
第2期計算期間	2015年 4月21日～2015年10月20日	1,116,037,756	334,592,586	1,849,380,439
第3期計算期間	2015年10月21日～2016年 4月20日	1,083,752,766	334,386,357	2,598,746,848
第4期計算期間	2016年 4月21日～2016年10月20日	602,284,502	175,969,377	3,025,061,973
第5期計算期間	2016年10月21日～2017年 4月20日	856,851,109	594,236,350	3,287,676,732
第6期計算期間	2017年 4月21日～2017年10月20日	584,835,788	781,663,341	3,090,849,179
第7期計算期間	2017年10月21日～2018年 4月20日	473,012,411	582,449,995	2,981,411,595
第8期計算期間	2018年 4月21日～2018年10月22日	199,195,642	276,588,300	2,904,018,937
第9期計算期間	2018年10月23日～2019年 4月22日	166,800,463	345,148,199	2,725,671,201
第10期計算期間	2019年 4月23日～2019年10月21日	156,918,897	207,929,245	2,674,660,853
第11期計算期間	2019年10月22日～2020年 4月20日	163,015,795	423,953,521	2,413,723,127
第12期計算期間	2020年 4月21日～2020年10月20日	126,592,041	260,782,440	2,279,532,728
第13期計算期間	2020年10月21日～2021年 4月20日	92,056,120	324,043,645	2,047,545,203
第14期計算期間	2021年 4月21日～2021年10月20日	106,905,068	90,001,351	2,064,448,920
第15期計算期間	2021年10月21日～2022年 4月20日	85,522,955	149,318,352	2,000,653,523

(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。

## 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-CLASS 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。

## 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。

#### 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。

#### ロ.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・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。

## 新興国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(%)
株式	マルタ共和国	1,053,689	0.21
投資証券	南アフリカ	162,383,308	32.16
	メキシコ	103,562,201	20.51
	インド	58,665,379	11.62
	タイ	46,695,637	9.25
	マレーシア	40,552,504	8.03
	サウジアラビア	29,688,539	5.88
	フィリピン	23,096,046	4.57
	トルコ	18,253,370	3.62
	香港	5,232,295	1.04
	小計	488,129,279	96.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		15,684,934	3.11
合計(純資産総額)		504,867,902	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		1,237,305	0.25

(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 (%)
南アフリカ	投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	368,555	115.41	42,537,697	118.47	43,662,711	8.65
メキシコ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	318,400	138.52	44,105,349	135.18	43,042,318	8.53
インド	投資証券	EMBASSY OFFICE PARKS REIT	56,929	575.58	32,767,672	631.71	35,962,789	7.12
南アフリカ	投資証券	REDEFINE PROPERTIES LTD	704,051	37.04	26,079,809	35.80	25,208,546	4.99
メキシコ	投資証券	PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	49,700	307.61	15,288,482	339.10	16,853,445	3.34
メキシコ	投資証券	PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIA	85,800	192.98	16,558,359	188.73	16,193,266	3.21
南アフリカ	投資証券	RESILIENT REIT LTD	34,557	448.24	15,489,878	451.68	15,608,965	3.09
タイ	投資証券	CPN RETAIL GROWTH LEASEHOLD	201,500	78.31	15,780,850	72.75	14,659,125	2.90
メキシコ	投資証券	CONCENTRADORA FIBRA DANHOS S	90,600	162.87	14,756,137	157.04	14,228,561	2.82
インド	投資証券	MINDSPACE BUSINESS PARKS REI	24,062	545.99	13,137,626	579.05	13,933,289	2.76
メキシコ	投資証券	MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	79,000	159.40	12,592,982	167.65	13,244,611	2.62
南アフリカ	投資証券	FORTRESS REIT LTD-A	130,265	112.11	14,604,986	100.64	13,111,172	2.60
南アフリカ	投資証券	EQUITES PROPERTY FUND LTD	79,600	176.46	14,046,813	159.80	12,720,279	2.52
南アフリカ	投資証券	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	37,648	276.20	10,398,754	301.04	11,333,648	2.24
マレーシア	投資証券	KLCCP STAPLED GROUP	55,300	200.81	11,104,896	199.05	11,007,627	2.18
南アフリカ	投資証券	VUKILE PROPERTY FUND LTD	96,614	99.00	9,564,786	113.10	10,927,768	2.16
タイ	投資証券	LOTUS'S RETAIL GROWTH FREEHO	191,400	58.50	11,196,900	52.12	9,976,725	1.98
インド	投資証券	BROOKFIELD INDIA REAL ESTATE	15,799	445.17	7,033,379	555.05	8,769,301	1.74
マレーシア	投資証券	SUNWAY REAL ESTATE INVESTMENT	194,000	43.09	8,360,223	45.14	8,758,329	1.73
マレーシア	投資証券	IGB REAL ESTATE INVESTMENT T	172,700	49.25	8,505,511	47.49	8,201,743	1.62
マレーシア	投資証券	AXIS REAL ESTATE INVESTMENT	129,700	56.87	7,376,332	55.99	7,262,265	1.44
フィリピン	投資証券	RL COMMERCIAL REIT INC	404,000	17.62	7,121,429	17.44	7,048,526	1.40
タイ	投資証券	FRASERS PROPERTY THAILAND IN	164,600	47.62	7,839,075	41.62	6,851,475	1.36
サウジアラビア	投資証券	JADWA REIT SAUDI FUND	13,541	503.18	6,813,574	476.48	6,452,037	1.28
南アフリカ	投資証券	INVESTEC PROPERTY FUND LTD	61,848	89.92	5,561,682	101.47	6,276,026	1.24
タイ	投資証券	WIHA PREMIUM GROWTH FREEHOLD	160,300	49.12	7,874,738	39.00	6,251,700	1.24
南アフリカ	投資証券	STOR-AGE PROPERTY REIT LTD	50,755	114.92	5,832,891	119.54	6,067,379	1.20
フィリピン	投資証券	AREIT INC	63,020	105.46	6,646,418	91.89	5,790,908	1.15

トルコ	投資証券	IS GAYRIMENKUL YATIRIM ORTAK	51,071	14.55	743,198	109.68	5,601,961	1.11
サウジア ラビア	投資証券	RIYAD REIT FUND	13,266	342.30	4,540,952	375.84	4,985,965	0.99

(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	不動産	0.21
投資証券			96.68
合計			96.89

(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


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	南アフリカランド	買建	150,000.00	1,220,100	1,237,305	0.25

(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：2014年11月28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 13,325円  
純資産総額 26.60億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年4月	0円
2020年10月	0円
2021年4月	0円
2021年10月	0円
2022年4月	0円
設定後 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	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実効利率
外国株式インデックスマザーファンド	25.0%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア	-	-	1.2%
		MICROSOFT CORP.	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	0.9%
外国債券インデックスマザーファンド	22.9%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.2%
		T 1.25% 08/15/31	アメリカ	国債	-	1.250%	2031/08/15	0.1%
グローバルREITインデックスマザーファンド	12.8%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.8%
		EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.5%
新興国株式インデックスマザーファンド	11.2%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.7%
		SAMSUNG ELECTRONICS CO.LTD	韓国	株式	テクノロジー/ハードウェア	-	-	0.4%
新興国債券インデックスマザーファンド	11.1%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.3%
		BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	国債	-	0.000%	2024/01/01	0.3%
新興国REITインデックスマザーファンド	6.6%	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	南アメリカ	投資証券	-	-	-	0.6%
		FRBA UNO ADMINISTRACION SA	メキシコ	投資証券	-	-	-	0.6%
国内株式インデックスマザーファンド	4.1%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.2%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.1%
国内債券インデックスマザーファンド	3.2%	第150回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/12/20	0.0%
		第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2024/09/20	0.0%
J-REITインデックスマザーファンド	2.2%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.2%
		ジャパックスリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移(暦年ベース)**


※2014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ます。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

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

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### <一部解約受付の中止等>

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

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

(イ) 国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### (2) 【保管】

該当事項はありません。

### (3) 【信託期間】

無期限とします。（2014年11月28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4月21日から10月20日まで及び10月21日から翌年4月20日までとします。

ただし、第1計算期間は2014年11月28日から2015年4月20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30億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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いて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続に従います。

## (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）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、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該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行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

## < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

## < 運用報告書 >

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

## < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示

のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前に

において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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



### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間(2021年10月21日から2022年4月20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 インデックスバランス・オープン】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (2021年10月20日現在)	第15期 (2022年4月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	29,701,056	34,380,332
親投資信託受益証券	2,723,250,911	2,766,075,688
未収入金	10,550,000	840,000
流動資産合計	2,763,501,967	2,801,296,020
資産合計	2,763,501,967	2,801,296,020
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	6,311,550	1,054,113
未払受託者報酬	722,265	731,180
未払委託者報酬	6,500,316	6,580,565
未払利息	54	26
その他未払費用	72,161	73,054
流動負債合計	13,606,346	8,438,938
負債合計	13,606,346	8,438,938
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,064,448,920	2,000,653,523
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	685,446,701	792,203,559
(分配準備積立金)	687,126,537	767,331,118
元本等合計	2,749,895,621	2,792,857,082
純資産合計	2,749,895,621	2,792,857,082
負債純資産合計	2,763,501,967	2,801,296,020

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期		第15期	
	自	2021年 4月21日 至 2021年10月20日	自	2021年10月21日 至 2022年 4月20日
営業収益				
受取利息		84		87
有価証券売買等損益		214,935,017		134,764,777
営業収益合計		214,935,101		134,764,864
営業費用				
支払利息		6,506		5,592
受託者報酬		722,265		731,180
委託者報酬		6,500,316		6,580,565
その他費用		72,161		73,054
営業費用合計		7,301,248		7,390,391
営業利益又は営業損失（ ）		207,633,853		127,374,473
経常利益又は経常損失（ ）		207,633,853		127,374,473
当期純利益又は当期純損失（ ）		207,633,853		127,374,473
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		3,780,244		1,443,525
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		473,221,877		685,446,701
剰余金増加額又は欠損金減少額		29,161,441		27,303,361
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		29,161,441		27,303,361
剰余金減少額又は欠損金増加額		20,790,226		49,364,501
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		20,790,226		49,364,501
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		685,446,701		792,203,559

## (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14期 (2021年10月20日現在)	第15期 (2022年 4月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,064,448,920口	2,000,653,523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) 1.3320円 (13,320円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3960円 (13,960円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期 自 2021年 4月21日 至 2021年10月20日	第15期 自 2021年10月21日 至 2022年 4月20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>31,145,967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>172,707,642円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>198,620,257円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>483,272,928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>885,746,794円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,064,448,920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>4,290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	31,145,967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	172,707,642円	収益調整金額	C	198,620,257円	分配準備積立金額	D	483,272,928円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	885,746,794円	当ファンドの期末残存口数	F	2,064,448,920口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,290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>31,507,303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>97,310,695円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>220,176,500円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>638,513,120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>987,507,618円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,000,653,523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>4,935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	31,507,303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	97,310,695円	収益調整金額	C	220,176,500円	分配準備積立金額	D	638,513,120円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	987,507,618円	当ファンドの期末残存口数	F	2,000,653,523口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,935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	31,145,967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	172,707,642円																																																											
収益調整金額	C	198,620,257円																																																											
分配準備積立金額	D	483,272,928円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	885,746,794円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,064,448,920口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,290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	31,507,303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	97,310,695円																																																											
収益調整金額	C	220,176,500円																																																											
分配準備積立金額	D	638,513,120円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	987,507,618円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,000,653,523口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,935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15期 自 2021年10月21日 至 2022年 4月20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15期 (2022年 4月20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14期	第15期
	自 2021年 4月21日 至 2021年10月20日	自 2021年10月21日 至 2022年 4月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,047,545,203円	2,064,448,920円
期中追加設定元本額	106,905,068円	85,522,955円
期中一部解約元本額	90,001,351円	149,318,352円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第14期 (2021年10月20日現在)	第15期 (2022年 4月20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	211,844,853	134,733,812
合計	211,844,853	134,733,812

（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	26,342,963	56,189,540	
	グローバルR E I Tインデックス マザーファンド	134,720,651	390,447,390	
	新興国株式インデックス マザーファンド	83,320,465	308,027,427	

国内株式インデックス マザーファンド	57,870,979	109,353,001	
外国株式インデックス マザーファンド	156,547,017	713,149,935	
国内債券インデックス マザーファンド	61,237,942	84,606,340	
外国債券インデックス マザーファンド	196,641,091	619,675,070	
新興国債券インデックス マザーファンド	168,322,045	303,467,814	
新興国REITインデックス マザーファンド	240,073,113	181,159,171	
合計	1,125,076,266	2,766,075,688	

(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

	2022年 4月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,769,020,335
株式	480,748,319,990
派生商品評価勘定	156,068,600
未収配当金	5,581,636,049
差入委託証拠金	413,140,000
流動資産合計	489,668,184,974
資産合計	489,668,184,974
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	139,600,600
前受金	16,514,750
未払金	286,520
未払解約金	43,116,396
未払利息	2,119
流動負債合計	199,520,385
負債合計	199,520,385
純資産の部	
元本等	
元本	259,034,900,279
剰余金	

	2022年 4月20日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	230,433,764,310
元本等合計	489,468,664,589
純資産合計	489,468,664,589
負債純資産合計	489,668,184,974

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 4月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
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>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</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 4月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	259,034,900,279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 1.8896円 (1万口当たり純資産額) (18,896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 4月20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 4月20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 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年10月21日
期首元本額	250,628,037,965円
期中追加設定元本額	18,839,967,015円
期中一部解約元本額	10,433,104,701円
期末元本額	259,034,900,279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）	404,033,397円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,961,550,539円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,945,801円
S M T T O P I X インデックス・オープン	11,633,179,830円
世界経済インデックスファンド	3,723,037,325円
日本株式インデックス・オープン	3,352,019,618円
D C マイセレクション 2 5	6,204,408,454円
D C マイセレクション 5 0	18,834,993,749円
D C マイセレクション 7 5	18,659,552,634円
D C 日本株式インデックス・オープン	6,146,680,687円
D C マイセレクション S 2 5	3,045,811,735円
D C マイセレクション S 5 0	8,948,388,467円
D C マイセレクション S 7 5	6,745,113,461円
D C 日本株式インデックス・オープン S	8,160,239,649円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	195,238,731円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	690,207,756円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	502,549,670円
D C 世界経済インデックスファンド	3,524,739,974円
日本株式インデックス・オープン（S M A 専用）	1,800,584,636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

区分	2022年 4月20日現在
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	19,058,334円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	22,371,205円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	187,155,746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）	24,905,932円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	72,194,987円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	934,862,847円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	440,196,567円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,858,492,133円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	60,925,073円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	25,409,793円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	493,377,595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）	353,711,707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）	586,851,793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	1,900,116,738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	1,375,097,034円
分散投資コア戦略ファンドS	5,892,977,661円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	465,519,652円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	413,997,505円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,859,069,062円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	220,156,996円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,137,484円
SMT インデックスバランス・オープン	57,870,979円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	28,811,551,979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	44,977,291円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	167,197,043円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	30,544,974円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,961,315円
グローバル経済コア	215,821,248円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	26,821,951円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	97,946,414円
DCターゲット・イヤーフンド2055	23,614,106円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,220,681,847円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	175,225,571円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	9,130,822円

区分	2022年 4月20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	8,364,675円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	3,238,921円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	4,334,584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）	43,898,491,919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）	940,927,159円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	275,859,311円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	52,094,085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）	46,942,686,927円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	11,872,314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）	234,367,142円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,010,421,174
合計	2,010,421,174

(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 4月20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	8,673,045,250	-	8,689,560,000	16,514,750
	合計	8,673,045,250	-	8,689,560,000	16,514,750

## (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	8,700	3,225.00	28,057,500	
日本水産	249,600	571.00	142,521,600	
マルハニチロ	39,100	2,404.00	93,996,400	
雪国まいたけ	18,200	1,116.00	20,311,200	
カネコ種苗	7,100	1,640.00	11,644,000	
サカタのタネ	29,800	4,165.00	124,117,000	
ホクト	20,900	1,996.00	41,716,400	
ホクリヨウ	3,400	677.00	2,301,800	
住石ホールディングス	43,700	183.00	7,997,100	
日鉄鉱業	5,700	6,870.00	39,159,000	
三井松島ホールディングス	10,400	2,194.00	22,817,600	
I N P E X	949,400	1,651.00	1,567,459,400	
石油資源開発	29,300	2,680.00	78,524,000	
K & O エナジーグループ	11,300	1,668.00	18,848,400	
ヒノキヤグループ	5,400	2,353.00	12,706,200	
ショーボンドホールディングス	35,600	5,400.00	192,240,000	
ミライト・ホールディングス	80,300	1,813.00	145,583,900	
タマホーム	15,100	2,485.00	37,523,500	
サンヨーホームズ	2,900	750.00	2,175,000	
日本アクア	9,900	605.00	5,989,500	
ファーストコーポレーション	6,100	797.00	4,861,700	
ベステラ	5,000	1,200.00	6,000,000	
Robot Home	41,600	207.00	8,611,200	
キャンディル	4,300	510.00	2,193,000	
ダイセキ環境ソリューション	4,800	1,038.00	4,982,400	
第一カッター興業	6,200	1,311.00	8,128,200	
安藤・間	123,900	890.00	110,271,000	
東急建設	73,100	670.00	48,977,000	
コムシスホールディングス	80,400	2,667.00	214,426,800	
ピーアールホールディングス	34,000	292.00	9,928,000	
高松コンストラクショングループ	15,300	2,195.00	33,583,500	
東建コーポレーション	6,900	8,720.00	60,168,000	
ソネック	2,600	1,018.00	2,646,800	
ヤマウラ	12,000	925.00	11,100,000	
オリエンタル白石	83,900	233.00	19,548,700	
大成建設	166,500	3,545.00	590,242,500	
大林組	576,300	903.00	520,398,900	
清水建設	539,900	733.00	395,746,700	
飛島建設	15,400	1,020.00	15,708,000	

長谷工コーポレーション	171,600	1,407.00	241,441,200
松井建設	22,700	654.00	14,845,800
銭高組	2,500	3,845.00	9,612,500
鹿島建設	422,300	1,475.00	622,892,500
不動テトラ	12,200	1,536.00	18,739,200
大末建設	6,100	1,341.00	8,180,100
鉄建建設	12,500	1,818.00	22,725,000
西松建設	34,900	3,875.00	135,237,500
三井住友建設	129,900	423.00	54,947,700
大豊建設	8,400	4,570.00	38,388,000
佐田建設	12,400	455.00	5,642,000
ナカノフドー建設	13,800	318.00	4,388,400
奥村組	33,900	3,035.00	102,886,500
東鉄工業	26,800	2,162.00	57,941,600
イチケン	4,200	1,846.00	7,753,200
富士ピー・エス	7,400	482.00	3,566,800
浅沼組	6,500	5,200.00	33,800,000
戸田建設	239,300	745.00	178,278,500
熊谷組	29,400	2,710.00	79,674,000
北野建設	3,500	2,084.00	7,294,000
植木組	5,100	1,449.00	7,389,900
矢作建設工業	25,500	791.00	20,170,500
ピーエス三菱	19,000	568.00	10,792,000
日本ハウスホールディングス	39,300	454.00	17,842,200
大東建託	59,000	12,470.00	735,730,000
新日本建設	24,500	720.00	17,640,000
東亜道路工業	3,000	4,960.00	14,880,000
日本道路	5,600	7,450.00	41,720,000
東亜建設工業	14,100	2,919.00	41,157,900
日本国土開発	56,100	538.00	30,181,800
若築建設	9,600	2,011.00	19,305,600
東洋建設	64,600	939.00	60,659,400
五洋建設	228,500	634.00	144,869,000
世紀東急工業	27,700	733.00	20,304,100
福田組	6,200	4,460.00	27,652,000
住友林業	147,400	2,119.00	312,340,600
日本基礎技術	15,800	810.00	12,798,000
巴コーポレーション	25,600	460.00	11,776,000
大和ハウス工業	532,200	3,113.00	1,656,738,600
ライト工業	35,700	1,941.00	69,293,700
積水ハウス	625,100	2,253.50	1,408,662,850
日特建設	11,900	699.00	8,318,100

北陸電気工事	12,000	758.00	9,096,000
ユアテック	33,000	671.00	22,143,000
日本リーテック	12,100	1,219.00	14,749,900
四電工	6,300	1,739.00	10,955,700
中電工	26,500	2,068.00	54,802,000
関電工	93,700	816.00	76,459,200
きんでん	128,800	1,548.00	199,382,400
東京エネシス	19,100	997.00	19,042,700
トーエネック	5,800	3,335.00	19,343,000
住友電設	14,200	2,200.00	31,240,000
日本電設工業	31,600	1,556.00	49,169,600
エクシオグループ	86,600	2,151.00	186,276,600
新日本空調	15,200	1,812.00	27,542,400
九電工	44,500	2,883.00	128,293,500
三機工業	37,400	1,423.00	53,220,200
日揮ホールディングス	177,600	1,552.00	275,635,200
中外炉工業	5,800	1,473.00	8,543,400
ヤマト	16,900	771.00	13,029,900
太平電業	12,800	2,687.00	34,393,600
高砂熱学工業	52,100	1,685.00	87,788,500
三晃金属工業	2,300	2,443.00	5,618,900
朝日工業社	7,800	1,540.00	12,012,000
明星工業	37,300	690.00	25,737,000
大気社	28,000	3,155.00	88,340,000
ダイダン	12,800	2,072.00	26,521,600
日比谷総合設備	18,500	1,862.00	34,447,000
フィル・カンパニー	3,300	1,267.00	4,181,100
テスホールディングス	12,000	1,492.00	17,904,000
インフロニア・ホールディングス	245,700	964.00	236,854,800
東洋エンジニアリング	24,200	650.00	15,730,000
レイズネクスト	27,800	1,058.00	29,412,400
ニッポン	54,000	1,666.00	89,964,000
日清製粉グループ本社	208,400	1,725.00	359,490,000
日東富士製粉	2,700	4,430.00	11,961,000
昭和産業	17,500	2,584.00	45,220,000
鳥越製粉	16,300	645.00	10,513,500
中部飼料	20,800	1,009.00	20,987,200
フィード・ワン	24,400	662.00	16,152,800
東洋精糖	3,100	1,004.00	3,112,400
日本甜菜製糖	9,600	1,636.00	15,705,600
D M三井製糖ホールディングス	16,800	1,905.00	32,004,000
塩水港精糖	22,000	219.00	4,818,000

日新製糖	8,700	1,717.00	14,937,900
森永製菓	43,300	3,940.00	170,602,000
中村屋	4,400	3,120.00	13,728,000
江崎グリコ	50,800	3,675.00	186,690,000
名糖産業	8,100	1,588.00	12,862,800
井村屋グループ	10,500	2,236.00	23,478,000
不二家	10,300	2,363.00	24,338,900
山崎製パン	138,300	1,575.00	217,822,500
第一屋製パン	3,600	524.00	1,886,400
モロゾフ	5,900	2,991.00	17,646,900
亀田製菓	10,500	4,075.00	42,787,500
寿スピリッツ	17,800	6,740.00	119,972,000
カルビー	84,100	2,315.00	194,691,500
森永乳業	34,100	5,050.00	172,205,000
六甲バター	13,500	1,490.00	20,115,000
ヤクルト本社	136,600	6,540.00	893,364,000
明治ホールディングス	122,000	6,390.00	779,580,000
雪印メグミルク	44,400	1,951.00	86,624,400
プリマハム	23,100	2,136.00	49,341,600
日本ハム	70,500	4,110.00	289,755,000
林兼産業	5,600	496.00	2,777,600
丸大食品	18,100	1,504.00	27,222,400
S Foods	16,600	3,120.00	51,792,000
柿安本店	6,400	2,350.00	15,040,000
伊藤ハム米久ホールディングス	118,800	657.00	78,051,600
サッポロホールディングス	62,900	2,374.00	149,324,600
アサヒグループホールディングス	433,900	4,516.00	1,959,492,400
キリンホールディングス	677,900	1,785.50	1,210,390,450
宝ホールディングス	125,300	1,060.00	132,818,000
オエノンホールディングス	52,400	310.00	16,244,000
養命酒製造	5,600	1,746.00	9,777,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	129,500	1,440.00	186,480,000
サントリー食品インターナショナル	123,400	4,880.00	602,192,000
ダイドーグループホールディングス	9,500	4,850.00	46,075,000
伊藤園	56,000	5,350.00	299,600,000
キーコーヒー	18,100	1,986.00	35,946,600
ユニカフェ	5,500	928.00	5,104,000
ジャパンフーズ	2,600	1,135.00	2,951,000
日清オイリオグループ	23,100	2,909.00	67,197,900
不二製油グループ本社	40,000	1,805.00	72,200,000
かどや製油	2,000	3,595.00	7,190,000
J - オイルミルズ	17,200	1,576.00	27,107,200



キッコーマン	132,700	8,360.00	1,109,372,000
味の素	407,300	3,426.00	1,395,409,800
ブルドックソース	7,800	1,912.00	14,913,600
キューピー	96,900	2,149.00	208,238,100
ハウス食品グループ本社	69,000	2,945.00	203,205,000
カゴメ	70,000	3,265.00	228,550,000
焼津水産化学工業	8,900	893.00	7,947,700
アリアケジャパン	16,800	4,800.00	80,640,000
ピエトロ	2,400	1,774.00	4,257,600
エバラ食品工業	4,000	2,820.00	11,280,000
やまみ	1,600	1,695.00	2,712,000
ニチレイ	84,100	2,300.00	193,430,000
東洋水産	88,600	3,880.00	343,768,000
イトアンドホールディングス	7,000	2,103.00	14,721,000
大冷	2,100	1,882.00	3,952,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,500	520.00	4,940,000
日清食品ホールディングス	71,400	8,860.00	632,604,000
永谷園ホールディングス	8,200	1,931.00	15,834,200
一正蒲鉾	8,000	816.00	6,528,000
フジッコ	17,100	2,022.00	34,576,200
ロック・フィールド	19,900	1,473.00	29,312,700
日本たばこ産業	989,000	2,202.00	2,177,778,000
ケンコーマヨネーズ	10,300	1,401.00	14,430,300
わらべや日洋ホールディングス	12,100	1,657.00	20,049,700
なとり	10,300	1,960.00	20,188,000
イフジ産業	3,200	995.00	3,184,000
ピクルスコーポレーション	8,800	1,294.00	11,387,200
ファーマフーズ	17,400	1,822.00	31,702,800
ユーグレナ	93,900	896.00	84,134,400
紀文食品	10,700	1,122.00	12,005,400
ミヨシ油脂	7,100	1,128.00	8,008,800
理研ビタミン	19,200	1,622.00	31,142,400
片倉工業	20,300	2,243.00	45,532,900
ゲンゼ	11,600	3,745.00	43,442,000
東洋紡	71,600	1,061.00	75,967,600
ユニチカ	51,100	281.00	14,359,100
富士紡ホールディングス	8,200	3,140.00	25,748,000
倉敷紡績	15,700	1,731.00	27,176,700
シキボウ	9,400	878.00	8,253,200
日本毛織	54,800	949.00	52,005,200
トーア紡コーポレーション	6,600	384.00	2,534,400
帝国繊維	20,600	1,648.00	33,948,800

帝人	169,800	1,356.00	230,248,800
東レ	1,303,900	627.00	817,545,300
住江織物	3,500	1,845.00	6,457,500
日本フェルト	11,200	426.00	4,771,200
イチカワ	2,700	1,413.00	3,815,100
日東製網	1,900	1,600.00	3,040,000
アツギ	14,100	541.00	7,628,100
ダイニック	6,800	719.00	4,889,200
セーレン	37,100	2,049.00	76,017,900
ソトー	6,800	839.00	5,705,200
東海染工	2,200	1,148.00	2,525,600
小松マテーレ	29,700	1,438.00	42,708,600
ワコールホールディングス	45,000	1,853.00	83,385,000
ホギメディカル	24,300	3,185.00	77,395,500
T S Iホールディングス	60,700	312.00	18,938,400
マツオカコーポレーション	5,900	1,119.00	6,602,100
ワールド	23,700	1,320.00	31,284,000
三陽商会	8,600	861.00	7,404,600
ナイガイ	6,700	305.00	2,043,500
オンワードホールディングス	108,900	246.00	26,789,400
ルックホールディングス	5,800	1,479.00	8,578,200
ゴールドウイン	32,500	6,250.00	203,125,000
デサント	35,200	2,630.00	92,576,000
キング	8,800	509.00	4,479,200
ヤマトインターナショナル	16,400	290.00	4,756,000
特種東海製紙	11,100	3,450.00	38,295,000
王子ホールディングス	752,400	615.00	462,726,000
日本製紙	86,200	1,046.00	90,165,200
三菱製紙	25,500	308.00	7,854,000
北越コーポレーション	118,000	659.00	77,762,000
中越パルプ工業	6,900	941.00	6,492,900
巴川製紙所	5,300	819.00	4,340,700
大王製紙	86,800	1,518.00	131,762,400
阿波製紙	4,600	337.00	1,550,200
レンゴー	170,100	758.00	128,935,800
トモク	11,000	1,514.00	16,654,000
ザ・パック	13,600	2,462.00	33,483,200
北の達人コーポレーション	64,400	194.00	12,493,600
クラレ	263,200	1,042.00	274,254,400
旭化成	1,193,000	1,076.00	1,283,668,000
共和レザー	11,200	665.00	7,448,000
昭和電工	156,100	2,409.00	376,044,900

住友化学	1,322,400	560.00	740,544,000
住友精化	8,000	3,015.00	24,120,000
日産化学	97,900	7,260.00	710,754,000
ラサ工業	6,300	1,456.00	9,172,800
クレハ	14,200	9,820.00	139,444,000
多木化学	7,000	5,060.00	35,420,000
テイカ	13,200	1,200.00	15,840,000
石原産業	30,000	1,029.00	30,870,000
片倉コープアグリ	4,100	1,299.00	5,325,900
日本曹達	23,000	3,390.00	77,970,000
東ソー	259,700	1,773.00	460,448,100
トクヤマ	57,600	1,677.00	96,595,200
セントラル硝子	29,400	2,351.00	69,119,400
東亜合成	100,000	1,080.00	108,000,000
大阪ソーダ	16,800	3,190.00	53,592,000
関東電化工業	39,400	956.00	37,666,400
デンカ	65,700	3,360.00	220,752,000
信越化学工業	309,100	17,630.00	5,449,433,000
日本カーバイド工業	6,400	1,380.00	8,832,000
堺化学工業	12,600	1,864.00	23,486,400
第一稀元素化学工業	16,700	1,006.00	16,800,200
エア・ウォーター	170,400	1,673.00	285,079,200
日本酸素ホールディングス	173,000	2,222.00	384,406,000
日本化学工業	5,600	2,254.00	12,622,400
東邦アセチレン	3,000	1,132.00	3,396,000
日本パーカラライジング	90,800	901.00	81,810,800
高压ガス工業	28,500	651.00	18,553,500
チタン工業	2,100	1,718.00	3,607,800
四国化成工業	23,500	1,322.00	31,067,000
戸田工業	3,800	2,707.00	10,286,600
ステラ ケミファ	9,000	2,431.00	21,879,000
保土谷化学工業	5,800	3,680.00	21,344,000
日本触媒	30,300	5,300.00	160,590,000
大日精化工業	14,900	1,953.00	29,099,700
カネカ	46,600	3,465.00	161,469,000
三菱瓦斯化学	167,400	1,865.00	312,201,000
三井化学	163,500	2,953.00	482,815,500
J S R	167,700	3,520.00	590,304,000
東京応化工業	29,200	6,740.00	196,808,000
大阪有機化学工業	15,300	2,884.00	44,125,200
三菱ケミカルホールディングス	1,203,200	793.20	954,378,240
K Hネオケム	29,700	2,519.00	74,814,300

ダイセル	259,300	783.00	203,031,900
住友ベークライト	28,300	4,400.00	124,520,000
積水化学工業	376,600	1,675.00	630,805,000
日本ゼオン	162,300	1,307.00	212,126,100
アイカ工業	50,100	2,908.00	145,690,800
UBE	84,800	2,025.00	171,720,000
積水樹脂	27,200	1,745.00	47,464,000
タキロンシーアイ	38,900	548.00	21,317,200
旭有機材	10,200	1,881.00	19,186,200
ニチバン	10,600	1,712.00	18,147,200
リケンテクノス	43,900	441.00	19,359,900
大倉工業	9,200	1,800.00	16,560,000
積水化成成品工業	24,100	423.00	10,194,300
群栄化学工業	4,100	2,807.00	11,508,700
タイガースポリマー	9,500	422.00	4,009,000
ミライアル	5,800	1,699.00	9,854,200
ダイキアクシス	7,000	733.00	5,131,000
ダイキョーニシカワ	37,900	525.00	19,897,500
竹本容器	6,400	833.00	5,331,200
森六ホールディングス	9,700	1,799.00	17,450,300
恵和	4,900	4,965.00	24,328,500
日本化薬	139,500	1,123.00	156,658,500
カーリットホールディングス	17,800	633.00	11,267,400
日本精化	14,500	2,102.00	30,479,000
扶桑化学工業	16,200	3,805.00	61,641,000
トリケミカル研究所	18,500	2,626.00	48,581,000
ADEKA	82,900	2,639.00	218,773,100
日油	61,400	4,785.00	293,799,000
新日本理化	29,800	236.00	7,032,800
ハリマ化成グループ	13,400	793.00	10,626,200
花王	406,500	5,058.00	2,056,077,000
第一工業製薬	6,700	2,644.00	17,714,800
石原ケミカル	9,100	1,260.00	11,466,000
日華化学	6,100	778.00	4,745,800
ニイタカ	3,700	2,384.00	8,820,800
三洋化成工業	10,700	4,945.00	52,911,500
有機合成薬品工業	12,500	271.00	3,387,500
大日本塗料	22,000	779.00	17,138,000
日本ペイントホールディングス	676,300	1,031.00	697,265,300
関西ペイント	186,700	1,796.00	335,313,200
神東塗料	14,200	154.00	2,186,800
中国塗料	42,500	919.00	39,057,500

日本特殊塗料	13,500	800.00	10,800,000
藤倉化成	22,400	450.00	10,080,000
太陽ホールディングス	26,500	3,140.00	83,210,000
D I C	76,000	2,439.00	185,364,000
サカタイクス	35,700	928.00	33,129,600
東洋インキS Cホールディングス	38,000	1,935.00	73,530,000
T & K T O K A	14,500	810.00	11,745,000
富士フィルムホールディングス	323,000	7,473.00	2,413,779,000
資生堂	342,300	6,120.00	2,094,876,000
ライオン	218,300	1,281.00	279,642,300
高砂香料工業	12,600	2,579.00	32,495,400
マンダム	38,600	1,311.00	50,604,600
ミルボン	22,700	5,250.00	119,175,000
ファンケル	74,400	2,549.00	189,645,600
コーセー	34,600	12,960.00	448,416,000
コタ	12,800	1,412.00	18,073,600
シーボン	2,400	1,710.00	4,104,000
ポーラ・オルビスホールディングス	78,400	1,509.00	118,305,600
ノエビアホールディングス	15,600	4,950.00	77,220,000
アジュバンホールディングス	4,100	1,048.00	4,296,800
新日本製薬	5,000	1,452.00	7,260,000
エステー	11,800	1,511.00	17,829,800
アグロ カネショウ	6,100	1,112.00	6,783,200
コニシ	30,200	1,532.00	46,266,400
長谷川香料	31,700	2,600.00	82,420,000
星光P M C	10,400	578.00	6,011,200
小林製薬	51,500	9,360.00	482,040,000
荒川化学工業	15,300	1,025.00	15,682,500
メック	13,700	2,756.00	37,757,200
日本高純度化学	5,000	2,408.00	12,040,000
タカラバイオ	48,100	2,218.00	106,685,800
J C U	20,700	3,385.00	70,069,500
新田ゼラチン	11,500	639.00	7,348,500
O A T アグリオ	7,600	1,174.00	8,922,400
デクセリアルズ	47,800	3,040.00	145,312,000
アース製薬	15,100	5,300.00	80,030,000
北興化学工業	17,100	999.00	17,082,900
大成ラミック	5,600	2,581.00	14,453,600
クミアイ化学工業	68,400	886.00	60,602,400
日本農薬	32,700	621.00	20,306,700
アキレス	11,800	1,315.00	15,517,000
有沢製作所	26,800	906.00	24,280,800

日東電工	111,100	8,770.00	974,347,000
レック	24,000	865.00	20,760,000
三光合成	21,000	342.00	7,182,000
きもと	28,100	217.00	6,097,700
藤森工業	16,500	3,525.00	58,162,500
前澤化成工業	11,700	1,278.00	14,952,600
未来工業	6,600	1,487.00	9,814,200
ウェーブロックホールディングス	7,000	676.00	4,732,000
J S P	10,800	1,513.00	16,340,400
エフピコ	33,800	2,814.00	95,113,200
天馬	14,400	2,259.00	32,529,600
信越ポリマー	33,000	1,100.00	36,300,000
東リ	45,800	224.00	10,259,200
ニフコ	61,300	2,661.00	163,119,300
バルカー	14,900	2,587.00	38,546,300
ユニ・チャーム	354,200	4,448.00	1,575,481,600
ショーエイコーポレーション	4,900	575.00	2,817,500
協和キリン	215,700	2,700.00	582,390,000
武田薬品工業	1,444,400	3,760.00	5,430,944,000
アステラス製薬	1,593,400	2,053.00	3,271,250,200
住友ファーマ	113,500	1,089.00	123,601,500
塩野義製薬	231,100	6,880.00	1,589,968,000
わかもと製薬	21,900	288.00	6,307,200
日本新薬	48,100	8,910.00	428,571,000
中外製薬	574,800	4,215.00	2,422,782,000
科研製薬	28,800	3,820.00	110,016,000
エーザイ	220,000	5,731.00	1,260,820,000
ロート製薬	94,300	3,330.00	314,019,000
小野薬品工業	422,000	3,220.00	1,358,840,000
久光製薬	48,600	3,420.00	166,212,000
持田製薬	23,200	3,650.00	84,680,000
参天製薬	342,900	1,020.00	349,758,000
扶桑薬品工業	6,500	2,173.00	14,124,500
日本ケミファ	2,200	1,985.00	4,367,000
ツムラ	56,900	3,185.00	181,226,500
日医工	57,000	748.00	42,636,000
キッセイ薬品工業	32,500	2,435.00	79,137,500
生化学工業	32,400	845.00	27,378,000
栄研化学	32,300	1,683.00	54,360,900
日水製薬	6,800	975.00	6,630,000
鳥居薬品	9,900	3,220.00	31,878,000
J C R ファーマ	51,800	2,331.00	120,745,800

東和薬品	26,500	2,645.00	70,092,500
富士製薬工業	11,300	941.00	10,633,300
ゼリア新薬工業	33,300	1,922.00	64,002,600
第一三共	1,444,200	2,896.50	4,183,125,300
キョーリン製薬ホールディングス	36,900	1,770.00	65,313,000
大幸薬品	27,700	595.00	16,481,500
ダイト	12,000	2,617.00	31,404,000
大塚ホールディングス	381,900	4,175.00	1,594,432,500
大正製薬ホールディングス	43,700	4,690.00	204,953,000
ペプチドリーム	96,400	2,002.00	192,992,800
あすか製薬ホールディングス	20,900	1,169.00	24,432,100
サワイグループホールディングス	40,300	4,245.00	171,073,500
日本コークス工業	155,300	144.00	22,363,200
ニチレキ	23,500	1,159.00	27,236,500
ユシロ化学工業	9,500	1,010.00	9,595,000
ビーピー・カストロール	6,600	1,261.00	8,322,600
富士石油	49,100	297.00	14,582,700
MORESCO	6,100	1,195.00	7,289,500
出光興産	203,900	3,525.00	718,747,500
ENEOSホールディングス	2,764,600	458.90	1,268,674,940
コスモエネルギーホールディングス	53,200	3,365.00	179,018,000
横浜ゴム	106,400	1,744.00	185,561,600
TOYO TIRE	96,700	1,477.00	142,825,900
ブリヂストン	529,400	4,739.00	2,508,826,600
住友ゴム工業	165,100	1,139.00	188,048,900
藤倉コンポジット	14,700	715.00	10,510,500
オカモト	10,900	3,905.00	42,564,500
フコク	8,000	932.00	7,456,000
ニッタ	19,000	2,745.00	52,155,000
住友理工	35,600	574.00	20,434,400
三ツ星ベルト	22,300	1,998.00	44,555,400
バンドー化学	29,600	851.00	25,189,600
日東紡績	27,400	2,489.00	68,198,600
A G C	168,700	4,950.00	835,065,000
日本板硝子	88,200	399.00	35,191,800
石塚硝子	3,100	2,009.00	6,227,900
日本山村硝子	7,100	793.00	5,630,300
日本電気硝子	73,900	2,638.00	194,948,200
オハラ	7,300	1,138.00	8,307,400
住友大阪セメント	34,000	4,045.00	137,530,000
太平洋セメント	104,500	2,052.00	214,434,000
日本ヒューム	18,600	673.00	12,517,800

日本コンクリート工業	36,600	305.00	11,163,000
三谷セキサン	8,600	5,380.00	46,268,000
アジアパイルホールディングス	28,500	420.00	11,970,000
東海カーボン	154,100	1,061.00	163,500,100
日本カーボン	9,500	4,180.00	39,710,000
東洋炭素	12,000	2,891.00	34,692,000
ノリタケカンパニーリミテド	10,200	4,115.00	41,973,000
TOTO	131,300	4,405.00	578,376,500
日本碍子	199,100	1,717.00	341,854,700
日本特殊陶業	139,800	1,959.00	273,868,200
MARUWA	6,400	14,390.00	92,096,000
品川リフラクトリーズ	4,300	3,685.00	15,845,500
黒崎播磨	3,100	4,085.00	12,663,500
ヨータイ	11,800	1,333.00	15,729,400
東京窯業	23,700	289.00	6,849,300
ニッカトー	8,500	494.00	4,199,000
フジインコーポレーテッド	14,800	5,670.00	83,916,000
クニミネ工業	5,900	1,024.00	6,041,600
エーアンドエーマテリアル	3,100	856.00	2,653,600
ニチアス	42,600	2,347.00	99,982,200
ニチハ	25,600	2,339.00	59,878,400
日本製鉄	813,400	2,158.00	1,755,317,200
神戸製鋼所	339,300	585.00	198,490,500
中山製鋼所	28,900	430.00	12,427,000
合同製鐵	9,800	1,333.00	13,063,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	490,800	1,690.00	829,452,000
東京製鐵	62,000	1,213.00	75,206,000
共英製鋼	20,500	1,364.00	27,962,000
大和工業	34,800	3,770.00	131,196,000
東京鐵鋼	8,100	1,307.00	10,586,700
大阪製鐵	9,700	1,541.00	14,947,700
淀川製鋼所	23,900	2,689.00	64,267,100
丸一鋼管	57,500	2,835.00	163,012,500
モリ工業	5,400	2,498.00	13,489,200
大同特殊鋼	29,800	3,565.00	106,237,000
日本高周波鋼業	6,900	330.00	2,277,000
日本冶金工業	13,300	2,649.00	35,231,700
山陽特殊製鋼	18,700	2,115.00	39,550,500
愛知製鋼	10,200	2,340.00	23,868,000
日立金属	195,800	2,007.00	392,970,600
日本金属	4,600	1,331.00	6,122,600
大平洋金属	11,200	3,975.00	44,520,000



新日本電工	117,500	323.00	37,952,500
栗本鐵工所	8,300	1,585.00	13,155,500
虹技	2,600	946.00	2,459,600
三菱製鋼	11,700	1,086.00	12,706,200
日亜鋼業	23,900	266.00	6,357,400
日本精線	3,000	4,270.00	12,810,000
エンビプロ・ホールディングス	12,000	1,018.00	12,216,000
シンニッタン	22,300	218.00	4,861,400
新家工業	4,500	1,585.00	7,132,500
大紀アルミニウム工業所	27,500	1,576.00	43,340,000
日本軽金属ホールディングス	46,100	1,700.00	78,370,000
三井金属鉱業	49,100	3,465.00	170,131,500
東邦亜鉛	10,100	3,050.00	30,805,000
三菱マテリアル	120,100	2,142.00	257,254,200
住友金属鉱山	232,300	6,568.00	1,525,746,400
DOWAホールディングス	49,500	6,130.00	303,435,000
古河機械金属	30,100	1,281.00	38,558,100
大阪チタニウムテクノロジーズ	21,100	1,463.00	30,869,300
東邦チタニウム	32,600	1,589.00	51,801,400
UACJ	27,600	2,288.00	63,148,800
CKサンエツ	3,800	4,110.00	15,618,000
古河電気工業	56,500	2,130.00	120,345,000
住友電気工業	679,600	1,417.50	963,333,000
フジクラ	202,800	567.00	114,987,600
昭和電線ホールディングス	15,900	1,710.00	27,189,000
東京特殊電線	2,800	2,703.00	7,568,400
タツタ電線	32,300	464.00	14,987,200
カナレ電気	2,800	1,618.00	4,530,400
平河ヒューテック	10,200	1,106.00	11,281,200
リョービ	22,500	1,065.00	23,962,500
アーレスティ	19,700	371.00	7,308,700
アサヒホールディングス	72,800	2,286.00	166,420,800
稲葉製作所	10,200	1,281.00	13,066,200
宮地エンジニアリンググループ	5,500	3,450.00	18,975,000
トーカロ	46,900	1,287.00	60,360,300
アルファC o	7,000	962.00	6,734,000
SUMCO	279,700	1,907.00	533,387,900
川田テクノロジーズ	3,700	3,530.00	13,061,000
RS Technologies	5,900	5,990.00	35,341,000
ジェイテックコーポレーション	2,300	1,750.00	4,025,000
信和	11,300	783.00	8,847,900
東洋製罐グループホールディングス	115,700	1,394.00	161,285,800

ホッカホールディングス	10,000	1,258.00	12,580,000	
コロナ	10,000	843.00	8,430,000	
横河ブリッジホールディングス	31,200	1,858.00	57,969,600	
駒井ハルテック	3,400	1,964.00	6,677,600	
高田機工	1,700	2,811.00	4,778,700	
三和ホールディングス	171,300	1,173.00	200,934,900	
文化シャッター	57,700	947.00	54,641,900	
三協立山	23,400	592.00	13,852,800	
アルインコ	13,200	857.00	11,312,400	
東洋シャッター	4,000	548.00	2,192,000	
LIXIL	286,000	2,151.00	615,186,000	
日本フィルコン	12,600	509.00	6,413,400	
ノーリツ	34,800	1,477.00	51,399,600	
長府製作所	18,500	1,898.00	35,113,000	
リンナイ	34,200	8,000.00	273,600,000	
ダイニチ工業	8,700	644.00	5,602,800	
日東精工	22,800	496.00	11,308,800	
三洋工業	2,200	1,830.00	4,026,000	
岡部	34,700	664.00	23,040,800	
ジーテクト	22,600	1,276.00	28,837,600	
東プレ	33,900	1,095.00	37,120,500	
高周波熱錬	32,500	578.00	18,785,000	
東京製綱	11,100	874.00	9,701,400	
サンコール	15,500	498.00	7,719,000	
モリテック スチール	14,200	321.00	4,558,200	
パイオラックス	26,100	1,520.00	39,672,000	
エイチワン	17,800	596.00	10,608,800	
日本発條	167,100	845.00	141,199,500	
中央発條	8,700	699.00	6,081,300	
アドバネクス	2,400	1,646.00	3,950,400	
立川ブラインド工業	8,000	1,090.00	8,720,000	
三益半導体工業	14,200	2,303.00	32,702,600	
日本ドライケミカル	4,600	1,641.00	7,548,600	
日本製鋼所	55,200	3,685.00	203,412,000	
三浦工業	78,700	2,696.00	212,175,200	
タクマ	61,700	1,372.00	84,652,400	
ツガミ	40,100	1,212.00	48,601,200	
オークマ	21,200	4,685.00	99,322,000	
芝浦機械	20,600	3,110.00	64,066,000	
アマダ	287,100	1,006.00	288,822,600	
アイダエンジニアリング	47,800	987.00	47,178,600	
滝澤鉄工所	5,300	1,188.00	6,296,400	

F U J I	83,800	2,133.00	178,745,400
牧野フライス製作所	20,000	3,895.00	77,900,000
オーエスジー	84,200	1,638.00	137,919,600
ダイジェット工業	2,300	947.00	2,178,100
旭ダイヤモンド工業	48,100	580.00	27,898,000
D M G 森精機	108,000	1,614.00	174,312,000
ソディック	40,000	726.00	29,040,000
ディスコ	26,800	30,050.00	805,340,000
日東工器	10,000	1,488.00	14,880,000
日進工具	14,400	1,432.00	20,620,800
パンチ工業	15,400	485.00	7,469,000
富士ダイス	9,300	639.00	5,942,700
豊和工業	9,600	800.00	7,680,000
O K K	6,500	1,004.00	6,526,000
東洋機械金属	12,000	577.00	6,924,000
津田駒工業	3,500	607.00	2,124,500
エンシュウ	4,400	675.00	2,970,000
島精機製作所	26,700	1,901.00	50,756,700
オプトラン	22,800	1,971.00	44,938,800
N C ホールディングス	5,200	1,601.00	8,325,200
イワキポンプ	11,600	1,080.00	12,528,000
フリー	16,200	1,085.00	17,577,000
ヤマシンフィルタ	36,900	359.00	13,247,100
日阪製作所	22,500	766.00	17,235,000
やまびこ	35,300	1,402.00	49,490,600
野村マイクロ・サイエンス	4,800	3,730.00	17,904,000
平田機工	8,600	4,845.00	41,667,000
ペガサスミシン製造	18,600	645.00	11,997,000
マルマエ	7,500	2,203.00	16,522,500
タツモ	8,500	1,506.00	12,801,000
ナプテスコ	103,700	3,130.00	324,581,000
三井海洋開発	19,400	1,250.00	24,250,000
レオン自動機	19,500	1,051.00	20,494,500
S M C	53,800	65,140.00	3,504,532,000
ホソカワミクロン	12,800	2,493.00	31,910,400
ユニオンツール	6,800	3,680.00	25,024,000
オイレス工業	25,500	1,494.00	38,097,000
日精エー・エス・ビー機械	6,200	2,963.00	18,370,600
サトーホールディングス	24,000	1,711.00	41,064,000
技研製作所	16,100	3,530.00	56,833,000
日本エアテック	8,400	1,047.00	8,794,800
カワタ	5,900	992.00	5,852,800

日精樹脂工業	13,000	958.00	12,454,000
オカダアイヨン	5,800	1,593.00	9,239,400
ワイエイシイホールディングス	7,200	1,563.00	11,253,600
小松製作所	833,000	3,029.00	2,523,157,000
住友重機械工業	105,300	2,762.00	290,838,600
日立建機	73,700	3,250.00	239,525,000
日工	25,500	607.00	15,478,500
巴工業	7,300	2,300.00	16,790,000
井関農機	17,300	1,245.00	21,538,500
TOWA	15,700	2,090.00	32,813,000
丸山製作所	3,900	1,528.00	5,959,200
北川鉄工所	8,500	1,281.00	10,888,500
ローツェ	9,100	12,140.00	110,474,000
タカキタ	6,600	596.00	3,933,600
クボタ	890,400	2,273.00	2,023,879,200
荏原実業	8,500	2,349.00	19,966,500
三菱化工機	6,000	1,943.00	11,658,000
月島機械	34,100	1,024.00	34,918,400
帝国電機製作所	12,900	1,585.00	20,446,500
新東工業	40,900	677.00	27,689,300
澁谷工業	16,200	2,341.00	37,924,200
アイチ コーポレーション	26,500	888.00	23,532,000
小森コーポレーション	46,900	708.00	33,205,200
鶴見製作所	14,300	1,881.00	26,898,300
住友精密工業	2,800	2,098.00	5,874,400
日本ギア工業	6,900	262.00	1,807,800
酒井重工業	3,300	3,200.00	10,560,000
荏原製作所	73,500	6,040.00	443,940,000
石井鐵工所	2,700	2,929.00	7,908,300
西島製作所	16,900	1,282.00	21,665,800
北越工業	17,300	841.00	14,549,300
ダイキン工業	234,100	20,245.00	4,739,354,500
オルガノ	5,300	9,030.00	47,859,000
トーヨーカネツ	7,000	2,416.00	16,912,000
栗田工業	99,500	4,295.00	427,352,500
椿本チエイン	24,100	2,950.00	71,095,000
大同工業	8,400	919.00	7,719,600
木村化工機	15,600	826.00	12,885,600
アネスト岩田	28,700	822.00	23,591,400
ダイフク	101,200	8,050.00	814,660,000
サムコ	4,600	2,468.00	11,352,800
加藤製作所	9,000	800.00	7,200,000

油研工業	3,200	1,677.00	5,366,400
タダノ	96,300	927.00	89,270,100
フジテック	68,200	2,930.00	199,826,000
C K D	54,300	1,696.00	92,092,800
キトー	15,700	1,691.00	26,548,700
平和	51,300	1,891.00	97,008,300
理想科学工業	15,200	2,330.00	35,416,000
S A N K Y O	39,700	3,625.00	143,912,500
日本金銭機械	18,800	715.00	13,442,000
マースグループホールディングス	11,700	1,700.00	19,890,000
フクシマガリレイ	12,600	3,755.00	47,313,000
オーイズミ	6,600	444.00	2,930,400
ダイコク電機	8,500	1,237.00	10,514,500
竹内製作所	28,000	2,272.00	63,616,000
アマノ	48,200	2,068.00	99,677,600
J U K I	25,600	903.00	23,116,800
ジャノメ	15,700	685.00	10,754,500
マックス	24,500	1,561.00	38,244,500
グローリー	47,200	2,039.00	96,240,800
新晃工業	17,100	1,592.00	27,223,200
大和冷機工業	26,600	1,080.00	28,728,000
セガサミーホールディングス	182,300	2,283.00	416,190,900
日本ピストンリング	6,800	1,294.00	8,799,200
リケン	7,900	2,392.00	18,896,800
T P R	24,800	1,267.00	31,421,600
ツバキ・ナカシマ	40,400	934.00	37,733,600
ホシザキ	53,700	8,110.00	435,507,000
大豊工業	15,100	660.00	9,966,000
日本精工	346,100	721.00	249,538,100
N T N	394,900	207.00	81,744,300
ジェイテクト	176,400	905.00	159,642,000
不二越	15,700	3,775.00	59,267,500
日本トムソン	50,500	516.00	26,058,000
T H K	103,800	2,616.00	271,540,800
ユーシン精機	14,400	641.00	9,230,400
前澤給装工業	13,900	929.00	12,913,100
イーグル工業	22,800	952.00	21,705,600
前澤工業	12,400	643.00	7,973,200
日本ピラー工業	18,600	2,682.00	49,885,200
キッツ	62,000	656.00	40,672,000
マキタ	223,700	3,792.00	848,270,400
三井E & S ホールディングス	66,400	370.00	24,568,000

日立造船	155,800	691.00	107,657,800
三菱重工業	288,800	4,399.00	1,270,431,200
I H I	114,800	3,090.00	354,732,000
スター精密	27,300	1,448.00	39,530,400
日清紡ホールディングス	112,400	995.00	111,838,000
イビデン	96,600	5,490.00	530,334,000
コニカミノルタ	403,800	505.00	203,919,000
ブラザー工業	224,900	2,245.00	504,900,500
ミネベアミツミ	317,200	2,559.00	811,714,800
日立製作所	883,900	6,009.00	5,311,355,100
東芝	321,200	5,129.00	1,647,434,800
三菱電機	1,837,700	1,394.00	2,561,753,800
富士電機	110,700	5,630.00	623,241,000
東洋電機製造	6,700	956.00	6,405,200
安川電機	197,800	4,555.00	900,979,000
シンフォニアテクノロジー	22,100	1,266.00	27,978,600
明電舎	31,200	2,327.00	72,602,400
オリジン	4,600	1,380.00	6,348,000
山洋電気	8,400	4,520.00	37,968,000
デンヨー	15,700	1,596.00	25,057,200
P H C ホールディングス	21,800	1,842.00	40,155,600
東芝テック	19,700	4,585.00	90,324,500
芝浦メカトロニクス	3,400	7,450.00	25,330,000
マブチモーター	42,900	3,600.00	154,440,000
日本電産	476,400	8,726.00	4,157,066,400
トレックス・セミコンダクター	9,700	2,297.00	22,280,900
東光高岳	11,000	1,490.00	16,390,000
ダイヘン	20,100	3,610.00	72,561,000
ヤーマン	30,900	1,260.00	38,934,000
J V C ケンウッド	156,200	169.00	26,397,800
ミマキエンジニアリング	18,000	688.00	12,384,000
I - P E X	9,300	1,405.00	13,066,500
日新電機	43,100	1,361.00	58,659,100
大崎電気工業	33,700	497.00	16,748,900
オムロン	153,000	7,563.00	1,157,139,000
日東工業	24,100	1,520.00	36,632,000
I D E C	22,700	2,312.00	52,482,400
正興電機製作所	6,700	1,198.00	8,026,600
不二電機工業	4,500	1,071.00	4,819,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	60,300	2,266.00	136,639,800
サクサホールディングス	4,300	1,505.00	6,471,500
メルコホールディングス	4,400	3,935.00	17,314,000

テクノメディカ	4,900	1,521.00	7,452,900
日本電気	233,500	5,100.00	1,190,850,000
富士通	165,400	18,915.00	3,128,541,000
沖電気工業	74,600	849.00	63,335,400
岩崎通信機	7,500	838.00	6,285,000
電気興業	9,600	2,406.00	23,097,600
サンケン電気	17,200	4,835.00	83,162,000
ナカヨ	3,300	1,089.00	3,593,700
アイホン	10,400	1,974.00	20,529,600
ルネサスエレクトロニクス	998,400	1,343.00	1,340,851,200
セイコーエプソン	228,000	1,831.00	417,468,000
ワコム	143,800	968.00	139,198,400
アルバック	36,600	5,180.00	189,588,000
アクセル	8,800	977.00	8,597,600
E I Z O	14,300	3,375.00	48,262,500
日本信号	46,800	898.00	42,026,400
京三製作所	39,400	423.00	16,666,200
能美防災	24,900	1,884.00	46,911,600
ホーチキ	14,100	1,181.00	16,652,100
星和電機	10,400	519.00	5,397,600
エレコム	42,900	1,516.00	65,036,400
パナソニック ホールディングス	1,960,100	1,140.50	2,235,494,050
シャープ	209,500	1,118.00	234,221,000
アンリツ	118,400	1,608.00	190,387,200
富士通ゼネラル	49,900	2,259.00	112,724,100
ソニーグループ	1,151,200	11,430.00	13,158,216,000
T D K	266,400	4,070.00	1,084,248,000
帝国通信工業	8,900	1,429.00	12,718,100
タムラ製作所	70,800	564.00	39,931,200
アルプスアルパイン	163,600	1,227.00	200,737,200
池上通信機	5,400	602.00	3,250,800
日本電波工業	17,500	1,215.00	21,262,500
鈴木	10,500	732.00	7,686,000
メイコー	15,200	3,590.00	54,568,000
日本トリム	3,900	2,433.00	9,488,700
ローランド ディー・ジー	11,200	3,370.00	37,744,000
フォスター電機	18,500	690.00	12,765,000
S M K	4,300	2,198.00	9,451,400
ヨコオ	14,100	2,440.00	34,404,000
ホシデン	45,300	1,225.00	55,492,500
ヒロセ電機	28,300	16,250.00	459,875,000
日本航空電子工業	42,100	1,968.00	82,852,800

TOA	19,700	682.00	13,435,400
マクセル	37,500	1,163.00	43,612,500
古野電気	23,000	941.00	21,643,000
ユニデンホールディングス	4,000	3,520.00	14,080,000
スミダコーポレーション	18,500	833.00	15,410,500
アイコム	6,800	2,353.00	16,000,400
リオン	7,500	2,365.00	17,737,500
本多通信工業	16,700	461.00	7,698,700
横河電機	183,900	2,130.00	391,707,000
新電元工業	7,100	2,971.00	21,094,100
アズビル	107,700	3,890.00	418,953,000
東亜ディーケーケー	10,300	923.00	9,506,900
日本光電工業	76,300	3,025.00	230,807,500
チノー	5,800	1,573.00	9,123,400
共和電業	17,600	361.00	6,353,600
日本電子材料	9,300	1,987.00	18,479,100
堀場製作所	34,000	5,920.00	201,280,000
アドバンテスト	136,600	8,440.00	1,152,904,000
小野測器	10,100	507.00	5,120,700
エスペック	15,500	1,717.00	26,613,500
キーエンス	166,500	53,590.00	8,922,735,000
日置電機	9,000	7,780.00	70,020,000
シスメックス	155,600	8,953.00	1,393,086,800
日本マイクロニクス	32,700	1,514.00	49,507,800
メガチップス	17,000	3,445.00	58,565,000
OBARA GROUP	8,700	2,883.00	25,082,100
澤藤電機	3,000	1,496.00	4,488,000
原田工業	9,900	889.00	8,801,100
コーセル	21,800	758.00	16,524,400
イリソ電子工業	15,800	3,005.00	47,479,000
オブテックスグループ	30,800	1,750.00	53,900,000
千代田インテグレ	8,300	2,160.00	17,928,000
レーザーテック	80,700	18,090.00	1,459,863,000
スタンレー電気	128,800	2,184.00	281,299,200
岩崎電気	7,200	2,312.00	16,646,400
ウシオ電機	94,800	1,687.00	159,927,600
岡谷電機産業	16,900	278.00	4,698,200
ヘリオス テクノ ホールディング	19,500	291.00	5,674,500
エノモト	5,800	1,522.00	8,827,600
日本セラミック	17,600	2,363.00	41,588,800
遠藤照明	9,600	925.00	8,880,000
古河電池	14,000	1,228.00	17,192,000



双信電機	10,700	600.00	6,420,000
山一電機	13,900	1,666.00	23,157,400
図研	12,300	2,875.00	35,362,500
日本電子	38,400	5,680.00	218,112,000
カシオ計算機	133,000	1,350.00	179,550,000
ファナック	161,300	21,000.00	3,387,300,000
日本シイエムケイ	37,900	541.00	20,503,900
エンプラス	4,900	2,823.00	13,832,700
大真空	25,800	1,164.00	30,031,200
ローム	82,400	8,920.00	735,008,000
浜松ホトニクス	132,000	5,860.00	773,520,000
三井ハイテック	18,100	11,740.00	212,494,000
新光電気工業	54,200	5,620.00	304,604,000
京セラ	258,700	6,835.00	1,768,214,500
太陽誘電	89,400	5,080.00	454,152,000
村田製作所	540,000	7,787.00	4,204,980,000
双葉電子工業	33,200	656.00	21,779,200
北陸電気工業	7,800	1,127.00	8,790,600
ニチコン	58,900	1,147.00	67,558,300
日本ケミコン	18,000	1,845.00	33,210,000
K O A	28,500	1,356.00	38,646,000
市光工業	24,900	378.00	9,412,200
小糸製作所	101,100	4,750.00	480,225,000
ミツバ	33,800	353.00	11,931,400
S C R E E Nホールディングス	31,900	10,430.00	332,717,000
キャノン電子	17,600	1,584.00	27,878,400
キャノン	913,200	3,114.00	2,843,704,800
リコー	510,000	994.00	506,940,000
象印マホービン	50,500	1,362.00	68,781,000
M U T O Hホールディングス	2,900	2,077.00	6,023,300
東京エレクトロン	116,600	54,730.00	6,381,518,000
トヨタ紡織	75,000	1,943.00	145,725,000
芦森工業	3,500	910.00	3,185,000
ユニプレス	27,400	758.00	20,769,200
豊田自動織機	148,700	7,900.00	1,174,730,000
モリタホールディングス	29,400	1,214.00	35,691,600
三櫻工業	25,400	719.00	18,262,600
デンソー	404,600	7,538.00	3,049,874,800
東海理化電機製作所	48,400	1,464.00	70,857,600
川崎重工業	134,100	2,391.00	320,633,100
名村造船所	55,200	430.00	23,736,000
日本車輛製造	6,700	2,142.00	14,351,400

三菱ロジスネクスト	24,300	777.00	18,881,100
近畿車輛	2,800	1,171.00	3,278,800
日産自動車	2,167,400	550.80	1,193,803,920
いすゞ自動車	576,700	1,581.00	911,762,700
トヨタ自動車	9,308,800	2,258.50	21,023,924,800
日野自動車	229,500	693.00	159,043,500
三菱自動車工業	680,200	335.00	227,867,000
エフテック	12,800	542.00	6,937,600
レシップホールディングス	7,300	567.00	4,139,100
G M B	3,300	721.00	2,379,300
ファルテック	3,200	645.00	2,064,000
武蔵精密工業	41,000	1,346.00	55,186,000
日産車体	26,900	532.00	14,310,800
新明和工業	51,900	902.00	46,813,800
極東開発工業	34,100	1,285.00	43,818,500
トピー工業	15,100	1,044.00	15,764,400
ティラド	5,300	2,318.00	12,285,400
曙ブレーキ工業	100,900	156.00	15,740,400
タチエス	32,200	1,000.00	32,200,000
N O K	88,900	1,099.00	97,701,100
フタバ産業	46,000	337.00	15,502,000
K Y B	19,100	2,869.00	54,797,900
大同メタル工業	35,200	565.00	19,888,000
プレス工業	91,100	378.00	34,435,800
ミクニ	23,300	391.00	9,110,300
太平洋工業	38,500	915.00	35,227,500
河西工業	22,500	280.00	6,300,000
アイシン	134,500	3,965.00	533,292,500
マツダ	576,800	954.00	550,267,200
今仙電機製作所	12,100	604.00	7,308,400
本田技研工業	1,447,000	3,433.00	4,967,551,000
スズキ	420,300	4,126.00	1,734,157,800
S U B A R U	526,600	1,936.00	1,019,497,600
安永	8,900	741.00	6,594,900
ヤマハ発動機	239,800	2,733.00	655,373,400
T B K	20,100	351.00	7,055,100
エクセディ	27,700	1,544.00	42,768,800
豊田合成	59,400	1,851.00	109,949,400
愛三工業	28,800	686.00	19,756,800
盟和産業	2,600	1,017.00	2,644,200
日本プラスト	14,400	498.00	7,171,200
ヨロズ	17,200	806.00	13,863,200

エフ・シー・シー	30,000	1,297.00	38,910,000
シマノ	73,500	25,495.00	1,873,882,500
テイ・エス テック	77,600	1,347.00	104,527,200
ジャムコ	10,700	842.00	9,009,400
テルモ	520,000	3,923.00	2,039,960,000
クリエートメディック	5,500	999.00	5,494,500
日機装	55,100	810.00	44,631,000
日本エム・ディ・エム	10,600	1,643.00	17,415,800
島津製作所	236,500	4,115.00	973,197,500
JMS	15,600	593.00	9,250,800
長野計器	13,300	1,122.00	14,922,600
ブイ・テクノロジー	8,000	3,010.00	24,080,000
東京計器	11,700	1,193.00	13,958,100
愛知時計電機	7,900	1,543.00	12,189,700
インターアクション	9,200	1,914.00	17,608,800
オーバル	16,500	311.00	5,131,500
東京精密	31,100	4,395.00	136,684,500
マニー	73,200	1,498.00	109,653,600
ニコン	280,700	1,480.00	415,436,000
トプコン	86,400	1,699.00	146,793,600
オリンパス	963,700	2,393.50	2,306,615,950
理研計器	14,900	4,325.00	64,442,500
タムロン	14,300	2,296.00	32,832,800
HOYA	358,600	13,025.00	4,670,765,000
シード	8,600	493.00	4,239,800
ノーリツ鋼機	16,500	2,242.00	36,993,000
A & Dホロンホールディングス	20,700	886.00	18,340,200
朝日インテック	201,500	2,699.00	543,848,500
シチズン時計	215,300	499.00	107,434,700
リズム	5,800	1,432.00	8,305,600
大研医器	14,600	519.00	7,577,400
メニコン	61,000	2,804.00	171,044,000
シンシア	2,000	468.00	936,000
松風	7,700	1,560.00	12,012,000
セイコーホールディングス	26,000	2,198.00	57,148,000
ニプロ	137,000	1,023.00	140,151,000
中本パックス	5,100	1,510.00	7,701,000
スノーピーク	23,900	2,714.00	64,864,600
パラマウントベッドホールディングス	35,200	2,067.00	72,758,400
トランザクション	10,100	1,079.00	10,897,900
粧美堂	5,400	417.00	2,251,800
ニホンフラッシュ	15,700	966.00	15,166,200

前田工織	20,200	2,888.00	58,337,600
永大産業	24,000	289.00	6,936,000
アートネイチャー	15,700	720.00	11,304,000
バンダイナムコホールディングス	164,700	9,008.00	1,483,617,600
アイフィスジャパン	4,700	657.00	3,087,900
共立印刷	30,800	139.00	4,281,200
SHOEI	17,200	4,765.00	81,958,000
フランスベッドホールディングス	23,600	865.00	20,414,000
パイロットコーポレーション	31,000	5,140.00	159,340,000
萩原工業	11,900	1,058.00	12,590,200
フジシールインターナショナル	44,600	1,670.00	74,482,000
タカラトミー	75,900	1,244.00	94,419,600
広済堂ホールディングス	11,400	804.00	9,165,600
エステールホールディングス	4,400	642.00	2,824,800
タカノ	6,300	760.00	4,788,000
プロネクサス	14,200	1,044.00	14,824,800
ホクシン	13,000	208.00	2,704,000
ウッドワン	5,600	1,440.00	8,064,000
大建工業	10,800	2,120.00	22,896,000
凸版印刷	279,300	2,128.00	594,350,400
大日本印刷	217,200	2,665.00	578,838,000
共同印刷	5,300	2,686.00	14,235,800
NISSHA	37,700	1,442.00	54,363,400
光村印刷	1,600	1,327.00	2,123,200
TAKARA & COMPANY	11,300	1,838.00	20,769,400
アシックス	162,500	2,175.00	353,437,500
ツツミ	4,600	1,865.00	8,579,000
ローランド	12,800	4,210.00	53,888,000
小松ウオール工業	5,600	1,820.00	10,192,000
ヤマハ	106,900	5,120.00	547,328,000
河合楽器製作所	5,100	2,934.00	14,963,400
クリナップ	17,100	521.00	8,909,100
ピジョン	111,100	2,083.00	231,421,300
兼松サステック	1,200	1,734.00	2,080,800
キングジム	16,200	933.00	15,114,600
リンテック	39,400	2,429.00	95,702,600
イトーキ	33,900	349.00	11,831,100
任天堂	103,700	64,260.00	6,663,762,000
三菱鉛筆	30,300	1,259.00	38,147,700
タカラスタンダード	38,000	1,292.00	49,096,000
コクヨ	88,100	1,667.00	146,862,700
ナカバヤシ	16,400	489.00	8,019,600

グローブライド	16,400	2,662.00	43,656,800
オカムラ	63,200	1,170.00	73,944,000
美津濃	18,200	2,099.00	38,201,800
東京電力ホールディングス	1,375,400	489.00	672,570,600
中部電力	562,200	1,322.00	743,228,400
関西電力	696,300	1,219.00	848,789,700
中国電力	287,200	882.00	253,310,400
北陸電力	168,000	554.00	93,072,000
東北電力	430,400	741.00	318,926,400
四国電力	165,500	789.00	130,579,500
九州電力	378,800	843.00	319,328,400
北海道電力	159,700	505.00	80,648,500
沖縄電力	39,000	1,301.00	50,739,000
電源開発	156,700	1,820.00	285,194,000
エフオン	11,100	565.00	6,271,500
イーレックス	27,100	1,990.00	53,929,000
レノバ	36,000	1,530.00	55,080,000
東京瓦斯	352,300	2,320.00	817,336,000
大阪瓦斯	332,800	2,142.00	712,857,600
東邦瓦斯	84,100	2,575.00	216,557,500
北海道瓦斯	9,100	1,478.00	13,449,800
広島ガス	35,000	319.00	11,165,000
西部ガスホールディングス	20,700	1,931.00	39,971,700
静岡ガス	47,800	882.00	42,159,600
メタウォーター	19,100	1,971.00	37,646,100
SBSホールディングス	13,600	3,050.00	41,480,000
東武鉄道	179,600	3,005.00	539,698,000
相鉄ホールディングス	58,800	2,297.00	135,063,600
東急	463,500	1,633.00	756,895,500
京浜急行電鉄	236,000	1,340.00	316,240,000
小田急電鉄	273,300	2,061.00	563,271,300
京王電鉄	95,400	5,020.00	478,908,000
京成電鉄	127,900	3,385.00	432,941,500
富士急行	21,900	4,160.00	91,104,000
新京成電鉄	4,200	2,132.00	8,954,400
東日本旅客鉄道	323,500	7,039.00	2,277,116,500
西日本旅客鉄道	222,800	5,013.00	1,116,896,400
東海旅客鉄道	152,800	16,175.00	2,471,540,000
西武ホールディングス	239,900	1,328.00	318,587,200
鴻池運輸	29,200	1,096.00	32,003,200
西日本鉄道	50,900	2,630.00	133,867,000
ハマキョウレックス	13,000	2,828.00	36,764,000

サカイ引越センター	8,500	4,295.00	36,507,500
近鉄グループホールディングス	174,100	3,770.00	656,357,000
阪急阪神ホールディングス	217,600	3,495.00	760,512,000
南海電気鉄道	77,600	2,385.00	185,076,000
京阪ホールディングス	77,500	2,805.00	217,387,500
神戸電鉄	4,100	3,250.00	13,325,000
名古屋鉄道	143,100	2,148.00	307,378,800
山陽電気鉄道	13,400	2,040.00	27,336,000
アルプス物流	12,100	1,023.00	12,378,300
ヤマトホールディングス	243,900	2,382.00	580,969,800
山九	45,800	3,790.00	173,582,000
丸運	9,900	240.00	2,376,000
丸全昭和運輸	14,100	3,090.00	43,569,000
センコーグループホールディングス	87,300	853.00	74,466,900
トナミホールディングス	4,200	3,595.00	15,099,000
ニッコンホールディングス	58,400	1,894.00	110,609,600
日本石油輸送	1,900	2,567.00	4,877,300
福山通運	28,600	3,450.00	98,670,000
セイノーホールディングス	118,500	1,015.00	120,277,500
エスライン	5,200	895.00	4,654,000
神奈川中央交通	4,300	3,310.00	14,233,000
日立物流	33,600	6,730.00	226,128,000
丸和運輸機関	36,800	1,396.00	51,372,800
C & F ロジホールディングス	17,600	1,077.00	18,955,200
九州旅客鉄道	134,600	2,573.00	346,325,800
S Gホールディングス	328,800	2,148.00	706,262,400
NIPPON EXPRESSホールディングス	60,300	7,500.00	452,250,000
日本郵船	145,900	9,890.00	1,442,951,000
商船三井	290,100	3,235.00	938,473,500
川崎汽船	53,600	7,480.00	400,928,000
NSユナイテッド海運	10,400	4,005.00	41,652,000
飯野海運	85,000	782.00	66,470,000
共栄タンカー	6,200	1,117.00	6,925,400
乾汽船	11,900	1,697.00	20,194,300
日本航空	399,100	2,200.00	878,020,000
ANAホールディングス	442,100	2,485.00	1,098,618,500
パスコ	3,300	1,396.00	4,606,800
ランコム	4,900	6,930.00	33,957,000
日新	13,900	1,551.00	21,558,900
三菱倉庫	55,200	2,988.00	164,937,600
三井倉庫ホールディングス	18,500	2,415.00	44,677,500
住友倉庫	61,500	2,169.00	133,393,500

澁澤倉庫	10,400	2,227.00	23,160,800
東陽倉庫	29,200	309.00	9,022,800
日本トランスシティ	38,300	573.00	21,945,900
ケイヒン	3,000	1,362.00	4,086,000
中央倉庫	10,600	948.00	10,048,800
川西倉庫	3,200	1,138.00	3,641,600
安田倉庫	14,300	972.00	13,899,600
ファイブホールディングス	3,700	673.00	2,490,100
東洋埠頭	5,300	1,465.00	7,764,500
上組	95,700	2,162.00	206,903,400
サンリツ	4,800	780.00	3,744,000
キムラユニティー	4,500	1,323.00	5,953,500
キューソー流通システム	8,700	1,032.00	8,978,400
近鉄エクスプレス	32,900	3,125.00	102,812,500
東海運	9,900	295.00	2,920,500
エーアイティー	10,900	1,508.00	16,437,200
内外トランスライン	6,700	1,799.00	12,053,300
日本コンセプト	5,500	1,384.00	7,612,000
NEC ネットズエスアイ	59,800	1,679.00	100,404,200
クロスキャット	9,600	1,002.00	9,619,200
システナ	257,700	414.00	106,687,800
デジタルアーツ	9,700	7,550.00	73,235,000
日鉄ソリューションズ	26,200	3,790.00	99,298,000
キューブシステム	9,300	893.00	8,304,900
WOW WORLD	2,700	1,106.00	2,986,200
コア	7,700	1,564.00	12,042,800
手間いらず	2,700	4,670.00	12,609,000
ラクーンホールディングス	15,500	1,310.00	20,305,000
ソリトンシステムズ	9,100	1,491.00	13,568,100
ソフトクリエイティブホールディングス	7,900	4,390.00	34,681,000
T I S	172,000	2,797.00	481,084,000
J N S ホールディングス	8,300	397.00	3,295,100
グリー	82,200	1,253.00	102,996,600
G M O ペパボ	2,000	2,098.00	4,196,000
コーエーテクモホールディングス	57,600	3,940.00	226,944,000
三菱総合研究所	7,800	3,895.00	30,381,000
電算	2,100	2,232.00	4,687,200
A G S	9,400	780.00	7,332,000
ファインデックス	15,500	672.00	10,416,000
ブレインパッド	15,400	1,184.00	18,233,600
K L a b	33,100	438.00	14,497,800
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	26,300	1,030.00	27,089,000

ネクソン	407,200	2,944.00	1,198,796,800
アイスタイル	47,600	169.00	8,044,400
エムアップホールディングス	21,000	994.00	20,874,000
エイチーム	12,700	758.00	9,626,600
エニグモ	19,800	554.00	10,969,200
テクノスジャパン	14,400	440.00	6,336,000
コロプラ	59,600	648.00	38,620,800
ブロードリーフ	89,900	362.00	32,543,800
クロス・マーケティンググループ	7,000	927.00	6,489,000
デジタルハーツホールディングス	8,300	1,702.00	14,126,600
システム情報	13,700	946.00	12,960,200
メディアドゥ	6,400	1,927.00	12,332,800
じげん	51,600	306.00	15,789,600
ブイキューブ	18,500	966.00	17,871,000
エンカレッジ・テクノロジー	4,300	533.00	2,291,900
サイバーリンクス	6,200	1,119.00	6,937,800
フィックスターズ	19,400	847.00	16,431,800
CARTA HOLDINGS	7,400	2,396.00	17,730,400
オブティム	12,800	944.00	12,083,200
セレス	6,900	1,472.00	10,156,800
SHIFT	9,100	24,740.00	225,134,000
ティーガイア	16,100	1,640.00	26,404,000
セック	2,700	2,189.00	5,910,300
テクマトリックス	30,600	2,019.00	61,781,400
プロシップ	6,100	1,380.00	8,418,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	46,900	2,710.00	127,099,000
GMOペイメントゲートウェイ	35,000	11,130.00	389,550,000
ザッパラス	7,400	444.00	3,285,600
システムリサーチ	5,400	1,900.00	10,260,000
インターネットイニシアティブ	48,100	4,085.00	196,488,500
さくらインターネット	19,700	544.00	10,716,800
ヴィンクス	5,200	1,141.00	5,933,200
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,000	5,830.00	23,320,000
SRAホールディングス	8,800	2,761.00	24,296,800
システムインテグレータ	6,000	475.00	2,850,000
朝日ネット	16,800	574.00	9,643,200
eBASE	21,900	456.00	9,986,400
アバント	19,500	1,181.00	23,029,500
アドソル日進	6,500	1,536.00	9,984,000
ODKソリューションズ	4,100	577.00	2,365,700
フリービット	9,600	871.00	8,361,600
コムチュア	20,300	2,865.00	58,159,500



サイバーコム	2,900	1,134.00	3,288,600
アステリア	13,200	1,011.00	13,345,200
アイル	10,100	1,434.00	14,483,400
マークラインズ	9,100	2,605.00	23,705,500
メディカル・データ・ビジョン	23,000	1,045.00	24,035,000
g u m i	25,300	552.00	13,965,600
ショーケース	4,300	474.00	2,038,200
モバイルファクトリー	4,300	1,078.00	4,635,400
テラスカイ	6,700	1,416.00	9,487,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,100	1,213.00	9,825,300
P C Iホールディングス	8,200	996.00	8,167,200
パイプドHD	3,400	2,267.00	7,707,800
アイビーシー	3,300	527.00	1,739,100
ネオジャパン	5,300	1,135.00	6,015,500
P R T I M E S	3,900	2,059.00	8,030,100
ラクス	62,100	1,612.00	100,105,200
ランドコンピュータ	4,300	894.00	3,844,200
ダブルスタンダード	5,500	1,887.00	10,378,500
オープンドア	10,800	2,060.00	22,248,000
マイネット	6,500	512.00	3,328,000
アカツキ	8,100	3,085.00	24,988,500
ベネフィットジャパン	1,400	2,130.00	2,982,000
U b i c o mホールディングス	4,800	2,824.00	13,555,200
カナミックネットワーク	19,600	509.00	9,976,400
ノムラシステムコーポレーション	10,100	230.00	2,323,000
チェンジ	33,400	1,853.00	61,890,200
シンクロ・フード	9,900	274.00	2,712,600
オークネット	9,700	1,585.00	15,374,500
キャピタル・アセット・プランニング	3,900	744.00	2,901,600
セグエグループ	5,000	568.00	2,840,000
エイトレッド	2,600	2,201.00	5,722,600
マクロミル	39,300	1,230.00	48,339,000
ビーグリー	4,400	1,363.00	5,997,200
オロ	5,800	1,881.00	10,909,800
ユーザーローカル	5,600	1,711.00	9,581,600
テモナ	4,400	406.00	1,786,400
ニーズウェル	4,400	668.00	2,939,200
マネーフォワード	27,500	5,050.00	138,875,000
サインポスト	5,800	1,005.00	5,829,000
電算システムホールディングス	7,500	2,572.00	19,290,000
ソルクシーズ	15,800	399.00	6,304,200
フェイス	5,000	727.00	3,635,000

プロトコーポレーション	19,300	1,007.00	19,435,100
ハイマックス	4,900	1,254.00	6,144,600
野村総合研究所	348,500	4,060.00	1,414,910,000
サイバネットシステム	13,100	787.00	10,309,700
C Eホールディングス	9,900	479.00	4,742,100
日本システム技術	3,600	2,557.00	9,205,200
インタージホールディングス	20,900	1,627.00	34,004,300
東邦システムサイエンス	5,000	918.00	4,590,000
ソースネクスト	78,900	190.00	14,991,000
インフォコム	19,800	2,138.00	42,332,400
シンプレクス・ホールディングス	21,300	1,779.00	37,892,700
HEROZ	5,300	984.00	5,215,200
ラクスル	19,800	2,870.00	56,826,000
I P S	5,000	2,118.00	10,590,000
F I G	20,200	284.00	5,736,800
システムサポート	6,700	1,046.00	7,008,200
イーソル	11,300	621.00	7,017,300
アルテリア・ネットワークス	23,000	1,302.00	29,946,000
東海ソフト	3,000	952.00	2,856,000
ウイングアーク1st	10,400	1,321.00	13,738,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,200	1,601.00	6,724,200
サーバーワークス	3,100	2,156.00	6,683,600
東名	1,900	787.00	1,495,300
ヴィッツ	1,800	1,315.00	2,367,000
トピラシステムズ	3,900	801.00	3,123,900
S a n s a n	64,300	1,316.00	84,618,800
L i n k - U	3,500	704.00	2,464,000
ギフトィ	16,600	1,092.00	18,127,200
ベース	3,100	5,850.00	18,135,000
J M D C	17,000	6,750.00	114,750,000
フォーカスシステムズ	12,300	897.00	11,033,100
クレスコ	13,200	1,857.00	24,512,400
フジ・メディア・ホールディングス	173,900	1,125.00	195,637,500
オービック	56,800	17,990.00	1,021,832,000
ジャストシステム	25,700	5,240.00	134,668,000
T D C ソフト	15,900	1,139.00	18,110,100
Zホールディングス	2,600,800	520.00	1,352,416,000
トレンドマイクロ	96,400	7,130.00	687,332,000
I Dホールディングス	11,600	821.00	9,523,600
日本オラクル	29,300	8,470.00	248,171,000
アルファシステムズ	4,900	3,700.00	18,130,000
フューチャー	38,200	1,550.00	59,210,000

C A C Holdings	10,700	1,346.00	14,402,200
S Bテクノロジー	7,900	2,468.00	19,497,200
トーセ	5,200	698.00	3,629,600
オービックビジネスコンサルタント	17,300	4,285.00	74,130,500
伊藤忠テクノソリューションズ	82,200	3,020.00	248,244,000
アイティフォー	22,100	791.00	17,481,100
東計電算	2,200	5,570.00	12,254,000
エクスネット	3,000	992.00	2,976,000
大塚商会	97,600	4,155.00	405,528,000
サイボウズ	24,200	1,281.00	31,000,200
電通国際情報サービス	26,100	3,675.00	95,917,500
A C C E S S	20,700	565.00	11,695,500
デジタルガレージ	29,800	4,350.00	129,630,000
E Mシステムズ	30,000	862.00	25,860,000
ウェザーニューズ	6,100	7,580.00	46,238,000
C I J	14,200	769.00	10,919,800
ビジネスエンジニアリング	2,100	3,840.00	8,064,000
日本エンタープライズ	19,500	166.00	3,237,000
WOWOW	8,800	1,505.00	13,244,000
スカラ	15,400	746.00	11,488,400
インテリジェント ウェイブ	9,400	565.00	5,311,000
I M A G I C A GROUP	15,600	714.00	11,138,400
ネットワンシステムズ	68,800	3,065.00	210,872,000
システムソフト	40,500	100.00	4,050,000
アルゴグラフィックス	14,100	2,956.00	41,679,600
マーベラス	28,700	748.00	21,467,600
エイベックス	31,200	1,418.00	44,241,600
B I P R O G Y	56,400	3,150.00	177,660,000
兼松エレクトロニクス	9,900	3,825.00	37,867,500
都築電気	9,300	1,474.00	13,708,200
T B Sホールディングス	108,000	1,697.00	183,276,000
日本テレビホールディングス	150,700	1,238.00	186,566,600
朝日放送グループホールディングス	18,200	717.00	13,049,400
テレビ朝日ホールディングス	43,500	1,469.00	63,901,500
スカパーJ S A Tホールディングス	153,200	416.00	63,731,200
テレビ東京ホールディングス	12,800	1,993.00	25,510,400
日本BS放送	6,300	1,013.00	6,381,900
ビジョン	31,000	1,240.00	38,440,000
スマートバリュー	4,500	534.00	2,403,000
U S E N - N E X T HOLDINGS	17,200	2,226.00	38,287,200
ワイヤレスゲート	8,000	307.00	2,456,000
コネクシオ	12,900	1,379.00	17,789,100

クロップス	3,500	965.00	3,377,500
日本電信電話	1,886,600	3,792.00	7,153,987,200
K D D I	1,314,700	4,225.00	5,554,607,500
ソフトバンク	2,731,500	1,493.00	4,078,129,500
光通信	20,800	14,850.00	308,880,000
エムティーアイ	17,900	484.00	8,663,600
G M Oインターネット	63,900	2,549.00	162,881,100
ファイバーゲート	8,400	1,203.00	10,105,200
アйдママーケティングコミュニケーション	4,500	284.00	1,278,000
K A D O K A W A	98,500	3,270.00	322,095,000
学研ホールディングス	25,700	897.00	23,052,900
ゼンリン	29,600	964.00	28,534,400
昭文社ホールディングス	7,700	405.00	3,118,500
インプレスホールディングス	14,900	218.00	3,248,200
アイネット	9,400	1,227.00	11,533,800
松竹	11,900	13,150.00	156,485,000
東宝	106,400	4,800.00	510,720,000
東映	5,900	17,220.00	101,598,000
エヌ・ティ・ティ・データ	480,200	2,372.00	1,139,034,400
ピー・シー・エー	10,700	1,475.00	15,782,500
ビジネスブレイン太田昭和	6,300	1,397.00	8,801,100
D T S	34,600	2,752.00	95,219,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	83,900	5,060.00	424,534,000
シーイーシー	19,500	1,200.00	23,400,000
カブコン	170,100	2,935.00	499,243,500
アイ・エス・ビー	8,600	1,073.00	9,227,800
ジャステック	10,600	1,115.00	11,819,000
S C S K	124,900	2,023.00	252,672,700
日本システムウエア	6,900	2,259.00	15,587,100
アイネス	16,500	1,471.00	24,271,500
T K C	30,600	3,275.00	100,215,000
富士ソフト	19,300	6,790.00	131,047,000
N S D	58,000	2,261.00	131,138,000
コナミホールディングス	65,500	8,070.00	528,585,000
福井コンピュータホールディングス	8,300	3,105.00	25,771,500
J B C Cホールディングス	12,300	1,476.00	18,154,800
ミロク情報サービス	16,000	1,295.00	20,720,000
ソフトバンクグループ	1,081,400	5,627.00	6,085,037,800
高千穂交易	7,000	1,485.00	10,395,000
オルバヘルスケアホールディングス	3,000	1,680.00	5,040,000
伊藤忠食品	4,400	4,950.00	21,780,000
エレマテック	14,500	1,073.00	15,558,500

あらた	14,400	3,330.00	47,952,000
トーメンデバイス	2,700	5,960.00	16,092,000
東京エレクトロン デバイス	5,400	5,000.00	27,000,000
フィールズ	15,800	887.00	14,014,600
双日	199,900	2,032.00	406,196,800
アルフレッサ ホールディングス	201,200	1,711.00	344,253,200
横浜冷凍	50,800	855.00	43,434,000
ラサ商事	8,900	983.00	8,748,700
アルコニックス	22,500	1,444.00	32,490,000
神戸物産	140,500	3,500.00	491,750,000
ハイパー	4,600	457.00	2,102,200
あい ホールディングス	25,900	1,686.00	43,667,400
ディーブイエックス	6,200	1,013.00	6,280,600
ダイワボウホールディングス	88,000	1,554.00	136,752,000
マクニカ・富士エレホールディングス	43,200	2,649.00	114,436,800
ラクト・ジャパン	6,200	2,003.00	12,418,600
グリムス	8,100	1,780.00	14,418,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	31,500	740.00	23,310,000
八洲電機	13,100	941.00	12,327,100
メディアスホールディングス	10,400	958.00	9,963,200
レスターホールディングス	17,200	2,017.00	34,692,400
ジューテックホールディングス	4,200	1,169.00	4,909,800
大光	7,700	721.00	5,551,700
OCHIホールディングス	5,300	1,247.00	6,609,100
TOKAIホールディングス	87,700	866.00	75,948,200
黒谷	5,000	614.00	3,070,000
Cominix	3,200	708.00	2,265,600
三洋貿易	18,200	983.00	17,890,600
ビューティガレージ	2,900	2,829.00	8,204,100
ウイン・パートナーズ	13,100	998.00	13,073,800
ミタチ産業	4,600	878.00	4,038,800
シップヘルスケアホールディングス	58,000	2,087.00	121,046,000
明治電機工業	6,000	1,035.00	6,210,000
デリカフーズホールディングス	7,100	534.00	3,791,400
スターティアホールディングス	4,100	568.00	2,328,800
コメダホールディングス	39,500	2,213.00	87,413,500
ピーバンドットコム	2,600	550.00	1,430,000
アセンテック	6,200	716.00	4,439,200
富士興産	4,500	876.00	3,942,000
協栄産業	1,800	1,458.00	2,624,400
フルサト・マルカホールディングス	17,400	3,375.00	58,725,000
ヤマエグループホールディングス	12,200	1,037.00	12,651,400

小野建	17,600	1,536.00	27,033,600
南陽	3,700	1,825.00	6,752,500
佐島電機	11,300	1,206.00	13,627,800
エコートレーディング	3,900	576.00	2,246,400
伯東	11,000	2,355.00	25,905,000
コンドーテック	13,600	1,083.00	14,728,800
中山福	9,600	348.00	3,340,800
ナガイレーベン	24,000	1,964.00	47,136,000
三菱食品	17,400	3,075.00	53,505,000
松田産業	13,200	2,369.00	31,270,800
第一興商	34,400	3,435.00	118,164,000
メディカルホールディングス	195,300	2,047.00	399,779,100
S P K	7,200	1,315.00	9,468,000
萩原電気ホールディングス	6,700	1,945.00	13,031,500
アズワン	26,000	6,900.00	179,400,000
スズデン	6,300	2,156.00	13,582,800
尾家産業	4,800	962.00	4,617,600
シモジマ	11,100	926.00	10,278,600
ドウシシャ	17,100	1,489.00	25,461,900
小津産業	4,000	2,013.00	8,052,000
高速	10,800	1,494.00	16,135,200
たけびし	6,800	1,454.00	9,887,200
リックス	4,100	1,613.00	6,613,300
丸文	16,100	681.00	10,964,100
ハピネット	15,100	1,484.00	22,408,400
橋本総業ホールディングス	3,700	1,974.00	7,303,800
日本ライフライン	53,600	1,102.00	59,067,200
タカショー	13,800	701.00	9,673,800
I D O M	54,900	640.00	35,136,000
進和	10,700	2,001.00	21,410,700
エスケイジャパン	4,400	431.00	1,896,400
ダイトロン	7,700	1,870.00	14,399,000
シークス	25,900	1,010.00	26,159,000
田中商事	5,600	618.00	3,460,800
オーハシテクニカ	9,700	1,284.00	12,454,800
白銅	5,800	2,510.00	14,558,000
ダイコー通産	2,200	1,329.00	2,923,800
伊藤忠商事	1,266,000	4,032.00	5,104,512,000
丸紅	1,785,400	1,480.50	2,643,284,700
高島	2,600	2,300.00	5,980,000
長瀬産業	97,800	1,853.00	181,223,400
蝶理	10,100	1,780.00	17,978,000

豊田通商	181,800	4,845.00	880,821,000
三共生興	23,700	536.00	12,703,200
兼松	67,500	1,341.00	90,517,500
ツカモトコーポレーション	3,000	1,290.00	3,870,000
三井物産	1,405,600	3,294.00	4,630,046,400
日本紙パルプ商事	9,400	3,815.00	35,861,000
カメイ	21,500	1,021.00	21,951,500
東都水産	900	4,355.00	3,919,500
OUGホールディングス	2,600	2,678.00	6,962,800
スターゼン	13,400	1,973.00	26,438,200
山善	76,200	939.00	71,551,800
椿本興業	3,700	3,565.00	13,190,500
住友商事	1,142,400	2,114.00	2,415,033,600
内田洋行	7,700	4,720.00	36,344,000
三菱商事	1,356,300	4,529.00	6,142,682,700
第一実業	8,200	3,700.00	30,340,000
キャノンマーケティングジャパン	44,900	2,641.00	118,580,900
西華産業	9,500	1,597.00	15,171,500
佐藤商事	15,000	1,121.00	16,815,000
菱洋エレクトロ	10,700	2,031.00	21,731,700
東京産業	16,400	715.00	11,726,000
ユアサ商事	17,200	2,890.00	49,708,000
神鋼商事	4,100	3,375.00	13,837,500
トルク	9,800	212.00	2,077,600
阪和興業	36,200	3,190.00	115,478,000
正栄食品工業	11,700	3,965.00	46,390,500
カナデン	14,700	953.00	14,009,100
菱電商事	14,300	1,650.00	23,595,000
岩谷産業	43,400	5,020.00	217,868,000
ナイス	6,200	1,905.00	11,811,000
ニチモウ	2,600	2,668.00	6,936,800
極東貿易	5,200	2,119.00	11,018,800
アステナホールディングス	25,600	434.00	11,110,400
三愛オブリ	44,600	957.00	42,682,200
稲畑産業	39,200	2,149.00	84,240,800
G S I クレオス	8,700	1,180.00	10,266,000
明和産業	16,700	901.00	15,046,700
クワザワホールディングス	7,200	517.00	3,722,400
ワキタ	38,600	1,044.00	40,298,400
東邦ホールディングス	58,100	2,088.00	121,312,800
サンゲツ	47,900	1,533.00	73,430,700
ミツウロコグループホールディングス	26,700	999.00	26,673,300

シナネンホールディングス	6,700	3,330.00	22,311,000	
伊藤忠エネクス	40,000	1,052.00	42,080,000	
サンリオ	55,900	2,799.00	156,464,100	
サンワテクノス	11,000	1,296.00	14,256,000	
リョーサン	20,000	2,255.00	45,100,000	
新光商事	27,200	931.00	25,323,200	
トーホー	8,200	1,083.00	8,880,600	
三信電気	8,300	1,522.00	12,632,600	
東陽テクニカ	17,900	1,039.00	18,598,100	
モスフードサービス	23,800	2,921.00	69,519,800	
加賀電子	16,400	3,060.00	50,184,000	
ソーダニッカ	17,800	668.00	11,890,400	
立花エレテック	14,300	1,609.00	23,008,700	
フォーバル	8,000	812.00	6,496,000	
PALTA C	25,400	4,410.00	112,014,000	
三谷産業	21,300	310.00	6,603,000	
西本Wismettacホールディングス	4,100	2,733.00	11,205,300	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,600	2,060.00	3,296,000	
コア商事ホールディングス	11,300	899.00	10,158,700	
国際紙パルプ商事	37,700	297.00	11,196,900	
ヤマタネ	8,400	1,625.00	13,650,000	
丸紅建材リース	1,600	1,718.00	2,748,800	
日鉄物産	12,900	5,400.00	69,660,000	
泉州電業	4,900	5,020.00	24,598,000	
トラスコ中山	37,700	2,078.00	78,340,600	
オートバックスセブン	60,900	1,340.00	81,606,000	
モリト	13,200	751.00	9,913,200	
加藤産業	26,100	3,190.00	83,259,000	
北恵	4,600	900.00	4,140,000	
イノテック	11,000	1,328.00	14,608,000	
イエローハット	31,400	1,568.00	49,235,200	
J Kホールディングス	14,600	1,157.00	16,892,200	
日伝	15,000	2,139.00	32,085,000	
北沢産業	12,400	214.00	2,653,600	
杉本商事	8,500	2,154.00	18,309,000	
因幡電機産業	48,300	2,534.00	122,392,200	
東テク	6,000	2,468.00	14,808,000	
ミスミグループ本社	227,200	3,235.00	734,992,000	
アルテック	12,300	251.00	3,087,300	
タキヒヨー	5,500	1,120.00	6,160,000	
蔵王産業	3,500	1,877.00	6,569,500	
スズケン	70,800	3,835.00	271,518,000	



ジェコス	12,500	786.00	9,825,000
グローセル	21,200	406.00	8,607,200
ローソン	40,100	4,785.00	191,878,500
サンエー	13,800	4,010.00	55,338,000
カワチ薬品	14,200	2,105.00	29,891,000
エービーシー・マート	28,300	5,300.00	149,990,000
ハードオフコーポレーション	8,400	801.00	6,728,400
アスクル	41,100	1,628.00	66,910,800
ゲオホールディングス	24,400	1,268.00	30,939,200
アダストリア	19,700	2,131.00	41,980,700
くら寿司	19,000	3,405.00	64,695,000
キャンドウ	6,800	2,259.00	15,361,200
アイケイ	6,300	505.00	3,181,500
パルグループホールディングス	16,100	1,398.00	22,507,800
エディオン	83,400	1,090.00	90,906,000
サーラコーポレーション	37,200	623.00	23,175,600
ワッツ	9,100	715.00	6,506,500
ハローズ	8,400	3,100.00	26,040,000
フジオフードグループ本社	15,300	1,318.00	20,165,400
あみやき亭	4,400	2,920.00	12,848,000
大黒天物産	5,800	5,010.00	29,058,000
ハニーズホールディングス	16,200	1,057.00	17,123,400
ファーマライズホールディングス	4,800	771.00	3,700,800
アルペン	13,600	1,953.00	26,560,800
ハブ	6,400	528.00	3,379,200
クオールホールディングス	22,500	1,092.00	24,570,000
ジinzホールディングス	12,400	4,675.00	57,970,000
ビックカメラ	107,600	1,095.00	117,822,000
D C Mホールディングス	112,000	1,022.00	114,464,000
Monotaro	229,000	2,473.00	566,317,000
東京一番フーズ	5,100	596.00	3,039,600
きちりホールディングス	4,800	362.00	1,737,600
アーランドサービスホールディングス	13,400	2,202.00	29,506,800
J．フロント リテイリング	216,400	977.00	211,422,800
ドトール・日レスホールディングス	31,400	1,462.00	45,906,800
マツキヨココカラ&カンパニー	111,400	4,095.00	456,183,000
ブロンコビリー	10,500	2,296.00	24,108,000
Z O Z O	124,600	3,125.00	389,375,000
トレジャー・ファクトリー	5,600	1,006.00	5,633,600
物語コーポレーション	9,000	5,340.00	48,060,000
三越伊勢丹ホールディングス	317,200	964.00	305,780,800
Hamee	6,800	1,099.00	7,473,200

マーケットエンタープライズ	1,800	811.00	1,459,800
ウエルシアホールディングス	95,800	2,616.00	250,612,800
クリエイトSDホールディングス	26,800	2,996.00	80,292,800
丸善CHIホールディングス	21,100	381.00	8,039,100
ミサワ	4,200	615.00	2,583,000
ティーライフ	2,700	1,390.00	3,753,000
チムニー	5,500	1,123.00	6,176,500
シュッピン	15,300	1,244.00	19,033,200
オイシックス・ラ・大地	26,100	2,751.00	71,801,100
ネクステージ	36,800	2,062.00	75,881,600
ジョイフル本田	54,600	1,525.00	83,265,000
鳥貴族ホールディングス	6,800	1,783.00	12,124,400
ホットランド	13,800	1,339.00	18,478,200
すかいらーくホールディングス	233,900	1,534.00	358,802,600
SFPホールディングス	8,800	1,413.00	12,434,400
綿半ホールディングス	13,800	1,306.00	18,022,800
ヨシックスホールディングス	3,700	2,150.00	7,955,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	52,900	1,097.00	58,031,300
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,700	1,089.00	10,563,300
B E E N O S	9,300	2,101.00	19,539,300
あさひ	15,200	1,355.00	20,596,000
日本調剤	11,200	1,235.00	13,832,000
コスモス薬品	18,300	12,100.00	221,430,000
トーエル	9,100	915.00	8,326,500
セブン&アイ・ホールディングス	708,100	5,810.00	4,114,061,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	96,400	807.00	77,794,800
ツルハホールディングス	39,500	6,470.00	255,565,000
サンマルクホールディングス	14,500	1,491.00	21,619,500
フェリシモ	4,300	1,123.00	4,828,900
トリドールホールディングス	45,100	2,485.00	112,073,500
T O K Y O B A S E	17,300	371.00	6,418,300
ウイルプラスホールディングス	3,700	918.00	3,396,600
J Mホールディングス	12,400	1,719.00	21,315,600
サツドラホールディングス	8,600	703.00	6,045,800
アレンザホールディングス	14,100	976.00	13,761,600
串カツ田中ホールディングス	5,000	1,763.00	8,815,000
パロックジャパンリミテッド	13,000	789.00	10,257,000
クスリのアオキホールディングス	18,000	5,990.00	107,820,000
力の源ホールディングス	9,300	560.00	5,208,000
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	106,100	3,220.00	341,642,000

メディカルシステムネットワーク	18,100	535.00	9,683,500
はるやまホールディングス	9,100	474.00	4,313,400
ノジマ	29,400	2,565.00	75,411,000
カップ・クリエイト	25,400	1,324.00	33,629,600
ライトオン	13,500	699.00	9,436,500
良品計画	208,500	1,221.00	254,578,500
パリミキホールディングス	23,600	261.00	6,159,600
アドヴァングループ	18,800	801.00	15,058,800
アルビス	6,000	2,228.00	13,368,000
コナカ	21,300	332.00	7,071,600
ハウス オブ ローゼ	2,400	1,647.00	3,952,800
G - 7ホールディングス	20,300	1,612.00	32,723,600
イオン北海道	32,000	995.00	31,840,000
コジマ	31,700	621.00	19,685,700
ヒマラヤ	6,700	936.00	6,271,200
コーナン商事	25,800	3,690.00	95,202,000
エコス	6,800	1,903.00	12,940,400
ワタミ	21,900	933.00	20,432,700
マルシェ	4,400	469.00	2,063,600
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	362,000	1,901.00	688,162,000
西松屋チェーン	39,900	1,463.00	58,373,700
ゼンショーホールディングス	88,500	2,981.00	263,818,500
幸楽苑ホールディングス	11,500	1,240.00	14,260,000
ハークスレイ	8,200	472.00	3,870,400
サイゼリヤ	27,000	2,376.00	64,152,000
V Tホールディングス	68,800	471.00	32,404,800
魚力	5,200	2,120.00	11,024,000
フジ・コーポレーション	9,800	1,190.00	11,662,000
ユナイテッドアローズ	19,100	1,816.00	34,685,600
ハイデイ日高	26,300	1,835.00	48,260,500
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	12,200	198.00	2,415,600
コロワイド	74,400	1,681.00	125,066,400
ピーシーデボコーポレーション	22,000	307.00	6,754,000
壱番屋	12,800	4,720.00	60,416,000
P L A N T	5,100	664.00	3,386,400
スギホールディングス	36,200	5,500.00	199,100,000
薬王堂ホールディングス	9,200	1,849.00	17,010,800
スクロール	28,200	797.00	22,475,400
ヨンドシーホールディングス	16,900	1,698.00	28,696,200
木曽路	24,900	2,049.00	51,020,100
S R Sホールディングス	25,800	799.00	20,614,200

千趣会	33,500	389.00	13,031,500
リテールパートナーズ	22,200	1,204.00	26,728,800
ケーヨー	33,700	889.00	29,959,300
上新電機	20,900	1,901.00	39,730,900
日本瓦斯	88,200	1,551.00	136,798,200
ロイヤルホールディングス	33,600	2,083.00	69,988,800
いなげや	22,600	1,329.00	30,035,400
チヨダ	18,100	711.00	12,869,100
ライフコーポレーション	17,000	3,030.00	51,510,000
リンガーハット	22,300	2,243.00	50,018,900
MrMaxHD	23,200	604.00	14,012,800
AOKIホールディングス	35,600	593.00	21,110,800
オークワ	28,600	841.00	24,052,600
コメリ	28,100	2,533.00	71,177,300
青山商事	37,900	672.00	25,468,800
しまむら	21,100	11,270.00	237,797,000
はせがわ	10,700	270.00	2,889,000
高島屋	132,000	1,184.00	156,288,000
松屋	36,700	725.00	26,607,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	86,000	871.00	74,906,000
近鉄百貨店	7,000	2,511.00	17,577,000
丸井グループ	143,000	2,255.00	322,465,000
アクシアル リテイリング	14,100	3,340.00	47,094,000
イオン	696,600	2,478.00	1,726,174,800
イズミ	32,800	2,741.00	89,904,800
平和堂	33,500	1,894.00	63,449,000
フジ	49,600	2,115.00	104,904,000
ヤオコー	20,600	6,810.00	140,286,000
ゼビオホールディングス	24,900	915.00	22,783,500
ケースホールディングス	167,100	1,231.00	205,700,100
Olympicグループ	9,800	670.00	6,566,000
日産東京販売ホールディングス	28,000	225.00	6,300,000
シルバーライフ	3,900	1,449.00	5,651,100
Genky DrugStores	8,000	3,845.00	30,760,000
ナルミヤ・インターナショナル	4,400	872.00	3,836,800
ブックオフグループホールディングス	10,600	1,021.00	10,822,600
ギフトホールディングス	3,000	2,477.00	7,431,000
アインホールディングス	24,300	5,600.00	136,080,000
元気寿司	5,200	2,488.00	12,937,600
ヤマダホールディングス	662,700	380.00	251,826,000
アーランドサカモト	28,500	1,483.00	42,265,500
ニトリホールディングス	71,800	13,680.00	982,224,000

グルメ杵屋	14,700	1,020.00	14,994,000
愛眼	13,200	198.00	2,613,600
ケーユーホールディングス	9,700	1,100.00	10,670,000
吉野家ホールディングス	63,300	2,393.00	151,476,900
松屋フーズホールディングス	8,800	3,760.00	33,088,000
サガミホールディングス	27,900	1,091.00	30,438,900
関西フードマーケット	13,900	1,346.00	18,709,400
王将フードサービス	12,000	6,000.00	72,000,000
プレナス	20,400	1,900.00	38,760,000
ミニストップ	13,600	1,386.00	18,849,600
アークス	34,700	2,018.00	70,024,600
パローホールディングス	40,200	2,051.00	82,450,200
ベルク	8,100	5,330.00	43,173,000
大庄	10,000	1,020.00	10,200,000
ファーストリテイリング	24,200	64,470.00	1,560,174,000
サンドラッグ	68,200	2,919.00	199,075,800
サックスパー ホールディングス	17,700	488.00	8,637,600
ヤマザワ	4,400	1,544.00	6,793,600
やまや	3,700	2,441.00	9,031,700
ベルーナ	39,300	730.00	28,689,000
島根銀行	5,800	525.00	3,045,000
じもとホールディングス	12,900	604.00	7,791,600
めぶきフィナンシャルグループ	941,800	265.00	249,577,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,700	1,811.00	41,109,700
九州フィナンシャルグループ	370,100	399.00	147,669,900
ゆうちょ銀行	427,900	984.00	421,053,600
富山第一銀行	43,200	318.00	13,737,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,035,200	486.00	503,107,200
西日本フィナンシャルホールディングス	118,400	792.00	93,772,800
三十三フィナンシャルグループ	16,800	1,438.00	24,158,400
第四北越フィナンシャルグループ	29,500	2,570.00	75,815,000
ひろぎんホールディングス	267,300	655.00	175,081,500
おきなわフィナンシャルグループ	16,300	2,254.00	36,740,200
十六フィナンシャルグループ	24,300	2,191.00	53,241,300
北國フィナンシャルホールディングス	16,800	3,450.00	57,960,000
プロクレアホールディングス	19,400	1,767.00	34,279,800
新生銀行	118,200	2,413.00	285,216,600
あおぞら銀行	101,200	2,616.00	264,739,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,367,400	774.40	8,802,914,560
りそなホールディングス	2,054,900	571.70	1,174,786,330
三井住友トラスト・ホールディングス	342,600	4,010.00	1,373,826,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,254,700	3,981.00	4,994,960,700

千葉銀行	604,900	786.00	475,451,400
群馬銀行	340,200	378.00	128,595,600
武蔵野銀行	27,000	1,824.00	49,248,000
千葉興業銀行	42,600	275.00	11,715,000
筑波銀行	70,700	202.00	14,281,400
七十七銀行	56,900	1,619.00	92,121,100
秋田銀行	11,600	1,692.00	19,627,200
山形銀行	20,400	846.00	17,258,400
岩手銀行	11,900	1,943.00	23,121,700
東邦銀行	151,300	207.00	31,319,100
東北銀行	8,700	1,011.00	8,795,700
ふくおかフィナンシャルグループ	152,700	2,468.00	376,863,600
静岡銀行	441,400	868.00	383,135,200
スルガ銀行	158,900	426.00	67,691,400
八十二銀行	408,300	426.00	173,935,800
山梨中央銀行	19,600	989.00	19,384,400
大垣共立銀行	35,800	1,943.00	69,559,400
福井銀行	15,500	1,382.00	21,421,000
清水銀行	7,500	1,580.00	11,850,000
富山銀行	3,300	2,088.00	6,890,400
滋賀銀行	34,100	2,457.00	83,783,700
南都銀行	28,300	2,042.00	57,788,600
百五銀行	174,000	348.00	60,552,000
京都銀行	64,900	5,400.00	350,460,000
紀陽銀行	61,400	1,416.00	86,942,400
ほくほくフィナンシャルグループ	113,100	885.00	100,093,500
山陰合同銀行	107,500	664.00	71,380,000
中国銀行	144,800	971.00	140,600,800
鳥取銀行	5,800	1,200.00	6,960,000
伊予銀行	240,200	638.00	153,247,600
百十四銀行	19,300	1,678.00	32,385,400
四国銀行	27,500	741.00	20,377,500
阿波銀行	27,800	2,186.00	60,770,800
大分銀行	10,400	1,871.00	19,458,400
宮崎銀行	11,300	2,083.00	23,537,900
佐賀銀行	10,300	1,456.00	14,996,800
琉球銀行	39,400	822.00	32,386,800
セブン銀行	538,300	245.00	131,883,500
みずほフィナンシャルグループ	2,318,100	1,609.00	3,729,822,900
高知銀行	6,600	769.00	5,075,400
山口フィナンシャルグループ	211,200	737.00	155,654,400
長野銀行	5,900	1,272.00	7,504,800

名古屋銀行	13,500	2,975.00	40,162,500
北洋銀行	273,200	248.00	67,753,600
愛知銀行	6,600	4,680.00	30,888,000
中京銀行	6,500	1,688.00	10,972,000
大光銀行	6,200	1,342.00	8,320,400
愛媛銀行	25,300	917.00	23,200,100
トマト銀行	6,500	1,035.00	6,727,500
京葉銀行	76,000	506.00	38,456,000
栃木銀行	87,600	240.00	21,024,000
北日本銀行	5,600	1,536.00	8,601,600
東和銀行	31,800	539.00	17,140,200
福島銀行	20,800	225.00	4,680,000
大東銀行	8,700	674.00	5,863,800
トモニホールディングス	140,100	327.00	45,812,700
フィデアホールディングス	16,600	1,309.00	21,729,400
池田泉州ホールディングス	208,400	177.00	36,886,800
F P G	61,200	793.00	48,531,600
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,200	1,222.00	17,352,400
マーキュリアホールディングス	7,600	590.00	4,484,000
S B Iホールディングス	223,700	2,904.00	649,624,800
ジャフコ グループ	69,400	1,782.00	123,670,800
大和証券グループ本社	1,357,800	656.80	891,803,040
野村ホールディングス	2,767,900	513.90	1,422,423,810
岡三証券グループ	143,200	364.00	52,124,800
丸三証券	54,300	491.00	26,661,300
東洋証券	61,300	169.00	10,359,700
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	209,400	409.00	85,644,600
光世証券	4,300	467.00	2,008,100
水戸証券	49,200	270.00	13,284,000
いちよし証券	34,200	606.00	20,725,200
松井証券	89,000	834.00	74,226,000
マネックスグループ	148,100	633.00	93,747,300
極東証券	24,600	708.00	17,416,800
岩井コスモホールディングス	17,300	1,320.00	22,836,000
アイザワ証券グループ	30,100	675.00	20,317,500
マネーパートナーズグループ	20,000	278.00	5,560,000
スパークス・グループ	84,500	260.00	21,970,000
かんぽ生命保険	182,400	2,193.00	400,003,200
S O M P Oホールディングス	297,600	5,148.00	1,532,044,800
アニコム ホールディングス	55,700	613.00	34,144,100
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	406,400	3,861.00	1,569,110,400
第一生命ホールディングス	892,200	2,695.00	2,404,479,000

東京海上ホールディングス	597,000	6,792.00	4,054,824,000
T & Dホールディングス	470,500	1,699.00	799,379,500
アドバンスクリエイト	8,700	896.00	7,795,200
全国保証	43,300	4,640.00	200,912,000
あんしん保証	6,800	286.00	1,944,800
イントラスト	8,400	529.00	4,443,600
日本モーゲージサービス	10,500	967.00	10,153,500
C a s a	6,900	809.00	5,582,100
アルヒ	27,200	1,020.00	27,744,000
プレミアグループ	9,300	4,090.00	38,037,000
ネットプロテクションズホールディングス	41,800	751.00	31,391,800
クレディセゾン	116,700	1,622.00	189,287,400
芙蓉総合リース	19,100	7,100.00	135,610,000
みずほリース	28,100	3,080.00	86,548,000
東京センチュリー	35,200	4,020.00	141,504,000
日本証券金融	71,600	947.00	67,805,200
アイフル	305,200	388.00	118,417,600
リコーリース	16,200	3,455.00	55,971,000
イオンフィナンシャルサービス	98,900	1,224.00	121,053,600
アコム	358,700	341.00	122,316,700
ジャックス	20,100	3,410.00	68,541,000
オリエントコーポレーション	493,500	129.00	63,661,500
オリックス	1,077,100	2,400.00	2,585,040,000
三菱HCキャピタル	670,300	588.00	394,136,400
九州リースサービス	9,600	583.00	5,596,800
日本取引所グループ	452,600	2,147.50	971,958,500
イー・ギャランティ	26,900	2,114.00	56,866,600
アサックス	10,000	608.00	6,080,000
NECキャピタルソリューション	7,600	2,073.00	15,754,800
いちご	206,600	296.00	61,153,600
日本駐車場開発	208,500	151.00	31,483,500
スター・マイカ・ホールディングス	10,900	1,713.00	18,671,700
S R Eホールディングス	5,000	3,135.00	15,675,000
A Dワークスグループ	37,600	149.00	5,602,400
ヒューリック	434,200	1,083.00	470,238,600
三栄建築設計	8,200	1,678.00	13,759,600
野村不動産ホールディングス	94,300	3,020.00	284,786,000
三重交通グループホールディングス	40,100	458.00	18,365,800
サムティ	29,800	2,085.00	62,133,000
ディア・ライフ	26,100	515.00	13,441,500
地主	12,300	1,923.00	23,652,900
プレサンスコーポレーション	24,600	1,672.00	41,131,200



ハウスコム	4,300	1,198.00	5,151,400
日本管理センター	10,100	1,010.00	10,201,000
サンセイランディック	7,100	821.00	5,829,100
フージャースホールディングス	23,200	658.00	15,265,600
オープンハウスグループ	57,800	5,350.00	309,230,000
東急不動産ホールディングス	536,200	680.00	364,616,000
飯田グループホールディングス	151,900	2,114.00	321,116,600
イーランド	4,000	1,347.00	5,388,000
ムゲンエステート	14,000	518.00	7,252,000
And Doホールディングス	8,900	911.00	8,107,900
シーアールイー	5,900	1,611.00	9,504,900
ケイアイスター不動産	8,400	5,560.00	46,704,000
グッドコムアセット	9,200	1,090.00	10,028,000
ジェイ・エス・ビー	4,100	3,500.00	14,350,000
テンポイノベーション	6,800	831.00	5,650,800
フェイスネットワーク	2,800	1,324.00	3,707,200
パーク24	98,100	1,917.00	188,057,700
パラカ	5,600	1,783.00	9,984,800
三井不動産	821,700	2,717.50	2,232,969,750
三菱地所	1,191,700	1,839.50	2,192,132,150
平和不動産	31,400	4,055.00	127,327,000
東京建物	179,800	1,846.00	331,910,800
京阪神ビルディング	29,000	1,383.00	40,107,000
住友不動産	380,700	3,464.00	1,318,744,800
テーオーシー	34,800	666.00	23,176,800
東京楽天地	3,300	3,990.00	13,167,000
スターツコーポレーション	25,300	2,363.00	59,783,900
フジ住宅	23,500	613.00	14,405,500
空港施設	20,900	538.00	11,244,200
明和地所	11,000	599.00	6,589,000
ゴールドクレスト	15,200	1,648.00	25,049,600
エスリード	7,900	1,663.00	13,137,700
日神グループホールディングス	32,600	464.00	15,126,400
日本エスコン	33,700	828.00	27,903,600
タカラレーベン	75,900	299.00	22,694,100
A V A N T I A	11,100	844.00	9,368,400
イオンモール	91,800	1,576.00	144,676,800
毎日コムネット	8,200	692.00	5,674,400
ファースト住建	8,000	1,152.00	9,216,000
カチタス	45,300	3,270.00	148,131,000
トーセイ	26,300	1,083.00	28,482,900
穴吹興産	4,600	2,183.00	10,041,800

サンフロンティア不動産	26,400	1,072.00	28,300,800
F Jネクストホールディングス	19,300	989.00	19,087,700
インテリックス	4,100	651.00	2,669,100
ランドビジネス	7,600	242.00	1,839,200
サンネクスタグループ	7,100	1,185.00	8,413,500
グランディハウス	15,100	527.00	7,957,700
日本空港ビルデング	69,400	5,560.00	385,864,000
明豊ファシリティワークス	8,500	709.00	6,026,500
日本工営	11,300	2,956.00	33,402,800
L I F U L L	55,000	233.00	12,815,000
ミクシィ	40,300	2,283.00	92,004,900
ジェイエシーリクルートメント	14,400	1,859.00	26,769,600
日本M & Aセンターホールディングス	288,200	1,692.00	487,634,400
メンバーズ	5,400	3,275.00	17,685,000
中広	3,700	373.00	1,380,100
U Tグループ	25,400	2,957.00	75,107,800
アイティメディア	8,500	1,737.00	14,764,500
E・Jホールディングス	10,400	1,152.00	11,980,800
夢真ビーネックスグループ	57,500	1,728.00	99,360,000
コシダカホールディングス	47,400	782.00	37,066,800
アルトナー	4,600	824.00	3,790,400
パソナグループ	19,200	2,165.00	41,568,000
C D S	4,600	1,644.00	7,562,400
リンクアンドモチベーション	38,700	481.00	18,614,700
エス・エム・エス	59,800	3,345.00	200,031,000
サニーサイドアップグループ	6,500	780.00	5,070,000
パーソルホールディングス	175,700	2,669.00	468,943,300
リニカル	10,300	818.00	8,425,400
クックパッド	56,300	277.00	15,595,100
アイ・ケイ・ケイホールディングス	9,100	596.00	5,423,600
学情	7,400	985.00	7,289,000
スタジオアリス	8,000	2,304.00	18,432,000
シミックホールディングス	9,900	1,544.00	15,285,600
エプコ	4,200	676.00	2,839,200
N J S	4,000	2,027.00	8,108,000
総合警備保障	70,000	3,580.00	250,600,000
カカクコム	129,000	2,623.00	338,367,000
アイロムグループ	6,300	2,078.00	13,091,400
セントケア・ホールディング	11,800	805.00	9,499,000
サイネックス	3,500	588.00	2,058,000
ルネサンス	12,500	936.00	11,700,000
ディップ	31,000	4,055.00	125,705,000

デジタルホールディングス	12,500	1,421.00	17,762,500
新日本科学	21,600	1,553.00	33,544,800
キャリアデザインセンター	4,700	1,129.00	5,306,300
ベネフィット・ワン	64,000	2,212.00	141,568,000
エムスリー	309,900	4,467.00	1,384,323,300
ツカダ・グローバルホールディング	11,200	309.00	3,460,800
アウトソーシング	100,800	1,247.00	125,697,600
ウェルネット	18,300	500.00	9,150,000
ワールドホールディングス	7,200	2,386.00	17,179,200
ディー・エヌ・エー	67,000	1,956.00	131,052,000
博報堂D Yホールディングス	244,700	1,544.00	377,816,800
ぐるなび	29,600	433.00	12,816,800
タカミヤ	22,200	356.00	7,903,200
ジャパンベストレスキューシステム	11,900	960.00	11,424,000
ファンコミュニケーションズ	44,700	436.00	19,489,200
ライク	6,000	2,174.00	13,044,000
ビジネス・ブレークスルー	7,300	409.00	2,985,700
エスプール	49,900	1,336.00	66,666,400
WDBホールディングス	8,100	2,828.00	22,906,800
ティア	11,000	428.00	4,708,000
C D G	2,100	1,283.00	2,694,300
アドウェイズ	26,600	804.00	21,386,400
バリューコマース	13,900	3,705.00	51,499,500
インフォマート	192,900	663.00	127,892,700
J Pホールディングス	46,700	217.00	10,133,900
エコナックホールディングス	35,400	90.00	3,186,000
C Lホールディングス	4,000	1,140.00	4,560,000
プレステージ・インターナショナル	66,300	642.00	42,564,600
アミューズ	9,700	1,944.00	18,856,800
ドリームインキュベータ	4,900	2,035.00	9,971,500
クイック	12,200	1,550.00	18,910,000
T A C	11,100	215.00	2,386,500
電通グループ	181,100	4,915.00	890,106,500
イオンファンタジー	6,900	2,203.00	15,200,700
シーティーエス	20,200	845.00	17,069,000
ネクシィーズグループ	6,700	532.00	3,564,400
H . U . グループホールディングス	46,000	2,938.00	135,148,000
アルプス技研	15,500	1,935.00	29,992,500
ダイオーズ	3,800	1,014.00	3,853,200
日本空調サービス	18,800	802.00	15,077,600
オリエンタルランド	207,500	22,585.00	4,686,387,500
ダスキン	40,900	2,727.00	111,534,300

明光ネットワークジャパン	21,200	573.00	12,147,600
ファルコホールディングス	8,500	2,124.00	18,054,000
ラウンドワン	49,300	1,493.00	73,604,900
リゾートトラスト	80,700	2,186.00	176,410,200
ビー・エム・エル	22,700	3,255.00	73,888,500
りらいあコミュニケーションズ	26,200	1,057.00	27,693,400
リソー教育	81,100	381.00	30,899,100
早稲田アカデミー	10,100	1,042.00	10,524,200
ユー・エス・エス	196,800	2,095.00	412,296,000
東京個別指導学院	16,000	569.00	9,104,000
サイバーエージェント	433,000	1,418.00	613,994,000
楽天グループ	903,400	961.00	868,167,400
クリーク・アンド・リバー社	9,400	2,191.00	20,595,400
モーニングスター	31,300	565.00	17,684,500
テー・オー・ダブリュー	34,600	313.00	10,829,800
山田コンサルティンググループ	9,400	1,232.00	11,580,800
セントラルスポーツ	6,700	2,379.00	15,939,300
フルキャストホールディングス	15,100	2,452.00	37,025,200
エン・ジャパン	28,500	3,110.00	88,635,000
リソルホールディングス	2,000	4,335.00	8,670,000
テクノプロ・ホールディングス	105,300	3,190.00	335,907,000
アトラグループ	3,900	258.00	1,006,200
インターワークス	5,900	368.00	2,171,200
アイ・アールジャパンホールディングス	8,200	4,245.00	34,809,000
K e e P e r 技研	11,400	2,765.00	31,521,000
ファーストロジック	3,800	795.00	3,021,000
三機サービス	3,400	1,097.00	3,729,800
G u n o s y	10,000	1,241.00	12,410,000
デザインワン・ジャパン	6,200	186.00	1,153,200
イー・ガーディアン	7,200	2,975.00	21,420,000
リブセンス	11,600	164.00	1,902,400
ジャパンマテリアル	54,200	1,841.00	99,782,200
ベクトル	24,900	1,278.00	31,822,200
ウチヤマホールディングス	9,700	322.00	3,123,400
チャーム・ケア・コーポレーション	13,300	1,211.00	16,106,300
キャリアリンク	6,700	1,449.00	9,708,300
I B J	14,800	713.00	10,552,400
アサンテ	8,000	1,476.00	11,808,000
バリューHR	14,300	1,375.00	19,662,500
M & A キャピタルパートナーズ	14,600	4,410.00	64,386,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,100	1,186.00	8,420,600
E R I ホールディングス	5,200	1,295.00	6,734,000

アビスト	2,800	2,704.00	7,571,200
シグマクシス・ホールディングス	21,400	1,083.00	23,176,200
ウィルグループ	13,200	1,140.00	15,048,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	25,300	171.00	4,326,300
メドピア	13,600	3,530.00	48,008,000
レアジョブ	3,700	830.00	3,071,000
リクルートホールディングス	1,354,800	5,095.00	6,902,706,000
エラン	24,500	1,023.00	25,063,500
土木管理総合試験所	9,100	333.00	3,030,300
ネットマーケティング	9,200	606.00	5,575,200
日本郵政	2,293,500	908.90	2,084,562,150
ベルシステム24ホールディングス	25,500	1,487.00	37,918,500
鎌倉新書	20,500	612.00	12,546,000
S MN	4,400	596.00	2,622,400
グローバルキッズCOMPANY	3,700	717.00	2,652,900
エアトリ	11,500	3,250.00	37,375,000
アトラエ	12,400	1,805.00	22,382,000
ストライク	6,700	4,220.00	28,274,000
ソラスト	43,500	888.00	38,628,000
セラク	5,800	1,333.00	7,731,400
インソース	17,200	2,105.00	36,206,000
ベйкаレント・コンサルティング	12,400	38,850.00	481,740,000
Orchestra Holdings	3,500	2,620.00	9,170,000
アイモバイル	5,300	1,221.00	6,471,300
キャリアインデックス	6,500	600.00	3,900,000
MS - Japan	7,500	825.00	6,187,500
船場	4,000	702.00	2,808,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	55,900	1,579.00	88,266,100
フルテック	2,700	1,385.00	3,739,500
GameWith	5,900	509.00	3,003,100
MS&Consulting	3,000	720.00	2,160,000
ウェルビー	11,800	1,007.00	11,882,600
エル・ティー・エス	2,400	2,738.00	6,571,200
ミダックホールディングス	8,000	2,263.00	18,104,000
日総工産	14,200	681.00	9,670,200
キュービーネットホールディングス	8,300	1,446.00	12,001,800
RPAホールディングス	25,600	375.00	9,600,000
スプリックス	5,200	1,218.00	6,333,600
マネジメントソリューションズ	8,700	4,580.00	39,846,000
プロレド・パートナーズ	4,300	585.00	2,515,500
テノ・ホールディングス	2,600	671.00	1,744,600
フロンティア・マネジメント	4,900	960.00	4,704,000

ピアラ	3,400	1,019.00	3,464,600
コプロ・ホールディングス	3,800	996.00	3,784,800
ギークス	3,300	1,208.00	3,986,400
カーブスホールディングス	48,700	782.00	38,083,400
フォーラムエンジニアリング	12,600	811.00	10,218,600
Fast Fitness Japan	2,600	1,974.00	5,132,400
ダイレクトマーケティングミックス	20,500	1,643.00	33,681,500
ポピンズ	4,200	1,963.00	8,244,600
LITALICO	14,300	2,737.00	39,139,100
アドバンテッジリスクマネジメント	9,400	548.00	5,151,200
リログループ	96,200	1,865.00	179,413,000
東祥	13,300	1,696.00	22,556,800
TREホールディングス	24,200	2,147.00	51,957,400
人・夢・技術グループ	7,100	2,120.00	15,052,000
エイチ・アイ・エス	39,200	2,220.00	87,024,000
ラックランド	5,400	2,924.00	15,789,600
共立メンテナンス	31,400	4,735.00	148,679,000
イチネンホールディングス	18,300	1,260.00	23,058,000
建設技術研究所	10,600	2,222.00	23,553,200
スペース	12,900	909.00	11,726,100
燦ホールディングス	7,800	1,530.00	11,934,000
スバル興業	1,100	8,130.00	8,943,000
東京テアトル	6,900	1,224.00	8,445,600
タナベ経営	7,200	672.00	4,838,400
ナガワ	5,600	9,200.00	51,520,000
東京都競馬	13,200	4,425.00	58,410,000
カナモト	31,100	1,968.00	61,204,800
西尾レントオール	16,300	2,748.00	44,792,400
トランス・コスモス	22,400	3,075.00	68,880,000
乃村工藝社	75,600	884.00	66,830,400
藤田観光	7,700	2,376.00	18,295,200
KNT-CTホールディングス	10,900	1,516.00	16,524,400
日本管財	18,900	2,782.00	52,579,800
トーカイ	15,600	1,710.00	26,676,000
セコム	173,100	8,883.00	1,537,647,300
セントラル警備保障	8,600	2,183.00	18,773,800
丹青社	36,300	797.00	28,931,100
メイテック	21,300	6,880.00	146,544,000
応用地質	19,900	1,958.00	38,964,200
船井総研ホールディングス	36,100	2,140.00	77,254,000
進学会ホールディングス	6,700	331.00	2,217,700
オオバ	12,600	777.00	9,790,200

いであ	4,900	1,787.00	8,756,300	
学究社	5,800	1,584.00	9,187,200	
ベネッセホールディングス	58,700	2,178.00	127,848,600	
イオンディライト	21,700	2,786.00	60,456,200	
ナック	8,700	940.00	8,178,000	
ダイセキ	32,100	4,285.00	137,548,500	
ステップ	6,600	1,749.00	11,543,400	
合 計	199,523,400		480,748,319,990	

## (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。

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2022年 4月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	515,365,705
国債証券	520,759,606,500
地方債証券	33,354,717,608
特殊債証券	36,980,264,633
社債証券	28,936,145,160
未収利息	820,092,735
前払費用	15,324,310
差入委託証拠金	70,000
流動資産合計	621,381,586,651
資産合計	621,381,586,651
負債の部	
流動負債	
未払金	120,660
未払解約金	118,571,060
未払利息	394
流動負債合計	118,692,114
負債合計	118,692,114
純資産の部	
元本等	
元本	449,683,563,005

	2022年 4月20日現在
項目	金額（円）
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	171,579,331,532
元本等合計	621,262,894,537
純資産合計	621,262,894,537
負債純資産合計	621,381,586,651

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 4月20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 4月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	449,683,563,005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 100,058,000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 1.3816円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,816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 4月20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 4月20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 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年10月21日
期首元本額	467,135,093,262円
期中追加設定元本額	20,961,310,404円
期中一部解約元本額	38,412,840,661円
期末元本額	449,683,563,005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）	3,998,039,849円
S B I 資産設計オープン（分配型）	17,347,710円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,464,278,775円
世界経済インデックスファンド	3,577,945,158円
D C マイセレクション 2 5	25,650,582,590円
D C マイセレクション 5 0	29,252,453,254円
D C マイセレクション 7 5	8,533,767,178円
D C 日本債券インデックス・オープン	444,968,766円
D C 日本債券インデックス・オープン S	92,764,363,709円
D C 日本債券インデックス・オープン P	67,400,211,103円
D C マイセレクション S 2 5	12,538,228,496円
D C マイセレクション S 5 0	14,006,888,932円
D C マイセレクション S 7 5	3,043,907,484円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	788,314,570円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	2,159,337,350円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	800,698,135円
D C 世界経済インデックスファンド	3,271,295,223円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	8,500,107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
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	92,634,852円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	128,536,453円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	33,571,372円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	28,390,725円

区分	2022年 4月20日現在
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,003,635,473円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	769,989,781円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,230,956,864円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	102,672,036円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	78,494,840円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,019,449,041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）	1,446,641,577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	15,923,996,060円
分散投資コア戦略ファンドA	19,625,662,016円
分散投資コア戦略ファンドS	24,977,685,407円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	154,896,490円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,336,492,878円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	66,041,339円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	37,420,345円
SMT インデックスバランス・オープン	61,237,942円
SMT 世界経済インデックス・オープン	35,101,431円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	68,443,802円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	110,110,493円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,065,025円
グローバル経済コア	227,614,794円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	29,524,491円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	18,079,005円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	14,802,005円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	8,821,936円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	2,194,113円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	1,781,181円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	362,824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）	80,464,837,118円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	87,396,383円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	10,978,595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）	373,848,034円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	14,048,347,650
地方債証券	575,600,010

特殊債券	555,080,663
社債券	433,053,000
合計	15,612,081,323

(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 4 回利付国債(2年)	1,590,000,000	1,591,383,300	
	第4 2 5 回利付国債(2年)	2,810,000,000	2,812,500,900	
	第4 2 6 回利付国債(2年)	620,000,000	620,589,000	
	第4 2 7 回利付国債(2年)	3,330,000,000	3,333,396,600	
	第4 2 8 回利付国債(2年)	230,000,000	230,250,700	
	第4 2 9 回利付国債(2年)	950,000,000	951,092,500	
	第4 3 0 回利付国債(2年)	2,010,000,000	2,012,291,400	
	第4 3 4 回利付国債(2年)	1,915,000,000	1,917,317,150	
	第4 3 5 回利付国債(2年)	780,000,000	780,834,600	
	第1 3 6 回利付国債(5年)	4,330,000,000	4,338,789,900	
	第1 3 7 回利付国債(5年)	6,760,000,000	6,776,764,800	
	第1 3 8 回利付国債(5年)	6,890,000,000	6,908,947,500	
	第1 3 9 回利付国債(5年)	5,590,000,000	5,606,546,400	
	第1 4 0 回利付国債(5年)	5,330,000,000	5,347,322,500	
	第1 4 1 回利付国債(5年)	7,550,000,000	7,576,425,000	
	第1 4 2 回利付国債(5年)	4,370,000,000	4,386,300,100	
	第1 4 3 回利付国債(5年)	5,110,000,000	5,130,082,300	
	第1 4 4 回利付国債(5年)	6,310,000,000	6,335,934,100	
	第1 4 5 回利付国債(5年)	5,820,000,000	5,844,851,400	
	第1 4 6 回利付国債(5年)	3,150,000,000	3,163,860,000	
第1 4 7 回利付国債(5年)	4,170,000,000	4,172,418,600		

第148回利付国債(5年)	6,950,000,000	6,952,849,500	
第149回利付国債(5年)	5,130,000,000	5,130,000,000	
第150回利付国債(5年)	5,880,000,000	5,877,236,400	
第1回利付国債(40年)	400,000,000	536,212,000	
第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,467,327,600	
第3回利付国債(40年)	550,000,000	718,316,500	
第4回利付国債(40年)	1,200,000,000	1,572,324,000	
第5回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,350,564,700	
第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,564,718,400	
第7回利付国債(40年)	1,240,000,000	1,478,600,800	
第8回利付国債(40年)	1,230,000,000	1,368,768,600	
第9回利付国債(40年)	2,050,000,000	1,699,757,500	
第10回利付国債(40年)	2,100,000,000	2,040,360,000	
第11回利付国債(40年)	1,790,000,000	1,684,264,700	
第12回利付国債(40年)	1,290,000,000	1,092,539,700	
第13回利付国債(40年)	2,140,000,000	1,803,699,000	
第14回利付国債(40年)	1,670,000,000	1,502,298,600	
第329回利付国債(10年)	4,410,000,000	4,454,937,900	
第330回利付国債(10年)	3,910,000,000	3,958,484,000	
第331回利付国債(10年)	900,000,000	908,613,000	
第332回利付国債(10年)	4,800,000,000	4,853,184,000	
第333回利付国債(10年)	3,030,000,000	3,067,965,900	
第334回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,319,980,800	
第335回利付国債(10年)	2,310,000,000	2,340,445,800	
第336回利付国債(10年)	950,000,000	963,689,500	
第337回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,825,396,000	
第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	4,617,820,800	
第339回利付国債(10年)	4,750,000,000	4,814,647,500	
第340回利付国債(10年)	4,830,000,000	4,900,179,900	
第341回利付国債(10年)	5,340,000,000	5,402,638,200	
第342回利付国債(10年)	5,050,000,000	5,071,715,000	
第343回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,681,667,900	
第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	5,924,721,000	
第345回利付国債(10年)	3,540,000,000	3,554,018,400	
第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	5,769,722,500	
第347回利付国債(10年)	4,050,000,000	4,061,461,500	
第348回利付国債(10年)	4,340,000,000	4,349,331,000	
第349回利付国債(10年)	5,000,000,000	5,007,050,000	
第350回利付国債(10年)	6,630,000,000	6,633,845,400	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	5,110,000,000	5,108,415,900	
第352回利付国債(10年)	4,510,000,000	4,504,227,200	
第353回利付国債(10年)	5,250,000,000	5,237,820,000	

第354回利付国債(10年)	4,790,000,000	4,773,570,300	
第355回利付国債(10年)	3,550,000,000	3,532,392,000	
第356回利付国債(10年)	4,080,000,000	4,054,622,400	
第357回利付国債(10年)	2,770,000,000	2,750,111,400	
第358回利付国債(10年)	3,560,000,000	3,532,267,600	
第359回利付国債(10年)	3,420,000,000	3,389,801,400	
第360回利付国債(10年)	4,890,000,000	4,841,491,200	
第361回利付国債(10年)	3,940,000,000	3,896,463,000	
第362回利付国債(10年)	3,850,000,000	3,802,953,000	
第363回利付国債(10年)	5,560,000,000	5,487,720,000	
第364回利付国債(10年)	4,210,000,000	4,151,902,000	
第365回利付国債(10年)	6,560,000,000	6,467,110,400	
第366回利付国債(10年)	150,000,000	149,274,000	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	131,188,200	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	187,371,200	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	140,091,600	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	135,005,200	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	58,786,000	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	421,214,500	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	216,277,200	
第8回利付国債(30年)	350,000,000	404,708,500	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	267,422,400	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	173,432,000	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	298,997,400	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	227,373,000	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	475,304,000	
第14回利付国債(30年)	800,000,000	989,800,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	426,033,600	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	251,166,000	
第17回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,434,176,500	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	427,054,800	
第19回利付国債(30年)	530,000,000	657,576,300	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	609,124,800	
第21回利付国債(30年)	500,000,000	622,690,000	
第22回利付国債(30年)	540,000,000	688,991,400	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	549,570,100	
第24回利付国債(30年)	780,000,000	999,180,000	
第25回利付国債(30年)	350,000,000	439,383,000	
第26回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,449,635,400	
第27回利付国債(30年)	1,920,000,000	2,476,704,000	
第28回利付国債(30年)	2,140,000,000	2,768,796,200	
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,140,004,800	

第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,245,793,700
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,379,697,000
第32回利付国債(30年)	1,560,000,000	1,985,708,400
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,225,932,800
第34回利付国債(30年)	1,795,000,000	2,257,876,650
第35回利付国債(30年)	2,300,000,000	2,813,475,000
第36回利付国債(30年)	2,130,000,000	2,609,356,500
第37回利付国債(30年)	2,310,000,000	2,790,202,800
第38回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,679,140,800
第39回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,792,502,000
第40回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,717,416,000
第41回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,349,835,500
第42回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,315,283,200
第43回利付国債(30年)	1,290,000,000	1,515,698,400
第44回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,304,838,300
第45回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,633,392,000
第46回利付国債(30年)	1,650,000,000	1,871,826,000
第47回利付国債(30年)	1,560,000,000	1,802,127,600
第48回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,904,820,300
第49回利付国債(30年)	1,700,000,000	1,893,528,000
第50回利付国債(30年)	1,590,000,000	1,564,862,100
第51回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,495,959,300
第52回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,575,967,200
第53回利付国債(30年)	1,320,000,000	1,236,312,000
第54回利付国債(30年)	1,680,000,000	1,644,132,000
第55回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,407,556,800
第56回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,444,894,400
第57回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,373,438,700
第58回利付国債(30年)	2,350,000,000	2,286,197,500
第59回利付国債(30年)	1,190,000,000	1,128,834,000
第60回利付国債(30年)	1,530,000,000	1,520,253,900
第61回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,379,393,400
第62回利付国債(30年)	240,000,000	215,008,800
第63回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,096,162,200
第64回利付国債(30年)	1,860,000,000	1,612,917,600
第65回利付国債(30年)	1,590,000,000	1,377,289,800
第66回利付国債(30年)	1,030,000,000	892,216,900
第67回利付国債(30年)	1,990,000,000	1,815,059,100
第68回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,356,600,300
第69回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,253,221,600
第70回利付国債(30年)	1,740,000,000	1,622,915,400
第71回利付国債(30年)	1,430,000,000	1,333,131,800
第72回利付国債(30年)	1,010,000,000	940,057,500

第73回利付国債(30年)	1,920,000,000	1,784,121,600	
第74回利付国債(30年)	80,000,000	80,369,600	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	323,260,800	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	204,370,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	328,960,000	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	227,207,200	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	340,259,700	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	134,864,600	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	198,200,400	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	406,087,500	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	421,232,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	209,750,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	662,684,400	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	379,594,800	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	211,420,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	138,091,200	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	285,230,700	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	307,202,800	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	180,392,100	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	287,358,300	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	234,841,200	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	417,003,600	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	643,596,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	312,553,300	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	504,827,000	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	313,948,200	
第86回利付国債(20年)	510,000,000	556,109,100	
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,988,276,700	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	460,320,000	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	382,144,000	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	691,053,300	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	495,598,500	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	965,544,800	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	449,618,300	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	671,933,300	
第95回利付国債(20年)	610,000,000	680,869,800	
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,758,349,200	
第97回利付国債(20年)	400,000,000	446,212,000	
第98回利付国債(20年)	440,000,000	488,457,200	
第99回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,437,782,400	
第100回利付国債(20年)	480,000,000	539,721,600	
第101回利付国債(20年)	715,000,000	812,368,700	



第102回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,437,546,600
第103回利付国債(20年)	400,000,000	453,912,000
第104回利付国債(20年)	160,000,000	179,604,800
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,329,187,400
第106回利付国債(20年)	380,000,000	430,464,000
第107回利付国債(20年)	260,000,000	293,846,800
第108回利付国債(20年)	660,000,000	737,200,200
第109回利付国債(20年)	520,000,000	582,654,800
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,247,598,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,110,155,300
第112回利付国債(20年)	790,000,000	898,553,900
第113回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,304,678,600
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,667,244,200
第115回利付国債(20年)	700,000,000	806,610,000
第116回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,723,453,200
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,240,790,400
第118回利付国債(20年)	660,000,000	755,429,400
第119回利付国債(20年)	530,000,000	598,120,900
第120回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,746,562,200
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,709,640,000
第122回利付国債(20年)	940,000,000	1,063,600,600
第123回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,169,873,200
第124回利付国債(20年)	610,000,000	702,628,500
第125回利付国債(20年)	1,820,000,000	2,134,041,000
第126回利付国債(20年)	730,000,000	843,208,400
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,169,266,800
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,115,383,600
第129回利付国債(20年)	740,000,000	844,273,400
第130回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,470,258,450
第131回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,134,960,000
第132回利付国債(20年)	1,160,000,000	1,320,602,000
第133回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,411,917,000
第134回利付国債(20年)	830,000,000	955,354,900
第135回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,175,590,500
第136回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,640,921,500
第137回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,245,423,100
第138回利付国債(20年)	620,000,000	696,129,800
第139回利付国債(20年)	830,000,000	940,132,700
第140回利付国債(20年)	2,520,000,000	2,883,636,000
第141回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,833,392,000
第142回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,179,344,400
第143回利付国債(20年)	1,920,000,000	2,183,731,200
第144回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,295,808,500

第145回利付国債(20年)	2,705,000,000	3,110,722,950	
第146回利付国債(20年)	2,780,000,000	3,202,532,200	
第147回利付国債(20年)	2,380,000,000	2,719,530,800	
第148回利付国債(20年)	2,090,000,000	2,367,552,000	
第149回利付国債(20年)	2,600,000,000	2,948,842,000	
第150回利付国債(20年)	2,730,000,000	3,065,598,900	
第151回利付国債(20年)	2,125,000,000	2,335,545,000	
第152回利付国債(20年)	2,860,000,000	3,144,770,200	
第153回利付国債(20年)	2,440,000,000	2,714,622,000	
第154回利付国債(20年)	2,810,000,000	3,090,325,600	
第155回利付国債(20年)	2,940,000,000	3,156,295,800	
第156回利付国債(20年)	2,710,000,000	2,690,488,000	
第157回利付国債(20年)	2,950,000,000	2,842,325,000	
第158回利付国債(20年)	2,530,000,000	2,536,805,700	
第159回利付国債(20年)	2,400,000,000	2,436,120,000	
第160回利付国債(20年)	1,610,000,000	1,654,677,500	
第161回利付国債(20年)	1,990,000,000	2,012,367,600	
第162回利付国債(20年)	630,000,000	635,827,500	
第163回利付国債(20年)	1,980,000,000	1,994,275,800	
第164回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,217,429,400	
第165回利付国債(20年)	2,180,000,000	2,152,619,200	
第166回利付国債(20年)	1,620,000,000	1,646,665,200	
第167回利付国債(20年)	2,150,000,000	2,112,611,500	
第168回利付国債(20年)	1,410,000,000	1,359,395,100	
第169回利付国債(20年)	1,990,000,000	1,880,987,800	
第170回利付国債(20年)	2,390,000,000	2,252,073,100	
第171回利付国債(20年)	1,670,000,000	1,568,664,400	
第172回利付国債(20年)	2,290,000,000	2,182,370,000	
第173回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,232,782,000	
第174回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,349,031,200	
第175回利付国債(20年)	1,960,000,000	1,884,383,200	
第176回利付国債(20年)	3,000,000,000	2,875,770,000	
第177回利付国債(20年)	2,390,000,000	2,242,298,000	
第178回利付国債(20年)	1,690,000,000	1,611,550,200	
第179回利付国債(20年)	3,090,000,000	2,939,949,600	
国債証券合計	501,415,000,000	520,759,606,500	
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	100,069,000	
第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,281,000	
第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	100,000,000	92,404,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,701,000	
第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	126,746,000	

第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	124,372,000	
第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	120,080,000	
第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	118,448,000	
第16回東京都公募公債(20年)	200,000,000	223,404,000	
第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,228,000	
第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	113,124,000	
第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	92,484,000	
第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	227,946,000	
第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	227,002,000	
第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	199,596,000	
第720回東京都公募公債	100,000,000	100,996,000	
第726回東京都公募公債	200,000,000	202,368,000	
第728回東京都公募公債	100,000,000	101,050,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	101,133,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	100,562,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	100,282,000	
第781回東京都公募公債	300,000,000	299,175,000	
第800回東京都公募公債	200,000,000	196,770,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,581,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,060,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,699,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	199,286,000	
第29回1号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	101,015,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	259,908,000	
第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	112,876,000	
第15回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	227,220,000	
第17回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,885,000	
第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	113,638,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,340,000	
第78回神奈川県公募公債(5年)	200,000,000	199,890,000	
第201回神奈川県公募公債	200,250,000	202,222,462	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	202,218,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	101,400,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,493,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,488,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,282,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	196,694,000	
第6回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	227,356,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	227,540,000	
第10回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	113,670,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,119,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,099,000	

第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,252,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	152,774,250	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,586,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,557,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	156,124,800	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,368,000	
第439回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,260,000	
第440回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	99,636,000	
第465回大阪府公募公債(10年)	160,000,000	156,972,800	
第468回大阪府公募公債(10年)	182,000,000	178,583,860	
第469回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	196,130,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	113,931,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	113,495,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	101,118,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	101,585,000	
平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	97,040,000	
平成29年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	100,557,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	138,081,995	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	111,918,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	101,536,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	107,016,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	105,830,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	105,725,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	400,000,000	458,548,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,197,000	
第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	99,095,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	296,622,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	112,449,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	96,141,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	113,608,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	112,181,000	
平成26年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	101,363,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,333,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,436,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,348,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	306,856,600	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	114,220,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,296,000	
	200,000,000	202,648,000	

平成26年度第5回愛知県公募公債(10年)			
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,177,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,979,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	200,836,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	299,823,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,939,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	94,981,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	196,830,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	98,665,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	184,134,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	113,466,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	227,236,000	
平成25年度第4回広島県公募公債	100,000,000	101,051,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	127,100,936	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,260,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	385,905,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	111,773,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	112,959,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	99,970,000	
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	195,756,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	227,220,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	194,448,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	101,216,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	101,501,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,022,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,743,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,308,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	98,428,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	98,278,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	147,021,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	111,862,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	111,965,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	105,765,000	
	100,000,000	114,901,000	

平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）			
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	106,450,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	123,622,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	109,638,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	101,483,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	94,981,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	99,839,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	296,283,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	98,440,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	96,751,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	225,918,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	113,821,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	113,608,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	101,116,000	
平成25年度第8回千葉県公募公債	300,000,000	303,138,000	
平成25年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	101,143,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,108,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	101,537,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,022,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,512,400	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	295,014,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	98,642,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	296,364,000	
平成30年度第3回茨城県公募公債	350,000,000	350,084,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	225,364,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	100,246,000	
第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,178,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,015,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,030,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,614,000	
第131回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,181,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,672,000	
第134回共同発行市場公募地方債	112,000,000	113,508,640	
第135回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,371,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,303,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,244,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,416,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,170,000	

第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,098,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	127,431,480	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,566,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,117,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,039,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,958,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,786,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,652,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,839,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,427,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,724,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,564,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	194,193,135	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,300,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	299,730,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,305,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,304,000	
第13回大阪市公募公債(20年)	200,000,000	228,336,000	
第15回大阪市公募公債(30年)	100,000,000	91,654,000	
第22回大阪市公募公債(20年)	300,000,000	292,413,000	
第24回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	101,170,000	
平成25年度第8回大阪市公募公債	100,000,000	101,332,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	196,968,000	
第1回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	125,564,000	
第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	128,683,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	112,096,000	
第11回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	117,400,000	
第499回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	100,611,000	
第512回名古屋市公募公債(10年)	300,000,000	296,169,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	200,854,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	120,000,000	132,308,400	
平成20年度第1回神戸市公募公債(20年)	200,000,000	226,278,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	114,806,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	113,809,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	91,331,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	91,956,000	
第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	106,700,000	
第20回横浜市公募公債(20年)	300,000,000	340,122,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,402,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,572,000	

	平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	100,029,000	
	平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,443,000	
	第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	222,170,000	
	令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	296,298,000	
	令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	98,484,000	
	平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	106,729,000	
	平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,053,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	112,673,000	
	第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,348,000	
	第93回川崎市公募公債	100,000,000	98,275,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,113,000	
	平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,549,000	
	平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	100,039,000	
	平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	113,558,000	
	平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	112,355,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	202,544,000	
	平成30年度第5回福岡市公募公債（5年）	200,000,000	200,046,000	
	平成30年度第10回福岡市公募公債（5年）	100,000,000	100,000,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	151,798,500	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,128,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,366,450	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	170,453,900	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	542,333,000	
	令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	200,000,000	199,718,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	196,676,000	
	平成25年度第4回福井県公募公債	100,000,000	101,358,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	201,610,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	111,514,000	
	地方債証券合計	32,261,680,000	33,354,717,608	
特殊債券	第2回政府保証新関西国際空港債券	202,000,000	204,147,260	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	300,000,000	307,731,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,092,000	
	第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,975,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	85,409,000	
	第21回道路債券	100,000,000	125,062,000	
	第27回道路債券	400,000,000	418,176,000	
	第28回道路債券	200,000,000	253,494,000	



第33回道路債券	200,000,000	256,954,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,757,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	140,304,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,356,000	
第42回道路債券	100,000,000	106,322,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,656,000	
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	133,047,000	
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	227,128,000	
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	229,156,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,893,000	
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	124,692,000	
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,883,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,018,000	
第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,217,000	
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	115,452,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,227,000	
第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,047,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,135,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,619,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	218,066,000	
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	113,498,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	598,158,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	628,000,000	632,320,640	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,140,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	149,753,800	
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	101,101,000	
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	268,755,696	

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	202,392,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,811,000	
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	422,000,000	427,730,760	
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	101,270,000	
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	224,506,000	
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	103,403,520	
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	101,409,000	
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	101,359,000	
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	223,072,000	
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	101,340,000	
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	101,225,000	
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	302,586,000	
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	108,698,000	
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	218,876,000	
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	202,134,000	
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	100,408,000	
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	88,139,000	
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	106,703,610	
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	205,438,700	
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	100,317,000	
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	200,426,000	
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	100,186,000	
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	120,285,600	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,696,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	298,887,000	
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	214,335,980	
	100,000,000	98,336,000	

第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	98,084,000	
第2回公営企業債券(30年)	300,000,000	365,958,000	
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	100,000,000	106,100,000	
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	100,000,000	100,416,000	
第5回公営企業債券(30年)	300,000,000	380,610,000	
第7回公営企業債券(20年)	100,000,000	104,145,000	
第7回公営企業債券(30年)	200,000,000	254,580,000	
第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	41,696,400	
第8回公営企業債券(30年)	100,000,000	125,415,000	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	227,510,000	
第10回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	223,228,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	600,000,000	599,952,000	
第11回地方公共団体金融機構債券(30年)	200,000,000	179,224,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	110,400,000	
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	228,244,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	113,331,000	
第34回地方公共団体金融機構債券(20年)	500,000,000	566,560,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,663,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,123,000	
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	106,141,350	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,466,000	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,255,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,352,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,708,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,224,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,222,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,016,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,407,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,271,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,923,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,120,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,933,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,092,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	251,727,900	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,595,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,260,000	

第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,211,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,297,000	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,891,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	156,280,800	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,187,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,271,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,264,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,366,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,514,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,080,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,968,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,082,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,999,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	106,175,000	
第19回水資源債券(サステナビリティボンド)	200,000,000	199,764,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	113,756,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	115,939,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,902,980	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,260,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	209,601,000	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	187,282,370	
第77回株式会社日本政策金融公庫社債	400,000,000	399,908,000	
第87回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,852,000	
第88回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,908,000	
第89回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,942,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	207,668,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	156,450,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	85,938,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	183,482,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	105,795,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,248,000	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	98,687,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,363,000	10,447,354	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,730,000	10,867,236	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,884,000	11,054,116	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	137,037,000	136,403,889	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	96,944,000	96,561,071	

第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,780,000	10,933,183
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,742,000	11,980,714
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	172,881,000	171,822,968
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,621,000	11,849,468
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	195,423,000	193,910,425
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	69,898,000	69,531,035
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	10,086,000	10,163,863
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,034,000	12,324,500
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	233,394,000	231,858,267
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	10,320,000	10,400,599
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	160,948,000	160,025,767
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,197,000	12,522,659
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,905,000
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,034,000	16,832,974
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,225,000	17,083,140
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,046,000	19,112,518
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,026,000	21,100,795
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,033,000	23,342,421
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,484,000	23,786,498
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,142,000	49,749,424
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,470,000	10,549,153
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,275,000	22,362,152
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,766,000	10,895,514
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,422,000	10,515,172
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,706,000	22,809,967
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,342,000	22,460,534
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,142,000	21,143,057
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,635,000	11,919,592
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,100,000	44,999,417
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,682,000	23,708,360
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,419,000	11,645,552
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,109,000	31,441,323
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,042,000	30,310,844
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,469,000	30,782,433
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,746,000	70,617,752
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,658,000	80,404,763
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,831,000	41,195,211

第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,353,000	42,074,862	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,519,000	42,296,568	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,388,000	36,818,736	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,814,000	35,959,032	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,325,000	42,131,156	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	172,894,500	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	105,819,000	109,296,212	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	143,700,000	148,400,427	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,023,000	42,277,893	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,307,000	43,626,132	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,176,000	44,396,585	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,977,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	136,158,000	139,947,277	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,934,000	48,049,151	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,514,000	100,169,035	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,545,000	55,634,809	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,579,000	59,567,813	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,033,000	59,301,021	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,156,000	184,775,199	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	121,376,000	124,331,505	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,657,000	59,965,637	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,679,000	65,113,687	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,995,000	69,384,643	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,515,000	75,031,704	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,257,000	74,600,006	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,443,000	75,106,524	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,922,000	75,906,056	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,557,000	76,409,244	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,364,000	78,148,499	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,771,000	78,633,938	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,620,000	78,266,210	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,727,000	78,365,643	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,471,000	79,135,632	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,864,000	159,819,992	

第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,545,000	79,153,638	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	162,458,000	162,003,117	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,629,000	80,223,436	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,766,000	160,654,667	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,889,000	81,454,169	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,540,000	163,368,475	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,524,000	164,312,364	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	121,953,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,072,000	83,865,182	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,475,000	83,448,288	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,787,000	83,063,918	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	172,382,000	170,127,243	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,380,000	85,151,676	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,828,000	84,728,543	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,698,000	171,198,485	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,039,000	86,144,400	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	266,352,000	259,245,728	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,376,000	173,572,334	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,602,000	89,398,805	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,185,000	89,718,745	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,084,000	184,870,796	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,676,000	93,427,223	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,596,000	187,034,558	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,712,000	187,771,220	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,212,000	93,983,765	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,330,000	189,619,509	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,496,000	190,526,765	

第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,848,000	95,751,680	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,785,000	96,142,212	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	293,631,000	288,645,145	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,080,000	96,541,124	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,928,000	99,859,049	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	94,609,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	92,281,000	
第64回日本学生支援債券	300,000,000	299,916,000	
第65回日本学生支援債券	200,000,000	199,906,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	106,272,000	
第24回沖縄振興開発金融公庫債券	600,000,000	600,582,000	
い第823号商工債	200,000,000	200,320,000	
い第829号商工債	200,000,000	200,152,000	
い第832号商工債	200,000,000	199,834,000	
い第833号商工債	100,000,000	99,863,000	
い第843号商工債	200,000,000	199,896,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,833,000	
い第850号商工債	200,000,000	199,490,000	
第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,070,000	
第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,035,000	
第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,662,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,706,000	
第254号商工債（3年）	300,000,000	299,796,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	101,403,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	114,191,000	
第53回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,082,000	
第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,586,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	198,210,000	
第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	494,380,000	
第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,605,000	
第60回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,916,000	
第63回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,870,000	
第57回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	400,000,000	403,776,000	
第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,943,000	
第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,892,000	
第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	195,450,000	
特殊債券合計	35,942,352,000	36,980,264,633	



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	99,949,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	300,000,000	298,851,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	99,707,000	
	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	400,948,000	
	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	99,681,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,228,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,912,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,560,000	
	第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債	400,000,000	398,896,000	
	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	400,164,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,584,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,587,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,625,000	
	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	199,516,000	
	第11回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,967,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	298,587,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,138,000	
	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	100,150,000	
	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	199,630,000	
	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	100,198,000	
	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	199,748,000	
	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	101,214,000	
	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	198,694,000	
	第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,002,000	
	第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,518,000	
	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	99,063,000	
	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	99,918,000	
	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	99,772,000	
	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	199,804,000	
	第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,729,000	

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	99,831,000	
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	99,967,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,473,000	
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	99,950,000	
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	199,168,000	
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	200,016,000	
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	99,489,000	
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	94,665,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,717,000	
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,644,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,926,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	198,874,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	292,146,000	
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	100,005,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	97,367,000	
第15回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,647,000	
第19回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	95,762,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	101,780,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,316,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,792,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,902,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,405,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,834,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,871,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,637,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	106,228,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,699,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,636,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,925,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	98,730,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,218,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,606,000	
第20回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,856,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,792,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	98,019,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,566,000	

第19回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,481,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,104,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,684,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,068,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,669,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	197,304,000	
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	96,776,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,734,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	93,047,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,309,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,961,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	114,738,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	197,478,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,805,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,841,000	
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	99,064,000	
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	115,901,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	110,394,000	
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	101,061,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,021,000	
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	303,141,000	
第3回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,909,000	
第4回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,827,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,028,000	
第16回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,876,000	
第18回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	198,572,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	98,183,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,752,000	
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,676,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,865,000	
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,756,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,895,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,330,000	

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	99,567,000	
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	99,431,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,710,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,389,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,197,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,796,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,131,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	97,851,000	
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,732,000	
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	200,156,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,044,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,870,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,149,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,799,000	
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	99,593,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,066,000	
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	99,502,000	
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	199,268,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,472,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,466,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	94,791,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	97,953,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,409,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,419,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	97,945,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,124,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,123,000	
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,711,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	93,241,000	
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	199,582,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,490,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	95,304,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	89,256,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	96,525,000	

第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,656,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,912,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	226,562,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,427,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,563,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,741,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,950,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	93,133,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	94,911,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	90,900,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	112,448,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	94,040,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,441,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	499,605,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	94,679,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	124,613,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,499,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,241,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	98,727,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	85,310,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	81,620,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	92,467,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	98,555,000	
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	179,514,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,552,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,135,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,704,000	
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	397,488,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	196,382,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	98,173,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	97,538,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,372,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,747,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,126,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	93,436,000	

第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,359,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	200,926,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,999,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,184,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,645,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,170,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,693,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,334,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,813,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	198,230,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,742,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	103,266,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,050,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	197,888,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	128,162,160	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,870,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,733,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,713,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	198,214,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,685,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,415,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	99,026,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,648,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	200,718,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,450,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,752,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	197,442,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,953,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,399,000	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,928,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,482,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	98,097,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,732,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,444,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,399,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,272,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	201,630,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	301,308,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,327,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	301,164,000	

第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,183,000	
第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,549,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,685,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	287,919,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	92,418,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	197,232,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	196,464,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	94,245,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	100,931,000	
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	200,008,000	
社債券合計	29,026,000,000	28,936,145,160	
合計		620,030,733,901	

(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。

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 4月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	11,546,385,170
コール・ローン	89,793,202
株式	536,335,860,799
投資信託受益証券	222,937,828
投資証券	13,451,869,016
派生商品評価勘定	641,660,342
未収入金	4,598,752
未収配当金	603,780,957
差入委託証拠金	2,373,907,194
流動資産合計	565,270,793,260
資産合計	565,270,793,260
負債の部	
流動負債	

	2022年 4月20日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	31,333,226
前受金	610,323,948
未払解約金	74,672,397
未払利息	68
流動負債合計	716,329,639
負債合計	716,329,639
純資産の部	
元本等	
元本	123,929,377,953
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	440,625,085,668
元本等合計	564,554,463,621
純資産合計	564,554,463,621
負債純資産合計	565,270,793,260

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 4月20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</p>



	2022年 4月20日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 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 4月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	123,929,377,953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 4.5555円 (1万口当たり純資産額) (45,555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 4月20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 4月20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 4月20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 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年10月21日
期首元本額	127,550,881,460円
期中追加設定元本額	7,171,664,195円
期中一部解約元本額	10,793,167,702円
期末元本額	123,929,377,953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）	1,883,752,073円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,198,335円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	31,183,922,145円
世界経済インデックスファンド	10,148,182,733円
外国株式インデックス・オープン	866,234,559円
D C マイセレクション 2 5	809,746,907円
D C マイセレクション 5 0	3,603,129,814円
D C マイセレクション 7 5	4,354,963,264円
D C 外国株式インデックス・オープン	11,836,960,585円
D C マイセレクション S 2 5	393,795,788円
D C マイセレクション S 5 0	1,805,557,938円
D C マイセレクション S 7 5	1,545,479,518円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	45,545,235円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	160,766,060円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	117,032,282円
D C 世界経済インデックスファンド	9,573,353,890円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,492,962,985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）	29,940,584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）	10,814,723円

区分	2022年 4月20日現在
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	31,344,556円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	291,232,163円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	177,651,120円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,305,192,045円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	129,842,367円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	32,525,051円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	168,231,355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）	1,152,286,158円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,137,204,646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	1,459,650,384円
分散投資コア戦略ファンドS	8,123,388,172円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,255,679,732円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,070,738,627円
コア投資戦略ファンド（切替型）	575,048,113円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	599,012,567円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,223,026円
SMT インデックスバランス・オープン	156,547,017円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	391,684,846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	185,384,559円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	702,083,024円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	132,943,871円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,020,941円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	159,191,126円
グローバル経済コア	636,973,141円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	13,098,611円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,460,400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）	65,769,583円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	25,376,746円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	23,068,609円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	8,920,017円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	12,090,246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）	287,174,228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）	210,221,391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）	969,841,971円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,157,567,158円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	211,437,921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

区分	2022年 4月20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）	50,428,053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）	77,755,345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2020-05（適格機関投資家専用）	255,559,021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 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	18,261,690,311
投資信託受益証券	8,776,671
投資証券	1,501,785,488
合計	19,772,252,470

(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 4月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	13,952,005,212	-	14,562,329,160	610,323,948
	合計	13,952,005,212	-	14,562,329,160	610,323,948

## (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

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	124,243,200	-	124,246,368	3,168
	アメリカドル	124,243,200	-	124,246,368	3,168
	合計	124,243,200	-	124,246,368	3,168

## (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	36.74	2,306,831.12	
	CHENIERE ENERGY INC	19,034	139.13	2,648,200.42	
	CHEVRON CORP	150,711	171.83	25,896,671.13	
	CONOCOPHILLIPS	104,031	101.56	10,565,388.36	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	30.47	1,950,080.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	51,677	63.00	3,255,651.00	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	137.92	1,829,784.64	
	EOG RESOURCES INC	46,119	121.76	5,615,449.44	
	EXXON MOBIL	330,112	87.76	28,970,629.12	
	HALLIBURTON CO	68,269	41.31	2,820,192.39	
	HESS CORP	22,781	114.38	2,605,690.78	
	KINDER MORGAN INC	159,310	19.60	3,122,476.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	48,069	90.44	4,347,360.36	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	69,966	60.38	4,224,547.08	
	ONEOK INC	33,279	72.17	2,401,745.43	
	PHILLIPS 66	35,503	89.55	3,179,293.65	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	18,224	250.82	4,570,943.68	
	SCHLUMBERGER	107,126	43.43	4,652,482.18	
	VALERO ENERGY CORP	30,763	107.74	3,314,405.62	

WILLIAMS COS	98,553	35.41	3,489,761.73
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,541	249.57	4,377,707.37
ALBEMARLE CORP	9,440	218.15	2,059,336.00
AMCOR PLC	111,485	11.76	1,311,063.60
AVERY DENNISON CORP	6,638	169.03	1,122,021.14
BALL CORP	25,605	87.63	2,243,766.15
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	147.39	1,264,900.98
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	14,951	107.00	1,599,757.00
CORTEVA INC	58,500	61.14	3,576,690.00
CROWN HOLDINGS INC	9,940	120.63	1,199,062.20
DOW INC	57,346	67.05	3,845,049.30
DUPONT DE NEMOURS INC	40,980	69.27	2,838,684.60
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	109.57	1,213,487.75
ECOLAB INC	19,895	180.76	3,596,220.20
FMC CORP	10,507	139.33	1,463,940.31
FREEMONT-MCMORAN INC	113,194	50.64	5,732,144.16
INT'L PAPER CO	30,800	48.65	1,498,420.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,494	124.54	2,427,782.76
LINDE PLC	40,161	318.15	12,777,222.15
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,803	110.61	2,190,409.83
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,631	369.70	1,712,080.70
MOSAIC CO/THE	27,732	77.98	2,162,541.36
NEWMONT CORPORATION	61,555	82.86	5,100,447.30
NUCOR CORP	22,299	171.83	3,831,637.17
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	163.94	1,260,206.78
PPG INDUSTRIES INC	19,278	129.64	2,499,199.92
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	87.34	913,227.04
SEALED AIR CORP	11,690	67.70	791,413.00
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,719	252.25	4,974,117.75
STEEL DYNAMICS INC	15,552	91.98	1,430,472.96
VULCAN MATERIALS CO	10,247	177.21	1,815,870.87
WESTROCK CO	21,356	51.32	1,095,989.92
3 M COMPANY	44,860	150.10	6,733,486.00
AERCAP HOLDINGS NV	11,005	52.76	580,623.80
ALLEGION PLC	7,601	109.29	830,713.29
AMETEK INC	18,006	130.13	2,343,120.78
BOEING CO	43,246	185.98	8,042,891.08
CARRIER GLOBAL CORP	63,164	42.50	2,684,470.00
CATERPILLAR	42,499	232.16	9,866,567.84
CUMMINS INC	11,214	201.28	2,257,153.92
DEERE&CO	23,252	437.82	10,180,190.64
DOVER CORP	10,672	151.68	1,618,728.96

EATON CORP	31,624	145.77	4,609,830.48
EMERSON ELECTRIC CO	46,305	95.69	4,430,925.45
FASTENAL CO	44,846	56.70	2,542,768.20
FORTIVE CORP	25,722	59.08	1,519,655.76
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	71.73	739,536.30
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	267.20	1,392,379.20
GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	246.59	4,677,812.30
GENERAL ELECTRIC CO	85,187	91.90	7,828,685.30
GRAINGER (WW) INC	3,236	507.73	1,643,014.28
HEICO CORP	3,640	150.21	546,764.40
HEICO CORP-CLASS A	6,449	124.60	803,545.40
HONEYWELL INTL INC	53,646	197.20	10,578,991.20
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	36.64	1,157,604.16
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	224.11	789,315.42
IDEX CORP	5,916	193.61	1,145,396.76
ILLINOIS TOOL WORKS	24,227	203.39	4,927,529.53
INGERSOLL-RAND INC	31,562	47.95	1,513,397.90
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	56.03	991,731.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	56,689	63.53	3,601,452.17
KORNIT DIGITAL LTD	2,776	72.83	202,176.08
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,684	257.73	4,042,237.32
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	246.47	622,583.22
LOCKHEED MARTIN CORP	19,332	459.90	8,890,786.80
MASCO CORP	19,462	51.02	992,951.24
NORDSON CORP	4,121	223.14	919,559.94
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,737	464.41	5,450,780.17
OTIS WORLDWIDE CORP	30,653	75.37	2,310,316.61
OWENS CORNING	8,642	87.65	757,471.30
PACCAR INC	28,106	85.90	2,414,305.40
PARKER HANNIFIN CORP	9,900	282.95	2,801,205.00
PENTAIR PLC	14,533	53.62	779,259.46
PLUG POWER INC	41,884	28.05	1,174,846.20
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	117,233	104.55	12,256,710.15
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,098	270.91	2,464,739.18
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,314	462.75	3,847,303.50
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	48.24	667,062.72
SMITH (A.O.) CORP	9,016	65.37	589,375.92
SNAP-ON INC	4,000	226.87	907,480.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	144.56	1,821,166.88
SUNRUN INC	13,917	24.50	340,966.50
TEXTRON	16,934	70.09	1,186,904.06
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	149.73	2,790,667.74



TRANSDIGM GROUP INC	4,075	643.74	2,623,240.50
UNITED RENTALS INC	5,393	351.48	1,895,531.64
WABTEC CORP	15,024	90.95	1,366,432.80
XYLEM INC	13,269	85.34	1,132,376.46
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	87.38	992,986.32
CINTAS CORP	7,423	418.96	3,109,940.08
CLARIVATE PLC	27,357	17.07	466,983.99
COPART INC	16,617	120.42	2,001,019.14
COSTAR GROUP INC	32,116	63.33	2,033,906.28
EQUIFAX INC	9,509	218.43	2,077,050.87
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,661	147.35	1,570,898.35
LEIDOS HOLDINGS	11,220	109.61	1,229,824.20
REPUBLIC SERVICES INC	16,942	133.72	2,265,484.24
ROBERT HALF INTL INC	9,566	113.10	1,081,914.60
ROLLINS INC	17,468	34.59	604,218.12
TRANSUNION	15,741	95.07	1,496,496.87
VERISK ANALYTICS INC	12,503	215.33	2,692,270.99
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	138.37	2,943,821.75
WASTE MANAGEMENT INC	32,770	159.08	5,213,051.60
AMERCO	734	561.39	412,060.26
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,292	103.39	1,167,479.88
CSX CORP	173,146	35.29	6,110,322.34
DELTA AIR LINES INC	14,609	43.04	628,771.36
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	98.69	1,408,503.68
FEDEX CORP	19,524	208.81	4,076,806.44
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	83,011	3.29	273,106.19
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	173.88	1,226,201.76
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	47.31	506,217.00
LYFT INC-A	21,288	36.31	772,967.28
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	264.86	5,055,382.82
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	273.82	2,191,381.46
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	47.35	640,787.55
UBER TECHNOLOGIES INC	113,645	33.80	3,841,201.00
UNION PACIFIC CORP	50,721	245.62	12,458,092.02
UNITED PARCEL SERVICE B	56,644	190.69	10,801,444.36
APTIV PLC	20,714	110.47	2,288,275.58
BORGWARNER INC	19,781	38.43	760,183.83
FORD MOTOR COMPANY	305,209	16.15	4,929,125.35
GENERAL MOTORS CO	103,796	42.08	4,367,735.68
LEAR CORP	5,287	132.18	698,835.66
LUCID GROUP INC	31,234	21.41	668,719.94
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	13,363	39.15	523,161.45

TESLA INC	66,795	1,028.15	68,675,279.25
DR HORTON INC	27,764	74.12	2,057,867.68
GARMIN LTD	12,854	113.20	1,455,072.80
HASBRO INC	10,572	87.84	928,644.48
LENNAR CORP-CL A	20,844	79.55	1,658,140.20
LULULEMON ATHLETICA INC	9,305	404.66	3,765,361.30
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	127.88	647,328.56
NEWELL BRANDS INC	31,461	22.87	719,513.07
NIKE B	99,467	137.05	13,631,952.35
NVR INC	247	4,444.64	1,097,826.08
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	24.53	533,184.08
PULTE GROUP INC	21,609	43.69	944,097.21
VF CORP	25,718	57.37	1,475,441.66
WHIRLPOOL CORP	5,220	176.55	921,591.00
AIRBNB INC-CLASS A	23,026	170.12	3,917,183.12
ARAMARK	20,955	37.29	781,411.95
BOOKING HOLDINGS INC	3,187	2,239.38	7,136,904.06
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	71.75	1,259,930.00
CARNIVAL CORPORATION	62,102	19.91	1,236,450.82
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,164	1,632.03	3,531,712.92
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	135.40	1,450,404.80
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	394.08	1,122,339.84
DRAFTKINGS INC - CL A	27,674	16.88	467,137.12
EXPEDIA GROUP INC	11,638	186.34	2,168,624.92
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,878	163.14	3,569,176.92
LAS VEGAS SANDS CORP	24,370	38.24	931,908.80
MARRIOTT INTL A	21,139	188.78	3,990,620.42
MCDONALD'S CORP	58,134	255.40	14,847,423.60
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	6.84	120,808.08
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,874	42.77	1,234,940.98
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,767	84.48	1,416,476.16
STARBUCKS CORP	91,531	81.22	7,434,147.82
VAIL RESORTS INC	3,014	265.23	799,403.22
WYNN RESORTS LTD	9,302	77.80	723,695.60
YUM BRANDS INC	22,637	124.64	2,821,475.68
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,643	79.03	4,871,646.29
ALPHABET INC-CL A	23,507	2,600.18	61,122,431.26
ALPHABET INC-CL C	22,377	2,610.62	58,417,843.74
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	38,290	18.68	715,257.20
CABLE ONE INC	445	1,415.07	629,706.15
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	9,809	557.75	5,470,969.75
COMCAST CORP-CL A	356,721	48.11	17,161,847.31

DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	33.50	674,422.00
ELECTRONIC ARTS INC	21,814	124.04	2,705,808.56
FOX CORP - CLASS A	27,658	39.18	1,083,640.44
FOX CORP- CLASS B	10,345	36.20	374,489.00
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	97.17	653,079.57
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	35.55	1,202,798.70
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	134.54	346,978.66
LIBERTY BROADBAND-C	11,268	139.48	1,571,660.64
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	68.42	1,052,231.18
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	45.31	615,491.04
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	45.38	289,705.92
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,343	113.74	1,403,892.82
MATCH GROUP INC	20,191	93.91	1,896,136.81
META PLATFORMS INC-CLASS A	185,146	217.31	40,234,077.26
NETFLIX INC	34,441	348.61	12,006,477.01
NEWS CORP-CLASS A	33,479	21.73	727,498.67
OMNICOM GROUP	16,538	80.82	1,336,601.16
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	48,586	36.28	1,762,700.08
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	22.72	1,039,826.24
ROKU INC	9,122	116.78	1,065,267.16
SEA LTD-ADR	25,116	107.53	2,700,723.48
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	6.41	387,599.88
SNAP INC - A	83,375	33.63	2,803,901.25
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,973	140.37	1,259,540.01
THE WALT DISNEY CO	141,614	131.90	18,678,886.60
TWITTER INC	63,066	46.16	2,911,126.56
WARNER BROS DISCOVERY INC	175,398	24.49	4,295,497.02
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	21,935	56.68	1,243,275.80
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	222.90	1,186,719.60
AMAZON.COM	35,733	3,162.31	112,998,823.23
AUTOZONE INC	1,639	2,196.79	3,600,538.81
BATH & BODY WORKS INC	19,806	55.57	1,100,619.42
BEST BUY COMPANY INC	18,175	95.57	1,736,984.75
BURLINGTON STORES INC	5,108	227.54	1,162,274.32
CARMAX INC	12,051	96.29	1,160,390.79
CARVANA CO	5,700	101.77	580,089.00
CHEWY INC - CLASS A	6,878	42.39	291,558.42
DOLLAR GENERAL CORP	18,686	255.36	4,771,656.96
DOLLAR TREE INC	17,931	171.87	3,081,800.97
DOORDASH INC - A	8,334	106.51	887,654.34
EBAY	51,021	55.17	2,814,828.57
ETSY INC	10,294	115.29	1,186,795.26

FIVERR INTERNATIONAL LTD	1,486	63.80	94,806.80
GENUINE PARTS CO	10,119	133.82	1,354,124.58
HOME DEPOT	81,549	307.80	25,100,782.20
LKQ CORP	22,779	49.76	1,133,483.04
LOWES COMPANIES	52,191	203.04	10,596,860.64
MERCADOLIBRE INC	3,567	1,130.35	4,031,958.45
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,407	730.29	3,948,678.03
POOL CORP	3,304	429.79	1,420,026.16
ROSS STORES INC	28,076	107.36	3,014,239.36
TARGET (DAYTON HUDSON)	37,156	246.05	9,142,233.80
TJX COMPANIES INC	93,142	65.43	6,094,281.06
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	221.65	1,977,561.30
ULTA BEAUTY INC	3,990	428.37	1,709,196.30
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	106.60	639,600.00
COSTCO WHOLESALE CORP	34,433	594.30	20,463,531.90
KROGER CO	56,126	57.79	3,243,521.54
SYSCO CORP	40,288	88.10	3,549,372.80
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	45.60	2,725,375.20
WALMART INC	120,012	157.65	18,919,891.80
ALTRIA GROUP INC	142,972	55.22	7,894,913.84
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,967	95.93	4,121,824.31
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	68.03	1,633,128.18
BUNGE LIMITED	11,604	123.24	1,430,076.96
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	46.20	733,147.80
COCA-COLA CO	319,753	65.07	20,806,327.71
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	49.52	762,310.88
CONAGRA BRANDS INC	35,941	36.23	1,302,142.43
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	253.87	3,285,077.80
GENERAL MILLS INC	46,541	71.72	3,337,920.52
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,352	226.98	2,576,676.96
HORMEL FOODS CORP	23,338	53.73	1,253,950.74
JM SMUCKER CO	9,145	142.32	1,301,516.40
KELLOGG CO	21,630	68.30	1,477,329.00
KEURIG DR PEPPER INC	52,526	37.56	1,972,876.56
KRAFT HEINZ CO/THE	52,188	42.61	2,223,730.68
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,909	101.53	1,919,830.77
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	55.87	819,557.03
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	108,376	65.21	7,067,198.96
MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	83.80	2,703,974.60
PEPSICO INC	107,665	172.90	18,615,278.50
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	121,262	102.58	12,439,055.96
TYSON FOODS INC	21,804	97.48	2,125,453.92

CHURCH & DWIGHT CO INC	17,995	102.35	1,841,788.25
CLOROX COMPANY	9,570	145.31	1,390,616.70
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,788	80.61	5,141,950.68
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,438	274.56	5,062,337.28
KIMBERLY-CLARK CORP	25,886	126.87	3,284,156.82
PROCTER & GAMBLE CO	189,391	159.41	30,190,819.31
ABBOTT LABORATORIES	138,079	119.98	16,566,718.42
ABIOMED INC	3,781	323.42	1,222,851.02
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	424.54	2,523,041.22
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	162.85	2,100,113.60
ANTHEM INC	18,926	517.04	9,785,499.04
BAXTER INTERNATIONAL	38,403	76.51	2,938,213.53
BECTON DICKINSON & CO	22,232	263.49	5,857,909.68
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,802	45.72	5,157,307.44
CARDINAL HEALTH	21,902	62.72	1,373,693.44
CENTENE CORP	44,550	85.99	3,830,854.50
CERNER CORP	22,894	93.46	2,139,673.24
CIGNA CORP	26,327	261.03	6,872,136.81
CVS HEALTH CORP	102,569	103.86	10,652,816.34
DAVITA INC	5,784	120.76	698,475.84
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	42.20	750,062.80
DEXCOM INC	7,647	491.79	3,760,718.13
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	48,336	124.52	6,018,798.72
HCA HEALTHCARE INC	19,440	261.96	5,092,502.40
HENRY SCHEIN INC	11,747	88.92	1,044,543.24
HOLOGIC INC	19,018	76.28	1,450,693.04
HUMANA INC	9,953	458.69	4,565,341.57
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	500.85	3,381,238.35
INMODE LTD	5,500	30.88	169,840.00
INSULET CORP	5,311	270.83	1,438,378.13
INTUITIVE SURGICAL INC	27,694	294.86	8,165,852.84
LABORATORY CRP OF AMER	7,595	271.14	2,059,308.30
MASIMO CORP	4,147	136.33	565,360.51
MCKESSON CORP	12,089	324.70	3,925,298.30
MEDTRONIC PLC	104,586	110.22	11,527,468.92
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	335.57	1,525,165.65
NOVOCURE LTD	7,933	82.44	653,996.52
QUEST DIAGNOSTICS	10,005	135.88	1,359,479.40
RESMED INC	11,440	239.42	2,738,964.80
STERIS PLC	8,018	247.35	1,983,252.30
STRYKER CORP	26,295	271.67	7,143,562.65
TELADOC HEALTH INC	11,375	64.62	735,052.50

TELEFLEX INC	3,934	338.73	1,332,563.82
THE COOPER COS INC	4,134	410.77	1,698,123.18
UNITEDHEALTH GROUP INC	73,563	537.70	39,554,825.10
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	151.46	924,208.92
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	199.26	2,242,671.30
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,281	130.60	2,126,298.60
10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	63.71	360,280.05
ABBVIE INC	137,691	156.35	21,527,987.85
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	126.53	3,009,516.05
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	161.20	1,554,451.60
AMGEN	44,045	253.37	11,159,681.65
AVANTOR INC	42,980	31.67	1,361,176.60
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	556.46	1,031,120.38
BIO-TECHNE CORP	3,245	413.25	1,340,996.25
BIOGEN INC	11,860	223.02	2,645,017.20
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	80.58	1,191,214.14
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	172,791	76.40	13,201,232.40
CATALENT INC	13,739	95.33	1,309,738.87
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	288.55	1,213,064.20
DANAHER CORP	50,501	273.10	13,791,823.10
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	26.12	941,913.32
EXACT SCIENCES CORP	14,756	68.98	1,017,868.88
GILEAD SCIENCES INC	97,060	62.78	6,093,426.80
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	114.75	2,057,008.50
ILLUMINA INC	11,258	342.27	3,853,275.66
INCYTE CORP	15,212	79.47	1,208,897.64
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	237.87	3,598,021.62
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	166.54	827,870.34
JOHNSON & JOHNSON	205,370	183.08	37,599,139.60
LILLY (ELI) & CO	63,296	297.01	18,799,544.96
MERCK & CO	197,066	85.79	16,906,292.14
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,331.04	2,406,520.32
MODERNA INC	27,309	152.72	4,170,630.48
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	97.78	828,587.72
NOVAVAX INC	5,754	54.59	314,110.86
PERKINELMER INC	9,372	160.80	1,507,017.60
PFIZER	437,000	50.18	21,928,660.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,116	716.22	5,812,841.52
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,128	44.20	1,154,857.60
SEAGEN INC	10,071	144.29	1,453,144.59
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	10.18	818,482.18
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,643	574.15	17,593,678.45

VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,030	282.52	5,658,875.60
VIATRIS INC	90,748	10.92	990,968.16
WATERS CORP	4,749	300.80	1,428,499.20
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	371.00	2,139,557.00
ZOETIS INC	36,750	185.94	6,833,295.00
BANK OF AMERICA CORP	576,261	39.57	22,802,647.77
CITIGROUP	155,162	52.92	8,211,173.04
CITIZENS FINANCIAL GROUP	32,251	44.04	1,420,334.04
FIFTH THIRD BANCORP	52,803	40.79	2,153,834.37
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	656.50	623,675.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,787	163.21	2,250,176.27
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	14.07	1,605,555.84
JPMORGAN CHASE & CO	231,226	131.12	30,318,353.12
KEY CORP	71,472	21.43	1,531,644.96
M & T BANK CORP	14,037	162.04	2,274,555.48
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,936	178.05	5,864,254.80
REGIONS FINL CORP	70,814	21.68	1,535,247.52
SIGNATURE BANK	4,686	288.20	1,350,505.20
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	537.08	2,441,028.60
TRUIST FINANCIAL CORP	103,413	52.01	5,378,510.13
US BANCORP	109,092	52.88	5,768,784.96
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	52.26	745,906.98
WELLS FARGO & CO	311,895	47.83	14,917,937.85
ALLY FINANCIAL INC	27,761	44.81	1,243,970.41
AMERICAN EXPRESS	51,483	187.17	9,636,073.11
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	297.63	2,589,976.26
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	26,880	58.59	1,574,899.20
BANK NEW YORK CO	61,254	46.52	2,849,536.08
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	101,985	348.50	35,541,772.50
BLACKROCK INC	11,820	701.57	8,292,557.40
BLACKSTONE INC	54,507	117.48	6,403,482.36
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,256	141.59	4,708,717.04
CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	43.95	553,550.25
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	117.78	1,045,297.50
CME GROUP INC	27,828	234.10	6,514,534.80
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	2,868	151.27	433,842.36
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,403	118.75	2,779,106.25
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,355	31.84	870,983.20
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	434.49	1,367,774.52
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	26.76	697,633.20
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	34.39	148,427.24
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,636	335.95	8,948,364.20

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,703	122.93	5,495,339.79
INVESCO LTD	26,420	21.74	574,370.80
KKR & CO INC	39,913	56.43	2,252,290.59
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	263.71	845,717.97
MOODY'S CORP	13,365	333.54	4,457,762.10
MORGAN STANLEY	106,388	88.91	9,458,957.08
MSCI INC	6,518	490.52	3,197,209.36
NASDAQ INC	9,657	181.04	1,748,303.28
NORTHERN TRUST CORP	15,902	111.69	1,776,094.38
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	145.12	2,598,663.84
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	113.05	1,750,692.30
ROBINHOOD MARKETS INC - A	13,050	11.56	150,858.00
S&P GLOBAL INC	27,736	395.35	10,965,427.60
SCHWAB (CHARLES) CORP	112,432	76.90	8,646,020.80
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	59.12	564,596.00
SOFI TECHNOLOGIES INC	38,996	7.41	288,960.36
STATE STREET CORP	27,998	74.91	2,097,330.18
SYNCHRONY FINANCIAL	45,369	40.70	1,846,518.30
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	84.53	765,926.33
UPSTART HOLDINGS INC	3,148	87.50	275,450.00
AFLAC	50,591	65.49	3,313,204.59
ALLEGHANY CORP	906	837.28	758,575.68
ALLSTATE CORP	23,095	141.74	3,273,485.30
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	146.02	922,700.38
AMERICAN INT'L GROUP	65,898	63.61	4,191,771.78
AON PLC	17,508	330.79	5,791,471.32
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	48.92	1,454,195.92
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	179.50	2,936,440.50
ASSURANT INC	4,726	189.52	895,671.52
BROWN & BROWN INC	19,873	70.16	1,394,289.68
CHUBB LTD	33,670	209.92	7,068,006.40
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	138.84	1,775,902.44
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	179.00	387,714.00
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	291.13	957,235.44
FNF GROUP	20,461	42.57	871,024.77
GLOBE LIFE INC	8,106	102.69	832,405.14
HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,721	73.47	2,036,661.87
LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	67.52	910,439.68
LOEWS CORP	16,741	65.68	1,099,548.88
MARKEL CORP	1,156	1,471.74	1,701,331.44
MARSH & MCLENNAN COS	39,216	172.06	6,747,504.96
METLIFE INC	57,127	71.84	4,104,003.68



PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,719	75.17	1,557,447.23
PROGRESSIVE CORP	45,110	111.15	5,013,976.50
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,511	119.42	3,524,203.62
TRAVELERS COS INC/THE	19,772	176.16	3,483,035.52
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,061	235.20	2,366,347.20
MR BERKLEY CORP	17,572	69.20	1,215,982.40
CBRE GROUP INC-A	25,382	86.46	2,194,527.72
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.82	475,734.00
WEYERHAEUSER CO	58,295	41.43	2,415,161.85
ZILLOW GROUP INC-A	5,497	46.61	256,215.17
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	48.34	649,061.18
ACCENTURE PLC-CL A	49,381	320.57	15,830,067.17
ADOBE INC	37,107	436.40	16,193,494.80
AFFIRM HOLDINGS INC	12,816	37.03	474,576.48
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	121.34	1,659,081.82
ANSYS INC	6,794	291.46	1,980,179.24
ASANA INC - CL A	4,986	32.86	163,839.96
AUTODESK INC	17,467	203.80	3,559,774.60
AUTOMATIC DATA PROCESS	32,782	229.60	7,526,747.20
AVALARA INC	6,847	91.02	623,213.94
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	44.38	621,142.48
BILL.COM HOLDINGS INC	5,794	206.82	1,198,315.08
BLACK KNIGHT INC	11,543	68.09	785,962.87
BLOCK INC	39,674	125.62	4,983,847.88
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	154.64	1,506,502.88
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,922	155.62	3,411,501.64
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	61.32	654,161.76
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	144.28	1,172,130.72
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	101.94	1,064,661.36
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	111.15	2,254,455.45
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	40,421	85.74	3,465,696.54
COUPA SOFTWARE INC	6,059	99.27	601,476.93
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	14,479	228.66	3,310,768.14
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	175.81	545,011.00
DATADOG INC - CLASS A	17,059	137.28	2,341,859.52
DOCUSIGN INC	14,969	102.03	1,527,287.07
DROPBOX INC-CLASS A	28,845	23.18	668,627.10
DYNATRACE INC	14,790	42.87	634,047.30
EPAM SYSTEMS INC	4,403	297.98	1,312,005.94
FAIR ISAAC CORP	2,125	409.55	870,293.75
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	48,175	104.89	5,053,075.75
FISERV INC	46,421	102.45	4,755,831.45

FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	261.11	1,567,182.22
FORTINET INC	10,645	335.19	3,568,097.55
GARTNER INC	6,340	306.35	1,942,259.00
GLOBAL PAYMENTS INC	22,567	144.60	3,263,188.20
GODADDY INC - CLASS A	13,798	86.80	1,197,666.40
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	93.01	587,637.18
HUBSPOT INC	3,646	454.95	1,658,747.70
INTL BUSINESS MACHINES CORP	69,612	129.15	8,990,389.80
INTUIT INC	21,247	485.07	10,306,282.29
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	202.18	1,271,914.38
MASTERCARD INC-CLASS A	68,686	363.87	24,992,774.82
MICROSOFT CORP	558,777	285.30	159,419,078.10
MONGODB INC	4,623	416.00	1,923,168.00
NORTONLIFELOCK INC	43,549	26.87	1,170,161.63
OKTA INC	11,505	149.05	1,714,820.25
ORACLE CORP	128,255	79.56	10,203,967.80
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	12.91	1,616,900.04
PALO ALTO NETWORKS INC	7,648	628.56	4,807,226.88
PAYCHEX INC	25,433	137.46	3,496,020.18
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	318.97	1,350,837.95
PAYPAL HOLDINGS INC	88,224	103.66	9,145,299.84
PTC INC	8,304	99.92	829,735.68
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	105.44	674,077.92
SALESFORCE INC	76,228	191.39	14,589,276.92
SERVICENOW INC	15,383	514.40	7,913,015.20
SNOWFLAKE INC-CLASS A	16,606	197.43	3,278,522.58
SPLUNK INC	13,355	136.44	1,822,156.20
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	71.80	1,388,253.00
SYNOPSYS INC	12,038	306.33	3,687,600.54
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,090	66.89	2,213,390.10
TWILIO INC - A	12,842	145.17	1,864,273.14
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	410.79	1,371,627.81
UNITY SOFTWARE INC	4,329	91.64	396,709.56
VERISIGN INC	7,790	218.28	1,700,401.20
VISA INC-CLASS A SHARES	130,637	215.70	28,178,400.90
VMWARE INC-CLASS A	16,717	111.67	1,866,787.39
WESTERN UNION CO	29,297	19.24	563,674.28
WIX.COM LTD	5,010	94.15	471,691.50
WORKDAY INC-CLASS A	14,681	224.62	3,297,646.22
ZENDESK INC	8,890	129.12	1,147,876.80
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,028	111.18	1,893,173.04
ZSCALER INC	6,234	228.79	1,426,276.86

AMPHENOL CORPORATION	45,988	71.11	3,270,206.68
APPLE INC	1,284,469	167.40	215,020,110.60
ARISTA NETWORKS INC	18,880	128.84	2,432,499.20
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	112.03	683,383.00
CDW CORP/DE	10,882	173.94	1,892,815.08
CISCO SYSTEMS	328,253	51.83	17,013,352.99
COGNEX CORP	14,352	71.98	1,033,056.96
CORNING	64,989	34.71	2,255,768.19
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	47.99	1,078,863.19
F5 INC	4,150	202.46	840,209.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	98,742	16.11	1,590,733.62
HP INC	92,346	38.69	3,572,866.74
IPG PHOTONICS CORP	3,207	100.24	321,469.68
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	35.77	905,732.17
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	148.36	2,223,768.04
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,961	234.22	3,035,725.42
NETAPP INC	18,303	77.11	1,411,344.33
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	15,060	84.13	1,266,997.80
TE CONNECTIVITY LTD	26,068	124.38	3,242,337.84
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	482.46	1,881,111.54
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	69.31	1,467,708.56
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	48.95	1,262,420.50
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	406.62	1,692,352.44
AT&T INC	555,579	19.49	10,828,234.71
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	25.49	395,502.84
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	26.29	722,633.23
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	11.53	850,556.57
T-MOBILE US INC	49,657	132.84	6,596,435.88
VERIZON COMMUNICATIONS	322,452	53.75	17,331,795.00
AES CORP	54,375	24.42	1,327,837.50
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	63.88	1,327,298.64
AMEREN CORPORATION	20,898	96.62	2,019,164.76
AMERICAN ELECTRIC POWER	38,104	102.43	3,902,992.72
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,174	164.38	2,329,922.12
ATMOS ENERGY CORP	9,688	120.61	1,168,469.68
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	32.17	1,549,371.54
CMS ENERGY CORP	23,697	72.31	1,713,530.07
CONSOLIDATED EDISON INC	27,507	98.01	2,695,961.07
CONSTELLATION ENERGY	25,732	66.71	1,716,581.72
DOMINION ENERGY INC	62,375	86.97	5,424,753.75
DTE ENERGY COMPANY	14,651	137.77	2,018,468.27
DUKE ENERGY CORP	59,845	114.47	6,850,457.15

EDISON INTL	28,027	71.81	2,012,618.87
ENERGY CORP	15,166	124.55	1,888,925.30
ESSENTIAL UTILITIES INC	17,002	49.23	837,008.46
EVERGY INC	18,475	71.11	1,313,757.25
EVERSOURCE ENERGY	26,753	92.50	2,474,652.50
EXELON CORP	77,196	49.50	3,821,202.00
FIRSTENERGY CORP	41,156	47.50	1,954,910.00
NEXTERA ENERGY INC	152,538	81.83	12,482,184.54
NISOURCE INC	28,687	31.77	911,385.99
NRG ENERGY INC	19,068	39.71	757,190.28
PG&E CORP	118,132	12.31	1,454,204.92
PPL CORPORATION	58,459	29.83	1,743,831.97
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	73.08	2,884,321.44
SEMPRA ENERGY	24,535	170.27	4,177,574.45
SOUTHERN CO	84,113	76.27	6,415,298.51
UGI CORP	18,019	36.72	661,657.68
VISTRA CORP	37,797	24.82	938,121.54
WEC ENERGY GROUP INC	24,561	104.52	2,567,115.72
XCEL ENERGY INC	43,741	74.84	3,273,576.44
ADVANCED MICRO DEVICES	127,867	96.93	12,394,148.31
ANALOG DEVICES	41,625	162.32	6,756,570.00
APPLIED MATERIALS	71,368	117.06	8,354,338.08
BROADCOM INC	32,460	597.62	19,398,745.20
ENPHASE ENERGY INC	10,113	195.60	1,978,102.80
ENTEGRIS INC	10,491	116.60	1,223,250.60
INTEL CORP	318,822	47.93	15,281,138.46
KLA CORP	12,119	337.82	4,094,040.58
LAM RESEARCH CORP	10,992	479.19	5,267,256.48
MARVELL TECHNOLOGY INC	63,360	63.77	4,040,467.20
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	42,031	68.90	2,895,935.90
MICRON TECHNOLOGY	87,336	72.73	6,351,947.28
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	437.45	1,544,635.95
NVIDIA CORP	196,119	221.98	43,534,495.62
NXP SEMICONDUCTORS NV	20,848	178.65	3,724,495.20
ON SEMICONDUCTOR CORP	31,766	56.38	1,790,967.08
QORVO INC	8,556	117.34	1,003,961.04
QUALCOMM	87,800	141.05	12,384,190.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	122.00	1,631,384.00
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	3,750	304.82	1,143,075.00
TERADYNE INC	12,318	112.61	1,387,129.98
TEXAS INSTRUMENTS	71,796	179.06	12,855,791.76
	25,007,719		3,049,035,324.58

	アメリカドル 小計			(394,636,642,060)
カナダドル	CAMECO CORP	26,880	38.14	1,025,203.20
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,194	84.50	7,874,893.00
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	22.65	2,189,484.90
	ENBRIDGE	156,497	58.57	9,166,029.29
	IMPERIAL OIL	16,573	63.79	1,057,191.67
	KEYERA CORP	18,607	34.00	632,638.00
	PARKLAND CORP	14,075	36.50	513,737.50
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	50.23	2,293,803.18
	SUNCOR ENERGY	116,208	42.97	4,993,457.76
	TC ENERGY CORP	77,328	72.39	5,597,773.92
	TOURMALINE OIL CORP	22,173	63.19	1,401,111.87
	AGNICO EAGLE MINES	36,354	80.92	2,941,765.68
	BARRICK GOLD CORP	139,009	31.55	4,385,733.95
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	56.93	748,003.27
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	42.15	1,812,450.00
	FRANCO-NEVADA CORP	15,363	208.31	3,200,266.53
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	11.95	619,571.65
	KINROSS GOLD CORP	108,451	7.62	826,396.62
	LUNDIN MINING CORP	62,243	13.92	866,422.56
	NUTRIEN LTD	44,786	143.04	6,406,189.44
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	36.17	665,925.87
	TECK RESOURCES LTD-CL B	34,747	54.49	1,893,364.03
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	101.20	789,360.00
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,238	64.02	2,191,916.76
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	19,724	13.09	258,187.16
	CAE INC	25,999	34.42	894,885.58
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,585	123.29	688,574.65
	WSP GLOBAL INC	8,602	164.92	1,418,641.84
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	42.25	570,586.25
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	70.55	722,784.75
	THOMSON REUTERS CORP	13,293	134.27	1,784,851.11
	AIR CANADA	13,805	23.94	330,491.70
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	55,489	160.70	8,917,082.30
	CP RAILWAY LIMITED	73,737	98.00	7,226,226.00
	TFI INTERNATIONAL INC	5,837	105.06	613,235.22
	MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	80.20	1,867,216.40
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	46.09	787,171.11
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	75.98	1,753,086.54
	QUEBECOR INC -CL B	15,200	32.49	493,848.00
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	38.92	1,378,624.24
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,579	190.64	682,300.56

DOLLARAMA INC	22,000	75.14	1,653,080.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	67,467	58.18	3,925,230.06
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	44.00	671,132.00
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	118.42	1,529,157.46
METRO INC	18,840	72.83	1,372,117.20
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	159.62	834,174.12
SAPUTO INC	20,898	30.89	645,539.22
BAUSCH HEALTH COS INC	20,800	27.95	581,360.00
CANOPY GROWTH CORP	20,989	7.50	157,417.50
BANK MONTREAL	51,389	144.54	7,427,766.06
BANK NOVA SCOTIA	96,500	85.83	8,282,595.00
CANADIAN IMPERIAL BANK	34,494	145.99	5,035,779.06
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	94.61	2,581,812.29
ROYAL BANK OF CANADA	110,677	138.72	15,353,113.44
TORONTO-DOMINION BANK	141,487	94.45	13,363,447.15
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	110,505	69.19	7,645,840.95
IGM FINANCIAL INC	7,685	43.37	333,298.45
ONEX CORP	6,603	81.36	537,220.08
TMX GROUP LTD	4,685	129.27	605,629.95
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	711.49	1,517,608.17
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	37.01	880,393.88
IA FINANCIAL CORP INC	10,099	74.29	750,254.71
INTACT FINANCIAL CORP	13,312	179.99	2,396,026.88
MANULIFE FINANCIAL CORP	147,886	26.88	3,975,175.68
POWER CORP OF CANADA	43,577	39.01	1,699,938.77
SUN LIFE FINANCIAL INC	45,702	68.46	3,128,758.92
FIRSTSERVICE CORP	2,690	172.54	464,132.60
BLACKBERRY LIMITED	39,400	8.35	328,990.00
CGI INC - CL A	16,178	102.57	1,659,377.46
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,527	2,272.62	3,470,290.74
LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	32.05	265,886.80
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	86.80	373,326.80
OPEN TEXT CORP	20,463	53.11	1,086,789.93
SHOPIFY INC - CLASS A	8,756	764.63	6,695,100.28
BCE INC	6,203	73.28	454,555.84
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	26,167	73.79	1,930,862.93
TELUS CORP	32,908	33.58	1,105,050.64
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	19.65	1,018,223.70
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	30.98	755,757.10
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	49.21	555,826.95
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	39.27	405,423.48
EMERA INC	18,723	64.49	1,207,446.27

	FORTIS INC	36,823	63.62	2,342,679.26
	HYDRO ONE LTD	23,269	34.69	807,201.61
	NORTHLAND POWER INC	17,854	39.95	713,267.30
	カナダドル 小計	3,100,298		207,004,540.75 (21,249,016,107)
ユーロ	ENI	197,669	14.15	2,797,016.35
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	27,945	11.77	329,052.37
	NESTE OIL OYJ	32,126	43.63	1,401,657.38
	OMV AG	12,549	45.20	567,214.80
	REPSOL SA	111,112	13.64	1,516,123.24
	TENARIS SA	40,648	15.02	610,736.20
	TOTALENERGIES SE	194,564	47.34	9,211,632.58
	AIR LIQUIDE	36,913	160.90	5,939,301.70
	AKZO NOBEL	15,301	76.80	1,175,116.80
	ARCELORMITTAL	55,231	30.41	1,679,850.86
	ARKEMA	4,369	109.15	476,876.35
	BASF SE	71,168	52.19	3,714,257.92
	COVESTRO AG	14,454	44.76	646,961.04
	CRH PLC	59,653	36.49	2,177,036.23
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	24.62	394,830.94
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	30.06	173,205.72
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	51.70	674,219.70
	KONINKLIJKE DSM NV	13,707	155.10	2,125,955.70
	LANXESS	7,293	35.71	260,433.03
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	38.55	751,879.20
	SOLVAY SA	5,356	88.06	471,649.36
	STORA ENSO OYJ R	42,169	19.68	829,885.92
	SYMRISE AG	9,776	107.80	1,053,852.80
	UMICORE	17,605	38.46	677,088.30
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	30.65	1,297,230.60
	VOESTALPINE AG	7,152	25.04	179,086.08
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	21,143	24.74	523,077.82
	AIRBUS SE	45,872	104.22	4,780,779.84
	ALSTOM	24,388	21.53	525,073.64
	BOUYGUES ORD	16,606	31.48	522,756.88
	BRENTAG SE	12,514	73.72	922,532.08
	CNH INDUSTRIAL NV	81,026	14.50	1,175,282.13
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,388	24.52	818,673.76
	DASSAULT AVIATION SA	2,130	159.30	339,309.00
	EIFFAGE	5,924	92.92	550,458.08
	FERROVIAL SA	33,914	25.34	859,380.76
	GEA GROUP AG	13,382	37.68	504,233.76

IMCD NV	4,641	148.70	690,116.70
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	85.64	1,061,764.72
KION GROUP AG	5,887	55.00	323,785.00
KNORR-BREMSE AG	5,022	69.66	349,832.52
KONE OYJ-B	26,311	46.42	1,221,356.62
LEGRAND SA	21,768	82.16	1,788,458.88
MTU AERO ENGINES AG	3,962	190.20	753,572.40
PRYSMIAN SPA	21,155	29.88	632,111.40
RATIONAL AG	483	621.00	299,943.00
SAFRAN SA	26,190	102.80	2,692,332.00
SAINT-GOBAIN	40,093	51.58	2,067,996.94
SCHNEIDER ELECTRIC SE	41,726	140.74	5,872,517.24
SIEMENS	59,486	117.12	6,967,000.32
SIEMENS ENERGY AG	26,851	19.56	525,205.56
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	15.40	345,499.00
THALES SA	7,437	129.00	959,373.00
VINCI S.A.	41,084	89.24	3,666,336.16
WARTSILA OYJ	41,917	8.49	355,959.16
BUREAU VERITAS SA	25,073	25.22	632,341.06
RANDSTAD NV	7,558	51.84	391,806.72
TELEPERFORMANCE	4,734	325.30	1,539,970.20
WOLTERS KLUWER	20,839	96.58	2,012,630.62
ADP	2,382	143.85	342,650.70
AENA SME SA	5,508	150.15	827,026.20
ATLANTIA SPA	35,937	22.78	818,644.86
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	7.20	326,560.28
DEUTSCHE POST AG-REG	78,714	41.40	3,259,153.17
GETLINK	29,362	17.17	504,292.35
INPOST SA	12,480	5.42	67,741.44
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	78.02	2,036,868.14
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	69.25	345,626.75
CONTINENTAL AG	8,168	65.98	538,924.64
FAURECIA	10,948	22.53	246,658.44
FERRARI NV	10,170	205.60	2,090,952.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	66,777	64.28	4,292,425.56
MICHELIN	13,839	121.40	1,680,054.60
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	82.12	964,499.40
RENAULT SA	17,362	22.74	394,898.69
STELLANTIS NV	159,744	13.34	2,132,262.91
VALEO SA	21,538	17.04	367,007.52
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,282	153.00	2,185,146.00
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	214.60	533,495.60



ADIDAS AG	14,703	203.70	2,995,001.10
ESSILORLUXOTTICA	22,072	165.25	3,647,398.00
HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,237.00	3,140,743.00
KERING	5,855	529.90	3,102,564.50
LVMH	21,584	634.10	13,686,414.40
MONCLER SPA	14,361	49.65	713,023.65
PUMA SE	9,220	75.44	695,556.80
SEB SA	2,282	125.20	285,706.40
ACCOR	14,436	29.67	428,316.12
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,048	102.15	1,332,853.20
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	35.69	289,374.52
SODEXO	6,027	70.76	426,470.52
BOLLORE SE	83,646	4.48	374,901.37
PUBLICIS GROUPE	17,077	55.88	954,262.76
SCOUT24 SE	7,492	59.54	446,073.68
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	36.63	259,010.73
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	61,243	24.46	1,498,003.78
VIVENDI SE	61,243	11.89	728,179.27
DELIVERY HERO SE	13,414	35.50	476,197.00
INDITEX	87,326	20.77	1,813,761.02
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	26.10	406,429.20
PROSUS	72,497	44.88	3,253,665.36
ZALANDO SE	17,664	43.44	767,324.16
CARREFOUR	52,544	20.60	1,082,406.40
COLRUYT SA	5,424	34.94	189,514.56
HELLOFRESH SE	13,805	39.22	541,432.10
JERONIMO MARTINS	24,901	20.86	519,434.86
KESKO OYJ-B SHS	20,083	23.88	479,582.04
KONINKLIJKE AHOLD NV	79,170	28.46	2,253,574.05
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	68,711	54.58	3,750,246.38
DANONE (GROUPE)	51,543	52.63	2,712,708.09
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	10.45	513,100.03
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	72.05	666,534.55
HEINEKEN NV	20,157	89.34	1,800,826.38
JDE PEET'S BV	7,000	27.24	190,680.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	100.05	1,305,652.50
PERNOD-RICARD	15,976	191.15	3,053,812.40
REMY COINTREAU	1,382	186.90	258,295.80
BEIERSDORF AG	7,430	93.36	693,664.80
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	58.30	511,874.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	58.60	846,125.40
LOREAL	19,839	350.95	6,962,497.05

AMPLIFON SPA	11,650	40.82	475,553.00
BIOMERIEUX	3,044	95.70	291,310.80
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	131.25	450,187.50
DIASORIN SPA	2,070	134.15	277,690.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	14,472	62.46	903,921.12
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	34.36	1,157,554.04
KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	27.39	1,965,728.22
ORPEA	4,336	35.21	152,670.56
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	374.80	683,635.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	55.82	1,203,869.94
ARGENX SE	3,428	297.80	1,020,858.40
BAYER	76,002	66.42	5,048,052.84
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	94.88	969,673.60
GRIFOLS SA	27,685	16.04	444,067.40
IPSEN	3,532	115.20	406,886.40
MERCK KGAA	10,555	179.95	1,899,372.25
ORION OYJ-CLASS B	9,854	42.27	416,528.58
QIAGEN N.V.	17,038	43.29	737,575.02
RECORDATI SPA	9,859	48.14	474,612.26
SANOFI	88,048	102.54	9,028,441.92
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,939	337.40	654,218.60
UCB (GROUPE)	9,389	115.30	1,082,551.70
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	11.85	473,263.45
BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	5.08	2,718,189.01
BANCO SANTANDER SA	1,339,491	3.16	4,235,470.54
BNP PARIBAS	86,730	49.74	4,314,383.85
CAIXABANK	330,447	3.03	1,002,906.64
COMMERZBANK AG	81,889	6.52	533,916.28
CREDIT AGRICOLE SA	89,515	10.05	899,625.75
ERSTE GROUP BANK AG	23,905	31.89	762,330.45
FINECOBANK SPA	53,120	13.78	732,259.20
ING GROEP NV-CVA	301,618	9.55	2,880,451.90
INTESA SANPAOLO	1,251,055	1.97	2,468,331.51
KBC GROEP NV	18,608	64.00	1,190,912.00
MEDIOBANCA	53,990	9.23	498,651.64
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	11.32	141,386.80
SOCIETE GENERALE	63,329	23.17	1,467,332.93
UNICREDIT SPA	168,352	9.28	1,563,653.37
AMUNDI SA	4,626	60.50	279,873.00
DEUTSCHE BANK NAMEN	160,613	11.00	1,767,064.22
DEUTSCHE BOERSE	14,999	163.80	2,456,836.20
EURAZEO SA	3,357	77.50	260,167.50

EURONEXT NV	6,480	80.70	522,936.00
EXOR NV	7,825	68.94	539,455.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	93.82	798,877.30
SOFINA	1,238	314.40	389,227.20
WENDEL	2,023	95.00	192,185.00
AEGON	114,647	5.24	600,750.28
AGEAS	11,086	47.11	522,261.46
ALLIANZ SE-REG	32,037	218.05	6,985,667.85
ASSICURAZIONI GENERALI	85,637	18.75	1,605,693.75
AXA SA	148,584	26.59	3,950,848.56
CNP ASSURANCES	16,287	21.82	355,382.34
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	144.40	625,685.20
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,795	238.50	2,574,607.50
NN GROUP NV	22,611	47.81	1,081,031.91
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.65	444,421.89
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	47.33	1,829,541.15
AROUNDTOWN SA	64,068	4.93	316,047.44
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	99.14	522,963.50
VONOVIA SE	59,080	39.13	2,311,800.40
ADYEN NV	1,566	1,665.80	2,608,642.80
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	56.84	2,022,594.56
BECHTLE AG	7,659	44.65	341,974.35
CAPGEMINI SA	12,715	187.80	2,387,877.00
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	40.24	2,123,607.91
EDENRED	18,664	49.28	919,761.92
NEMETSCHKE SE	5,455	83.28	454,292.40
NEXI SPA	31,458	9.04	284,380.32
SAP SE	81,213	97.17	7,891,467.21
WORLDLINE SA	20,332	35.02	712,026.64
NOKIA OYJ	427,600	4.86	2,078,563.60
CELLNEX TELECOM SA	41,435	45.28	1,876,176.80
DEUTSCHE TELEKOM	258,113	17.13	4,423,024.36
ELISA A	10,227	55.50	567,598.50
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	10.43	316,963.12
KPN (KON.)	282,927	3.34	946,673.74
ORANGE	153,815	11.17	1,718,113.55
PROXIMUS	13,141	17.24	226,616.54
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.30	260,880.91
TELEFONICA	417,939	4.94	2,065,872.47
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.76	273,144.40
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	30.99	294,807.87
E.ON SE	170,377	10.10	1,720,807.70

	EDP RENOVAVEIS SA	21,466	22.80	489,424.80
	ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	8.65	341,856.65
	ELIA GROUP SA/NV	2,925	154.00	450,450.00
	ENAGAS	15,690	20.95	328,705.50
	ENDESA	25,972	19.44	504,895.68
	ENEL	617,915	6.18	3,819,332.61
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.69	1,059,910.33
	ENGIE	141,564	11.68	1,654,316.90
	FORTUM OYJ	32,550	15.82	514,941.00
	IBERDROLA SA	449,446	10.46	4,703,452.39
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	29.11	291,391.10
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	19.15	587,637.09
	RWE STAMM	49,680	40.20	1,997,136.00
	SNAM SPA	147,559	5.35	790,621.12
	TERNA SPA	102,810	8.08	831,527.28
	UNIPER SE	7,335	23.20	170,172.00
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,027	27.34	1,395,078.18
	VERBUND AG	6,430	95.40	613,422.00
	ASM INTERNATIONAL NV	3,483	298.35	1,039,153.05
	ASML HOLDING NV	32,248	561.60	18,110,476.80
	INFINEON TECHNOLOGIES	101,861	27.68	2,819,512.48
	STMICROELECTRONICS	55,076	34.59	1,905,354.22
	ユーロ 小計	14,428,349		349,307,685.49 (48,808,762,893)
イギリスポンド	BP PLC	1,555,608	4.01	6,238,765.88
	SHELL PLC-NEW	598,230	22.28	13,328,564.40
	ANGLO AMERICAN PLC	102,156	41.55	4,244,581.80
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	16.87	604,890.72
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	74.18	810,342.32
	GLENCORE PLC	767,331	5.35	4,109,824.83
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	19.14	322,470.72
	MONDI PLC	36,710	14.43	529,725.30
	RIO TINTO PLC REG	87,100	61.42	5,349,682.00
	ASHTREAD GROUP PLC	34,104	45.92	1,566,055.68
	BAE SYSTEMS PLC	260,104	7.60	1,976,790.40
	BUNZL PLC	24,880	30.67	763,069.60
	DCC PLC	6,622	59.00	390,698.00
	FERGUSON PLC	17,761	102.50	1,820,502.50
	MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	1.21	388,369.16
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	0.95	607,293.09
	SMITHS GROUP PLC	26,476	14.53	384,828.66
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	124.65	687,320.10

EXPERIAN PLC	74,115	27.11	2,009,257.65
INTERTEK GROUP PLC	13,890	49.43	686,582.70
RELX PLC	149,517	23.99	3,586,912.83
RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	5.14	722,067.20
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	5.15	377,136.70
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7,688	39.87	306,520.56
BURBERRY GROUP PLC	29,776	16.11	479,691.36
PERSIMMON PLC	25,686	21.85	561,239.10
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.32	348,881.38
COMPASS GROUP PLC	142,427	16.69	2,377,818.76
ENTAIN PLC	49,630	15.74	781,176.20
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,541	51.84	650,125.44
WHITBREAD PLC	17,434	29.10	507,329.40
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.42	465,206.04
INFORMA PLC	110,598	5.97	660,712.45
PEARSON	66,305	7.67	508,559.35
WPP PLC	95,821	9.77	936,937.73
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.43	295,863.16
KINGFISHER PLC	153,717	2.59	399,356.76
NEXT PLC	11,468	62.38	715,373.84
OCADO GROUP PLC	35,862	11.43	409,902.66
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.44	363,272.41
TESCO PLC	601,050	2.70	1,624,638.15
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	16.30	419,690.70
BRITISH AMERICAN TOBACCO	168,277	32.77	5,514,437.29
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	15.71	282,241.40
DIAGEO	180,509	38.67	6,981,185.57
IMPERIAL BRANDS PLC	76,080	16.75	1,274,720.40
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	54,630	59.50	3,250,485.00
UNILEVER PLC	201,915	34.21	6,908,521.72
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	12.34	846,462.30
ASTRAZENECA	120,234	105.00	12,624,570.00
GLAXOSMITHKLINE	388,893	17.59	6,842,961.22
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	20.81	342,407.74
BARCLAYS	1,339,545	1.45	1,951,717.06
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,583,882	5.25	8,324,883.79
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,443,807	0.45	2,469,855.23
NATWEST GROUP PLC	443,701	2.20	977,917.00
STANDARD CHARTERED PLC	212,446	5.08	1,080,075.46
3I GROUP PLC	74,757	13.34	997,632.16
ABRDN PLC	153,430	1.93	296,426.76
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	9.59	317,293.76

	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	24,732	79.60	1,968,667.20
	M&G PLC	229,107	2.09	480,208.27
	SCHRODERS PLC	11,794	31.12	367,029.28
	ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	13.57	555,679.05
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	24.44	397,272.20
	AVIVA PIC	296,550	4.35	1,292,364.90
	LEGAL & GENERAL GROUP	460,759	2.71	1,251,882.20
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.16	314,370.16
	PRUDENTIAL	210,968	10.56	2,227,822.08
	AVEVA GROUP PLC	10,917	24.21	264,300.57
	SAGE GROUP PLC	76,660	7.20	552,105.32
	HALMA PLC	31,069	24.96	775,482.24
	BT GROUP PLC	716,738	1.85	1,332,057.57
	VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	1.30	2,874,547.83
	NATIONAL GRID PLC	286,046	11.68	3,341,017.28
	SEVERN TRENT PLC	22,468	30.29	680,555.72
	SSE PLC	81,663	17.85	1,457,684.55
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	11.12	651,702.50
	イギリスポンド 小計	22,479,764		146,386,570.47 (24,664,673,258)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	15.93	277,150.14
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	860.50	493,927.00
	GIVAUDAN-REG	748	3,806.00	2,846,888.00
	HOLCIM LTD	40,627	43.93	1,784,744.11
	SIKA AG-BR	10,926	311.20	3,400,171.20
	ABB LTD	127,656	29.80	3,804,148.80
	GEBERIT AG-REG	2,964	546.00	1,618,344.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,375	189.80	260,975.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	191.60	592,427.20
	VAT GROUP AG	1,956	316.80	619,660.80
	ADECCO GROUP AG-REG	10,450	38.26	399,817.00
	SGS SA	506	2,513.00	1,271,578.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	265.80	1,216,566.60
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,341	119.60	4,944,383.60
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	256.10	635,896.30
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	49.06	193,198.28
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,232.00	624,960.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	112,800.00	902,400.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,960.00	898,720.00
	NESTLE SA - REGISTERED	219,354	121.64	26,682,220.56
	ALCON INC	39,333	74.26	2,920,868.58
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,007	382.20	1,531,475.40

	STRAUMANN HOLDING AG-REG	854	1,273.00	1,087,142.00
	BACHEM HOLDING AG-REG B	370	484.60	179,302.00
	LONZA GROUP AG-REG	5,895	634.60	3,740,967.00
	NOVARTIS	170,286	87.09	14,830,207.74
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,799	409.40	1,145,910.60
	ROCHE HOLDING GENUSS	54,689	377.25	20,631,425.25
	VIFOR PHARMA AG/NEW	3,360	168.80	567,168.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	7.27	1,552,710.35
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	48.72	920,661.84
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	1,130.50	2,072,206.50
	UBS GROUP AG	271,096	16.82	4,559,834.72
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,174	173.20	549,736.80
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	617.80	1,494,458.20
	SWISS RE LTD	22,836	82.42	1,882,143.12
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,660	449.00	5,235,340.00
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	93.80	532,690.20
	TEMENOS AG - REG	5,150	94.94	488,941.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	66.98	983,668.28
	SWISSCOM	2,187	568.60	1,243,528.20
	スイスフラン 小計	1,344,888		121,618,562.37 (16,523,097,883)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	431.10	7,424,404.20
	BOLIDEN AB	18,479	502.80	9,291,241.20
	SCA SV CELLULOSA B	43,887	198.65	8,718,152.55
	ALFA LAVAL AB	27,268	311.00	8,480,348.00
	ASSA ABLOY AB-B	78,158	247.90	19,375,368.20
	ATLAS COPCO A	51,320	470.30	24,135,796.00
	ATLAS COPCO B	31,902	414.00	13,207,428.00
	EPIROC AB-A	46,999	198.45	9,326,951.55
	EPIROC AB-B	28,804	167.15	4,814,588.60
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	92.52	3,581,634.24
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	286.20	4,007,372.40
	LIFCO AB-B SHS	17,970	220.10	3,955,197.00
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	107,624	102.80	11,063,747.20
	SANDVIK AB	87,644	196.40	17,213,281.60
	SKANSKA B	25,507	199.45	5,087,371.15
	SKF AB-B	24,865	157.90	3,926,183.50
	VOLVO AB-A SHS	13,514	162.00	2,189,268.00
	VOLVO B	111,799	157.80	17,641,882.20
	SECURITAS B	29,533	116.60	3,443,547.80
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	154.02	3,275,851.38
	EVOLUTION AB	14,096	964.60	13,597,001.60

	EMBRACER GROUP AB	37,510	71.80	2,693,218.00	
	HENNES & MAURITZ B	55,229	131.16	7,243,835.64	
	SWEDISH MATCH AB	127,270	78.50	9,990,695.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	229.00	11,329,546.00	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	350.50	6,237,498.00	
	NORDEA BANK ABP	253,851	99.52	25,263,251.52	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	120,740	106.60	12,870,884.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	110,736	93.16	10,316,165.76	
	SWEDBANK AB-A	72,526	155.15	11,252,408.90	
	EQT AB	23,207	356.70	8,277,936.90	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	267.00	3,155,406.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	261.30	2,918,198.40	
	INVESTOR AB-A SHS	38,925	224.60	8,742,555.00	
	INVESTOR AB-B SHS	142,777	208.25	29,733,310.25	
	KINNEVIK AB - B	18,792	231.40	4,348,468.80	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	480.70	3,499,496.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	9,450	538.20	5,085,990.00	
	SAGAX AB-B	12,402	246.30	3,054,612.60	
	SINCH AB	44,150	56.98	2,515,667.00	
	ERICSSON (LM) B	225,508	81.98	18,487,145.84	
	HEXAGON AB-B SHS	153,838	131.25	20,191,237.50	
	TELE2 AB-B SHS	32,829	147.15	4,830,787.35	
	TELIA CO AB	230,643	39.41	9,089,640.63	
	スウェーデンクローナ 小計	2,658,493		414,884,571.46 (5,629,983,634)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	6,114	361.20	2,208,376.80	
	EQUINOR ASA	76,370	340.00	25,965,800.00	
	NORSK HYDRO	96,800	90.48	8,758,464.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	489.40	6,116,521.20	
	ADEVINTA ASA	19,117	70.55	1,348,704.35	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	180.10	1,670,247.40	
	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	197.70	1,400,111.40	
	MOWI ASA	31,968	254.70	8,142,249.60	
	ORKLA	69,804	78.06	5,448,900.24	
	DNB BANK ASA	71,795	194.15	13,938,999.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	210.40	3,907,969.60	
	TELENOR ASA	51,193	131.00	6,706,283.00	
	ノルウェークローネ 小計	470,589		85,612,626.84 (1,254,224,983)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	534.60	4,535,011.80	
	NOVOZYMES A/S	17,111	461.10	7,889,882.10	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,957.00	1,477,535.00	



	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	81,654	203.30	16,600,258.20
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	18,660.00	4,086,540.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	19,195.00	8,330,630.00
	DSV A/S	16,380	1,145.00	18,755,100.00
	PANDORA A/S	8,163	643.40	5,252,074.20
	CARLSBERG AS-B	7,077	853.60	6,040,927.20
	AMBU A/S-B	13,555	106.85	1,448,351.75
	COLOPLAST-B	9,208	1,082.50	9,967,660.00
	DEMANT A/S	8,512	297.20	2,529,766.40
	GN STORE NORD A/S	9,226	279.50	2,578,667.00
	GENMAB A/S	5,250	2,630.00	13,807,500.00
	NOVO NORDISK A/S-B	132,369	790.70	104,664,168.30
	DANSKE BANK A/S	56,132	112.70	6,326,076.40
	TRYG A/S	29,772	166.45	4,955,549.40
	ORSTED A/S	15,439	813.30	12,556,538.70
	デンマーククローネ 小計	419,739		231,802,236.45 (4,353,246,000)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	32.12	662,603.48
	SANTOS	236,159	8.32	1,964,842.88
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	28.80	369,014.40
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,404	32.91	2,448,635.64
	BHP GROUP LTD	397,288	53.17	21,123,802.96
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	22.00	764,940.00
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	4.68	571,680.72
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	127,366	21.73	2,767,663.18
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	40.89	1,510,803.72
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	61.66	888,458.94
	NEWCREST MINING LIMITED	61,178	28.84	1,764,373.52
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	11.48	1,166,689.44
	ORICA LTD	38,288	16.29	623,711.52
	RIO TINTO LTD	28,818	121.66	3,505,997.88
	SOUTH32 LTD	341,133	5.24	1,787,536.92
	REECE LTD	16,814	17.22	289,537.08
	BRAMBLES LTD	108,007	9.92	1,071,429.44
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.87	462,817.17
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.39	458,150.00
	TRANSURBAN GROUP	233,493	13.75	3,210,528.75
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	32.85	1,517,998.50
	CROWN RESORTS LTD	30,328	12.84	389,411.52
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	80.75	285,935.75
	IDP EDUCATION LTD	17,793	27.50	489,307.50
	TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	5.41	984,690.33

	REA GROUP LTD	3,586	127.36	456,712.96	
	SEEK LTD	28,001	28.23	790,468.23	
	WESFARMERS LTD	87,120	48.51	4,226,191.20	
	COLES GROUP LTD	108,486	18.34	1,989,633.24	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	7.81	858,326.81	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	38.61	3,857,177.61	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	45,808	11.10	508,468.80	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	224.45	1,073,544.35	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	64.39	1,046,208.72	
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	35.50	1,322,410.50	
	CSL LIMITED	37,659	262.35	9,879,838.65	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	225,511	27.75	6,257,930.25	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	134,082	107.01	14,348,114.82	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	253,530	33.25	8,429,872.50	
	WESTPAC BANKING	283,793	24.40	6,924,549.20	
	ASX LTD	14,549	82.37	1,198,401.13	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	27,074	205.55	5,565,060.70	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	168,725	4.38	739,015.50	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.17	736,020.11	
	QBE INSURANCE GROUP	111,591	12.26	1,368,105.66	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	11.18	1,060,579.52	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	25.75	1,142,682.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	46.35	639,676.35	
	XERO LTD	11,340	100.95	1,144,773.00	
	TELSTRA CORP	308,467	4.03	1,243,122.01	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	119,082	6.59	784,750.38	
	オーストラリアドル 小計	5,112,487		128,672,195.44 (12,317,789,269)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.69	906,427.99	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	22.26	889,954.80	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	9.02	327,579.34	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.85	839,622.30	
	MERCURY NZ LTD	64,613	5.90	381,216.70	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.85	536,138.40	
	ニュージーランドドル 小計	542,443		3,880,939.53 (339,077,686)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	193,996	57.10	11,077,171.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	111.80	11,962,600.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	17.36	2,985,920.00	
	MTR CORP	125,000	42.20	5,275,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	27.80	3,336,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	45.50	7,917,000.00	

	SANDS CHINA LTD	198,000	18.30	3,623,400.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	12.90	2,221,380.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	19.92	2,906,328.00	
	WH GROUP LTD	474,801	5.26	2,497,453.26	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	29.45	8,290,175.00	
	HANG SENG BANK	59,400	152.00	9,028,800.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,800	331.00	31,709,800.00	
	AIA GROUP LTD	933,800	78.35	73,163,230.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	55.15	9,071,954.40	
	ESR CAYMAN LTD	157,000	24.30	3,815,100.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	16.60	2,871,800.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	33.15	4,151,308.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	31.80	4,336,725.00	
	SINO LAND CO	315,400	10.72	3,381,088.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	95.30	10,292,400.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	44.95	1,820,475.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	20.05	1,928,810.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	38.15	4,539,850.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	53.50	3,611,250.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	76.45	10,511,875.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	8.98	8,123,819.86	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	52.35	5,863,200.00	
	香港ドル 小計	5,910,253		250,313,913.32 (4,130,179,569)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	137,300	6.60	906,180.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	4.05	596,970.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.44	589,326.08	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.79	485,850.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.53	809,058.00	
	DBS GROUP	141,500	33.00	4,669,500.00	
	OCBC BANK	257,100	11.90	3,059,490.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	30.43	2,857,377.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	45,100	9.92	447,392.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.97	887,295.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	8.33	356,524.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.05	334,875.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	16.96	435,872.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	584,543	2.58	1,508,120.94	
	シンガポールドル 小計	2,648,275		17,943,830.02 (1,697,127,443)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	42,053	40.90	1,719,967.70	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	716.00	1,536,536.00	

BANK HAPOALIM BM	98,310	31.41	3,087,917.10
BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	35.11	3,822,215.04
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	19.86	1,976,070.00
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	123.90	1,549,121.70
AZRIELI GROUP	4,323	288.30	1,246,320.90
NICE LTD	4,991	678.40	3,385,894.40
イスラエルシェケル 小計	372,690		18,324,042.84 (732,040,014)
合 計	84,495,987		536,335,860,799 (536,335,860,799)

## (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	917,892.30	
		LENDLEASE GROUP	64,786	735,321.10	
	オーストラリアドル 小計		147,479	1,653,213.40 (158,262,118)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,693,440.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	205,000	2,226,300.00	
	香港ドル 小計		425,500	3,919,740.00 (64,675,710)	
投資信託受益証券合計			572,979	222,937,828 (222,937,828)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	548,643.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,971	2,167,321.05	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	35,326	9,141,309.02	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	95,067	622,688.85	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,798,097.44	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	1,420,998.39	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	1,284,319.26	
		CROWN CASTLE INTL CORP	33,199	6,436,290.13	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	22,174	3,333,860.90	
		DUKE REALTY CORP	27,540	1,658,183.40	
		EQUINIX INC	7,120	5,370,046.40	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	1,143,685.30	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	27,140	2,468,654.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST	4,770	1,658,433.60	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	2,372,701.76	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,578,390.55	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,159,872.39			

	INVITATION HOMES INC	46,840	2,015,993.60
	IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,316,985.96
	KIMCO REALTY CORP	47,897	1,235,742.60
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	991,213.16
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,403	1,743,706.53
	PROLOGIS INC	57,379	9,729,183.24
	PUBLIC STORAGE	12,441	5,140,247.97
	REALTY INCOME CORP	44,162	3,273,287.44
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	896,162.93
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	3,097,690.53
	SIMON PROPERTY GROUP	25,518	3,351,023.76
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,705,942.35
	UDR INC	24,265	1,407,370.00
	VENTAS INC	31,565	1,911,576.40
	VICI PROPERTIES INC	51,921	1,553,476.32
	VORNADO REALTY TRUST	11,390	474,849.10
	WELLTOWER INC	32,739	3,168,480.42
	WP CAREY INC	14,258	1,215,209.34
	アメリカドル 小計	979,202	89,391,638.09 (11,569,959,717)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	256,127.67
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	387,714.70
	カナダドル 小計	20,377	643,842.37 (66,090,419)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	359,000.70
	GECINA SA	3,139	344,348.30
	KLEPIERRE	17,225	398,242.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	734,254.65
	ユーロ 小計	35,781	1,835,845.65 (256,522,712)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	406,917.33
	LAND SECURITIES GROUP PLC	46,289	350,500.30
	SEGRO PLC	93,383	1,265,339.65
	イギリスポンド 小計	219,086	2,022,757.28 (340,814,374)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	1,017,112.90
	GOODMAN GROUP	133,807	3,018,685.92
	GPT GROUP	167,884	861,244.92
	MIRVAC GROUP	266,683	650,706.52
	SCENTRE GROUP	382,183	1,138,905.34
	STOCKLAND	207,412	854,537.44
	VICINITY CENTERS	365,149	684,654.37

オーストラリアドル 小計		1,617,208	8,225,847.41 (787,460,372)
香港ドル	LINK REIT	170,500	11,790,075.00
香港ドル 小計		170,500	11,790,075.00 (194,536,237)
シンガポールドドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	812,634.68
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	340,429	765,965.25
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	409,200.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	512,572.09
シンガポールドドル 小計		1,127,756	2,500,372.02 (236,485,185)
投資証券合計		4,169,910	13,451,869,016 (13,451,869,016)
合計			13,674,806,844 (13,674,806,844)

(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%			71.8%
	投資証券 35銘柄			2.8%	2.1%
カナダドル	株式 86銘柄	99.7%			3.9%
	投資証券 2銘柄			0.3%	0.0%
ユーロ	株式 227銘柄	99.5%			8.9%
	投資証券 4銘柄			0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 78銘柄	98.6%			4.5%
	投資証券 3銘柄			1.4%	0.1%
スイスフラン	株式 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	92.9%			2.2%
	投資信託受 益証券 2銘柄		1.2%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.9%	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	94.1%			0.8%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.5%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.4%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	87.8%			0.3%
	投資証券 4銘柄			12.2%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 4月20日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	67,920,262
コール・ローン	4,306,763,921
国債証券	315,086,963,457
派生商品評価勘定	118,988,881
未収入金	323,408
未収利息	2,064,403,970
前払金	109,707,414
前払費用	110,572,731
差入委託証拠金	188,107,523
流動資産合計	322,053,751,567
資産合計	322,053,751,567
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	109,743,996
未払解約金	30,410,632
未払利息	3,296
流動負債合計	140,157,924
負債合計	140,157,924
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	102,152,335,338
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	219,761,258,305
元本等合計	321,913,593,643

	2022年 4月20日現在
項目	金額（円）
純資産合計	321,913,593,643
負債純資産合計	322,053,751,567

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 4月20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>
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) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）



		2022年 4月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		102,152,335,338口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.1513円 (31,513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 4月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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 4月20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>	

	2022年 4月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価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 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年10月21日
期首元本額	96,698,302,863円
期中追加設定元本額	8,111,924,531円
期中一部解約元本額	2,657,892,056円
期末元本額	102,152,335,338円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,327,680,175円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	574,554,358円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	387,700,518円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,157,769,194円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,639,026円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,109,714,867円
世界経済インデックスファンド	13,260,674,555円
D C マイセレクション25	1,941,511,941円

区分	2022年 4月20日現在
D Cマイセレクション5 0	1,667,358,032円
D Cマイセレクション7 5	1,144,332,675円
D C外国債券インデックス・オープン	2,288,992,750円
D CマイセレクションS 2 5	918,201,876円
D CマイセレクションS 5 0	725,880,091円
D CマイセレクションS 7 5	408,523,161円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	30,137,566円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	90,559,130円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	46,252,904円
D C世界経済インデックスファンド	12,434,221,561円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	651,265,711円
マイセレクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,650,011円
マイセレクション7 5 V A 1（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V A 1（適格機関投資家専用）	23,174,693円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	47,930,499円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	71,940,031円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	74,911,233円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	72,401,436円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,340,918,779円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	449,590,381円
バランスC（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,782,668,094円
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	95,467,003円
世界バランスV A 2（適格機関投資家専用）	55,728,791円
バランスD（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	457,134,447円
バランスE（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	170,008,549円
バランスF（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	212,902,050円
F O F s用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	748,490,419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）	2,038,279,390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	701,496,578円
コア投資戦略ファンド（安定型）	681,973,907円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,818,091,465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
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	531,540,128円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,948,250,042円
コア投資戦略ファンド（切替型）	785,303,718円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	249,913,440円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	110,864,837円
S M T グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,351,615,223円
S M T インデックスバランス・オープン	196,641,091円
外国債券S M T Bセレクション（SMA専用）	19,485,147,850円
S M T 世界経済インデックス・オープン	242,122,786円

区分	2022年 4月20日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	298,105,189円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	484,078,557円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,606,006円
グローバル経済コア	835,413,170円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	16,056,664円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,672,762円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	228,162,525円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	33,174,177円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	9,450,027円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	10,711,989円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	4,608,603円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	6,849,408円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	159,751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）	373,160,810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）	11,031,242,799円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	331,796,273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）	317,656,749円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	358,285,543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）	67,446,196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）	91,661,256円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	31,796,512,615
合計	31,796,512,615

(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 4月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	4,274,069,652	-	4,164,362,238	109,707,414
合計		4,274,069,652	-	4,164,362,238	109,707,414

## (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 4月20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	4,416,347,745	-	4,535,300,044	118,952,299
	アメリカドル	2,272,459,169	-	2,339,820,297	67,361,128
	カナダドル	168,857,609	-	174,357,610	5,500,001
	ユーロ	1,726,347,651	-	1,765,228,161	38,880,510
	イギリスポンド	248,683,316	-	255,893,976	7,210,660
合計		4,416,347,745	-	4,535,300,044	118,952,299

## (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	9,591,406.30	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,506,329.28	
		T 0.125% 03/31/23	8,000,000.00	7,868,593.76	
		T 0.125% 04/30/23	5,000,000.00	4,906,152.35	
		T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,351,464.82	

T 0.125% 05/31/23	6,800,000.00	6,655,632.80	
T 0.125% 07/31/23	5,000,000.00	4,865,039.05	
T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	7,813,949.63	
T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,733,906.24	
T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,125,458.99	
T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,438,359.44	
T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	9,984,467.81	
T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,518,359.40	
T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	7,833,281.28	
T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,542,265.67	
T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	920,312.50	
T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,772,828.11	
T 0.25% 09/30/23	12,000,000.00	11,639,062.56	
T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	6,852,539.10	
T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,281,906.26	
T 0.25% 11/15/23	11,000,000.00	10,627,675.74	
T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,274,687.52	
T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,696,210.92	
T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,429,062.48	
T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,555,276.56	
T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,814,003.92	
T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,735,156.25	
T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,234,421.90	
T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	6,968,125.04	
T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,740,195.32	
T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,647,031.24	
T 0.5% 02/28/26	11,500,000.00	10,487,910.18	
T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,746,187.50	
T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,607,527.33	
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,095,175.79	
T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	6,266,859.37	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,095,521.10	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,562,792.95	
T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	11,767,992.25	
T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,259,687.52	
T 0.625% 08/15/30	15,950,000.00	13,239,746.17	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,199,707.02	
T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	8,782,421.90	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,503,574.24	
T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	10,113,125.00	
T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,753,085.93	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,663,125.00	

T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	10,776,852.70	
T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,309,788.30	
T 0.75% 12/31/23	3,370,000.00	3,270,216.42	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,353,437.52	
T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,486,250.00	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,418,265.62	
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,496,921.89	
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	12,945,351.56	
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,104,218.75	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,216,250.00	
T 1.125% 05/15/40	6,260,000.00	4,494,484.37	
T 1.125% 08/15/40	7,300,000.00	5,212,656.25	
T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	9,118,008.64	
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	4,670,607.40	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,244,062.48	
T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	5,748,195.31	
T 1.25% 05/31/28	8,000,000.00	7,232,812.48	
T 1.25% 06/30/28	9,500,000.00	8,575,605.44	
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,493,125.00	
T 1.25% 08/15/31	12,680,000.00	10,941,453.18	
T 1.25% 09/30/28	14,500,000.00	13,035,839.88	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,495,781.25	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,604,998.05	
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,845,937.52	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,955,957.05	
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	6,790,781.25	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,468,017.57	
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	3,943,671.88	
T 1.375% 11/15/31	18,030,000.00	15,686,100.00	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	4,475,625.00	
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,428,757.83	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,618,906.28	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,825,527.37	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,986,640.64	
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	7,066,406.25	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,247,656.25	
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,839,062.50	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,722,210.97	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,487,900.39	
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,157,386.73	
T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	9,991,445.31	
T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	995,332.03	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,170,449.25	

T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,470,166.02	
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,645,234.36	
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	5,053,710.97	
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,511,871.87	
T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,680,414.63	
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,351,718.74	
T 1.75% 08/15/41	14,500,000.00	11,457,265.62	
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,762,109.39	
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	6,434,179.72	
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	5,150,578.15	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,973,479.68	
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,879,296.86	
T 1.875% 11/15/51	9,300,000.00	7,265,625.00	
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,210,585.92	
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,633,750.00	
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,057,964.83	
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,331,781.25	
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,348,250.00	
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,488,906.26	
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,737,375.02	
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,924,804.70	
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,665,343.75	
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	3,978,359.36	
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,674,507.81	
T 2.25% 02/15/52	2,300,000.00	1,967,937.50	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,313,671.87	
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	6,946,406.25	
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	5,586,890.62	
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	8,254,757.81	
T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	3,546,114.86	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	4,702,070.34	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,217,312.50	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,011,626.97	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,303,062.50	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,372,986.30	
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,478,994.13	
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,321,531.25	
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,739,300.00	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,547,492.19	
T 2.375% 05/15/27	5,840,000.00	5,688,068.77	
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,714,005.50	
T 2.375% 05/15/51	2,750,000.00	2,412,265.62	



T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,958,007.80
T 2.375% 11/15/49	6,100,000.00	5,363,710.96
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,465,594.73
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,956,835.95
T 2.5% 02/15/45	5,210,000.00	4,616,141.43
T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	3,554,687.52
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	7,875,929.72
T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	4,487,398.43
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,562,796.87
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,642,367.18
T 2.625% 02/15/29	13,340,000.00	13,064,862.50
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,207,519.56
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	4,928,519.51
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,506,083.98
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,764,073.46
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,009,199.23
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,476,312.50
T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,628,125.00
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	3,909,251.55
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,479,375.00
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,005,957.03
T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,210,218.75
T 2.75% 08/15/47	7,050,000.00	6,610,476.56
T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,508,261.71
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,869,812.50
T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,330,104.69
T 2.75% 11/15/42	3,920,000.00	3,644,375.00
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,860,804.68
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,001,718.76
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	7,221,431.25
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	3,930,503.92
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	5,406,381.25
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,821,342.95
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,459,360.14
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,897,643.76
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	2,181,945.32
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,783,955.09
T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,516,308.60
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	2,388,281.25
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,045,046.48
T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	7,492,382.85
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,269,319.55
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	4,030,078.15

T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,151,881.65	
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,265,263.29	
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,419,648.46	
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	6,697,026.18	
T 2% 08/15/51	15,150,000.00	12,189,832.10	
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	9,809,603.12	
T 2% 11/15/41	5,700,000.00	4,705,171.87	
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,041,386.72	
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,972,500.00	
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	5,996,249.24	
T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	4,082,428.12	
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	8,475,468.79	
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	1,732,363.29	
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	3,088,307.04	
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	5,621,726.58	
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	814,335.16	
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,556,562.51	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,128,750.00	
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,164,062.50	
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	3,253,828.14	
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,597,945.31	
T 3% 02/15/47	800,000.00	781,875.00	
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	4,387,769.55	
T 3% 02/15/49	7,000,000.00	6,955,156.25	
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,574,310.94	
T 3% 05/15/45	2,500,000.00	2,420,703.12	
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	3,141,787.50	
T 3% 08/15/48	5,450,000.00	5,378,894.55	
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,215,093.75	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,017,578.15	
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,706,593.76	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,042,523.44	
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	2,710,945.31	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,173,046.88	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,234,578.12	
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,286,375.00	
T 4.375% 11/15/39	2,960,000.00	3,473,837.49	
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,293,949.22	
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	654,156.25	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,027,914.07	
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,673,034.37	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	922,031.25	

	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,370,617.19
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,477,632.81
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,320,347.66
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,889,988.27
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,684,662.11
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,300,277.34
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,735,497.07
	アメリカドル 小計	1,273,780,000.00	1,190,386,350.55 (154,071,705,351)
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,078,584.80
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,297,544.00
	CAN 0.25% 05/01/23	2,600,000.00	2,547,272.00
	CAN 0.25% 08/01/23	1,360,000.00	1,324,232.00
	CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,309,400.80
	CAN 0.5% 12/01/30	4,420,000.00	3,641,991.60
	CAN 0.75% 02/01/24	1,300,000.00	1,260,103.00
	CAN 0.75% 10/01/24	450,000.00	430,677.00
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,386,561.60
	CAN 1.25% 03/01/27	2,980,000.00	2,781,830.00
	CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,219,085.00
	CAN 1.5% 05/01/24	490,000.00	479,778.60
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,060,894.30
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,299,180.80
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,551,760.50
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,171,440.00
	CAN 1.5% 12/01/31	4,170,000.00	3,707,171.70
	CAN 1.75% 12/01/53	1,830,000.00	1,435,964.40
	CAN 1% 06/01/27	1,730,000.00	1,591,548.10
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,423,588.50
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,289,742.00
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,780,254.00
	CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,221,633.00
	CAN 2.5% 06/01/24	1,330,000.00	1,328,949.30
	CAN 2.75% 12/01/48	1,650,000.00	1,642,855.50
	CAN 2.75% 12/01/64	760,000.00	746,494.80
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,258,726.60
	CAN 2% 09/01/23	3,460,000.00	3,442,561.60
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	3,976,888.50
	CAN 3.5% 12/01/45	1,300,000.00	1,453,608.00
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,227,618.00
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,397,448.00
	CAN 5.75% 06/01/33	960,000.00	1,220,409.60
	CAN 5% 06/01/37	820,000.00	1,037,291.80

	カナダドル 小計	66,560,000.00	63,023,089.40 (6,469,320,126)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,298,210.50
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	31,358,838.40
	MBONO 5.5% 03/04/27	14,050,000.00	12,161,258.50
	MBONO 5.75% 03/05/26	47,710,000.00	42,816,862.40
	MBONO 5% 03/06/25	3,700,000.00	3,335,661.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	36,670,340.40
	MBONO 7.75% 05/29/31	35,980,000.00	33,373,968.60
	MBONO 7.75% 11/13/42	27,040,000.00	23,866,856.00
	MBONO 7.75% 11/23/34	10,600,000.00	9,654,480.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	38,660,000.00	37,796,722.20
	MBONO 8.5% 11/18/38	28,220,000.00	27,171,627.00
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	33,839,543.70
	MBONO 8% 11/07/47	28,400,000.00	25,597,204.00
	MBONO 8% 12/07/23	34,870,000.00	34,547,103.80
	メキシコペソ 小計	381,720,000.00	361,488,676.50 (2,337,168,889)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,258,742.30
	BGB 0.2% 10/22/23	1,030,000.00	1,035,191.20
	BGB 0.35% 06/22/32	480,000.00	432,062.40
	BGB 0.4% 06/22/40	1,240,000.00	974,367.20
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,630,708.20
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	367,641.60
	BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,711,516.80
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,690,895.70
	BGB 0.8% 06/22/28	2,160,000.00	2,147,342.40
	BGB 0.9% 06/22/29	2,360,000.00	2,338,618.40
	BGB 0% 10/22/27	430,000.00	410,882.20
	BGB 0% 10/22/31	1,020,000.00	899,374.80
	BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,487,670.00
	BGB 1.4% 06/22/53	610,000.00	531,932.20
	BGB 1.45% 06/22/37	1,050,000.00	1,017,922.50
	BGB 1.6% 06/22/47	1,380,000.00	1,304,279.40
	BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	1,246,791.00
	BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,085,322.00
	BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,315,340.00
	BGB 1% 06/22/31	2,770,000.00	2,710,915.90
	BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	923,947.20
	BGB 2.25% 06/22/23	1,180,000.00	1,215,683.20
	BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	830,190.90
BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,254,254.60	

BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	1,624,956.00
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,202,710.40
BGB 4.25% 03/28/41	1,870,000.00	2,597,635.70
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,316,814.00
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,350,270.00
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,537,883.60
BGB 5% 03/28/35	2,530,000.00	3,549,640.60
BKO 0% 06/16/23	1,090,000.00	1,094,327.30
BKO 0% 09/15/23	3,150,000.00	3,158,914.50
BKO 0% 12/15/23	1,880,000.00	1,882,688.40
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,527,304.80
BTPS 0.3% 08/15/23	2,900,000.00	2,910,034.00
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	569,589.00
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,855,962.00
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,851,363.00
BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	2,087,841.60
BTPS 0.6% 06/15/23	1,110,000.00	1,119,124.20
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,673,992.00
BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	674,576.10
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,174,355.00
BTPS 0.9% 04/01/31	3,800,000.00	3,336,780.00
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	803,811.00
BTPS 0.95% 06/01/32	2,550,000.00	2,192,949.00
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,002,718.40
BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,284,062.20
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,860,708.60
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	993,080.00
BTPS 0% 04/01/26	1,460,000.00	1,379,583.20
BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	2,961,870.00
BTPS 0% 08/01/26	2,580,000.00	2,419,472.40
BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,471,695.00
BTPS 0% 12/15/24	2,900,000.00	2,822,222.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,925,683.50
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	1,817,081.60
BTPS 1.45% 03/01/36	1,700,000.00	1,464,006.00
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,321,206.00
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,427,912.00
BTPS 1.5% 04/30/45	1,850,000.00	1,419,394.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,438,148.80
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	2,849,838.30
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	2,804,236.40
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,399,715.80
BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	1,264,468.80

BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,266,496.00	
BTPS 1.8% 03/01/41	2,260,000.00	1,912,118.20	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,508,604.00	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,752,380.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,783,812.60	
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,284,032.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	548,872.40	
BTPS 2.15% 09/01/52	920,000.00	757,472.80	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,339,667.60	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,840,000.00	1,748,533.60	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	2,616,187.20	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	1,615,081.10	
BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	3,007,077.60	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,077,056.50	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,070,832.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	2,128,583.60	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,130,000.00	1,029,384.80	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	1,987,883.10	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,101,721.50	
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,283,278.00	
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,142,877.00	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,474,371.80	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,062,885.50	
BTPS 3.35% 03/01/35	2,220,000.00	2,391,472.80	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,309,697.60	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,350,178.80	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,299,403.50	
BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	2,153,433.60	
BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	3,564,825.60	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	2,955,205.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,331,056.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,750,551.20	
BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	3,871,993.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,241,255.70	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,100,000.00	2,741,823.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	4,116,189.50	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	3,907,770.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,359,006.40	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,990,379.60	
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,072,994.40	
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	3,748,021.20	
BTPS 5% 09/01/40	2,240,000.00	2,942,934.40	

BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,512,348.00
BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	3,828,585.60
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,756,118.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	906,848.00
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	3,832,933.70
DBR 0.25% 02/15/29	3,080,000.00	2,983,811.60
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,556,386.30
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	3,100,944.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,006,090.00
DBR 0.5% 02/15/28	3,680,000.00	3,643,016.00
DBR 0.5% 08/15/27	4,040,000.00	4,012,366.40
DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,359,120.10
DBR 0% 02/15/31	3,120,000.00	2,899,416.00
DBR 0% 02/15/32	2,390,000.00	2,186,754.40
DBR 0% 05/15/35	2,820,000.00	2,469,925.20
DBR 0% 05/15/36	3,380,000.00	2,921,097.40
DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,255,909.50
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,314,185.00
DBR 0% 08/15/30	4,190,000.00	3,918,697.50
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	628,138.40
DBR 0% 08/15/31	3,450,000.00	3,182,245.50
DBR 0% 08/15/50	4,420,000.00	3,289,938.60
DBR 0% 08/15/52	1,730,000.00	1,251,845.30
DBR 0% 11/15/27	2,960,000.00	2,855,275.20
DBR 0% 11/15/28	2,500,000.00	2,386,750.00
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	3,766,732.80
DBR 1.5% 05/15/23	3,020,000.00	3,080,611.40
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,356,868.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,702,783.50
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,039,460.00
DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,776,956.80
DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	4,596,583.80
DBR 2.5% 08/15/46	3,810,000.00	5,046,878.40
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	2,948,030.80
DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	3,142,582.90
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,140,060.70
DBR 4.25% 07/04/39	2,310,000.00	3,486,921.90
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,187,245.00
DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	4,313,942.10
DBR 4.75% 07/04/40	2,480,000.00	4,011,499.20
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	3,960,607.20
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	3,019,030.00
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,581,391.70

DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,766,762.50	
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,274,735.00	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,572,547.20	
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,591,677.00	
FRTR 0.5% 05/25/26	6,690,000.00	6,636,346.20	
FRTR 0.5% 05/25/29	5,350,000.00	5,151,408.00	
FRTR 0.5% 05/25/40	2,760,000.00	2,251,911.60	
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	526,719.60	
FRTR 0.5% 06/25/44	1,530,000.00	1,185,061.50	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	6,223,577.60	
FRTR 0.75% 05/25/52	3,800,000.00	2,852,660.00	
FRTR 0.75% 05/25/53	2,060,000.00	1,518,508.40	
FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,764,239.00	
FRTR 0% 02/25/24	4,850,000.00	4,842,773.50	
FRTR 0% 02/25/25	1,000,000.00	986,440.00	
FRTR 0% 02/25/26	5,210,000.00	5,079,802.10	
FRTR 0% 02/25/27	3,560,000.00	3,421,088.80	
FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	5,932,626.00	
FRTR 0% 03/25/25	6,390,000.00	6,307,057.80	
FRTR 0% 05/25/32	1,970,000.00	1,715,653.30	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	4,839,883.80	
FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	5,438,778.40	
FRTR 0% 11/25/31	5,830,000.00	5,134,889.10	
FRTR 1.25% 05/25/34	5,090,000.00	4,950,126.80	
FRTR 1.25% 05/25/36	5,130,000.00	4,921,773.30	
FRTR 1.5% 05/25/31	6,770,000.00	6,924,694.50	
FRTR 1.5% 05/25/50	4,090,000.00	3,816,951.60	
FRTR 1.75% 05/25/23	5,380,000.00	5,502,664.00	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	1,688,152.00	
FRTR 1.75% 06/25/39	3,820,000.00	3,916,760.60	
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,308,678.40	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,688,176.50	
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,353,233.60	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,275,972.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000.00	7,068,593.40	
FRTR 2.75% 10/25/27	6,910,000.00	7,616,340.20	
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	3,721,944.40	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,800,000.00	4,889,270.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,066,661.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,650,000.00	6,020,640.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	6,577,820.40	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,630,000.00	5,032,886.10	



FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	3,707,319.00
FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	3,195,788.40
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	4,550,713.20
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	6,751,864.90
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	6,210,453.20
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,261,095.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,090,180.00
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	901,848.90
IRISH 0.2% 10/18/30	1,090,000.00	997,426.30
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	417,862.90
IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	525,136.80
IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	402,850.00
IRISH 0.9% 05/15/28	1,100,000.00	1,094,445.00
IRISH 0% 10/18/31	1,300,000.00	1,137,266.00
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,200,528.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	655,126.00
IRISH 1.35% 03/18/31	620,000.00	625,263.80
IRISH 1.5% 05/15/50	870,000.00	804,262.80
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	829,216.80
IRISH 1% 05/15/26	1,640,000.00	1,663,091.20
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,325,603.40
IRISH 2% 02/18/45	1,150,000.00	1,204,257.00
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,031,401.00
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,324,685.20
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,297,595.30
NETHER 0.25% 07/15/29	1,570,000.00	1,496,319.90
NETHER 0.5% 01/15/40	1,440,000.00	1,269,849.60
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,311,996.00
NETHER 0.5% 07/15/32	700,000.00	655,494.00
NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,111,751.30
NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,612,515.60
NETHER 0% 01/15/24	2,230,000.00	2,231,494.10
NETHER 0% 01/15/26	790,000.00	773,252.00
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,781,083.20
NETHER 0% 01/15/29	1,390,000.00	1,306,822.40
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	785,155.20
NETHER 0% 01/15/52	1,490,000.00	1,038,455.50
NETHER 0% 07/15/30	1,920,000.00	1,767,513.60
NETHER 0% 07/15/31	1,370,000.00	1,242,699.60
NETHER 1.75% 07/15/23	1,940,000.00	1,990,731.00
NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,294,558.40
NETHER 2.75% 01/15/47	2,490,000.00	3,312,646.20
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,072,326.30

NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	3,232,035.00	
NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	2,986,491.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,188,190.50	
OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,327,435.90	
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	3,012,529.60	
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,715,687.50	
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,228,613.60	
OBL 0% 04/16/27	1,100,000.00	1,067,176.00	
OBL 0% 10/09/26	2,900,000.00	2,829,066.00	
OBL 0% 10/10/25	3,500,000.00	3,452,400.00	
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,515,254.80	
OBL 0% 10/18/24	4,190,000.00	4,168,086.30	
RAGB 0.25% 10/20/36	730,000.00	607,732.30	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,770,000.00	1,705,996.80	
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	878,341.00	
RAGB 0.7% 04/20/71	440,000.00	281,613.20	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,780,000.00	1,765,831.20	
RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	628,906.20	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,085,699.20	
RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	173,246.70	
RAGB 0.9% 02/20/32	510,000.00	487,973.10	
RAGB 0% 02/20/30	1,450,000.00	1,323,270.00	
RAGB 0% 02/20/31	1,640,000.00	1,466,504.40	
RAGB 0% 04/20/23	1,140,000.00	1,144,765.20	
RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	918,142.50	
RAGB 0% 07/15/23	1,120,000.00	1,123,584.00	
RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,435,752.00	
RAGB 0% 10/20/40	670,000.00	500,932.20	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,070,000.00	1,095,487.40	
RAGB 1.5% 02/20/47	1,030,000.00	1,023,892.10	
RAGB 1.5% 11/02/86	370,000.00	320,682.70	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,025,768.70	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,367,958.20	
RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	826,621.20	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,200,290.40	
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,093,525.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	756,540.20	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,478,767.20	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,600,913.50	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,512,535.80	
RFGB 0.125% 04/15/36	540,000.00	447,552.00	
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	304,966.20	

RFGB 0.125% 09/15/31	540,000.00	484,515.00
RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	397,285.00
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	616,075.40
RFGB 0.5% 04/15/43	380,000.00	306,842.40
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	854,609.70
RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	630,649.50
RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	728,916.00
RFGB 0.75% 04/15/31	800,000.00	768,704.00
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	698,024.70
RFGB 0% 09/15/23	570,000.00	571,254.00
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	417,286.80
RFGB 0% 09/15/26	590,000.00	570,919.40
RFGB 0% 09/15/30	630,000.00	570,231.90
RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	542,236.80
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	480,043.20
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	661,843.00
RFGB 2.625% 07/04/42	640,000.00	762,470.40
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	610,835.50
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	757,769.20
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	924,711.30
SPGB 0.1% 04/30/31	3,180,000.00	2,763,165.60
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,281,023.20
SPGB 0.35% 07/30/23	3,590,000.00	3,608,739.80
SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,681,746.00
SPGB 0.5% 10/31/31	1,960,000.00	1,744,635.20
SPGB 0.6% 10/31/29	2,950,000.00	2,773,737.50
SPGB 0.7% 04/30/32	2,680,000.00	2,402,914.80
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,389,296.80
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,217,698.40
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,241,126.00
SPGB 0% 01/31/26	2,720,000.00	2,623,032.00
SPGB 0% 01/31/27	1,560,000.00	1,475,494.80
SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,795,266.70
SPGB 0% 04/30/23	1,630,000.00	1,635,036.70
SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,092,592.50
SPGB 1.2% 10/31/40	2,260,000.00	1,916,028.00
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	2,968,778.50
SPGB 1.3% 10/31/26	2,750,000.00	2,782,670.00
SPGB 1.4% 04/30/28	2,490,000.00	2,509,521.60
SPGB 1.4% 07/30/28	3,570,000.00	3,593,526.30
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,702,723.70
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,077,361.60
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	429,501.60

SPGB 1.5% 04/30/27	2,650,000.00	2,692,744.50	
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,134,698.50	
SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	2,706,192.50	
SPGB 1.9% 10/31/52	900,000.00	792,306.00	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	2,917,847.80	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,940,000.00	3,031,257.60	
SPGB 1% 07/30/42	650,000.00	525,258.50	
SPGB 1% 10/31/50	2,470,000.00	1,791,738.00	
SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	2,934,567.30	
SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,561,634.00	
SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	1,997,408.00	
SPGB 2.75% 10/31/24	3,050,000.00	3,223,331.50	
SPGB 2.9% 10/31/46	2,200,000.00	2,470,996.00	
SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	2,118,039.80	
SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,693,955.60	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,244,725.00	
SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,866,033.60	
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,188,013.60	
SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	3,712,183.20	
SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,590,200.00	
SPGB 4.9% 07/30/40	2,250,000.00	3,214,957.50	
SPGB 5.15% 10/31/28	4,290,000.00	5,306,515.50	
SPGB 5.15% 10/31/44	1,910,000.00	2,916,379.00	
SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,934,216.00	
SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,191,242.40	
SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,370,092.50	
ユーロ 小計	800,260,000.00	834,167,109.80 (116,558,170,252)	
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,436,020.00
	UKT 0.125% 01/31/24	3,300,000.00	3,213,573.00
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,060,894.00
	UKT 0.25% 01/31/25	1,110,000.00	1,066,066.20
	UKT 0.25% 07/31/31	3,270,000.00	2,798,956.50
	UKT 0.375% 10/22/26	1,910,000.00	1,799,067.20
	UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,138,287.80
	UKT 0.5% 01/31/29	1,020,000.00	933,779.40
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	798,626.60
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,648,252.00
	UKT 0.625% 07/31/35	2,360,000.00	1,942,940.80
	UKT 0.625% 10/22/50	1,590,000.00	1,090,183.50
	UKT 0.75% 07/22/23	2,360,000.00	2,338,878.00
	UKT 0.875% 01/31/46	1,170,000.00	889,246.80

UKT 0.875% 07/31/33	510,000.00	449,855.70	
UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,588,395.00	
UKT 1.125% 01/31/39	500,000.00	424,745.00	
UKT 1.125% 10/22/73	520,000.00	389,194.00	
UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	929,565.50	
UKT 1.25% 07/31/51	830,000.00	672,349.80	
UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,382,324.00	
UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,590,176.00	
UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	2,070,076.50	
UKT 1.5% 07/31/53	200,000.00	173,478.00	
UKT 1.625% 10/22/28	1,620,000.00	1,610,150.40	
UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	1,654,265.40	
UKT 1.625% 10/22/71	1,320,000.00	1,197,042.00	
UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,193,634.00	
UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	2,036,006.70	
UKT 1.75% 09/07/37	2,630,000.00	2,481,063.10	
UKT 1% 01/31/32	400,000.00	364,728.00	
UKT 1% 04/22/24	1,600,000.00	1,581,760.00	
UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,524,250.00	
UKT 2.5% 07/22/65	1,920,000.00	2,214,412.80	
UKT 2.75% 09/07/24	1,690,000.00	1,734,717.40	
UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,801,733.80	
UKT 3.25% 01/22/44	2,580,000.00	3,052,372.20	
UKT 3.5% 01/22/45	2,290,000.00	2,829,569.80	
UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	2,821,795.10	
UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,183,344.00	
UKT 4.25% 03/07/36	2,090,000.00	2,616,721.80	
UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,535,456.00	
UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	2,107,053.00	
UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,554,388.30	
UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	2,303,157.50	
UKT 4.25% 12/07/46	1,920,000.00	2,673,811.20	
UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	2,170,202.20	
UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	2,918,384.50	
UKT 4.5% 09/07/34	1,860,000.00	2,347,729.20	
UKT 4.5% 12/07/42	2,210,000.00	3,058,728.40	
UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,797,143.20	
UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,248,488.00	
UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	2,348,053.40	
UKT 5% 03/07/25	1,800,000.00	1,965,582.00	
UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,579,112.50	
イギリスポンド 小計	94,580,000.00	100,329,787.20 (16,904,565,845)	

スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	5,677,230.90	
	SGB 0.75% 05/12/28	7,800,000.00	7,471,464.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	9,010,000.00	8,508,863.80	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,623,875.00	
	SGB 1% 11/12/26	10,030,000.00	9,851,566.30	
	SGB 2.25% 06/01/32	4,980,000.00	5,280,642.60	
	SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	9,651,633.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,310,000.00	6,699,149.10	
スウェーデンクローナ 小計		65,400,000.00	65,764,424.70	(892,423,243)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,590,000.00	3,110,483.70	
	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	5,763,895.20	
	NGB 1.5% 02/19/26	6,360,000.00	6,085,947.60	
	NGB 1.75% 02/17/27	6,060,000.00	5,783,179.20	
	NGB 1.75% 03/13/25	5,720,000.00	5,591,643.20	
	NGB 1.75% 09/06/29	6,340,000.00	5,873,502.80	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,220,000.00	3,005,322.60	
	NGB 2% 04/26/28	5,020,000.00	4,792,041.80	
	NGB 2% 05/24/23	10,660,000.00	10,696,137.40	
	NGB 3% 03/14/24	7,760,000.00	7,867,010.40	
ノルウェークローネ 小計		61,210,000.00	58,569,163.90	(858,038,251)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	6,050,000.00	4,436,283.50	
	DGB 0.5% 11/15/27	8,850,000.00	8,654,680.50	
	DGB 0.5% 11/15/29	12,410,000.00	11,922,162.90	
	DGB 0% 11/15/24	2,130,000.00	2,108,337.90	
	DGB 0% 11/15/31	5,830,000.00	5,210,795.70	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,550,000.00	7,738,221.50	
	DGB 1.75% 11/15/25	7,280,000.00	7,566,759.20	
	DGB 4.5% 11/15/39	13,980,000.00	20,877,732.00	
デンマーククローネ 小計		64,080,000.00	68,514,973.20	(1,286,711,196)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,850,000.00	2,154,600.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,004,319.60	
	POLGB 0% 04/25/23	1,230,000.00	1,162,128.60	
	POLGB 0% 07/25/24	2,160,000.00	1,868,076.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	2,838,226.50	
	POLGB 1.75% 04/25/32	650,000.00	437,573.50	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,550,126.20	
	POLGB 2.5% 04/25/24	4,690,000.00	4,351,944.80	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	5,126,154.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	3,105,005.40	

	POLGB 2.75% 04/25/28	5,750,000.00	4,689,240.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	4,940,608.20	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	4,418,607.20	
	POLGB 4% 10/25/23	3,760,000.00	3,644,380.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	580,194.00	
	ポーランドズロチ 小計	54,300,000.00	45,871,184.00	(1,378,020,825)
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	3,430,000.00	3,251,640.00	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,150,764.20	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,040,000.00	1,852,299.60	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,306,915.60	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	2,793,355.40	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,760,000.00	1,198,859.20	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,910,000.00	2,553,990.60	
	ACGB 1% 11/21/31	3,250,000.00	2,693,535.00	
	ACGB 1% 12/21/30	3,310,000.00	2,797,744.40	
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,230,000.00	2,152,752.80	
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,830,000.00	2,727,412.50	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,396,297.80	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,471,938.90	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,050,000.00	997,500.00	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,923,109.90	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,644,230.00	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,410,000.00	1,388,582.10	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,560,000.00	2,615,142.40	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,243,626.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	1,101,195.20	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	1,708,111.80	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,537,939.20	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,890,000.00	2,003,362.20	
ACGB 4.5% 04/21/33	2,310,000.00	2,607,504.90		
ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,535,040.80		
ACGB 5.5% 04/21/23	2,500,000.00	2,602,625.00		
	オーストラリアドル 小計	57,290,000.00	54,255,475.50	(5,193,876,669)
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	709,350.00	
	SIGB 1.25% 11/01/26	530,000.00	506,939.70	
	SIGB 1.625% 07/01/31	650,000.00	600,554.50	
	SIGB 1.875% 03/01/50	810,000.00	671,198.40	
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	263,334.40	
	SIGB 2.125% 06/01/26	1,080,000.00	1,076,425.20	
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	839,670.50	
	SIGB 2.375% 06/01/25	730,000.00	737,263.50	

	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	408,689.20
	SIGB 2.625% 05/01/28	530,000.00	535,808.80
	SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	754,383.60
	SIGB 2.75% 04/01/42	750,000.00	748,080.00
	SIGB 2.75% 07/01/23	620,000.00	628,159.20
	SIGB 2.875% 07/01/29	950,000.00	972,819.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	1,020,000.00	1,045,296.00
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	410,967.60
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	884,896.20
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	925,760.00
	SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,627,253.70
	シンガポールドル 小計	14,530,000.00	14,346,849.50 (1,356,925,025)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	790,000.00	699,987.40
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,938,412.80
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,496,561.00
	MGS 3.733% 06/15/28	2,870,000.00	2,822,358.00
	MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,105,968.50
	MGS 3.757% 05/22/40	1,520,000.00	1,333,997.60
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	947,493.30
	MGS 3.828% 07/05/34	1,180,000.00	1,099,122.80
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,592,111.20
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,044,584.80
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,479,870.00
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,140,520.30
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,988,971.10
	MGS 3.9% 11/30/26	2,120,000.00	2,148,429.20
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	607,578.00
	MGS 3.955% 09/15/25	3,120,000.00	3,168,703.20
	MGS 4.059% 09/30/24	1,780,000.00	1,820,530.60
	MGS 4.065% 06/15/50	2,340,000.00	2,062,616.40
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,310,246.40
	MGS 4.232% 06/30/31	3,000,000.00	3,009,540.00
	MGS 4.254% 05/31/35	2,030,000.00	1,964,897.90
	MGS 4.392% 04/15/26	2,910,000.00	3,003,643.80
	MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	2,927,095.60
	MGS 4.642% 11/07/33	2,830,000.00	2,882,213.50
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,453,448.80
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,314,975.20
	MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,366,433.30
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,684,888.80
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,050,744.20



マレーシアリングット 小計		52,760,000.00	52,465,943.70 (1,587,477,798)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	840,000.00	830,268.68
	ILGOV 0.5% 02/27/26	860,000.00	816,786.20
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,334,421.54
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	1,853,473.43
	ILGOV 1.5% 11/30/23	2,230,000.00	2,242,165.76
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,243,443.10
	ILGOV 1% 03/31/30	2,830,000.00	2,568,938.44
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,010,000.00	2,022,759.27
	ILGOV 2% 03/31/27	2,750,000.00	2,752,486.27
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,259,092.41
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	3,483,205.47
	ILGOV 4.25% 03/31/23	3,430,000.00	3,542,062.21
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,410,000.00	3,361,578.61
	ILGOV 6.25% 10/30/26	3,060,000.00	3,630,289.75
イスラエルシェケル 小計		33,480,000.00	34,940,971.14 (1,395,881,314)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	29,520,000.00	29,130,926.40
	CGB 2.28% 03/17/24	9,700,000.00	9,702,910.00
	CGB 2.47% 09/02/24	18,980,000.00	19,034,852.20
	CGB 2.56% 10/21/23	30,440,000.00	30,608,942.00
	CGB 2.68% 05/21/30	22,480,000.00	22,117,847.20
	CGB 2.69% 08/12/26	17,240,000.00	17,320,166.00
	CGB 2.8% 03/24/29	7,900,000.00	7,889,651.00
	CGB 2.84% 04/08/24	11,650,000.00	11,782,344.00
	CGB 2.85% 06/04/27	12,330,000.00	12,445,778.70
	CGB 2.89% 11/18/31	5,510,000.00	5,531,048.20
	CGB 2.91% 10/14/28	10,280,000.00	10,352,474.00
	CGB 3.01% 05/13/28	3,950,000.00	4,004,747.00
	CGB 3.02% 05/27/31	2,900,000.00	2,930,015.00
	CGB 3.03% 03/11/26	14,760,000.00	15,026,860.80
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,071,940.00
	CGB 3.28% 12/03/27	5,410,000.00	5,583,931.50
	CGB 3.39% 03/16/50	5,520,000.00	5,517,957.60
	CGB 3.53% 10/18/51	2,950,000.00	3,044,577.00
	CGB 3.72% 04/12/51	2,390,000.00	2,536,052.90
	CGB 3.81% 09/14/50	7,460,000.00	8,027,556.80
CGB 3.86% 07/22/49	3,280,000.00	3,551,682.40	
CGB 4.08% 10/22/48	4,110,000.00	4,602,624.60	
オフショア人民元 小計		235,610,000.00	237,814,885.30 (4,796,678,673)

合計		315,086,963,457 (315,086,963,457)	
----	--	--------------------------------------	--

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 224銘柄	100.0%	48.9%
カナダドル	国債証券 34銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 348銘柄	100.0%	37.0%
イギリスポンド	国債証券 55銘柄	100.0%	5.4%
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 15銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 29銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券 22銘柄	100.0%	1.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2022年 4月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	

	2022年 4月20日現在
項目	金額（円）
預金	5,596,487,754
コール・ローン	11,082,784
株式	103,271,827,082
投資信託受益証券	259,976,979
投資証券	154,143,779
派生商品評価勘定	239,139,569
未収配当金	225,186,533
差入委託証拠金	462,793,876
流動資産合計	110,220,638,356
資産合計	110,220,638,356
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	49,305,712
前受金	189,831,745
未払金	16,620
未払解約金	5,807,536
未払利息	8
流動負債合計	244,961,621
負債合計	244,961,621
純資産の部	
元本等	
元本	29,748,283,292
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	80,227,393,443
元本等合計	109,975,676,735
純資産合計	109,975,676,735
負債純資産合計	110,220,638,356

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 4月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p>

2022年 4月20日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2022年 4月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	29,748,283,292口

		2022年 4月20日現在
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.6969円 (36,969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 4月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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 4月20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</p>	

	2022年 4月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価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 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年10月21日
期首元本額	27,875,662,010円
期中追加設定元本額	2,429,375,734円
期中一部解約元本額	556,754,452円
期末元本額	29,748,283,292円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,778,678,842円
世界経済インデックスファンド	5,609,793,493円
DC新興国株式インデックス・オープン	5,220,820,892円
DC世界経済インデックスファンド	5,218,582,365円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	167,793,634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
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	714,689,611円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	592,002,391円

区分	2022年 4月20日現在
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	335,513,590円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	16,773,922円
S M T インデックスバランス・オープン	83,320,465円
S M T 世界経済インデックス・オープン	152,005,953円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	591,261,216円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	102,764,680円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	4,030,012円
グローバル経済コア	349,497,618円
i - S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	42,515,768円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	14,336,977円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	13,217,956円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	5,049,216円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	6,842,501円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	978,880,325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）	182,070,320円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	42,242,143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）	10,333,159円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	13,718,409,050
投資信託受益証券	4,272,282
投資証券	12,996,607
合計	13,709,684,725

(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 4月20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	6,177,836,273	-	6,367,668,018	189,831,745
合計		6,177,836,273	-	6,367,668,018	189,831,745

(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 4月20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	82,828,800	-	82,830,912	2,112
	アメリカドル	82,828,800	-	82,830,912	2,112
	合計	82,828,800	-	82,830,912	2,112

### (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	10.33	174,886.90	
	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	72.68	696,637.80	



51JOB INC-ADR	2,701	60.45	163,275.45
DIDI GLOBAL INC	34,321	2.02	69,328.42
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	53,727	25.71	1,381,321.17
LI AUTO INC - ADR	60,121	25.34	1,523,466.14
NIO INC - ADR	147,534	19.87	2,931,500.58
XPENG INC - ADR	43,999	27.36	1,203,812.64
HUAZHU GROUP LTD-ADR	19,163	32.87	629,887.81
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	15,618	10.94	170,860.92
TAL EDUCATION GROUP- ADR	41,058	2.89	118,657.62
TRIP.COM GROUP LTD	55,661	22.76	1,266,844.36
YUM CHINA HOLDINGS INC	50,479	43.14	2,177,664.06
AUTOHOME INC-ADR	6,571	25.57	168,020.47
BAIDU INC - SPON ADR	31,841	126.61	4,031,389.01
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	18,268	24.10	440,258.80
HELLO GROUP INC -SPN ADR	15,529	4.72	73,296.88
IQIYI INC-ADR	28,984	4.03	116,805.52
JOYY INC	6,185	39.91	246,843.35
KANZHUN LTD	6,900	23.37	161,253.00
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	4.56	517,774.32
VK CO LTD	19,368	0.42	8,289.50
WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	22.60	118,627.40
YANDEX NV-A	32,725	9.47	309,905.75
DADA NEXUS LTD-ADR	7,696	8.15	62,722.40
OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	5.80	43,633.40
PINDUODUO INC-ADR	53,748	39.80	2,139,170.40
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	52,765	7.57	399,431.05
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	39,926	0.00	247.54
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	68,136	1.98	134,909.28
BEIGENE LTD-ADR	4,929	176.96	872,235.84
HUTCHMED CHINA-ADR	7,243	17.38	125,883.34
I-MAB-SPONSORED ADR	2,944	12.84	37,800.96
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	3,311	38.25	126,645.75
ZAI LAB LTD-ADR	12,825	45.12	578,664.00
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	189,281	2.07	391,811.67
CREDICORP LTD	7,637	146.07	1,115,536.59
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	14.62	117,851.82
LUFAX HOLDING LTD-ADR	75,232	5.57	419,042.24
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	21.13	42,703.73
KE HOLDINGS INC	49,295	13.63	671,890.85

	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	0.91	49,968.57
	CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	12,493	5.26	65,713.18
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	15,167	35.57	539,490.19
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	5,558	4.20	23,343.60
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	36,600	3.77	138,055.20
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT-SP ADR	39,854	2.75	109,598.50
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	46.74	366,207.90
	アメリカドル 小計	3,440,516		27,893,865.44 (3,610,303,003)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,052,361	9.67	19,846,330.87
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	377,892	110.08	41,598,351.36
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	244.78	3,549,310.00
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	50.83	4,922,987.16
	ALFA S.A.B. -A	313,500	15.11	4,736,985.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	73.86	2,769,750.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	416.99	9,717,951.95
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	43,680	303.33	13,249,454.40
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	158.98	6,786,061.30
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	288,490	45.54	13,137,834.60
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	59.80	1,877,720.00
	WALMART DE MEXICO-SER V	567,680	76.20	43,257,216.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	136.57	6,893,370.75
	BEACLE SAB DE CV	48,100	47.74	2,296,294.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	207,440	159.10	33,003,704.00
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	257.17	6,676,133.20
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	59.61	10,837,098.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	28.76	5,228,568.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	282,600	136.78	38,654,028.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	252,500	39.58	9,993,950.00
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,658,740	22.18	81,150,853.20
	メキシコペソ 小計	8,779,260		360,183,951.79 (2,328,733,321)
ブラジルリアル	COSAN SA	118,300	22.68	2,683,044.00
	PETRO RIO SA	84,700	24.66	2,088,702.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	435,900	34.71	15,130,089.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	544,440	31.65	17,231,526.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	14.53	1,098,468.00
	BRASKEM SA-PREF A	19,300	43.80	845,340.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	24.86	1,566,180.00
	GERDAU SA-PREF	141,800	30.27	4,292,286.00
	SUZANO SA	90,079	52.49	4,728,246.71
	VALE SA	467,987	87.68	41,033,100.16

	WEG SA	217,544	31.37	6,824,355.28	
	CCR SA	125,600	13.75	1,727,000.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	61,952	58.35	3,614,899.20	
	RUMO SA	159,700	18.00	2,874,600.00	
	ALPARGATAS SA - PREF	28,600	22.24	636,064.00	
	AMERICANAS SA	39,740	28.01	1,113,117.40	
	LOJAS RENNER S.A.	115,947	26.25	3,043,608.75	
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	5.94	1,814,670.00	
	VIBRA ENERGIA SA	134,600	22.49	3,027,154.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	22.06	915,490.00	
	RAIA DROGASIL SA	122,500	22.50	2,756,250.00	
	AMBEV SA	534,900	14.65	7,836,285.00	
	BRF SA	52,500	15.29	802,725.00	
	JBS SA	110,000	37.61	4,137,100.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	25.29	2,536,789.32	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	510,254	10.60	5,408,692.40	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	45,600	42.59	1,942,104.00	
	HYPERA SA	35,300	37.88	1,337,164.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	261,323	16.13	4,215,139.99	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	584,982	19.57	11,448,097.74	
	BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	35.21	3,109,043.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	575,881	26.01	14,978,664.81	
	ITAUSA SA	528,325	10.05	5,309,666.25	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	715,509	14.54	10,403,500.86	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	26.02	1,795,380.00	
	TOTVS SA	57,900	36.01	2,084,979.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	52.90	2,766,670.00	
	TIM SA	96,100	13.61	1,307,921.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	40.41	1,495,170.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,600	40.60	1,364,160.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	113,867	14.67	1,670,428.89	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	34,700	48.28	1,675,316.00	
	ENGIE BRASIL SA	29,250	43.57	1,274,422.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	133,600	25.25	3,373,400.00	
	ブラジルリアル 小計	8,194,788		211,317,010.26 (5,856,883,388)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	6,549.00	292,936,770.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,320.00	179,473,800.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	15,220	69,950.00	1,064,639,000.00	
	FALABELLA SA	70,837	2,474.90	175,314,491.30	
	CENCOSUD SA	137,988	1,490.00	205,602,120.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	5,735.00	42,352,975.00	

	BANCO DE CHILE	4,862,640	87.60	425,967,264.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,718	26,750.00	152,956,500.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	44.15	277,254,097.15	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	91.11	318,093,709.65	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	22.94	58,755,717.32	
	チリペソ 小計	17,612,897		3,193,346,444.42	(503,903,682)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	3,349.00	1,637,590,671.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	43,000.00	1,263,168,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	40,110.00	2,469,372,150.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	36,400.00	757,848,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	24,650.00	1,245,096,150.00	
	コロンビアペソ 小計	651,251		7,373,074,971.00	(254,267,863)
ユーロ	OPAP SA	18,496	14.12	261,163.52	
	JUMBO SA	19,341	15.70	303,653.70	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	1.07	283,443.10	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	282,775	1.02	288,996.05	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	17.99	471,463.93	
	PUBLIC POWER CORP	20,834	8.12	169,172.08	
	ユーロ 小計	631,321		1,777,892.38	(248,424,902)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	255.80	2,968,047.40	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	35.88	4,189,169.40	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	27.72	2,759,969.52	
	KOC HOLDING AS	89,884	42.06	3,780,521.04	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	17.97	5,368,501.56	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	309.70	2,013,359.70	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	85.55	3,663,593.20	
	AKBANK T.A.S.	276,321	9.38	2,591,890.98	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	14.18	3,403,086.56	
	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	10.77	1,863,339.24	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	23.32	3,336,882.12	
	トルコリラ 小計	1,498,297		35,938,360.72	(317,429,164)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	820.00	6,119,660.00	
	MONETA MONEY BANK AS	62,031	90.60	5,620,008.60	
	CEZ AS	18,145	984.00	17,854,680.00	
	チェココルナ 小計	87,639		29,594,348.60	(169,105,067)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	75,582	3,072.00	232,187,904.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	7,110.00	107,915,580.00	

	OTP BANK NYRT	31,101	10,475.00	325,782,975.00	
	ハンガリーフォリント 小計	121,861		665,886,459.00 (250,057,012)	
ポーランドズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	80.58	2,474,853.54	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	200,051	6.84	1,369,949.24	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	172.85	3,489,150.10	
	LPP SA	124	11,100.00	1,376,400.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	149.90	1,004,929.60	
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	26.50	956,597.00	
	ALLEGRO.EU SA	39,203	27.02	1,059,265.06	
	DINO POLSKA SA	5,945	322.00	1,914,290.00	
	BANK PEKAO SA	23,647	107.75	2,547,964.25	
	M BANK SA	1,423	337.40	480,120.20	
	PKO BANK POLSKI SA	93,312	37.63	3,511,330.56	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	285.80	1,033,167.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	94,203	33.82	3,185,945.46	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	7.41	412,425.78	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	9.25	587,338.00	
	ポーランドズロチ 小計	674,378		25,403,725.79 (763,155,866)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	7.16	2,355,640.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	8.41	1,614,720.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,915,400	4.00	11,661,600.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	411,500	25.95	10,678,425.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	236,000	4.70	1,109,200.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,648,000	4.12	10,909,760.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	142,000	24.10	3,422,200.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	4.73	1,608,200.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	144,500	41.25	5,960,625.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	219,000	10.92	2,391,480.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	468,000	4.47	2,091,960.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	10.32	4,251,840.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	6.47	1,863,360.00	
	DONGYUE GROUP	147,000	8.72	1,281,840.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	26,200	99.60	2,609,520.00	
	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	101,000	4.44	448,440.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	14.28	1,185,240.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	3.78	627,480.00	
	MMG LIMITED	304,000	3.89	1,182,560.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	7.02	905,580.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	50,750	17.60	893,200.00		
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	13.56	9,885,240.00		

AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	4.22	1,160,500.00
BOC AVIATION LTD	23,800	59.95	1,426,810.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.47	680,120.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	22.10	3,524,950.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	8.93	1,143,040.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	474,000	5.19	2,460,060.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	9.83	1,671,100.00
CITIC LTD	617,000	8.63	5,324,710.00
CRRC CORP LTD-H	409,000	2.90	1,186,100.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	8.13	2,341,440.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	19.02	1,483,560.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	7.79	1,246,400.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	54,500	9.21	501,945.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	211,800	11.28	2,389,104.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	141,216	11.66	1,646,578.56
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	25.55	1,591,765.00
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	5.14	597,268.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	4.80	1,848,355.20
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.73	1,226,220.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	4.53	1,123,440.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	14.00	2,317,658.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.59	807,840.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	13.06	6,765,733.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	5.92	1,484,582.08
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	156,000	8.06	1,257,360.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	8.59	1,098,849.98
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	6.75	594,000.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	5.47	2,014,800.00
BYD CO LTD-H	97,000	240.00	23,280,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	5.66	1,505,560.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	31.50	1,839,600.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	630,000	11.78	7,421,400.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	11.36	4,007,240.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	6.63	2,375,820.72
MINTH GROUP LTD	64,000	17.96	1,149,440.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	108,000	11.84	1,278,720.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	121,000	88.25	10,678,250.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	3.58	1,568,040.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	244,600	25.80	6,310,680.00
LI NING CO LTD	264,000	59.30	15,655,200.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	99,600	99.65	9,925,140.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	70,000	6.34	443,800.00

HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	116,000	15.78	1,830,480.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	57,000	16.60	946,200.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	68,400	13.70	937,080.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	0.68	986,000.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	31.20	1,609,920.00
KINGSOFT CORP LTD	92,000	23.05	2,120,600.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	52,300	61.80	3,232,140.00
NETEASE INC	235,230	146.00	34,343,580.00
TENCENT HOLDINGS LTD	655,100	364.00	238,456,400.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,730,088	91.50	158,303,052.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	422,000	4.51	1,903,220.00
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	54,000	26.60	1,436,400.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	268,000	2.01	538,680.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,206,958	0.46	555,200.68
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	47,300	48.80	2,308,240.00
JD.COM INC - CL A	205,611	222.20	45,686,764.20
MEITUAN-CLASS B	466,200	146.00	68,065,200.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	21.50	1,154,550.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	6.07	691,980.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	68,000	52.65	3,580,200.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	259,000	2.35	608,650.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	105.20	1,599,040.00
CHINA FEIHE LTD	346,000	7.33	2,536,180.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	370,000	41.70	15,429,000.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	182,000	44.70	8,135,400.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	4.03	991,380.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	193,000	41.65	8,038,450.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	17.18	3,350,100.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	14.50	3,306,000.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	68,000	61.65	4,192,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	6.94	555,200.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	6.69	3,746,400.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	23.55	1,130,400.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	36.90	3,228,750.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	19.14	478,500.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	35,200	35.80	1,260,160.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	124,000	5.75	713,000.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	15.40	1,016,400.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	8.54	2,083,760.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	12.90	1,656,360.00
SINOPHARM GROUP CO-H	125,200	17.42	2,180,984.00

VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	20,500	13.26	271,830.00
3SBIO INC	119,000	6.20	737,800.00
AKESO INC	25,000	14.14	353,500.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	10,000	100.50	1,005,000.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	11.18	2,761,460.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	956,160	8.27	7,907,443.20
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	3.84	637,440.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	21.80	2,877,600.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	88.70	452,370.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	12.66	1,544,520.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	139,000	26.20	3,641,800.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	22,300	98.70	2,201,010.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	32.60	2,379,800.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,113,000	4.09	4,552,170.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	42,288	112.20	4,744,713.60
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	423,000	60.25	25,485,750.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,825,000	3.00	8,475,000.00
BANK OF CHINA LTD-H	8,801,200	3.12	27,459,744.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	5.64	6,195,399.00
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	366,500	1.33	487,445.00
CHINA CITIC BANK-H	951,200	4.03	3,833,336.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	10,797,620	5.75	62,086,315.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.95	1,106,250.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	429,923	52.90	22,742,926.70
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	3.01	2,029,944.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,699,515	4.72	31,621,710.80
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,059,000	6.58	6,968,220.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.36	1,131,520.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.59	2,216,970.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	203,600	17.12	3,485,632.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	17.66	5,046,786.50
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	7.02	1,684,800.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	10.46	926,756.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	5.87	2,096,764.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	135,600	11.30	1,532,280.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	918,000	11.98	10,997,640.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	18.72	7,237,152.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	9.52	1,751,908.48
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	22.50	2,169,000.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.57	2,413,230.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	8.37	5,769,340.56
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	727,000	54.95	39,948,650.00



ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	24.70	1,128,790.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	41,500	12.82	532,030.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	4.01	569,420.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	2.78	1,606,840.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	415,540	26.65	11,074,141.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	80,000	9.83	786,400.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	367,111	37.85	13,895,151.35
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	67,600	38.20	2,582,320.00
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	20.45	3,648,280.00
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	64,000	11.36	727,040.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	564,000	4.35	2,453,400.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,016,654	6.02	6,120,257.08
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	232,000	36.55	8,479,600.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	15.46	1,120,850.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	7.92	1,425,600.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	436,800	3.05	1,332,240.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	66,000	16.60	1,095,600.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	152,500	3.23	492,575.00
LOGAN GROUP CO LTD	150,000	2.47	370,500.00
LONGFOR PROPERTIES	197,000	42.05	8,283,850.00
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	178,000	2.70	480,600.00
SEAZEN GROUP LTD	204,000	4.16	848,640.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	4.42	585,650.00
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	75,000	4.48	336,000.00
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	163,000	4.64	756,320.00
WHARF HOLDINGS	154,000	23.55	3,626,700.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	115,600	8.90	1,028,840.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	6.44	1,777,440.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	311,000	15.24	4,739,640.00
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	88,000	9.53	838,640.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	11.56	913,240.00
WEIMOB INC	149,000	4.81	716,690.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	16.74	1,196,910.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	60,500	14.66	886,930.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	36.55	2,448,850.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	12.08	833,520.00
LENOVO GROUP LTD	732,000	7.67	5,614,440.00
SUNNY OPTICAL TECH	76,800	105.20	8,079,360.00
XIAOMI CORP-CLASS B	1,405,800	12.04	16,925,832.00
ZTE CORP-H	82,908	15.62	1,295,022.96
CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	0.92	4,200,720.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	27.30	1,624,350.00

	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	2.60	1,586,000.00	
	CGN POWER CO LTD-H	791,000	2.05	1,621,550.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	9.33	4,351,512.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	339,000	16.82	5,701,980.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	4.00	2,664,000.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,000	31.70	3,360,200.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	15.10	2,648,540.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	83,300	103.10	8,588,230.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	320,000	10.02	3,206,400.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	3.67	1,357,900.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	360,000	6.73	2,422,800.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	29.15	1,865,600.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	29.70	1,336,500.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	531,987	13.64	7,256,302.68	
	香港ドル 小計	95,389,482		1,350,629,151.33 (22,285,380,996)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.59	1,071,400.12	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	21.20	532,120.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	10.40	2,806,960.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	288,600	6.54	1,887,444.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	7.40	282,680.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.41	810,593.86	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	6.75	719,509.50	
	MISC BHD	125,040	7.60	950,304.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.95	276,500.00	
	GENTING BHD	426,900	4.55	1,942,395.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.95	1,090,615.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	5,800	22.80	132,240.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	4.29	1,159,758.60	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	78,646	26.90	2,115,577.40	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	132.20	951,840.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	16.90	1,241,812.00	
	QL RESOURCES BHD	124,800	4.97	620,256.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	5.15	1,272,286.90	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	181,300	4.56	826,728.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	6.40	1,467,520.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	1.74	878,526.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	3.56	1,070,492.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	849,475	5.03	4,272,859.25	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	20.50	1,256,486.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	19.00	316,027.00	

	MALAYAN BANKING BHD	571,105	8.75	4,997,168.75	
	PUBLIC BANK BERHAD	1,675,000	4.63	7,755,250.00	
	RHB BANK BHD	210,820	5.88	1,239,621.60	
	INARI AMERTRON BHD	274,700	2.87	788,389.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	3.60	1,027,040.40	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	3.82	1,190,694.00	
	MAXIS BHD	267,900	3.85	1,031,415.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	5.00	1,357,760.00	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	16.88	1,274,440.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	305,275	8.93	2,726,105.75	
	マレーシアリングット 小計	9,669,801		53,340,815.13 (1,613,949,045)	
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	152.00	30,521,600.00	
	PTT PCL-NVDR	1,197,400	37.75	45,201,850.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	53.75	6,455,375.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	46.00	9,494,400.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	49.50	11,134,233.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	100,600	56.75	5,709,050.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	102,600	360.00	36,936,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	527,000	67.25	35,440,750.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.30	6,781,100.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	9.10	7,366,450.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	5.00	4,051,500.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	34.75	12,605,145.50	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	41.25	7,515,750.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	471,035	16.10	7,583,663.50	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	289,000	25.00	7,225,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	35.50	6,304,800.00	
	CP ALL PCL-NVDR	691,700	67.00	46,343,900.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	102.00	4,722,600.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	23.60	13,131,040.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	34.50	2,277,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	184,900	16.70	3,087,830.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,176,900	26.25	30,893,625.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	160.50	13,273,350.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	73,600	25.00	1,840,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	13.30	5,834,045.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	88,700	73.50	6,519,450.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	20.50	3,384,550.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	58.50	5,937,750.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	50.25	4,512,450.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	54.25	4,139,275.00	

	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	62.75	14,200,325.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	9.30	8,109,600.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	38,900	336.00	13,070,400.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	215.00	25,735,500.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	71.25	8,681,812.50	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	4.94	4,749,360.46	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	32.50	1,735,500.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	16,900	168.00	2,839,200.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	88.25	19,406,175.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	69.25	4,722,850.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	288,200	49.50	14,265,900.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	44.75	2,429,925.00	
	タイパーツ 小計	13,478,816		506,170,079.96 (1,938,631,406)	
フィリピン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	55.00	13,086,700.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	769.00	21,747,320.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	515.00	3,531,870.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	303,513	58.45	17,740,334.85	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	871.50	19,874,557.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	96,110	224.80	21,605,528.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	228.00	13,910,280.00	
	MONDE NISSIN CORP	490,500	13.66	6,700,230.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	117.40	11,218,744.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	212,515	99.80	21,208,997.00	
	BDO UNIBANK INC	219,911	129.80	28,544,447.80	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	53.60	8,644,983.20	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	3.88	9,140,116.00	
	AYALA LAND INC	794,100	34.00	26,999,400.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,348,750	37.25	50,240,937.50	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	2,472.00	11,593,680.00	
	PLDT INC	10,460	1,899.00	19,863,540.00	
	AC ENERGY CORP	737,000	8.41	6,198,170.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	357.00	10,392,270.00	
	フィリピン 小計	7,216,099		322,242,105.85 (794,842,378)	
インドネシア ピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	1,439,300	3,270.00	4,706,511,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	29,600.00	5,946,640,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	2,850.00	2,809,530,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	885.00	2,551,012,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	7,600.00	1,855,920,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	10,275.00	1,952,250,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,542,100	5,425.00	8,365,892,500.00	

	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	6,050.00	2,090,880,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,218,400	6,900.00	15,306,960,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	792,300	5,150.00	4,080,345,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	30,600.00	1,823,760,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	7,175.00	1,155,175,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,200.00	2,660,420,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	3,350.00	2,500,440,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,575.00	4,340,542,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	6,307,600	7,625.00	48,095,450,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	474,900	12,575.00	5,971,867,500.00	
	BANK MANDIRI	2,163,796	7,575.00	16,390,754,700.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	8,400.00	6,805,680,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	8,237,202	4,570.00	37,644,013,140.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	1,015.00	2,883,209,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,601,300	4,680.00	26,214,084,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,076,100	3,060.00	3,292,866,000.00	
	インドネシアルピア 小計	42,504,798		209,444,202,840.00 (1,905,942,245)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	6,593	44,450.00	293,058,850.00	
	HD HYUNDAI	5,180	59,100.00	306,138,000.00	
	S-OIL CORPORATION	4,447	105,000.00	466,935,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,647	220,000.00	1,242,340,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	12,381	33,900.00	419,715,900.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	42,650.00	477,210,850.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	657,000.00	514,431,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	154,000.00	292,292,000.00	
	LG CHEM LTD	5,403	503,000.00	2,717,709,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	257,000.00	225,389,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	195,000.00	376,350,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	3,350	130,000.00	435,500,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	9,290	288,500.00	2,680,165,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	1,122	129,000.00	144,738,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	4,038	121,500.00	490,617,000.00	
	SKC CO LTD	1,734	152,500.00	264,435,000.00	
	CJ CORP	1,230	87,900.00	108,117,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	42,250.00	182,013,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	42,494	21,350.00	907,246,900.00	
	ECOPRO BM CO LTD	1,170	480,000.00	561,600,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	42,150.00	284,934,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	44,500.00	434,676,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,139	44,800.00	319,827,200.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	97,400.00	424,079,600.00	

LG CORP	9,026	73,600.00	664,313,600.00
LG ENERGY SOLUTION	2,553	435,500.00	1,111,831,500.00
SAMSUNG C&T CORP	11,910	110,500.00	1,316,055,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	24,800.00	459,196,800.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	59,306	6,350.00	376,593,100.00
SK INC	4,545	251,000.00	1,140,795,000.00
S-1 CORPORATION	840	68,900.00	57,876,000.00
CJ LOGISTICS	862	130,000.00	112,060,000.00
HMM CO LTD	35,545	27,550.00	979,264,750.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,586	196,000.00	310,856,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	23,739	31,350.00	744,217,650.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	6,770.00	201,312,720.00
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	7,066	34,550.00	244,130,300.00
HANON SYSTEMS	19,000	11,550.00	219,450,000.00
HYUNDAI MOBIS	7,116	211,000.00	1,501,476,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	14,897	181,000.00	2,696,357,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,051	91,000.00	277,641,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	89,700.00	309,375,300.00
KIA CORP	29,259	78,100.00	2,285,127,900.00
COWAY CO LTD	5,058	65,700.00	332,310,600.00
F&F CO LTD / NEW	1,600	149,500.00	239,200,000.00
HLB INC	10,012	31,250.00	312,875,000.00
LG ELECTRONICS INC	13,527	124,500.00	1,684,111,500.00
KANGWON LAND INC	7,703	27,200.00	209,521,600.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	24,400.00	123,708,000.00
CJ ENM CO LTD	830	132,600.00	110,058,000.00
HYBE CO LTD	1,547	280,000.00	433,160,000.00
KAKAO CORP	34,497	95,100.00	3,280,664,700.00
KAKAO GAMES CORP	3,021	65,900.00	199,083,900.00
KRAFTON INC	2,345	261,500.00	613,217,500.00
NAVER CORP	14,614	312,000.00	4,559,568,000.00
NCSOFT CORPORATION	1,939	439,500.00	852,190,500.00
NETMARBLE CORP	2,465	103,500.00	255,127,500.00
PEARL ABYSS CORP	4,605	102,400.00	471,552,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	83,600.00	255,063,600.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	95,500.00	98,747,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	181,500.00	99,643,500.00
EMART	1,864	138,500.00	258,164,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	394,500.00	305,737,500.00
KT&G CORP	13,223	81,100.00	1,072,385,300.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	88,900.00	279,323,800.00
AMOREPACIFIC CORP	3,762	166,000.00	624,492,000.00

LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	956	903,000.00	863,268,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	389	493,000.00	191,777,000.00
PACIFIC CORP	3,393	47,450.00	160,997,850.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,851	61,500.00	544,336,500.00
SD BIOSENSOR INC	3,909	48,800.00	190,759,200.00
ALTEOGEN INC	2,841	54,400.00	154,550,400.00
CELLTRION INC	10,890	160,500.00	1,747,845,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,968	89,600.00	176,332,800.00
GREEN CROSS CORP	564	191,000.00	107,724,000.00
HANMI PHARM CO LTD	508	304,000.00	154,432,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,993	825,000.00	1,644,225,000.00
SEEGENE INC	3,838	42,300.00	162,347,400.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	88,300.00	282,295,100.00
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	136,500.00	286,650,000.00
YUHAN CORPORATION	6,107	59,800.00	365,198,600.00
HANA FINANCIAL GROUP	33,962	47,600.00	1,616,591,200.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	11,200.00	317,296,000.00
KAKAObANK CORP	10,063	45,600.00	458,872,800.00
KB FINANCIAL GROUP INC	42,887	59,700.00	2,560,353,900.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	50,883	40,650.00	2,068,393,950.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	15,800.00	938,614,800.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	75,200.00	346,070,400.00
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	7,939	41,000.00	325,499,000.00
MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	6,760.00	323,831,040.00
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	8,300.00	257,424,500.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	11,050.00	133,782,350.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	40,850.00	235,949,600.00
DB INSURANCE CO LTD	4,209	66,500.00	279,898,500.00
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	7,329	47,350.00	347,028,150.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	207,000.00	643,356,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	65,100.00	482,846,700.00
SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	139,000.00	517,775,000.00
ILJIN MATERIALS CO LTD	2,166	90,500.00	196,023,000.00
L&F CO LTD	2,281	242,700.00	553,598,700.00
LG DISPLAY CO LTD	24,071	18,900.00	454,941,900.00
LG INNOTEK CO LTD	1,415	391,500.00	553,972,500.00
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	6,845	157,000.00	1,074,665,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	543,916	67,300.00	36,605,546,800.00
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	96,421	61,000.00	5,881,681,000.00
SAMSUNG SDI CO LTD	6,526	610,000.00	3,980,860,000.00
LG UPLUS CORP	22,125	14,750.00	326,343,750.00
SK TELECOM	9,599	60,400.00	579,779,600.00

	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,459	21,700.00	574,160,300.00	
	SK HYNIX INC	62,753	112,500.00	7,059,712,500.00	
	SK SQUARE CO LTD	11,660	56,500.00	658,790,000.00	
	韓国ウォン 小計	1,799,723		123,633,751,210.00 (12,919,727,001)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	92.20	10,348,528.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	46.95	10,994,563.20	
	CHINA STEEL	1,266,261	38.60	48,877,674.60	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	420,061	79.70	33,478,861.70	
	FORMOSA PLASTICS CORP	441,824	105.50	46,612,432.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	647,752	88.00	57,002,176.00	
	TAIWAN CEMENT	589,511	46.35	27,323,834.85	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,557	875.00	10,987,375.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	30.10	10,475,642.80	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	50,207	223.00	11,196,161.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	6,000	1,360.00	8,160,000.00	
	EVERGREEN MARINE	266,039	141.50	37,644,518.50	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	28.30	13,357,600.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	64,900	156.00	10,124,400.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	180,000	123.00	22,140,000.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	34.05	6,028,927.05	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	462.00	9,210,894.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	43,448	189.50	8,233,396.00	
	GIANT MANUFACTURING	34,464	257.50	8,874,480.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	303.50	4,856,000.00	
	POU CHEN	273,780	30.50	8,350,290.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	42,000	579.00	24,318,000.00	
	MOMO.COM INC	5,000	984.00	4,920,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,544	267.00	15,898,248.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	645,395	66.80	43,112,386.00	
	ONENESS BIOTECH CO LTD	20,000	197.50	3,950,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	587,664	18.50	10,871,784.00	
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,011,237	28.95	58,225,311.15	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,397,452	32.15	44,928,081.80	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,248,238	27.75	34,638,604.50	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,059,344	23.60	25,000,518.40	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,211,339	41.50	50,270,568.50	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	18.35	21,228,913.15	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,009,432	19.40	19,582,980.80	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,078,434	28.55	30,789,290.70	
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	451,861	48.90	22,096,002.90	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	144,167	247.50	35,681,332.50	



YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,056,159	26.15	27,618,557.85
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	888,123	62.70	55,685,312.10
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,896,226	18.50	35,080,181.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	909,435	73.50	66,843,472.50
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,262,866	10.35	13,070,663.10
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	206,724	70.20	14,512,024.80
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	221.50	10,632,000.00
ACER INC	255,803	28.20	7,213,644.60
ADVANTECH CO LTD	43,336	370.50	16,055,988.00
ASUSTEK COMPUTER INC	72,092	357.00	25,736,844.00
AU OPTRONICS CORP	945,090	18.55	17,531,419.50
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	146.50	17,389,550.00
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	1,049,000	15.40	16,154,600.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	25.20	10,880,352.00
DELTA ELECTRONICS INC	217,903	247.50	53,930,992.50
E INK HOLDINGS INC	94,000	177.00	16,638,000.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	60.10	5,580,285.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,447,248	102.00	147,619,296.00
INVENTEC CO LTD	280,511	25.40	7,124,979.40
LARGAN PRECISION CO LTD	11,040	1,640.00	18,105,600.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	68.20	15,375,826.40
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	123.00	7,380,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	449.00	9,429,000.00
PEGATRON CORP	200,474	70.00	14,033,180.00
QUANTA COMPUTER INC	286,270	85.00	24,332,950.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	78.70	10,081,470.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	141,000	210.50	29,680,500.00
WIWYNN CORP	8,000	996.00	7,968,000.00
WPG HOLDINGS LTD	143,692	56.20	8,075,490.40
YAGEO CORPORATION	54,764	413.00	22,617,532.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	106.50	14,688,693.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	410,315	129.50	53,135,792.50
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	76.10	11,947,700.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	192,200	106.00	20,373,200.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	359,315	98.10	35,248,801.50
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	3,000	1,565.00	4,695,000.00
EMEMORY TECHNOLOGY INC	6,000	1,395.00	8,370,000.00
GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	601.00	14,424,000.00
MEDIATEK INC	173,804	838.00	145,647,752.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	115,000	64.40	7,406,000.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	74,045	402.00	29,766,090.00
PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	1,430.00	11,440,000.00

	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50,944	400.00	20,377,600.00
	SILERGY CORP	9,000	2,720.00	24,480,000.00
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,805,389	565.00	1,585,044,785.00
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,316,000	46.65	61,391,400.00
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	108.00	9,612,000.00
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	228.50	7,312,000.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	27.40	9,562,600.00
	新台湾ドル 小計	36,711,794		3,657,090,902.25 (16,187,381,460)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	96,221	375.85	36,164,662.85
	COAL INDIA LTD	180,326	197.75	35,659,466.50
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	293.00	17,411,525.00
	INDIAN OIL CORP LTD	193,765	130.30	25,247,579.50
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	177.15	44,767,399.35
	PETRONET LNG LTD	83,779	203.10	17,015,514.90
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	326,857	2,640.80	863,163,965.60
	ACC LTD	5,315	2,056.50	10,930,297.50
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	354.25	26,049,065.25
	ASIAN PAINTS LTD	42,204	2,991.20	126,240,604.80
	BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	702.70	20,693,812.30
	GRASIM INDUSTRIES LTD	31,529	1,720.40	54,242,491.60
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	180,501	540.80	97,614,940.80
	JSW STEEL LTD	99,332	746.40	74,141,404.80
	PI INDUSTRIES LTD	8,147	2,889.50	23,540,756.50
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	18,199	2,328.55	42,377,281.45
	SHREE CEMENT LTD	1,387	24,860.90	34,482,068.30
	SRF LTD	14,609	2,528.95	36,945,430.55
	TATA STEEL LTD	77,326	1,326.60	102,580,671.60
	ULTRATECH CEMENT LTD	11,556	6,585.70	76,104,349.20
	UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	804.90	43,628,799.60
	VEDANTA LTD	147,245	427.55	62,954,599.75
	ADANI ENTERPRISES LTD	26,979	2,168.30	58,498,565.70
	BHARAT ELECTRONICS LTD	116,287	250.30	29,106,636.10
	HAVELLS INDIA LTD	23,476	1,285.80	30,185,440.80
	LARSEN & TOUBRO LTD	82,638	1,705.75	140,959,768.50
	SIEMENS INDIA LTD	5,926	2,382.05	14,116,028.30
	INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	752.75	17,307,980.75
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	64,743	819.30	53,043,939.90
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	654.45	17,313,474.75
	INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,869.55	15,629,438.00
	BAJAJ AUTO LTD	9,644	3,657.15	35,269,554.60
	BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,097.95	18,526,996.45

BHARAT FORGE LTD	30,322	725.95	22,012,255.90
EICHER MOTORS LTD	14,685	2,454.85	36,049,472.25
HERO MOTOCORP LTD	12,238	2,263.25	27,697,653.50
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	101,669	872.50	88,706,202.50
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	15,707	7,435.10	116,783,115.70
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	124,426	133.95	16,666,862.70
MRF LTD	432	66,361.40	28,668,124.80
TATA MOTORS LTD	190,082	424.95	80,775,345.90
PAGE INDUSTRIES LTD	601	45,437.80	27,308,117.80
TITAN INDUSTRIES LTD	40,781	2,452.60	100,019,480.60
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	546.20	23,994,566.00
INFO EDGE INDIA LTD	7,855	4,611.95	36,226,867.25
TRENT LTD	19,255	1,248.45	24,038,904.75
ZOMATO LTD	170,264	80.45	13,697,738.80
AVENUE SUPERMARTS LTD	17,524	4,008.90	70,251,963.60
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	11,474	3,267.90	37,495,884.60
ITC LTD	345,135	261.55	90,270,059.25
MARICO LTD	81,711	504.10	41,190,515.10
NESTLE INDIA LIMITED	3,906	17,948.60	70,107,231.60
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	61,013	791.35	48,282,637.55
UNITED SPIRITS LTD	32,483	859.00	27,902,897.00
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	9,566	1,502.60	14,373,871.60
DABUR INDIA LTD	58,111	549.00	31,902,939.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	38,464	775.05	29,811,523.20
HINDUSTAN UNILEVER LTD	97,997	2,113.05	207,072,560.85
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	10,114	4,816.35	48,712,563.90
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	662.15	23,450,042.25
BIOCON LTD	58,256	337.95	19,687,615.20
CIPLA LTD	49,816	1,000.30	49,830,944.80
DIVI'S LABORATORIES LTD	14,782	4,411.40	65,209,314.80
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	4,209.70	53,227,446.80
LUPIN LTD	26,552	769.50	20,431,764.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	97,015	922.00	89,447,830.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	6,110	2,840.35	17,354,538.50
AXIS BANK LTD	273,120	797.80	217,895,136.00
BANDHAN BANK LTD	74,811	323.60	24,208,839.60
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	198,623	2,140.20	425,092,944.60
ICICI BANK LTD	591,364	766.30	453,162,233.20
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	62,523	1,707.50	106,758,022.50
STATE BANK OF INDIA	226,932	511.80	116,143,797.60
YES BANK LTD	1,020,164	13.75	14,027,255.00
BAJAJ FINANCE LTD	30,037	7,259.55	218,055,103.35

	BAJAJ FINSERV LTD	3,888	15,720.55	61,121,498.40
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	38,543	736.85	28,400,409.55
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	13,102	2,109.55	27,639,324.10
	MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,303.50	16,193,380.50
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	2,229.40	26,133,026.80
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	31,013	794.45	24,638,277.85
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	21,216	1,118.60	23,732,217.60
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	129,053	546.70	70,553,275.10
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	23,540	1,342.40	31,600,096.00
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	515.80	16,367,365.60
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	53,770	1,124.70	60,475,119.00
	DLF LTD	56,420	377.80	21,315,476.00
	GODREJ PROPERTIES LTD	12,724	1,565.95	19,925,147.80
	HCL TECHNOLOGIES LTD	123,161	1,070.25	131,813,060.25
	INFOSYS LTD	385,346	1,562.00	601,910,452.00
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	5,756	5,472.35	31,498,846.60
	MINDTREE LTD	6,247	3,635.65	22,711,905.55
	MPHASIS LTD	7,796	2,857.05	22,273,561.80
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	106,835	3,471.90	370,920,436.50
	TECH MAHINDRA LTD	72,109	1,301.20	93,828,230.80
	WIPRO LTD	179,580	530.45	95,258,211.00
	BHARTI AIRTEL LTD	294,891	723.50	213,353,638.50
	INDUS TOWERS LTD	90,578	213.65	19,351,989.70
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	2,911.95	123,990,831.00
	ADANI TOTAL GAS LTD	26,949	2,369.40	63,852,960.60
	ADANI TRANSMISSION LTD	27,228	2,598.05	70,739,705.40
	GAIL INDIA LTD	174,768	170.00	29,710,560.00
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	378.50	10,115,034.00
	NTPC LTD	664,141	160.65	106,694,251.65
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	327,337	227.85	74,583,735.45
	TATA POWER CO LTD	145,582	246.45	35,878,683.90
	インドルピー 小計	9,848,613		8,122,497,404.45 (13,808,245,587)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	60,443	18.54	1,120,613.22
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	296,777	3.51	1,043,764.70
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.83	1,257,639.52
	INDUSTRIES QATAR	196,788	19.97	3,929,856.36
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	7.59	1,549,916.02
	MASRAF AL RAYAN	599,719	5.59	3,357,826.68
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	12.51	1,232,973.09
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	25.46	2,908,295.80
	QATAR NATIONAL BANK	530,405	23.20	12,305,396.00

	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.51	729,534.84	
	OOREDOO QSC	72,800	7.08	515,788.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	62,421	18.03	1,125,450.63	
	カタールリアル 小計	2,887,547		31,077,054.86 (1,103,235,447)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	22,520	232.76	5,241,755.20	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	268.93	3,945,203.10	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	6,119	2,000.00	12,238,000.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	51,324	345.10	17,711,912.40	
	GOLD FIELDS LTD	97,102	222.97	21,650,832.94	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	56,301	68.78	3,872,382.78	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	91,758	217.87	19,991,315.46	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	652.33	3,504,316.76	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	33,950	190.90	6,481,055.00	
	SASOL LTD	69,301	370.56	25,680,178.56	
	SIBANYE STILLWATER LTD	313,727	59.72	18,735,776.44	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	216.66	6,001,915.32	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	128.56	5,210,408.24	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	222.39	6,340,338.90	
	NASPERS LTD-N SHS	25,573	1,528.83	39,096,769.59	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	144,533	22.37	3,233,203.21	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	59.66	6,592,131.70	
	BID CORP LTD	35,017	315.00	11,030,355.00	
	CLICKS GROUP LTD	26,921	301.32	8,111,835.72	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	60,003	234.06	14,044,302.18	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	165.00	3,840,210.00	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	145.92	1,900,316.16	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	176.93	9,940,281.26	
	ABSA GROUP LTD	95,814	183.10	17,543,543.40	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	8,544	2,101.63	17,956,326.72	
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	225.31	14,219,539.41	
	STANDARD BANK GROUP LTD	150,257	168.50	25,318,304.50	
	FIRSTRAND LTD	560,323	69.99	39,217,006.77	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	327.66	5,631,492.42	
	REMGRO LTD	55,441	146.50	8,122,106.50	
	DISCOVERY LIMITED	48,488	171.17	8,299,690.96	
	OLD MUTUAL LTD	489,612	12.33	6,036,915.96	
RAND MERCHANT INVESTMENT HD	101,268	48.30	4,891,244.40		
SANLAM LTD	214,053	69.25	14,823,170.25		
NEPI ROCKCASTLE PLC	60,556	95.46	5,780,675.76		
MTN GROUP LTD	194,516	173.85	33,816,606.60		
VODACOM GROUP	62,331	147.98	9,223,741.38		

	南アフリカランド 小計	3,475,407		465,275,160.95 (4,019,977,390)
アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	271,405	4.08	1,107,332.40
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	327,038	10.16	3,322,706.08
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	8.96	1,664,597.76
	DUBAI ISLAMIC BANK	335,455	6.16	2,066,402.80
	EMIRATES NBD PJSC	334,478	15.05	5,033,893.90
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	492,228	22.00	10,829,016.00
	ALDAR PROPERTIES PJSC	367,539	5.29	1,944,281.31
	EMAAR PROPERTIES PJSC	576,832	6.24	3,599,431.68
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	404,510	36.10	14,602,811.00
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	3,295,266		44,170,472.93 (1,553,917,237)
クウェートディ ナール	AGILITY	142,931	1.24	178,377.88
	BOUBYAN BANK K.S.C	136,519	0.90	123,686.21
	KUWAIT FINANCE HOUSE	565,723	0.98	557,237.15
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	838,738	1.04	873,964.99
	MABANEE CO KPSC	71,023	0.86	61,434.89
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	215,000	0.65	140,825.00
	クウェートディナール 小計	1,969,934		1,935,526.12 (821,630,837)
オフショア人民 元	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20,000	30.80	616,000.00
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	5.60	560,000.00
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	17.46	668,718.00
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	18.54	1,627,812.00
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	37.80	1,058,400.00
	YANZHOU COAL MINING CO-A	61,200	37.25	2,279,700.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	5.69	934,867.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	38.89	1,144,921.60
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	7.24	280,188.00
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	44.05	907,430.00
	CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	78,847	21.55	1,699,152.85
	CHINA JUSHI CO LTD -A	96,700	15.53	1,501,751.00
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	35.25	733,200.00
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	8,000	114.15	913,200.00
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	12,413	83.20	1,032,761.60
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	21.35	792,085.00
	HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	11,900	90.18	1,073,142.00
	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	20.48	204,800.00
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	2.21	1,018,810.00
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.91	294,600.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	13.97	311,531.00	

KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	30,400	9.03	274,512.00
LB GROUP CO LTD-A	15,300	21.01	321,453.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	15.68	1,241,856.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	3.75	825,375.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	14.47	701,071.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	28,320	40.17	1,137,614.40
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	21.99	159,471.48
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	33.09	593,634.60
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.74	1,071,884.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	5,600	127.87	716,072.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	7.16	983,784.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	16.20	798,660.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	6,000	72.34	434,040.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	16.15	158,270.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	6.37	587,314.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	82.54	1,444,450.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	49.43	455,744.60
YINTAI GOLD CO LTD-A	111,300	10.50	1,168,650.00
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	11,400	103.66	1,181,724.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	10,400	192.70	2,004,080.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	5,700	80.71	460,047.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	10.85	256,060.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	105,600	12.00	1,267,200.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	39.07	445,398.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	45.58	706,490.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	30.11	252,924.00
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	10.29	658,560.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	17.03	940,311.45
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.42	1,459,502.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	6.09	1,284,381.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	15,100	440.26	6,647,926.00
CRRG CORP LTD-A	185,800	5.24	973,592.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	102,600	12.78	1,311,228.00
EVE ENERGY CO LTD-A	7,573	70.94	537,228.62
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	8.01	182,628.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	6,800	192.82	1,311,176.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	28.89	167,562.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	95.49	601,587.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	13,600	23.38	317,968.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	18,800	43.70	821,560.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	46.77	535,797.12
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	15.12	727,272.00

METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.68	1,217,712.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	22.84	826,808.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	58,320	28.80	1,679,616.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	7.59	1,238,688.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	17.68	740,792.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	10,650	53.10	565,515.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	17,900	9.97	178,463.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	90.10	901,000.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	2,560	329.40	843,264.00
TBEA CO LTD-A	22,519	20.15	453,757.85
WEICHAH POWER CO LTD-A	43,200	12.42	536,544.00
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	2,760	48.63	134,218.80
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	3,800	137.00	520,600.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	5.35	1,066,790.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	11.98	240,929.78
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	28,280	23.46	663,448.80
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	34.74	1,097,784.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	39.39	325,361.40
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	47,190	15.47	730,029.30
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	6.57	526,257.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	5.21	419,926.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	48.24	530,640.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	10.12	262,108.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	106,700	4.88	520,696.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.91	196,400.00
S F HOLDING CO LTD-A	20,300	51.57	1,046,871.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	50.15	266,747.85
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	6.24	277,056.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	17.00	371,280.00
BYD CO LTD -A	9,700	244.86	2,375,142.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	33,348	10.64	354,822.72
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	34.85	644,725.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	19.51	669,193.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	12.62	369,766.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	28,300	49.89	1,411,887.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	16.73	712,698.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	19.77	776,051.58
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	1,031	499.31	514,788.61
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	102.22	286,216.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	31.55	1,372,425.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	30.43	844,736.80
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	6,102	61.00	372,222.00



OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	125.85	969,045.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	23.91	621,660.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	102,000	4.71	480,420.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	53.12	424,960.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	54.00	1,414,800.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	7.24	574,132.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	14.17	474,411.60
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	21.84	535,080.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	7.73	414,328.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	5.70	794,580.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	331.63	961,727.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	29.05	473,515.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	12.36	281,808.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	5.52	339,480.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	12,200	178.63	2,179,286.00
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	3.51	160,758.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	15,480	27.32	422,913.60
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	8,600	33.40	287,240.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	10,140	35.72	362,200.80
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	4.47	181,035.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	40.17	429,819.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	186.50	298,400.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	55.65	122,430.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	119.60	358,800.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	9.15	544,425.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	23.83	245,449.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	56.61	566,100.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	122.51	967,829.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	4,600	35.97	165,462.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	18,408	88.67	1,632,237.36
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	20.90	572,660.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	60.85	1,034,450.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	31.25	37,500.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	38.15	1,308,621.30
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	43.48	752,204.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	135.45	1,232,595.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	27,700	6.97	193,069.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	155.56	871,136.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	27.77	319,355.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	45.73	320,110.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	8,500	1,790.30	15,217,550.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	202.95	1,988,910.00

MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	57.45	1,927,907.10
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	16.79	449,972.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	261.14	2,449,493.20
TONGWEI CO LTD-A	31,600	39.95	1,262,420.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	22.61	862,797.60
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	21,200	165.00	3,498,000.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	49.80	502,980.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	19.00	100,700.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	20.59	611,523.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	23,226	33.07	768,083.82
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	6,500	46.02	299,130.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	33,700	28.29	953,373.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	74.31	210,891.78
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	34.40	334,368.00
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	7,875	43.85	345,318.75
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	43.05	531,667.50
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	18,000	27.39	493,020.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	13.36	138,944.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	18.92	280,016.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	5.73	142,333.20
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	35.42	255,342.78
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	8,400	328.31	2,757,804.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	142.60	285,200.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	37,830	8.19	309,827.70
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	303.66	60,732.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	23,400	21.15	494,910.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	5,167	261.67	1,352,048.89
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	46.16	743,176.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	74.83	411,565.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	152.25	334,950.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	37.09	378,318.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	109.27	1,081,773.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	31.97	709,510.21
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	29.40	470,400.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	97.92	783,360.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	17.92	337,792.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	473.03	983,902.40
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	38,102	33.11	1,261,557.22
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	7,940	95.89	761,366.60
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	21,294	28.15	599,426.10
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	5.75	368,575.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,800	76.17	517,956.00

SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	21.88	153,160.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	59,640	32.41	1,932,932.40
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	16.93	190,157.76
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	58.32	991,440.00
WUXI APPTTEC CO LTD-A	16,464	102.77	1,692,005.28
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	7,100	76.01	539,671.00
ZHANGZHOU PIENZTEHUANG PHA-A	3,900	306.62	1,195,818.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	17.33	156,316.60
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	29,040	31.18	905,467.20
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	35.35	342,895.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.06	1,082,016.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.64	269,120.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	113,400	16.23	1,840,482.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	5.15	509,335.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	15.39	1,734,453.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	75,140	7.39	555,284.60
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	11.77	594,385.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	26,400	37.68	994,752.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	6.70	304,850.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.12	764,388.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	3.29	424,081.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	137,700	42.10	5,797,170.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.78	1,034,208.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	308,600	3.29	1,015,294.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.61	669,834.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	4.73	1,235,476.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	21.45	2,042,040.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	15.81	1,887,714.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.60	792,400.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	8.14	1,125,762.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	4.11	503,475.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	13.10	1,040,140.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	7.85	450,040.50
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	6.12	121,788.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	9.55	445,985.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	14.46	414,423.60
CITIC SECURITIES CO-A	49,680	20.22	1,004,529.60
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	23.45	565,145.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	41,880	25.94	1,086,367.20
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	12.36	44,496.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	5.57	335,314.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	6.74	558,072.00

GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	16.77	1,016,262.00
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	127,170	8.03	1,021,175.10
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	15.44	1,116,312.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	7.54	1,146,457.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	91.50	494,100.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	14.44	454,860.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	6.77	595,083.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	42,700	8.73	372,771.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	9.49	300,833.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	69,616	6.93	482,438.88
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.34	899,248.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	4.29	489,060.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	94,600	3.38	319,748.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	10.33	451,421.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	21.97	399,854.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	46.44	3,102,192.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	16.28	890,516.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	20.66	1,109,442.00
GEMDALE CORP-A	45,500	14.55	662,025.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	123,480	5.11	630,982.80
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	18.38	1,503,484.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	29.01	371,328.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	12.92	109,820.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	9.12	245,328.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	180.66	871,323.18
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	18,900	18.46	348,894.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	11.80	339,840.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	78,400	9.95	780,080.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	6.75	375,975.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	12,740	38.15	486,031.00
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	40.60	438,480.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	13.76	456,832.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	99.40	298,200.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	6,110	47.20	288,392.00
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	91.10	501,050.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	20.42	268,931.40
ADDSINO CO LTD -A	5,800	10.56	61,248.00
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	28.72	1,088,488.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	4.09	468,714.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	27.80	778,400.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	10.45	363,660.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	14.57	303,056.00

FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	9.89	446,039.00
GOERTEK INC -A	26,900	32.05	862,145.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	4.67	233,500.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	68.25	477,750.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	26.92	530,647.04
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	10.50	176,400.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	29.05	1,349,372.50
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,080	205.34	221,767.20
NINESTAR CORP-A	18,543	42.50	788,077.50
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	6.26	195,938.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	16.72	406,296.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	95.17	453,009.20
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	23,500	10.59	248,865.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	13,400	16.26	217,884.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	88.45	569,175.75
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	17.40	495,900.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	10.13	476,110.00
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	18,340	17.61	322,967.40
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	2,800	11.23	31,444.00
WESTONE INFORMATION INDUST-A	20,100	40.96	823,296.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	69.38	291,396.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	29,512	16.97	500,818.64
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	164.49	773,103.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	78.00	877,500.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	16.53	500,859.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	30.14	262,218.00
ZTE CORP-A	12,600	22.64	285,264.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	7.99	1,388,662.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	5.72	1,380,236.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	134,000	23.19	3,107,460.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	17.41	967,996.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	9.74	658,424.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	107.78	764,914.66
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	3.23	266,475.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	6,272	135.27	848,413.44
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	10,800	103.10	1,113,480.00
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	44.20	331,500.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	83.00	622,500.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	17,450	81.00	1,413,450.00
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	23.92	712,816.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	33,600	69.10	2,321,760.00
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	60.13	1,266,037.15

	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	264.68	820,508.00	
	SG MICRO CORP-A	2,100	293.99	617,379.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2,600	65.80	171,080.00	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	29,500	41.61	1,227,495.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	9.73	318,657.50	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	15.20	341,483.20	
	TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	53.03	1,347,916.54	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	4,900	178.48	874,552.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	5,400	164.44	887,976.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	54.70	931,103.40	
	オフショア人民元 小計	15,035,109		263,383,066.04 (5,312,383,765)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	30.10	709,125.90	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	262,490	42.50	11,155,825.00	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	72.30	851,332.50	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	23.10	737,536.80	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	24,254	181.00	4,389,974.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	58.40	1,885,327.20	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	44,984	136.20	6,126,820.80	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	106,249	126.60	13,451,123.40	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	38,414	36.75	1,411,714.50	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	21.02	2,174,119.62	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	63.00	1,673,028.00	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	255.20	1,073,626.40	
	JARIR MARKETING CO	7,199	197.40	1,421,082.60	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	12,480	113.00	1,410,240.00	
	ALMARAI CO	30,130	50.80	1,530,604.00	
	SAVOLA	25,336	37.35	946,299.60	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	6,923	196.40	1,359,677.20	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	4,029	235.80	950,038.20	
	AL RAJHI BANK	138,223	176.20	24,354,892.60	
	ALINMA BANK	109,956	41.05	4,513,693.80	
	ARAB NATIONAL BANK	86,031	32.10	2,761,595.10	
	BANK AL-JAZIRA	35,813	31.00	1,110,203.00	
	BANK ALBILAD	61,145	53.30	3,259,028.50	
	BANQUE SAUDI FRANSI	67,536	54.00	3,646,944.00	
	RIYAD BANK	166,012	38.95	6,466,167.40	
	SAUDI BRITISH BANK	94,400	42.40	4,002,560.00	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	252,104	73.00	18,403,592.00	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	169.60	1,028,284.80	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,613	69.20	457,619.60	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	47,092	10.82	509,535.44	

	EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	11.34	523,760.58	
	ETIHAD ETISALAT CO	34,414	42.15	1,450,550.10	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	26,891	13.82	371,633.62	
	SAUDI TELECOM CO	66,310	113.40	7,519,554.00	
	SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	26.50	2,443,856.50	
	サウジアラビアリアル 小計	2,133,238		136,080,966.76 (4,704,319,020)	
	合 計	287,107,835		103,271,827,082 (103,271,827,082)	

## (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	6,570,584.00	
		メキシコペソ 小計	58,400	6,570,584.00 (42,481,453)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	131,500	3,407,165.00	
		BANCO INTER SA-UNITS	31,500	593,460.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,612,467.00	
		ENERGISA SA-UNITS	16,500	783,255.00	
		KLABIN SA-UNIT	64,600	1,450,916.00	
ブラジルリアル 小計	290,000	7,847,263.00 (217,495,526)			
投資信託受益証券合計			348,400	259,976,979 (259,976,979)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	547,200	12,804,480.00	
		OPERADORA DE SITES MEX-A-1	74,800	1,997,160.00	
		メキシコペソ 小計	622,000	14,801,640.00 (95,698,523)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	6,764,497.29	
	南アフリカランド 小計	478,733	6,764,497.29 (58,445,256)		
投資証券合計			1,100,733	154,143,779 (154,143,779)	
合計				414,120,758 (414,120,758)	

(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 62銘柄	100.0%			3.5%
メキシコペソ	株式 21銘柄	94.4%			2.2%
	投資信託受 益証券 1銘柄		1.7%		0.0%
	投資証券 2銘柄			3.9%	0.1%
ブラジルレアル	株式 44銘柄	96.4%			5.6%
	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%			0.7%
香港ドル	株式 205銘柄	100.0%			21.5%
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%			1.8%
韓国ウォン	株式 111銘柄	100.0%			12.5%
新台湾ドル	株式 86銘柄	100.0%			15.6%
インドルピー	株式 106銘柄	100.0%			13.3%
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 37銘柄	98.6%			3.9%
	投資証券 1銘柄			1.4%	0.1%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式 9銘柄	100.0%			1.5%
クウェートディナール	株式 6銘柄	100.0%			0.8%
オフショア人民元	株式 325銘柄	100.0%			5.1%
サウジアラビアリアル	株式 35銘柄	100.0%			4.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表



該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

#### 新興国債券インデックス マザーファンド

##### 貸借対照表

項目	2022年 4月20日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	280,783,099
コール・ローン	937,106,661
国債証券	82,019,953,418
未収利息	1,312,536,963
前払費用	118,682,481
流動資産合計	84,669,062,622
資産合計	84,669,062,622
負債の部	
流動負債	
未払解約金	7,203,432
未払利息	717
流動負債合計	7,204,149
負債合計	7,204,149
純資産の部	
元本等	
元本	46,958,531,099
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	37,703,327,374
元本等合計	84,661,858,473
純資産合計	84,661,858,473
負債純資産合計	84,669,062,622

##### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 4月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>

2022年 4月20日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2022年 4月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	46,958,531,099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 1.8029円 (1万口当たり純資産額) (18,029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 4月20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 4月20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 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年10月21日
期首元本額	44,300,326,019円
期中追加設定元本額	5,280,919,611円
期中一部解約元本額	2,622,714,531円
期末元本額	46,958,531,099円
期末元本額の内訳	

区分	2022年 4月20日現在
S M T 新興国債券インデックス・オープン	5,191,428,474円
世界経済インデックスファンド	11,686,756,110円
D C 新興国債券インデックス・オープン	5,073,770,075円
D C 世界経済インデックスファンド	10,595,856,493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）	4,014,677円
コア投資戦略ファンド（安定型）	146,670,330円
コア投資戦略ファンド（成長型）	399,809,303円
新興国債券インデックス・オープン（S M A 専用）	72,558,772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
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	441,573,365円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,361,889,391円
コア投資戦略ファンド（切替型）	154,101,775円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	206,755,566円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	95,721,241円
S M T インデックスバランス・オープン	168,322,045円
外国債券S M T B セレクション（S M A 専用）	4,115,346,630円
S M T 世界経済インデックス・オープン	316,884,768円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	389,074,447円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	632,065,451円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	7,991,449円
グローバル経済コア	729,156,784円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	43,103,997円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	5,601,256円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	15,203,026円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	12,920,652円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	4,705,832円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	6,117,464円
M y S M T 新興国債券インデックス（ノーロード）	285,051円
F O F s 用 新興国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	78,622,999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）	462,949,367円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	88,172,368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）	17,925,117円
S M T A M 海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	292,262,934円
S M T A M 海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	293,593,594円
S M T A M 海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	286,262,653円
S M T A M 海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	284,802,944円
S M T A M 海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	283,079,813円
S M T A M 海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	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 4月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		4,420,549,449
合計		4,420,549,449

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考		
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	31,800,000.00	34,582,818.00			
		MBONO 10% 12/05/24	104,250,000.00	106,975,095.00			
		MBONO 5.75% 03/05/26	198,300,000.00	177,962,352.00			
		MBONO 6.75% 03/09/23	69,600,000.00	68,597,064.00			
		MBONO 7.5% 06/03/27	144,000,000.00	135,711,360.00			
		MBONO 7.75% 05/29/31	124,600,000.00	115,575,222.00			
		MBONO 7.75% 11/13/42	96,500,000.00	85,175,725.00			
		MBONO 7.75% 11/23/34	34,600,000.00	31,513,680.00			
		MBONO 8.5% 05/31/29	136,900,000.00	133,843,023.00			
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	94,648,155.00			
		MBONO 8% 09/05/24	128,400,000.00	126,051,564.00			
		MBONO 8% 11/07/47	93,100,000.00	83,911,961.00			
		MBONO 8% 12/07/23	105,950,000.00	104,968,903.00			
			メキシコペソ 小計		1,366,300,000.00	1,299,516,922.00 (8,401,896,707)	
			ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/24	92,100,000.00	75,149,473.92	
BLTN 0% 07/01/23	70,000,000.00			60,451,034.00			
BLTN 0% 07/01/24	41,850,000.00			32,361,675.93			
BLTN 0% 07/01/25	4,500,000.00			3,126,986.55			
BNTNF 10% 01/01/23	40,100,000.00			39,325,093.12			

	BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000.00	30,272,265.64	
	BNTNF 10% 01/01/27	41,200,000.00	38,417,802.68	
	BNTNF 10% 01/01/29	21,700,000.00	19,774,314.63	
	BNTNF 10% 01/01/31	13,850,000.00	12,383,343.70	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,327,375.00	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,799,062.50	
	ブラジルレアル 小計	360,400,000.00	314,388,427.67	(8,713,621,100)
チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	995,000,000.00	778,630,026.30	
	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,685,000,000.00	2,401,773,695.95	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,820,000,000.00	1,685,039,021.12	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,940,000,000.00	1,717,543,389.36	
	BTPCL 4% 03/01/23	1,010,000,000.00	985,992,853.48	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,040,000,000.00	1,777,228,997.40	
	BTPCL 5% 10/01/28	660,000,000.00	608,854,791.60	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,650,000,000.00	1,547,604,616.80	
	チリペソ 小計	12,800,000,000.00	11,502,667,392.01	(1,815,097,909)
コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	68,100,000,000.00	69,060,210,000.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	4,400,000,000.00	3,992,648,000.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	33,600,000,000.00	27,306,384,000.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	11,300,000,000.00	8,266,741,000.00	
	コロンビアペソ 小計	117,400,000,000.00	108,625,983,000.00	(3,746,075,649)
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,500,000.00	3,404,475.00	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	6,350,000.00	5,191,696.50	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,684,904.00	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	8,900,000.00	8,306,103.00	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,000,000.00	6,313,160.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	7,700,000.00	7,395,773.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	7,450,000.00	6,814,291.50	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	8,950,000.00	8,648,922.00	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	6,050,000.00	6,413,423.50	
	ペルーソル 小計	60,600,000.00	56,172,748.50	(1,959,608,800)
ウルグアイペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	23,277,500.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	16,345,160.00	
	ウルグアイペソ 小計	42,000,000.00	39,622,660.00	(125,013,454)
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	20,856,348.00	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	33,000,000.00	33,700,920.00	
	ドミニカペソ 小計	53,400,000.00	54,557,268.00	(128,215,035)

チェココルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	26,100,000.00	18,914,409.00	
	CZGB 0.25% 02/10/27	53,700,000.00	43,660,248.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	47,000,000.00	43,739,610.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	64,900,000.00	50,182,627.00	
	CZGB 0% 12/12/24	12,000,000.00	10,517,760.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	57,000,000.00	44,583,120.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25	58,500,000.00	52,665,210.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	22,700,000.00	15,028,308.00	
	CZGB 1.75% 06/23/32	47,000,000.00	37,763,560.00	
	CZGB 1% 06/26/26	72,800,000.00	62,407,072.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	62,700,000.00	57,674,595.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	63,300,000.00	56,534,496.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	58,500,000.00	52,734,240.00	
	CZGB 2% 10/13/33	70,000,000.00	56,336,700.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	34,500,000.00	34,493,445.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	45,200,000.00	45,613,128.00	
	チェココルナ 小計		795,900,000.00	682,848,528.00
ハンガリーフォリント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	495,506,220.00	
	HGB 1.5% 08/23/23	322,500,000.00	302,147,025.00	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	410,243,960.00	
	HGB 1% 11/26/25	525,000,000.00	427,497,000.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	542,000,000.00	361,335,140.00	
	HGB 2.25% 06/22/34	256,000,000.00	164,016,640.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	494,849,480.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	470,500,000.00	391,710,070.00	
	HGB 2% 05/23/29	633,000,000.00	462,001,380.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	692,000,000.00	527,324,760.00	
	HGB 3% 04/25/41	321,000,000.00	199,029,630.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	372,876,000.00	
	HGB 3% 08/21/30	555,000,000.00	423,936,750.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	485,670,880.00	
	HGB 3% 10/27/38	380,000,000.00	244,997,400.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	632,240,400.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	396,000,000.00	392,261,760.00	
HGB 6.75% 10/22/28	382,000,000.00	377,614,640.00		
ハンガリーフォリント 小計		8,802,000,000.00	7,165,259,135.00	(2,690,733,936)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	18,500,000.00	13,986,000.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	19,500,000.00	16,456,245.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	15,200,000.00	10,395,432.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	5,200,000.00	3,500,588.00	

	POLGB 2.25% 10/25/24	17,950,000.00	16,214,953.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	16,500,000.00	16,102,680.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	15,350,000.00	14,243,572.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000.00	20,386,190.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	14,400,000.00	11,828,592.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	17,600,000.00	14,353,152.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000.00	20,731,491.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	17,350,000.00	15,613,612.00	
	POLGB 4% 10/25/23	12,700,000.00	12,309,475.00	
	ポーランドズロチ 小計	220,450,000.00	186,121,982.00 (5,591,309,073)	
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	3,000,000.00	2,447,430.00	
	ROMGB 3.25% 04/29/24	1,200,000.00	1,139,148.00	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	6,000,000.00	5,312,160.00	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	12,600,000.00	11,661,552.00	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	6,000,000.00	4,745,100.00	
	ROMGB 3.7% 11/25/24	10,000,000.00	9,445,800.00	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	10,500,000.00	9,306,360.00	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	5,400,000.00	4,525,308.00	
	ROMGB 4.25% 06/28/23	20,000,000.00	19,674,400.00	
	ROMGB 4.5% 06/17/24	2,200,000.00	2,132,174.00	
	ROMGB 4.75% 02/24/25	3,200,000.00	3,085,696.00	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	3,800,000.00	3,153,658.00	
	ROMGB 4% 10/25/23	13,800,000.00	13,431,264.00	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	3,000,000.00	2,903,940.00	
	ROMGB 5% 02/12/29	6,000,000.00	5,481,720.00	
	ルーマニアレイ 小計	106,700,000.00	98,445,710.00 (2,782,725,506)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	12,200,000.00	10,809,932.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,199,388.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	17,600,000.00	17,803,280.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	13,450,000.00	13,330,295.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	25,500,000.00	25,076,700.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	4,921,052.50	
	MGS 3.757% 05/22/40	18,350,000.00	16,104,510.50	
	MGS 3.8% 08/17/23	7,100,000.00	7,233,551.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	7,637,972.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	29,800,000.00	29,400,084.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	20,800,000.00	21,000,304.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	14,450,000.00	14,643,774.50	
	MGS 3.906% 07/15/26	8,700,000.00	8,809,881.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000.00	26,405,860.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	19,550,000.00	19,995,153.50	



	MGS 4.065% 06/15/50	13,950,000.00	12,296,367.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,100,000.00	9,315,033.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	20,050,000.00	19,406,996.50	
	MGS 4.762% 04/07/37	7,350,000.00	7,462,749.00	
マレーシアリングット 小計		282,150,000.00	276,852,884.00	(8,376,820,767)
タイバーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	90,500,000.00	89,814,915.00	
	THAIGB 0.95% 06/17/25	116,700,000.00	114,879,480.00	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	184,000,000.00	184,544,640.00	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	56,800,000.00	46,661,200.00	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	53,633,937.00	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	111,100,000.00	104,105,144.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	143,600,000.00	145,598,912.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	152,000,000.00	155,952,000.00	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	90,100,000.00	78,818,579.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	193,200,000.00	198,764,160.00	
	THAIGB 2% 06/17/42	65,600,000.00	50,349,968.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	65,000,000.00	65,655,850.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	122,700,000.00	121,011,648.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	129,200,000.00	130,958,412.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	99,000,000.00	102,473,910.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	175,500,000.00	189,596,160.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	122,500,000.00	133,877,800.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	113,667,576.00	
THAIGB 4.875% 06/22/29	119,500,000.00	139,990,665.00		
タイバーツ 小計		2,207,500,000.00	2,220,354,956.00	(8,503,959,481)
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	14,879,850.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	31,642,800.00	
フィリピンペソ 小計		45,000,000.00	46,522,650.00	(114,752,768)
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	9,020,756,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	19,099,638,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	26,000,000,000.00	25,112,620,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	36,500,000,000.00	36,294,505,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	50,300,000,000.00	51,160,633,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	34,000,000,000.00	33,514,480,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	17,083,016,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	41,000,000,000.00	39,256,680,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	62,500,000,000.00	60,994,375,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	44,300,000,000.00	45,883,725,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	31,000,000,000.00	30,118,360,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	22,300,000,000.00	22,025,041,000.00	

	INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	34,829,600,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	21,000,000,000.00	21,548,940,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	34,700,000,000.00	35,618,162,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	19,015,296,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	40,800,000,000.00	42,394,056,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	69,000,000,000.00	69,580,290,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	45,600,000,000.00	48,724,968,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	22,200,000,000.00	24,106,980,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	31,800,000,000.00	34,537,344,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,602,248,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	53,600,000,000.00	57,151,536,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	44,000,000,000.00	48,269,320,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	23,434,904,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	43,788,398,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	14,700,000,000.00	16,417,401,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,370,262,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	19,700,000,000.00	22,168,410,000.00	
	インドネシアルピア 小計	924,800,000,000.00	959,121,944,000.00 (8,728,009,690)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	155,400,000.00	168,848,316.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	54,800,000.00	37,611,432.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	46,100,000.00	30,011,100.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	32,000,000.00	32,579,840.00	
	SAGB 7% 02/28/31	64,700,000.00	53,003,534.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	97,200,000.00	85,037,364.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	97,700,000.00	81,450,536.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	86,000,000.00	70,575,040.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	134,200,000.00	109,712,526.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	78,000,000.00	68,445,780.00	
	SAGB 8% 01/31/30	122,700,000.00	110,274,171.00	
	SAGB 9% 01/31/40	64,450,000.00	54,923,645.50	
		南アフリカランド 小計	1,033,250,000.00	902,473,284.50 (7,797,369,178)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,420,752.00	
	CGB 2.36% 07/02/23	8,000,000.00	8,015,440.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	26,860,197.00	
	CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,046,500.00	
	CGB 2.75% 02/17/32	2,400,000.00	2,386,296.00	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,700,000.00	11,832,912.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	18,400,000.00	18,572,776.00	
	CGB 2.88% 11/05/23	16,900,000.00	17,071,873.00	
	CGB 2.89% 11/18/31	5,000,000.00	5,019,100.00	

	CGB 2.91% 10/14/28	6,000,000.00	6,042,300.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,330,740.00	
	CGB 3.01% 05/13/28	15,000,000.00	15,207,900.00	
	CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,587,975.00	
	CGB 3.02% 10/22/25	19,900,000.00	20,251,434.00	
	CGB 3.03% 03/11/26	17,500,000.00	17,816,400.00	
	CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,475,400.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	20,300,000.00	20,711,075.00	
	CGB 3.19% 04/11/24	24,100,000.00	24,535,487.00	
	CGB 3.22% 12/06/25	12,000,000.00	12,298,560.00	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,606,320.00	
	CGB 3.25% 11/22/28	14,900,000.00	15,330,312.00	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,712,800.00	
	CGB 3.28% 12/03/27	20,000,000.00	20,643,000.00	
	CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	14,677,262.00	
	CGB 3.29% 10/18/23	16,000,000.00	16,275,200.00	
	CGB 3.53% 10/18/51	5,100,000.00	5,263,506.00	
	CGB 3.72% 04/12/51	7,300,000.00	7,746,103.00	
	CGB 3.81% 09/14/50	19,300,000.00	20,768,344.00	
	オフショア人民元 小計	420,400,000.00	428,505,964.00 (8,642,879,592)	
	合計		82,019,953,418 (82,019,953,418)	

## 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%	10.2%
ブラジルレアル	国債証券 11銘柄	100.0%	10.6%
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%	4.6%
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%	4.8%
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 13銘柄	100.0%	6.8%
ルーマニアレイ	国債証券 15銘柄	100.0%	3.4%

マレーシアリングット	国債証券	19銘柄	100.0%	10.2%
タイバーツ	国債証券	19銘柄	100.0%	10.4%
フィリピンペソ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.1%
インドネシアルピア	国債証券	29銘柄	100.0%	10.6%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.0%	9.5%
オフショア人民元	国債証券	28銘柄	100.0%	10.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## J-REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 4月20日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	2,943,283,068
投資証券	109,666,513,100
派生商品評価勘定	150,343,600
未収配当金	960,109,395
差入委託証拠金	230,582,000
流動資産合計	113,950,831,163
資産合計	113,950,831,163
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受金	150,343,600
未払金	44,057,400
未払解約金	1,017,110
未払利息	2,253
流動負債合計	195,420,363
負債合計	195,420,363
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	53,331,017,445
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	60,424,393,355
元本等合計	113,755,410,800
純資産合計	113,755,410,800
負債純資産合計	113,950,831,163

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 4月20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 4月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	53,331,017,445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 2.1330円 (1万口当たり純資産額) (21,330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 4月20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 4月20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 4月20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 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年10月21日
期首元本額	50,765,275,109円
期中追加設定元本額	5,568,388,557円
期中一部解約元本額	3,002,646,221円
期末元本額	53,331,017,445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）	1,685,551,924円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,963,276円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	16,536,502,633円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	25,247,390,476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	26,342,963円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	260,548,498円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	7,000,817円
グローバル経済コア	239,420,901円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	11,631,951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）	67,971,842円
M y S M T J - R E I T インデックス（ノーロード）	228,840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）	482,814,460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）	19,728,019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）	82,427,231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）	862,850,502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）	260,538,934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）	297,063,535円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 4月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		4,094,375,169
合計		4,094,375,169

(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 4月20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	-		4,061,552,000	150,343,600
	合計	3,911,208,400	-		4,061,552,000	150,343,600

## (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ではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,022	270,948,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,181	323,189,600	
	S O S i L A 物流リート投資法人	4,672	717,619,200	
	東海道リート投資法人	769	87,512,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,467	2,173,809,000	



森ヒルズリート投資法人	11,809	1,746,551,100	
産業ファンド投資法人	14,256	2,584,612,800	
アドバンス・レジデンス投資法人	10,041	3,544,473,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,186	1,488,939,200	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,352	2,218,404,000	
G L P 投資法人	32,524	5,623,399,600	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,672	1,504,384,000	
日本プロロジスリート投資法人	16,430	5,914,800,000	
星野リゾート・リート投資法人	1,683	1,122,561,000	
O n e リート投資法人	1,743	484,554,000	
イオンリート投資法人	11,810	1,747,880,000	
ヒューリックリート投資法人	9,368	1,511,995,200	
日本リート投資法人	3,099	1,146,630,000	
積水ハウス・リート投資法人	30,482	2,395,885,200	
トーセイ・リート投資法人	2,098	281,551,600	
ケネディクス商業リート投資法人	4,010	1,099,943,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,460	390,402,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,275	293,475,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	32,474	5,303,004,200	
いちごホテルリート投資法人	1,664	147,430,400	
ラサールロジポート投資法人	12,293	2,159,880,100	
スターアジア不動産投資法人	10,378	624,755,600	
マリモ地方創生リート投資法人	1,176	155,232,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,956	2,183,712,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,621	111,362,700	
投資法人みらい	12,164	631,311,600	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,356	306,986,800	
三菱地所物流リート投資法人	2,917	1,343,278,500	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	3,889	755,243,800	
ザイマックス・リート投資法人	1,621	203,597,600	
タカラレーベン不動産投資法人	3,960	475,200,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,916	614,028,800	
日本ビルファンド投資法人	11,707	7,902,225,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	10,042	6,215,998,000	
日本都市ファンド投資法人	50,668	5,228,937,600	
オリックス不動産投資法人	20,009	3,397,528,200	
日本プライムリアルティ投資法人	6,862	2,707,059,000	
N T T 都市開発リート投資法人	9,626	1,510,319,400	
東急リアル・エステート投資法人	6,733	1,238,872,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	6,973	787,949,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	22,607	3,192,108,400	
森トラスト総合リート投資法人	7,177	1,011,957,000	

インヴィンシブル投資法人	44,200	1,935,960,000	
フロンティア不動産投資法人	3,520	1,770,560,000	
平和不動産リート投資法人	6,506	972,647,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,771	2,143,021,500	
福岡リート投資法人	5,194	855,451,800	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,107	2,190,435,000	
いちごオフィスリート投資法人	8,228	705,962,400	
大和証券オフィス投資法人	2,123	1,545,544,000	
阪急阪神リート投資法人	4,536	677,678,400	
スターツプロシード投資法人	1,564	364,568,400	
大和ハウスリート投資法人	15,078	4,817,421,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	30,765	2,067,408,000	
大和証券リビング投資法人	13,569	1,525,155,600	
ジャパンエクセレント投資法人	9,318	1,213,203,600	
合計	586,677	109,666,513,100	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	2022年 4月20日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
預金	371,369,603	
コール・ローン	3,650,422	
投資証券	112,154,963,390	
未収入金	1	
未収配当金	81,508,944	
流動資産合計	112,611,492,358	
資産合計	112,611,492,358	
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	168,428	
未払解約金	5,028,618	
未払利息	2	
流動負債合計	5,197,048	
負債合計	5,197,048	

	2022年 4月20日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	38,854,299,591
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	73,751,995,719
元本等合計	112,606,295,310
純資産合計	112,606,295,310
負債純資産合計	112,611,492,358

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 4月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		2022年 4月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		38,854,299,591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)	2.8982円 (28,982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 4月20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 4月20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。	

	2022年 4月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価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 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年10月21日
期首元本額	41,522,088,343円
期中追加設定元本額	3,949,384,830円
期中一部解約元本額	6,617,173,582円
期末元本額	38,854,299,591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	61,766,844円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	92,933,067円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,678,346,660円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,928,724円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	12,132,905,868円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	16,365,853,772円
コア投資戦略ファンド（安定型）	709,208,254円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,597,861,481円

区分	2022年 4月20日現在
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）	662,607,179円
SMT インデックスバランス・オープン	134,720,651円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	214,485,652円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,716,949円
グローバル経済コア	232,416,468円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	11,453,503円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	379,947,571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）	183,352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）	1,138,646,299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）	335,653,798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）	49,389,331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2020-05（適格機関投資家専用）	108,175,910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 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	1,967,502,138
合計	1,967,502,138

(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 4月20日現在）

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

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	83,281,320	-	83,449,748	168,428
	アメリカドル	74,898,000	-	75,065,786	167,786
	ユーロ	8,383,320	-	8,383,962	642
	合計	83,281,320	-	83,449,748	168,428

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	46,940	1,009,679.40	
		AGREE REALTY CORP	38,205	2,724,016.50	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	37,122	844,896.72	
		ALEXANDER'S INC	1,190	314,433.70	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	76,749	15,161,764.95	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	107,160.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	27,081	985,206.78	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	73,032	4,732,473.60	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	155,315	6,678,545.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST	139,990	3,984,115.40	
		APARTMENT INCOME REIT CO	82,424	4,359,405.36	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	79,751	543,104.31	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	115,391	2,080,499.73	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	38,600	558,542.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	147,560.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	73,715	18,201,707.80	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	394,267.50	
		BOSTON PROPERTIES	74,868	9,449,090.28	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	176,218.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	1,202,080.80	

BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	156,266	4,137,923.68	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	86,966	1,953,256.36	
BRT APARTMENTS CORP	5,000	119,500.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	53,830	8,921,784.20	
CARETRUST REIT INC	52,477	890,534.69	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	13,620	443,058.60	
CEDAR REALTY TRUST INC	6,800	192,576.00	
CENTERSPACE	7,659	763,985.25	
CHATHAM LODGING TRUST	25,360	349,714.40	
CITY OFFICE REIT INC	25,050	407,313.00	
CLIPPER REALTY INC	7,300	69,715.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	12,543	506,737.20	
CORPORATE OFFICE PPTYS	61,791	1,748,685.30	
COUSINS PROPERTIES INC	77,846	3,043,778.60	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	5,000	36,300.00	
CTO REALTY GROWTH INC	2,800	181,916.00	
CUBESMART	115,075	6,196,788.75	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	1,170,960.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	149,726	22,511,304.10	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	281,417	2,119,070.01	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	323,536.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	91,858	2,867,806.76	
DUKE REALTY CORP	200,731	12,086,013.51	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	47,668	964,323.64	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	21,355	4,459,564.65	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	726,817.28	
EPR PROPERTIES	41,014	2,256,590.28	
EQUINIX INC	47,521	35,841,288.62	
EQUITY COMMONWEALTH	58,772	1,590,958.04	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	90,856	7,374,781.52	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	180,224	16,393,175.04	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	66,811	1,758,465.52	
ESSEX PROPERTY TRUST	34,385	11,954,976.80	
EXTRA SPACE STORAGE INC	70,598	15,412,955.36	
FARMLAND PARTNERS INC	12,200	198,738.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	37,153	4,637,065.93	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	68,397	4,348,681.26	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	39,881	1,176,888.31	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	255,150.15	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	123,467	5,780,724.94	
GETTY REALTY CORP	21,985	630,309.95	



GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	464,256.00	
GLADSTONE LAND CORP	15,500	646,505.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	33,930	539,147.70	
GLOBAL NET LEASE INC	57,012	865,442.16	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	76,980	2,106,942.60	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	115,803	3,600,315.27	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	284,118	9,907,194.66	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	13,650	131,586.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	54,799	2,423,759.77	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	375,710	7,675,755.30	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	79,230	2,033,834.10	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	115,571	3,155,088.30	
INDUS REALTY TRUST INC	3,840	284,083.20	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	688,194.50	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	14,225	2,337,452.00	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	35,960	1,110,804.40	
INVITATION HOMES INC	314,573	13,539,221.92	
IRON MOUNTAIN INC	152,471	8,608,512.66	
JBG SMITH PROPERTIES	59,353	1,639,329.86	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	350,150.00	
KILROY REALTY CORPORATION	55,124	4,129,338.84	
KIMCO REALTY CORP	324,627	8,375,376.60	
KITE REALTY GROUP TRUST	114,476	2,568,841.44	
LIFE STORAGE INC	43,142	6,373,367.66	
LTC PROPERTIES INC	20,624	745,763.84	
LXP INDUSTRIAL TRUST	152,908	2,021,443.76	
MACERICH CO/THE	110,615	1,593,962.15	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	957,964	613,096.96	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	313,989	6,220,122.09	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	60,794	12,615,362.94	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	92,186	4,396,350.34	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	42,860	2,815,473.40	
NATL HEALTH INVESTORS INC	25,030	1,374,647.60	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	71,590	567,708.70	
NETSTREIT CORP	20,992	487,224.32	
NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	1,096,922.06	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	697,141.50	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	125,306	3,366,972.22	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	267,084.94	
ORION OFFICE REIT INC	30,374	425,843.48	
PARAMOUNT GROUP INC	89,726	945,712.04	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	129,203	2,556,927.37	

PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,613	1,793,905.65	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	35,000	18,900.00	
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	60,769	2,179,176.34	
PHYSICIANS REALTY TRUST	118,562	2,062,978.80	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	1,132,972.32	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	16,890	434,579.70	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	123,130.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	29,639	738,011.10	
PRIME US REIT	295,000	222,725.00	
PROLOGIS INC	390,733	66,252,687.48	
PS BUSINESS PARKS INC	11,044	1,857,379.92	
PUBLIC STORAGE	80,515	33,266,382.55	
REALTY INCOME CORP	298,481	22,123,411.72	
REGENCY CENTERS CORP	81,010	5,802,746.30	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	61,972	1,209,693.44	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	84,311	6,711,998.71	
RLJ LODGING TRUST	92,291	1,303,148.92	
RPT REALTY	43,950	613,981.50	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	28,793	2,827,184.67	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	118,863	1,476,278.46	
SAFEHOLD INC	8,335	396,162.55	
SAUL CENTERS INC	6,800	372,028.00	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	19,900	235,616.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	84,169	755,837.62	
SIMON PROPERTY GROUP	173,368	22,766,685.76	
SITE CENTERS CORP	98,828	1,647,462.76	
SL GREEN REALTY CORP	33,508	2,505,393.16	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	66,872	3,159,033.28	
STAG INDUSTRIAL INC	92,435	3,810,170.70	
STORE CAPITAL CORP	128,717	3,922,006.99	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	52,970	517,516.90	
SUN COMMUNITIES INC	61,104	11,499,161.76	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	120,963	1,461,233.04	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	53,323	943,817.10	
TERRENO REALTY CORP	39,525	3,056,073.00	
UDR INC	157,522	9,136,276.00	
UMH PROPERTIES INC	25,320	627,682.80	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	403,666.97	
URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	1,160,491.50	
URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	276,167.50	
VENTAS INC	210,428	12,743,519.68	

	VERIS RESIDENTIAL INC	42,236	703,229.40	
	VICI PROPERTIES INC	331,286	9,912,077.12	
	VORNADO REALTY TRUST	83,354	3,475,028.26	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	45,570	1,152,009.60	
	WELLTOWER INC	229,650	22,225,527.00	
	WHITESTONE REIT	30,474	405,913.68	
	WP CAREY INC	100,355	8,553,256.65	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,030	1,222,151.70	
	アメリカドル 小計	13,867,440	668,017,209.26 (86,461,467,394)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	33,942	1,524,335.22	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	410,668.20	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	172,200.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	13,260	771,997.20	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	88,000.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	44,074	2,309,918.34	
	CHOICE PROPERTIES REIT	86,170	1,344,252.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	486,359.10	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	506,072.50	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	60,960	974,750.40	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	375,489.40	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	112,330.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	1,005,187.40	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,545	1,651,191.00	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	72,239	952,110.02	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	77,691.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	34,090	522,599.70	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	629,238.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	224,109.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	250,710.50	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,000	124,740.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	60,470	839,928.30	
	PLAZA RETAIL REIT	25,000	124,500.00	
	PRIMARIS REIT	28,309	415,293.03	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	78,368	1,961,551.04	
	SLATE GROCERY REIT	17,300	283,720.00	
	SLATE OFFICE REI	17,000	87,890.00	

	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	36,116	1,189,661.04
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	1,013,320.00
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	182,922.00
	カナダドル 小計	980,045	20,612,734.39 (2,115,897,185)
ユーロ	AEDIFICA	19,087	2,193,096.30
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	7,200	100,728.00
	ALTAREA	2,480	367,040.00
	BEFIMMO S.C.A.	13,810	655,975.00
	CARE PROPERTY INVEST	15,000	374,250.00
	CARMILA	25,000	398,000.00
	COFINIMMO	15,427	2,047,162.90
	COIMA RES SPA	11,900	98,651.00
	COVIVIO(FP)	24,411	1,766,135.85
	CROMWELL REIT EUR	160,000	368,000.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,783	524,978.58
	GECINA SA	28,422	3,117,893.40
	HAMBORNER REIT AG	37,000	357,790.00
	HIBERNIA REIT PLC	365,550	592,191.00
	ICADE	16,740	997,704.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	154,082.40
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	135,462	1,109,433.78
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	344,245.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	312,480.00
	KLEPIERRE	101,585	2,348,645.20
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	174,080.00
	MERCIALYS	28,000	258,300.00
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	182,874	1,938,464.40
	MONTEA NV	5,300	632,820.00
	NSI NV	10,050	383,407.50
	RETAIL ESTATES	6,400	469,760.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	61,021	4,285,504.83
	VASTNED RETAIL	10,650	288,082.50
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	74,072	2,982,138.72
	WERELDHAVE NV	22,670	411,233.80
	XIOR STUDENT HOUSING NV	10,440	534,528.00
	ユーロ 小計	1,701,224	30,586,802.16 (4,273,893,865)
イギリスポ ンド	AEW UK REIT PLC	118,000	143,960.00
	ASSURA PLC	1,622,040	1,104,609.24
	BIG YELLOW GROUP PLC	90,946	1,369,646.76

	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	435,000	503,730.00
	BRITISH LAND CO PLC	485,911	2,489,807.96
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	485,308	782,801.80
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	289,138.69
	CUSTODIAN REIT PLC	234,276	238,024.41
	DERWENT LONDON PLC	58,772	1,857,195.20
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	278,460.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	138,780	977,011.20
	HAMMERSON PLC	1,784,000	563,208.80
	HOME REIT PLC	309,934	391,756.57
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	177,355	222,048.46
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	390,106	2,953,882.63
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	506,380	1,391,532.24
	LXI REIT PLC	486,008	725,123.93
	NEWRIVER REIT PL	126,000	112,014.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	270,680.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	685,888	1,029,517.88
	PRS REIT PLC/THE	325,000	360,100.00
	REGIONAL REIT LTD	222,000	192,252.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	110,637	1,461,514.77
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	212,800.00
	SEGRO PLC	631,633	8,558,627.15
	SHAFTESBURY PLC	155,193	926,502.21
	STANDARD LIFE INV PROP INC	260,756	226,596.96
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	544,000	685,440.00
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	187,836.26
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	966,516	2,364,098.13
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	490,000	457,660.00
	UNITE GROUP PLC	209,572	2,359,780.72
	WORKSPACE GROUP PLC	70,347	492,077.26
	イギリスbond 小計	14,099,671	36,188,705.23 (6,097,434,944)
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	197,716	662,348.60
	ARENA REIT	196,053	952,817.58
	BWP TRUST	262,160	1,077,477.60
	CENTURIA CAPITAL GROUP	356,300	979,825.00
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	301,606	1,179,279.46
	CENTURIA OFFICE REIT	240,945	542,126.25
	CHARTER HALL GROUP	254,969	4,010,662.37
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	307,782	1,640,478.06
	CHARTER HALL RETAIL REIT	291,160	1,260,722.80
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	772,548.00

	CROMWELL PROPERTY GROUP	822,633	699,238.05	
	DEXUS	561,242	6,067,026.02	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	385,330.00	
	GDI PROPERTY GROUP	324,500	361,817.50	
	GOODMAN GROUP	895,329	20,198,622.24	
	GPT GROUP	997,142	5,115,338.46	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	737,079.20	
	HEALTHCO REIT	137,130	260,547.00	
	HOME CONSORTIUM LTD	90,500	669,700.00	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	782,342	1,114,837.35	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	117,885	473,897.70	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	193,766	922,326.16	
	IRONGATE GROUP	272,000	520,880.00	
	MIRVAC GROUP	2,052,238	5,007,460.72	
	NATIONAL STORAGE REIT	546,840	1,460,062.80	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	180,154.80	
	RURAL FUNDS GROUP	191,095	586,661.65	
	SCENTRE GROUP	2,718,059	8,099,815.82	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	571,980	1,733,099.40	
	STOCKLAND	1,243,333	5,122,531.96	
	VICINITY CENTERS	2,002,663	3,754,993.12	
	WAYPOINT REIT LTD	390,099	1,053,267.30	
	オーストラリアドル 小計	17,979,217	77,602,972.97 (7,428,932,602)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	417,278	575,843.64	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	595,300	1,381,096.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	922,876.75	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	682,894	1,051,656.76	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	223,349	700,199.11	
	ニュージーランドドル 小計	2,777,311	4,631,672.26 (404,669,205)	
香港ドル	CHAMPION REIT	938,000	3,311,140.00	
	FORTUNE REIT	756,000	5,239,080.00	
	LINK REIT	1,106,000	76,479,900.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	2,068,000.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	2,143,020.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,315,660	4,236,425.20	
	香港ドル 小計	5,428,660	93,477,565.20 (1,542,379,825)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	382,250.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	744,977	633,230.45	

	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,746,218	4,994,183.48
	ASCOTT TRUST	991,877	1,081,145.93
	CAPITALAND CHINA TRUST	557,721	658,110.78
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,651,644	5,966,199.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	538,188.00
	EC WORLD REIT	180,000	117,900.00
	ESR REIT	1,448,995	608,577.90
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	359,100.00
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	166,811.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	574,262	1,372,486.18
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,483,196	2,135,802.24
	IREIT GLOBAL	405,985	257,800.47
	KEPPEL DC REIT	709,903	1,575,984.66
	KEPPEL REIT	1,051,400	1,251,166.00
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	1,105,950	862,641.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,181,473	2,197,539.78
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	995,763	2,648,729.58
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,647,285	2,981,585.85
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	1,187,100	1,460,133.00
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,273,644	528,562.26
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE TRUST	220,500	1,058,400.00
	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	1,989,360.00
	シンガポールドル 小計	24,435,393	36,889,683.56 (3,489,026,271)
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	152,496,000.00
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	81,340	584,021,200.00
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	68,755,830.00
	JR REIT XXVII	64,338	372,517,020.00
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	25,433	176,759,350.00
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	426,907,200.00
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	212,387,750.00
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	26,380	208,665,800.00
	SK REITS CO LTD	30,940	210,082,600.00
	韓国ウォン 小計	383,354	2,412,592,750.00 (252,115,942)
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	103,500	2,231,460.00
	イスラエルシェケル 小計	103,500	2,231,460.00

			(89,146,157)
合計	81,755,815	112,154,963,390	(112,154,963,390)

(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%	77.1%
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%	3.8%
イギリスポンド	投資証券 34銘柄	100.0%	5.4%
オーストラリアドル	投資証券 32銘柄	100.0%	6.6%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	1.4%
シンガポールドル	投資証券 27銘柄	100.0%	3.1%
韓国ウォン	投資証券 9銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 4月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	10,450,745
コール・ローン	644,171
投資証券	508,429,173



	2022年 4月20日現在
項目	金額（円）
未収配当金	422,431
流動資産合計	519,946,520
資産合計	519,946,520
負債の部	
流動負債	
未払解約金	512,328
流動負債合計	512,328
負債合計	512,328
純資産の部	
元本等	
元本	688,335,956
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	168,901,764
元本等合計	519,434,192
純資産合計	519,434,192
負債純資産合計	519,946,520

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 4月20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>
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>

	2022年 4月20日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 4月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	688,335,956口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 168,901,764円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.7546円 (1万口当たり純資産額) (7,546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 4月20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 4月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2022年 4月20日現在	
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 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年10月21日
期首元本額	738,933,019円
期中追加設定元本額	30,472,284円
期中一部解約元本額	81,069,347円
期末元本額	688,335,956円
期末元本額の内訳	
SMT インデックスバランス・オープン	240,073,113円
SMT 新興国REITインデックス・オープン	448,262,843円

## ( 有価証券に関する注記 )

売買目的有価証券

種類	2022年 4月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		12,458,636
合計		12,458,636

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「新興国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)

該当事項はありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資証券	メキシコペソ	CONCENTRADORA FIBRA DANHOS S	90,600	2,182,554.00		
		FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	318,400	7,450,560.00		
		MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	79,000	1,812,260.00		
		PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIA	85,800	2,353,494.00		
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	49,700	2,808,547.00		
		メキシコペソ 小計		623,500	16,607,415.00 (107,373,580)	
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	206,442	598,681.80		
		IS GAYRIMENKUL YATIRIM ORTAK	51,071	565,355.97		
		SINPAS GAYRIMENKUL YATIRIM O	36,500	283,240.00		
		VAKIF GAYRIMENKUL YATIRIM	61,695	137,579.85		
		YENI GIMAT GAYRIMENKUL ORTAK	12,759	284,270.52		
		ZIRAAT GAYRIMENKUL YATIRIM O	104,000	309,920.00		
		トルコリラ 小計		472,467	2,179,048.14 (19,246,660)	
	香港ドル	CHINA MERCHANTS COMMERCIAL R	59,000	159,300.00		
		SF REAL ESTATE INVESTMENT TR	58,000	185,600.00		
		香港ドル 小計		117,000	344,900.00 (5,690,850)	
			AXIS REAL ESTATE INVESTMENT	129,700	243,836.00	

マレーシア リンギット	IGB REAL ESTATE INVESTMENT T	172,700	269,412.00	
	KLCCP STAPLED GROUP	55,300	369,957.00	
	PAVILION REAL ESTATE INVESTMENT	73,000	93,440.00	
	SUNWAY REAL ESTATE INVESTMENT	194,000	273,540.00	
	YTL HOSPITALITY REIT	88,000	82,720.00	
マレーシアリンギット 小計		712,700	1,332,905.00	(40,330,106)
タイパーツ	ALLY LEASEHOLD REAL ESTATE I	76,200	506,730.00	
	CPN RETAIL GROWTH LEASEHOLD	201,500	4,050,150.00	
	FRASERS PROPERTY THAILAND IN	164,600	1,958,740.00	
	HEMARAJ LEASEHOLD REIT	83,000	713,800.00	
	IMPACT GROWTH REAL ESTATE IN	71,500	1,179,750.00	
	LOTUS'S RETAIL GROWTH FREEHO	191,400	2,679,600.00	
	WHA PREMIUM GROWTH FREEHOLD	160,300	1,811,390.00	
タイパーツ 小計		948,500	12,900,160.00	(49,407,612)
フィリピン ペソ	AREIT INC	63,020	2,769,729.00	
	DDMP REIT INC	653,000	1,018,680.00	
	FILINVEST REIT CORP	182,300	1,339,905.00	
	MREIT INC	106,000	1,829,560.00	
	RL COMMERCIAL REIT INC	404,000	2,989,600.00	
フィリピンペソ 小計		1,408,320	9,947,474.00	(24,536,439)
インドル ピー	BROOKFIELD INDIA REAL ESTATE	15,799	5,132,779.12	
	EMBASSY OFFICE PARKS REIT	56,929	21,170,187.23	
	MINDSPACE BUSINESS PARKS REI	24,062	8,379,350.88	
インドルピー 小計		96,790	34,682,317.23	(58,959,939)
南アフリカ ランド	ATTACQ LTD	81,466	588,184.52	
	EMIRA PROPERTY FUND LTD	34,614	373,831.20	
	EQUITES PROPERTY FUND LTD	79,600	1,666,028.00	
	FAIRVEST LTD-B	87,011	291,486.85	
	FORTRESS REIT LTD-A	130,265	1,600,956.85	
	FORTRESS REIT LTD-B	88,469	317,603.71	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	368,555	5,207,682.15	
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	37,648	1,354,198.56	
	INVESTEC PROPERTY FUND LTD	61,848	735,991.20	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	704,051	3,118,945.93	
	RESILIENT REIT LTD	34,557	1,994,975.61	
	SA CORPORATE REAL ESTATE FUN	275,044	627,100.32	
	STOR-AGE PROPERTY REIT LTD	50,755	743,560.75	

	VUKILE PROPERTY FUND LTD	96,614	1,302,356.72
	南アフリカランド 小計	2,130,497	19,922,902.37 (172,133,876)
サウジアラ ビアリアル	AL MAATHER REIT FUND	3,675	33,075.00
	AL RAJHI REIT	13,464	144,064.80
	ALAHLI REIT FUND 1	4,800	58,464.00
	ALINMA RETAIL REIT FUND	5,300	36,464.00
	ALKHABEER REIT	5,000	44,050.00
	DERAYAH REIT	10,370	129,832.40
	JADWA REIT SAUDI FUND	13,541	190,657.28
	MUSHARAKA REIT FUND	6,447	62,729.31
	RIYAD REIT FUND	13,266	145,926.00
	SEDCO CAPITAL REIT FUND	4,000	44,240.00
	サウジアラビアリアル 小計	79,863	889,502.79 (30,750,111)
	合計	6,589,637	508,429,173 (508,429,173)

(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
メキシコペソ	投資証券 5銘柄	100.0%	21.1%
トルコリラ	投資証券 6銘柄	100.0%	3.8%
香港ドル	投資証券 2銘柄	100.0%	1.1%
マレーシアリングット	投資証券 6銘柄	100.0%	7.9%
タイバーツ	投資証券 7銘柄	100.0%	9.7%
フィリピンペソ	投資証券 5銘柄	100.0%	4.8%
インドルピー	投資証券 3銘柄	100.0%	11.6%
南アフリカランド	投資証券 14銘柄	100.0%	33.9%
サウジアラビアリアル	投資証券 10銘柄	100.0%	6.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【SMT 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	2,662,156,149円
負債総額	1,779,221円
純資産総額( - )	2,660,376,928円
発行済口数	1,996,594,799口
1口当たり純資産額( / )	1.3325円
(1万口当たり純資産額)	(13,325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)

## 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）

## 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）

## 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）

## 新興国 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	504,867,903円
負債総額	1円
純資産総額（ - ）	504,867,902円

発行済口数	691,039,951口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7306円
（1万口当たり純資産額）	（7,306円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

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

###### 受益権の譲渡

イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

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

###### 受益権の譲渡の対抗要件

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

###### 受益権の再分割

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

###### 償還金

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

###### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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



## 第二部【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。

#### [ DO（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2022年 7月20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	1 289
器具備品	1 692	1 687
その他	1 0	1 -
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



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

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

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

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	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いません。

（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、

（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)	
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	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す。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 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)
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 (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)
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 (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)
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7月20日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2021年3月末日現在）

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

## (2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2021年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
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。
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。
立花証券株式会社	6,695	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。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	10,857	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。
ソニー銀行株式会社	36,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社荘内銀行	8,500	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
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。
アイザワ証券株式会社	3,000	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。

GMOクリック証券株式会社	4,346	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。
岡三証券株式会社	5,000	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。
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。
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

資本金の額は2021年10月1日現在です。

## 2【関係業務の概要】

### (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1)受託会社

該当事項はありません。

### (2)販売会社

該当事項はありません。

### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2021年3月末日現在）

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

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

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2022年 1月20日	有価証券届出書
2022年 1月20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6月30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 松崎雅則 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 インデックスバランス・オープンの2021年10月21日から2022年4月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT インデックスバランス・オープンの2022年4月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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。