

【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21日提出 |
| 【計算期間】 | 第7期(自 2021年4月27日至 2022年4月26日) |
| 【ファンド名】 | アセットアロケーション・ファンド(安定型) アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) アセットアロケーション・ファンド(成長型) |
| 【発行者名】 | 三井住友D S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 猿田 隆 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都港区虎ノ門一丁目17番1号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 土屋 裕子 |
| 【連絡場所】 | 東京都港区虎ノ門一丁目17番1号 |
| 【電話番号】 | 03-6205-1649 |
| 【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】

- イ 当ファンドは、主として、投資信託証券等への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドそれぞれ金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

(イ) 当ファンドが該当する商品分類

| 項目 | 該当する商品分類 | 内容 |
|-------------------|----------|---|
| 単位型・追加型 | 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います。 |
| 投資対象地域 | 内外 | 目論見書または信託約款において、国内およ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います。 |
| 投資対象資産 (収益の源泉) | 資産複合 | 目論見書または信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他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います。 |

(ロ) 当ファンドが該当する属性区分

| 項目 | 該当する属性区分 | 内容 |
|--------|---|---|
| 投資対象資産 | その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型）） | 目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式、債券および不動産投信であり、ファンドの収益はそれぞれの市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。 |
| 決算頻度 | 年1回 | 目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。 |
| 投資対象地域 | グローバル (日本を含む) | 目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| 投資形態 | ファンド・オブ・ファンズ | 一般社団法人投資信託協会「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・ファンズをいいます。 |
| 為替ヘッジ | 為替ヘッジあり (部分ヘッジ) | 目論見書または信託約款において、一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。 |

商品分類表

| 単字型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産 (収益の源泉) |
|------------|-----------|-----------------------------|
| 単字型 | 国内 | 株式 |
| | 海外 | 債券 |
| | | 不動産投信 |
| 追加型 | 内外 | 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 |
|--|------------|--------------------------------|--------------------------------|-----------------------------|
| 株式 | 年1回 | グローバル (日本を含む) | | |
| 一般 | | | | |
| 大型株 | 年2回 | 日本 | | |
| 中小型株 | 年4回 | 北米 | ファミリーファンド | あり (部分ヘッジ) |
| 債券 | 年6回(隔月) | 欧州 | | |
| 一般 | 年12回(毎月) | アジア | | |
| 公債 | 日々 | オセアニア | | |
| 社債 | その他 | 中南米 | ファンド・オブ・ファン ズ | なし |
| その他債券 | | | | |
| クレジット属性 () | | | | |
| 不動産投信 | () | アフリカ | | |
| その他資産 (投資信託証券(資 産複合(株式、債 券、不動産投信) 資産配分変更型)) | | 中近東(中東) | | |
| 資産複合 () | | エマージング | | |
| 資産配分固定 型 | | | | |
| 資産配分変更 型 | | | | |

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

(2)【ファンドの沿革】

2015年4月17日 信託契約締結、設定、運用開始。

(3)【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友DSアセットマネジメント株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書(目論見書)および運用報告書の作成等を行います。

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

(ハ) 販売会社

委託会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問いません。)に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書(目論見書)の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

〔参考情報：投資顧問会社〕

以下の各法人は当ファンドの関係法人には該当しませんが、当ファンドの運用に関し助言等を行う投資顧問会社であり、間接的に当ファンドの運用に関与します。

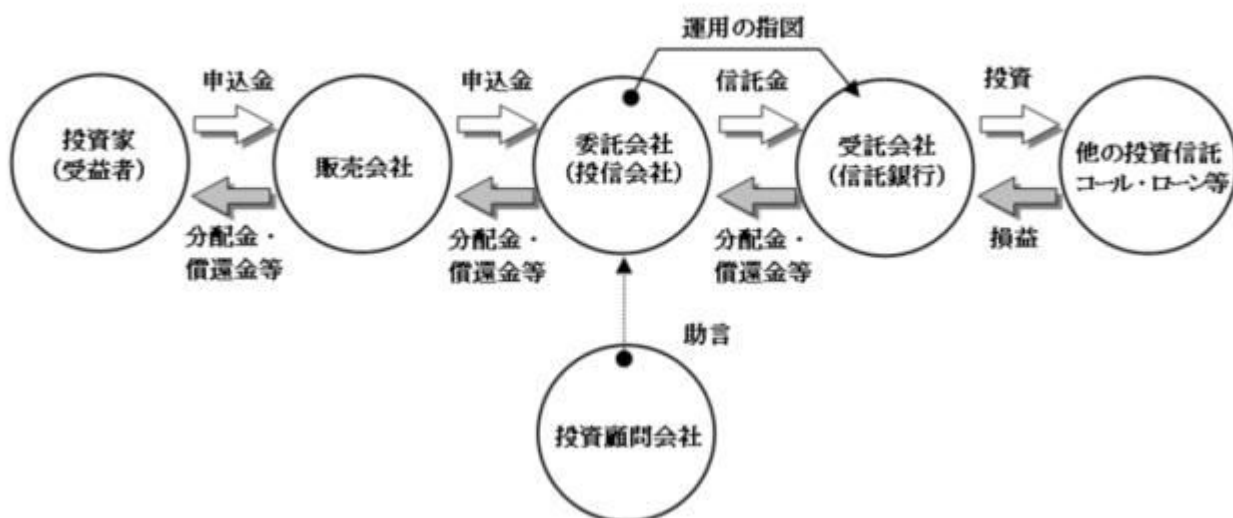
日興グローバルラップ株式会社

「安定型」・「安定成長型」・「成長型」の各ファンドの「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分に関する投資助言等を行います。

エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント(ルクセンブルグ)

世界経済の見通しと組入資産の投資見通しに関する投資助言を行います。

運営の仕組み



□ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2022年5月31日現在）

(ロ) 会社の沿革

- 1985年7月15日 三生投資顧問株式会社設立
- 1987年2月20日 証券投資顧問業の登録
- 1987年6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可
- 1999年1月1日 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
- 1999年2月5日 三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
- 2000年1月27日 証券投資信託委託業の認可取得
- 2002年12月1日 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 2013年4月1日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併
- 2019年4月1日 大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更

(ハ) 大株主の状況

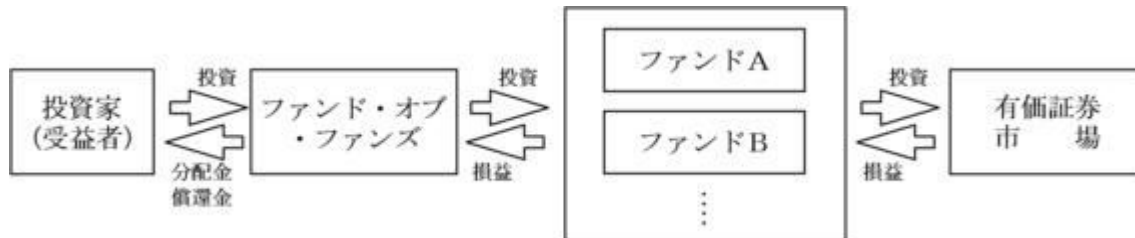
(2022年5月31日現在)

| 名称 | 住所 | 所有株式数 (株) | 比率 (%) |
|---------------------|---------------------|--------------|-----------|
| 株式会社三井住友フィナンシャルグループ | 東京都千代田区丸の内一丁目1番2号 | 16,977,897 | 50.1 |
| 株式会社大和証券グループ本社 | 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号 | 7,946,406 | 23.5 |
| 三井住友海上火災保険株式会社 | 東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地 | 5,080,509 | 15.0 |
| 住友生命保険相互会社 | 大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号 | 3,528,000 | 10.4 |
| 三井住友信託銀行株式会社 | 東京都千代田区丸の内一丁目4番1号 | 337,248 | 1.0 |

八 ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

一般に、「ファンド・オブ・ファンズ」においては、株式や債券などの有価証券に直接投資するのではなく、複数の他の投資信託（ファンド）を組み入れることにより運用を行います（投資信託に投資する投資信託）。また、種々の特長を持った投資信託を購入することにより、効率的に資産配分を行います。

〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



2【投資方針】

（1）【投資方針】

イ 基本方針

当ファンドは、投資信託証券等への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

（イ）主として投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資することにより、安定型は信託財産の安定性を、安定成長型は信託財産の安定性と収益性のバランスを、成長型は信託財産の収益性を重視した運用を行います。

（ ）主として、国内株式、先進国株式（除く日本）、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券（除く日本）、為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）、新興国債券、為替ヘッジ付き新興国債券、ハイイールド債券、為替ヘッジ付きハイイールド債券に投資します。

（ ）投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い必要な場合は追加・入替えも行います。

（ロ）運用にあたっては、市場のリスク選好状況を定量的に捉え、一定の範囲で資産配分を調整することにより、下方リスクを抑制しつつ、中長期的に収益の獲得を目指します。

（ハ）対円での為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れることがあります。また、投資対象とする投資信託証券の外貨建資産に対して対円での為替ヘッジを行うことがあります。

（ニ）投資信託証券への投資は、高位を保つことを原則とします。

（ホ）資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドの特色

1

投資信託証券等への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資します。

- 主として、インデックスファンドや上場投資信託証券（ETF）への投資を通じて、以下の資産等に投資します。

債券

国内債券

先進国債券(除く日本)*1

新興国債券*2

ハイイールド債券*2

株式

国内株式

先進国株式(除く日本)

新興国株式

リート

国内リート

外国リート

*1 対円での為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れることがあります。

*2 当該資産を投資対象とする外貨建投資信託証券に対して対円での為替ヘッジを行うことがあります。

2

資産配分比率は、ラップ口座の投資助言に実績を持つ日興グローバルラップおよびエドモン・ドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント（ルクセンブルグ）からの投資助言を基に決定します。

- 日興グローバルラップから、「安定型」・「安定成長型」・「成長型」の各ファンドの3つの基本資産配分（「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分）に関する投資助言を受けます。また、エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント（ルクセンブルグ）から、世界経済の見通しと組入資産の投資見通しに関する投資助言を受けます。
- 市場のリスク選好状況に応じて、「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分のいずれかに調整します。市場のリスク選好状況の判断には、リスク態度指数を使用します。



リスク態度指数

市場のリスク選好度合いを計るための指数です。リスクオン局面（リスク選好的な局面）とリスクオフ局面（リスク回避的な局面）を判断します。

3 目標リスク水準の異なる「安定型」・「安定成長型」・「成長型」の3つのファンドからお選びいただけます。各ファンド間でのスイッチングが可能です。

安定型 信託財産の安定性を重視した運用を行います。

安定成長型 信託財産の安定性と収益性のバランスを重視した運用を行います。

成長型 信託財産の収益性を重視した運用を行います。

□ 一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。また、スイッチングが行えない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドのしくみ

□ ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。

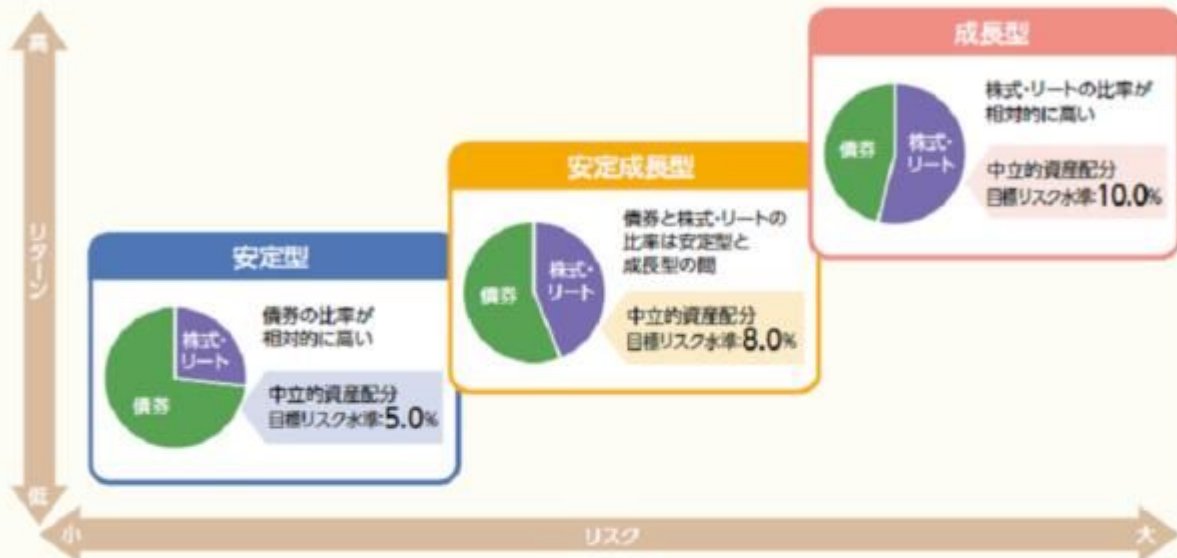


※日興グローバルラップは委託会社の子会社(100%出資)です。

お客様の投資スタイルに合わせて3つのファンドから選択

■お客様の投資スタイルに合わせて3つのファンド（安定型、安定成長型、成長型）からお選びいただけます。

[3つのファンド（安定型、安定成長型、成長型）のリスク・リターン特性のイメージ]



[各ファンドの3つの基本資産配分の目標リスク水準について]

各ファンドの目標リスク水準

| | 安定型 | 安定成長型 | 成長型 |
|---------|------|-------|-------|
| 保守的資産配分 | 3.0% | 5.5% | 7.1% |
| 中立的資産配分 | 5.0% | 8.0% | 10.0% |
| 積極的資産配分 | 7.1% | 10.5% | 13.0% |

- 中立的資産配分の目標リスク水準は、現時点で想定される各ファンドの中長期的な騰落率の変動率（年率標準偏差）を示します。
- 当ファンドでは、市場のリスク選好状況に応じて一定の範囲内で資産配分を調整するため、年1回（原則として毎年2月）、中立的資産配分に加えて、保守的資産配分、積極的資産配分の3つの基本資産配分を策定します。

(出所)日興グローバルラップ

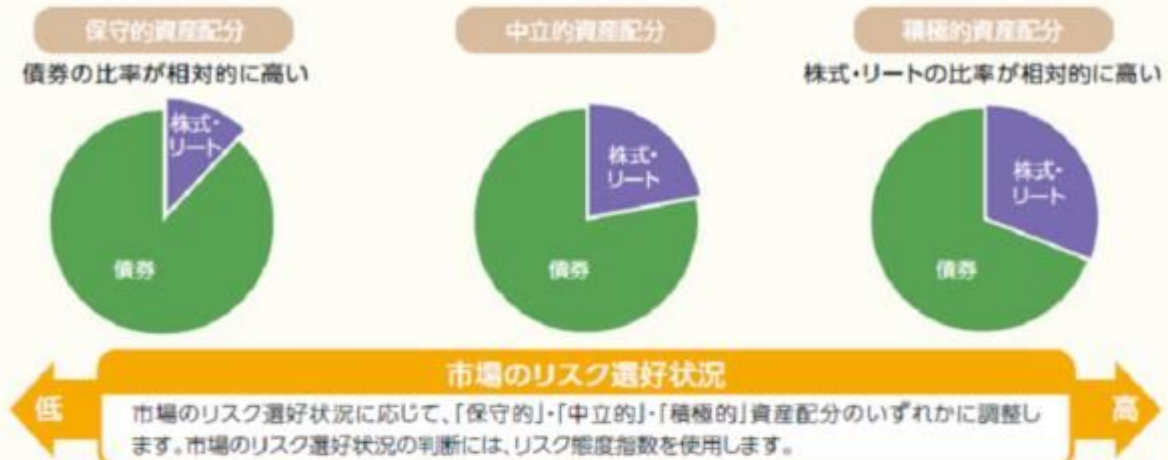
※上記はイメージであり、実際とは異なる場合があります。各ファンドの基準価額の騰落率の変動率（年率標準偏差）が目標リスク水準通りになるとは限りません。また、一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

※上記の目標リスク水準は2022年2月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

資産配分の調整について

- 市場のリスク選好状況に応じて、「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分のいずれかに資産配分を調整することで、中長期的な収益の獲得を目指します。

〔市場のリスク選好状況に応じた資産配分の調整〕

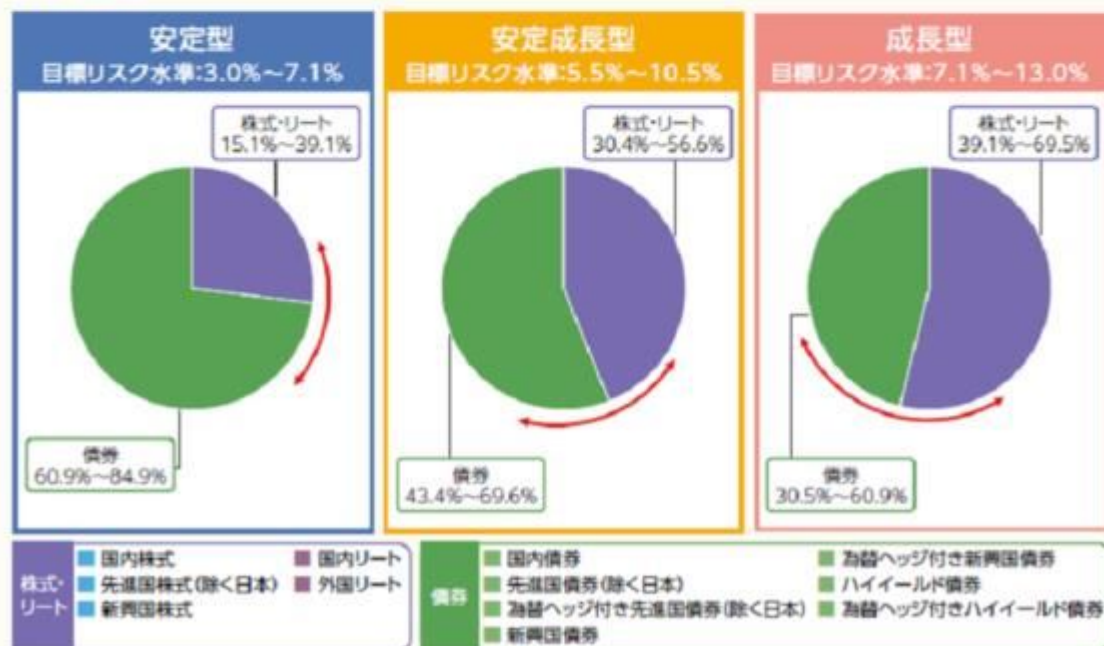


※資産配分の決定にあたっては、エドモンドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント(ルクセンブルグ)から投資助言を受けます。

※上記は、安定型を例にした資産配分の調整のイメージであり、実際とは異なる場合があります。

ポートフォリオのイメージ

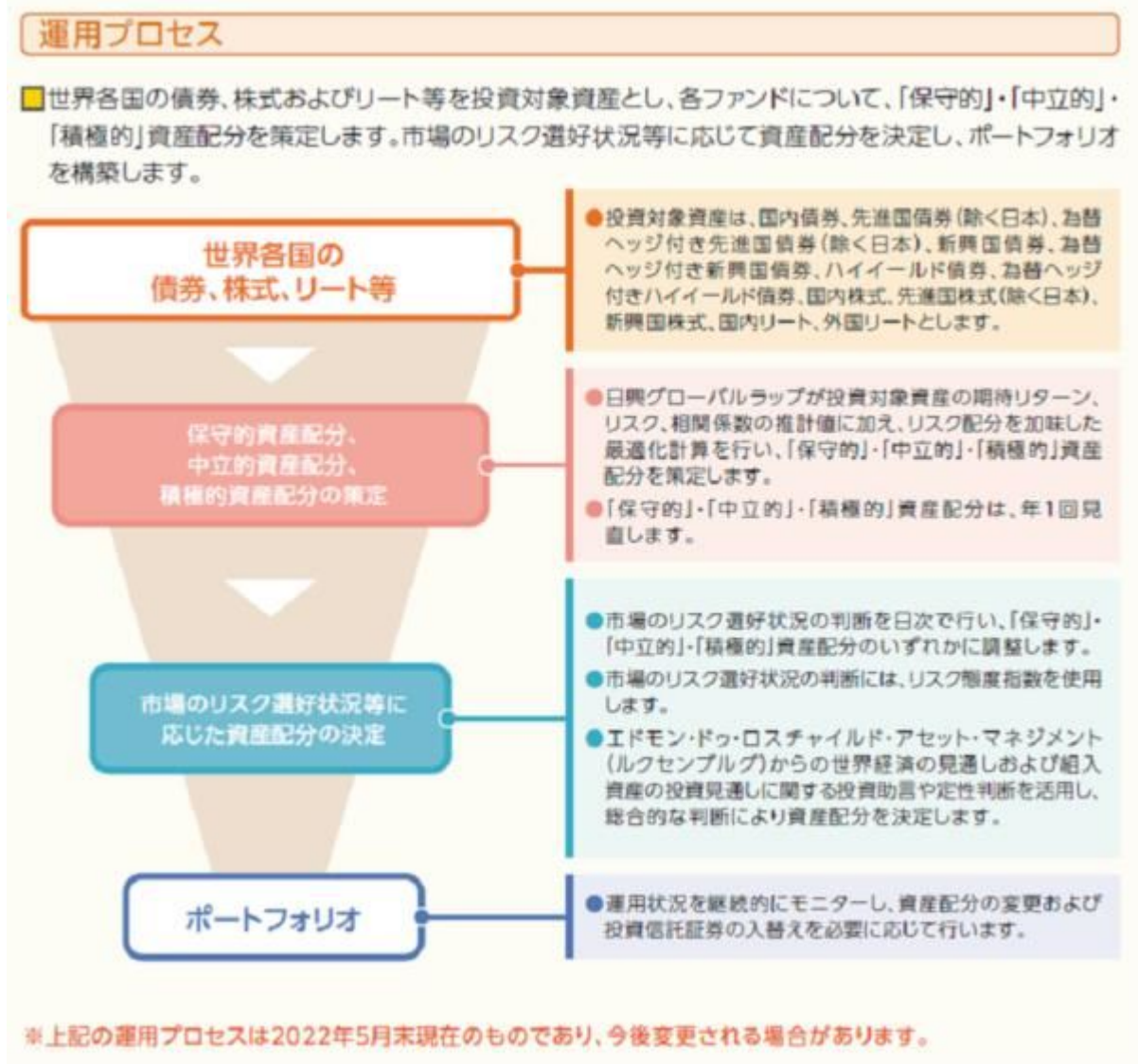
▶資産配分



(出所)日興グローバルラップ

※上記はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

※上記は2022年2月に日興グローバルラップから受けた投資助言に基づく資産配分であり、今後変更される場合があります。



（２）【投資対象】

イ 投資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（投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項の「特定資産」をいいます。以下同じ。）

- 1．有価証券
- 2．約束手形
- 3．金銭債権

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

- 1．為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、投資信託証券（投資信託また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。））ならびに投資証券または外国投資証券（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。））または次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 2．外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の性質を有するもの
- 3．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（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および短期社債等を除きます。)

なお、第3号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引(売戻条件付の買入れ)および債券貸借取引(現金担保付債券借入れ)に限り行うことができるものとします。

八 投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記口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

〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

●すべての投資信託証券に投資するとは限りません。

▶ 債券

| 国内債券 | |
|---------|--|
| ファンド名 | 国内債券パッシブ・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> ● NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指します。 ● 日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.03% |

| 先進国債券(除く日本) …為替ヘッジなし | |
|----------------------|--|
| ファンド名 | 外国債券パッシブ・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> ● 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、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ● ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。 ● 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1% |

| 為替ヘッジ付き先進国債券(除く日本) …為替ヘッジあり | |
|-----------------------------|--|
| ファンド名 | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> ● FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ● ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。 ● 保有する外貨建資産については、対円での為替のフルヘッジを原則とします。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1% |

新興国債券…為替ヘッジなし*1

| | |
|---------|---|
| ファンド名 | バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF |
| 形態 | 米国籍外国投資信託 |
| 運用会社 | ザ・バンガード・グループ・インク |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> ブルームバーグ米ドル建て新興市場政府債RIC基準インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。 ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。 |
| 取引通貨 | 米ドル |
| 管理報酬等*2 | 年0.20%程度 |
| 購入の可否*3 | 日本において一般投資者の購入が可能です。 |

| | |
|---------|--|
| ファンド名 | iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF |
| 形態 | 米国籍外国投資信託 |
| 運用会社 | ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。 ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。 |
| 取引通貨 | 米ドル |
| 管理報酬等*2 | 年0.39%程度 |
| 購入の可否*3 | 日本において一般投資者の購入が可能です。 |

- *1 上記の投資信託証券を組み入れた場合、安定型・安定成長型・成長型の各ファンドにおいて対円での為替ヘッジを行うことがあります。
- *2 管理報酬等とは各ETFの運用管理費用およびその他費用を各ETFの平均純資産総額で除したもので、本書の数値は各ETFの直近の目論見書等で開示されているものです（以下同じ。）。
- *3 外国籍のETFは、海外の上場有価証券を取り次ぐことのできる証券会社を通じて、日本国内の一般の投資者が、直接、購入することができるものがあります。直接購入される際は、売買委託手数料（証券会社ごとに異なります。）がかかります。また、円貨と外貨を交換する際に、証券会社が別途定める手数料がかかります（以下同じ。）。

※新興国債券を投資対象とする投資信託の一部入れ替えのため、2022年7月22日に「米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド」を投資対象とする投資信託に追加し、2023年1月24日に「iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF」を投資対象とする投資信託から削除する予定です。

| | |
|---------|--|
| ファンド名 | 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。 米ドル建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.2% |

ハイイールド債券…為替ヘッジなし*

| | |
|---------|--|
| ファンド名 | SPDR ブルームバーグ・ハイ・イールド債券ETF |
| 形態 | 米国籍外国投資信託 |
| 運用会社 | SSgA ファンズ・マネジメント・インク |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> ブルームバーグ・ハイ・イールド・ベリー・リキッド・インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。 ベンチマークの値動きと利回りに、経費控除前で、概ね連動する投資成果を上げることが目標とします。 |
| 取引通貨 | 米ドル |
| 管理報酬等 | 年0.40%程度 |
| 購入の可否 | 日本において一般投資者の購入が可能です。 |

*上記の投資信託証券を組み入れた場合、安定型・安定成長型・成長型の各ファンドにおいて対円での為替ヘッジを行うことがあります。

▶ 株式

国内株式

| | |
|---------|--|
| ファンド名 | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | 主としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.08% |

先進国株式(除く日本)…為替ヘッジなし

| | |
|---------|--|
| ファンド名 | 外国株式インデックス・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> 主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15% |

| 新興国株式…為替ヘッジなし | |
|---------------|---|
| ファンド名 | エマージング株式インデックス・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> 主として新興国の株式(預託証券(DR)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。)、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)の動きと連動する投資成果を目指します。 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15% |

▶ リート

| 国内リート | |
|---------|--|
| ファンド名 | リート・インデックス・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> 東証REIT指数(配当込み)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 日本の取引所に上場(上場予定を含みます。)している不動産投資信託(リート)を主要投資対象とします。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15% |

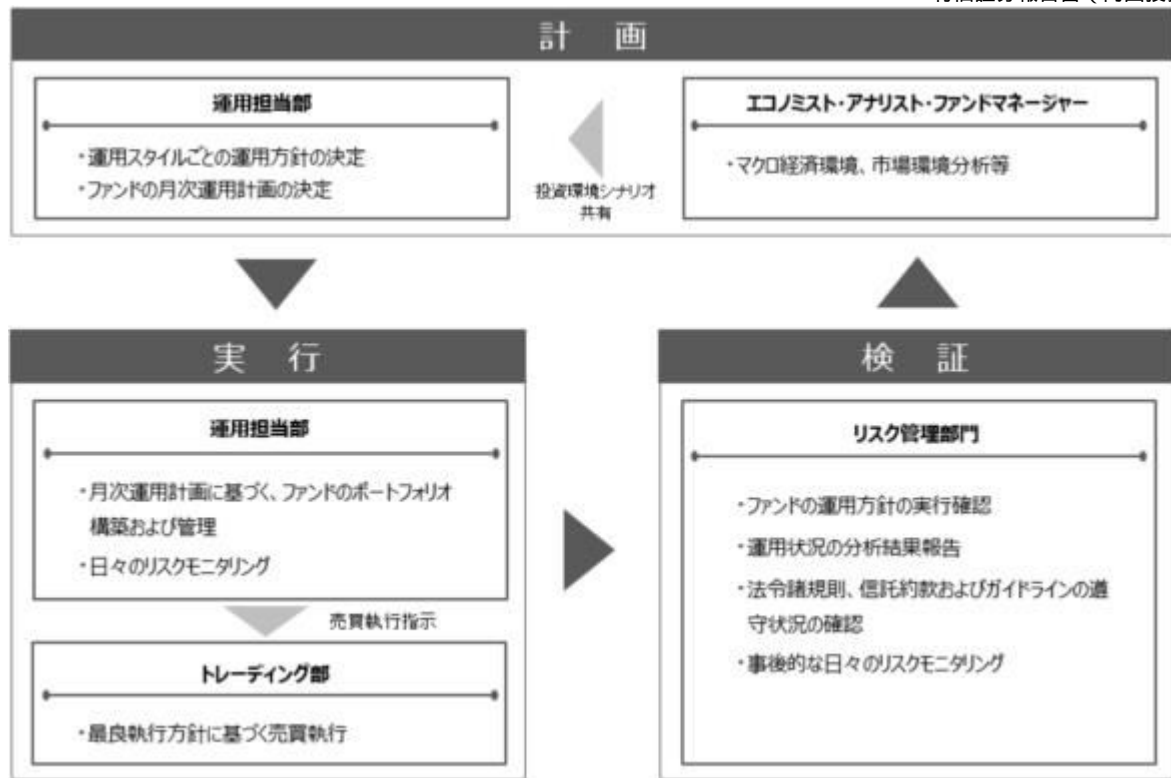
| 外国リート…為替ヘッジなし | |
|---------------|---|
| ファンド名 | 外国リート・インデックス・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 日本を除く世界各国の不動産投資信託(リート)などを主要投資対象とします。 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15% |

| |
|--|
| <p>指数の著作権など</p> <ul style="list-style-type: none"> ●NOMURA-BPI(総合)は野村證券株式会社、FTSE世界国債インデックスはFTSE Fixed Income LLC、ブルームバーグ米ドル建て新興市場政府債RIC基準インデックスおよびブルームバーグ・ハイ・イールド・ベリリー・リキッド・インデックスはBloomberg、J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックスおよびJPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスはJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー、TOPIX(東証株価指数)および東証REIT指数は株式会社JPX総研、MSCIコクサイインデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスはMSCI Inc.、S&P先進国REIT指数はS&P ダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが、それぞれ公表している指数です。 ●各インデックスに関する知的所有権その他一切の権利は、指数を公表する各社に帰属します。また、当該各社は当ファンドの運用に関して責任を負うものではありません。 |
|--|

※上記は、2022年7月現在における投資対象とする投資信託であり、今後変更となる場合があります。

(3) 【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

ファンドの運用体制は、委託会社の組織変更等により、変更されることがあります。

他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）の組入れは、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上、選定しています。また、定性・定量面における評価を継続的に実施するとともに、投資対象としての適格性を定期的に判断します。

□ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

（４）【分配方針】

年１回（原則として毎年４月26日。ただし、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。
- ロ 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、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。

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく投資制限

- イ 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- ロ 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。
- ハ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ニ 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ヘ 外国為替予約取引の指図
委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の対円での為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- ト 資金の借入れ
 - (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用なら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て（一部解約に伴う支払資金の手当て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、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。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てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から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または受益者への解約代金支払開始日から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、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入れ指図を行う日における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かかる借入期間は、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。
- (二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

- イ 同一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第9条）
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すべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に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、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- ロ デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）
委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

八 信用リスク集中回避のための投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2)

委託会社は、運用財産に関し、信用リスク(保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。)を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行う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】

イ ファンドのもつリスクの特性

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。したがって、投資者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。

運用の結果として信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。また、一定の投資成果を保証するものではありません。

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

(イ) 株式市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況、これらに対する外部的評価の変化等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。特に、企業が倒産や大幅な業績悪化に陥った場合、当該企業の株式の価値が大きく下落し、基準価額が大きく下落する要因となります。

(ロ) 債券市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により債券相場が下落(金利が上昇)した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、ファンドが保有する個々の債券については、下記「信用リスク」を負うことにもなります。

(ハ) 不動産投資信託(リート)に関するリスク

リートの価格は、不動産市況や金利・景気動向、関連法制度(税制、建築規制、会計制度等)の変更等の影響を受け変動します。また、リートに組み入れられている個々の不動産等の市場価値、賃貸収入等がマーケット要因によって上下するほか、自然災害等により個々の不動産等の毀損・滅失が生じる可能性もあります。さらに個々のリートは一般の法人と同様、運営如何によっては倒産の可能性もあります。これらの影響により、ファンドが組み入れているリートの価格が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ニ) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

(ホ) 為替変動リスク

外貨建資産への投資は、円建資産に投資する場合の通常のリスクのほかに、為替変動による影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落(円高)する場合、円ベースでの評価額は下落することがあります。為替の変動(円高)は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

実質外貨建資産の一部に対し、原則として対円で為替ヘッジを行うため、為替の変動による影響は限定的と考えられます。なお、対円で為替ヘッジ比率は、資産配分の調整に伴い変動します。

(ヘ) カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になること

や、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。特に投資先が新興国の場合、その証券市場は先進国の証券市場に比べ、より運用上の制約が大きいことが想定されます。また、先進国に比べ、一般に市場規模が小さいため、有価証券の需給変動の影響を受けやすく、価格形成が偏ったり、変動性が大きくなる傾向が考えられます。

（ト）市場流動性リスク

ファンドの資金流出入に伴い、有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、必要な取引ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

（チ）ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは一部、実質的に「ファミリーファンド方式」により運用します。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入る有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

（リ）換金制限等に関する留意点

ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や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、換金申込みの受付が中止となる可能性、既に受け付けた換金申込みが取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性等があります。

（ヌ）収益分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンド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およ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、分配金の一部または全部が、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。

□ 投資リスクの管理体制

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、運用リスク管理を行っています。

リスク管理担当部は、信託約款等に定める各種投資制限やリスク指標のモニタリングを実施し、制限に対する抵触等があった場合には運用部門に対処要請等を行い、結果をリスク管理会議へ報告します。

また、ファンドのパフォーマンスの分析・評価を行い、結果を運用評価会議等へ報告することで、運用方針等との整合性を維持するよう適切に管理しています。

さらに、流動性リスク管理について規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングやストレステストを実施するとともに、緊急時対応策等の策定や有効性の検証等を行います。なお、当該流動性リスクの適切な管理の実施等について、定期的にはリスク管理会議へ報告します。

コンプライアンス担当部は、法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行い、結果をコンプライアンス会

議に報告します。

（参考情報）投資リスクの定量的比較

【 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 】

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

■安定型



【 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 】

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



■安定成長型



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

■成長型



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



※ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

| | |
|------|--|
| 日本株 | TOPIX (配当込み) 株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社が算出、公表する指数で、日本の株式を対象としています。 |
| 先進国株 | MSCIコクサイインデックス (グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。 |
| 新興国株 | MSCIエマージング・マーケット・インデックス (グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。 |
| 日本国債 | NOMURA-BPI (国債) 野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。 |
| 先進国債 | FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。 |
| 新興国債 | JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド (円ベース) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。 |

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。
※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

原則として、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に、1.1%（税抜き1.0%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

申込手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の取扱い事務等の対価です。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

| | | | |
|---|---|--|---|
| ファンド | 純資産総額に年1.023%（税抜き0.93%）の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。信託報酬の配分は以下の通りです。 < 信託報酬の配分（税抜き） > | | |
| | 支払先 | 料率 | 役務の内容 |
| | 委託会社 | 年0.47% | ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価 |
| | 販売会社 | 年0.43% | 交付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0.03% | ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価 |
| 上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。 | | | |
| 投資対象とする投資信託 | 各ETFの配分比率の変動幅を加味した場合、管理報酬等の概算値は以下の通りとなります。 | | |
| | 安定型 | 年0.00637%～年0.07414%* | |
| | 安定成長型 | 年0.01957%～年0.09815%* | |
| | 成長型 | 年0.02479%～年0.11569%* | |
| 管理報酬等は年度によって異なります。 | | | |
| 実質的な負担 | ファンドの純資産総額に対して | | |
| | 安定型 | 年1.02937%（税抜き0.93637%）～年1.09714%（税抜き1.00414%）程度* | |
| | 安定成長型 | 年1.04257%（税抜き0.94957%）～年1.12115%（税抜き1.02815%）程度* | |
| | 成長型 | 年1.04779%（税抜き0.95479%）～年1.13869%（税抜き1.04569%）程度* | |
| 上記は直近の基本資産配分および管理報酬率を用いた試算の結果であり、基本資産配分の見直しおよび実際の組入れ状況等により変動します。新興国債券の費用は、管理報酬がより高いETFの数値を用いて試算しています。 | | | |

* 投資対象とする投資信託の信託報酬等は、年間最低報酬額等が定められている場合があるため、純資産総額によっては、上記の料率を上回ることがあります。

（４）【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0066%（税抜き0.006%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

上記ロ、ハにかかる費用に関しましては、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

上記（１）～（４）にかかる手数料等および他の投資信託（ファンド）の組入れを通じて間接的に負担する手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあったりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

（５）【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

- （イ）追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかか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）にあたります。
- （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。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
- （ハ）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（収益分配金の課税について）を参照。）

ロ 一部解約時および償還時の課税について

個人の受益者については、一部解約時および償還時の譲渡益が課税対象となり、法人の受益者については、一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

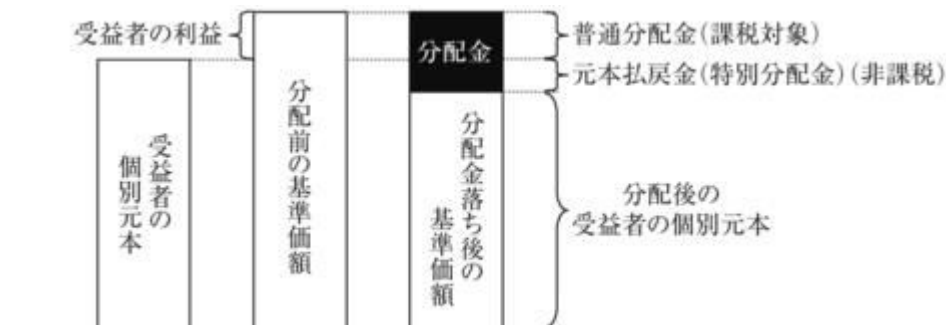
ハ 収益分配金の課税について

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）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

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また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ます。



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。なお、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。



上記、の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

・一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（上場株式、公募株式投資信託、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募公社債投資信託および特定公社債をいいます。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り、）および利子所得の金額との損益通算が可能です。

(ロ) 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ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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。課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISA、ジュニアNISAでの取扱い対象としない場合があります。

※NISA、ジュニアNISAをご利用になる場合、各制度の違いにご留意ください。
また、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

| | 少額投資非課税制度 NISA | 未成年者少額投資非課税制度 ジュニアNISA |
|-----------|---|---|
| 対象となる投資信託 | 公募株式投資信託 | |
| 非課税対象 | 公募株式投資信託から生じる 配当所得 および 譲渡所得 | |
| 利用対象となる方 | 20歳以上 *1の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在) | 0～19歳 *1の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在) |
| 非課税の期間 | 最長 5年間 (新規の購入は2023年まで)*2 | |
| 利用できる限度額 | 120万円/年 (最大 600万円) | 80万円/年 (最大 400万円) |

*1 2023年は成年年齢の引下げにより、NISAは18歳以上、ジュニアNISAは0～17歳になる予定です。
*2 2024年以降、NISA制度が見直しされます。また、ジュニアNISAで新規の購入ができなくなります。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2022年5月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

2022年5月31日現在

| 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 | 512,034,316 | 5.66 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 8,401,871,384 | 92.93 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 127,307,262 | 1.41 |
| 合計（純資産総額） | | 9,041,212,962 | 100.00 |

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。以下同じ。
その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建/ 売建 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率 (%) |
|--------|-----------|------|-------------|-------------|
| 為替予約取引 | 売建 | - | 376,372,490 | 4.16 |

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

2022年5月31日現在

| 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 | 802,455,857 | 11.03 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 6,371,889,910 | 87.60 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 99,618,473 | 1.37 |
| 合計(純資産総額) | | 7,273,964,240 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建/ 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率 (%) |
|--------|-----------|------|-------------|-------------|
| 為替予約取引 | 売建 | - | 627,842,605 | 8.63 |

アセットアロケーション・ファンド(成長型)

2022年5月31日現在

| 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 | 572,388,594 | 14.88 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 3,224,218,061 | 83.81 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 50,519,595 | 1.31 |
| 合計(純資産総額) | | 3,847,126,250 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建/ 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率 (%) |
|--------|-----------|------|-------------|-------------|
| 為替予約取引 | 売建 | - | 440,937,410 | 11.46 |

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)

イ 主要投資銘柄

2022年5月31日現在

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----------|-------------------|------------------------------------|---------------|-------------|---------------|------------------|---------------|-----------------|
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | ヘッジ付き外国 債券パッシブ・ マザーファンド | 3,257,841,127 | 1.3741 | 4,476,599,516 | 1.3611 | 4,434,247,557 | 49.04 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 国内債券パッシ ブ・マザーファ ンド | 2,012,126,562 | 1.2549 | 2,525,017,624 | 1.2552 | 2,525,621,260 | 27.93 |
| 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 | 94,042,185 | 6.0332 | 567,375,318 | 5.9238 | 557,087,095 | 6.16 |
| 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 (B号) | 144,761,601 | 3.1795 | 460,269,510 | 3.2401 | 469,042,063 | 5.19 |

| | | | | | | | | |
|------|-------------------|---|------------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| アメリカ | 投資証券 | S P D R ブ ルームバーグ・ ハイ・イールド 債券E T F | 25,274 | 12,749.20 | 322,223,341 | 12,728.69 | 321,704,880 | 3.56 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | Jリート・イン デックス・マ ザーファンド | 74,332,453 | 2.6624 | 197,902,722 | 2.6966 | 200,444,892 | 2.22 |
| アメリカ | 投資証券 | バンガード・米 ドル建て新興国 政府債券E T F | 21,775 | 8,532.38 | 185,792,476 | 8,442.63 | 183,838,235 | 2.03 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 外国債券パッシ ブ・マザーファ ンド | 50,990,976 | 1.9892 | 101,431,249 | 1.9824 | 101,084,510 | 1.12 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド | 44,385,580 | 1.6379 | 72,699,141 | 1.6684 | 74,052,901 | 0.82 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 外国リート・イン デックス・マ ザーファンド | 13,654,762 | 3.2211 | 43,983,354 | 2.9507 | 40,291,106 | 0.45 |
| アメリカ | 投資証券 | iシェアーズ J.P.モルガ ン・米ドル建て エマージング・ マーケット債券 E T F | 552 | 11,945.33 | 6,593,819 | 11,759.42 | 6,491,200 | 0.07 |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2022年5月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 投資証券 | 5.66 |
| 親投資信託受益証券 | 92.93 |
| 合計 | 98.59 |

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

イ 主要投資銘柄

2022年5月31日現在

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----------|-------------------|-------------------------------|---------------|-------------|---------------|------------------|---------------|-----------------|
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | ヘッジ付き外国 債券パッシブ・ マザーファンド | 1,966,701,748 | 1.3741 | 2,702,392,004 | 1.3611 | 2,676,877,749 | 36.80 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 国内債券パッシ ブ・マザーファ ンド | 1,075,370,269 | 1.2549 | 1,349,496,473 | 1.2552 | 1,349,804,761 | 18.56 |

| | | | | | | | | |
|------|-------------------|---|-------------|-----------|-------------|-----------|-------------|-------|
| 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 (B号) | 231,330,362 | 3.1795 | 735,514,885 | 3.2401 | 749,533,505 | 10.30 |
| 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 | 103,195,277 | 6.0332 | 622,597,745 | 5.9238 | 611,308,181 | 8.40 |
| アメリカ | 投資証 券 | バンガード・米 ドル建て新興国 政府債券ETF | 47,973 | 8,532.38 | 409,323,649 | 8,442.63 | 405,018,217 | 5.57 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド | 237,701,767 | 1.6379 | 389,331,724 | 1.6684 | 396,581,628 | 5.45 |
| アメリカ | 投資証 券 | SPDR ブ ルームバーグ・ ハイ・イールド 債券ETF | 30,857 | 12,749.20 | 393,402,138 | 12,728.69 | 392,769,150 | 5.40 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | Jリート・イン デックス・マ ザーファンド | 144,802,192 | 2.6624 | 385,521,355 | 2.6966 | 390,473,590 | 5.37 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 外国債券パッシ ブ・マザーファ ンド | 75,940,895 | 1.9892 | 151,061,628 | 1.9824 | 150,545,230 | 2.07 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 外国リート・イン デックス・マ ザーファンド | 15,848,872 | 3.2211 | 51,050,801 | 2.9507 | 46,765,266 | 0.64 |
| アメリカ | 投資証 券 | iシェアーズ J.P.モルガ ン・米ドル建て エマージング・ マーケット債券 ETF | 397 | 11,945.33 | 4,742,294 | 11,759.42 | 4,668,490 | 0.06 |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2022年5月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 投資証券 | 11.03 |
| 親投資信託受益証券 | 87.60 |
| 合計 | 98.63 |

アセットアロケーション・ファンド(成長型)

イ 主要投資銘柄

2022年5月31日現在

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----------|----|-----|----|-------------|-------------|------------------|------------|-----------------|
|----------|----|-----|----|-------------|-------------|------------------|------------|-----------------|

| | | | | | | | | |
|------|-------------------|---|-------------|-----------|---------------|-----------|---------------|-------|
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | ヘッジ付き外国 債券パッシブ・ マザーファンド | 794,172,937 | 1.3741 | 1,091,273,032 | 1.3611 | 1,080,948,784 | 28.10 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 国内債券パッシ ブ・マザーファ ンド | 428,125,024 | 1.2549 | 537,254,092 | 1.2552 | 537,382,530 | 13.97 |
| 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 (B号) | 152,943,467 | 3.1795 | 486,283,753 | 3.2401 | 495,552,127 | 12.88 |
| 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 | 68,329,125 | 6.0332 | 412,243,276 | 5.9238 | 404,768,070 | 10.52 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | Jリート・イン デックス・マ ザーファンド | 113,294,756 | 2.6624 | 301,635,958 | 2.6966 | 305,510,639 | 7.94 |
| アメリカ | 投資証 券 | バンガード・米 ドル建て新興国 政府債券ETF | 35,343 | 8,532.38 | 301,559,747 | 8,442.63 | 298,387,819 | 7.76 |
| アメリカ | 投資証 券 | SPDR ブ ルームバーグ・ ハイ・イールド 債券ETF | 21,335 | 12,749.20 | 272,004,233 | 12,728.69 | 271,566,575 | 7.06 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド | 157,541,199 | 1.6379 | 258,036,729 | 1.6684 | 262,841,736 | 6.83 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 外国債券パッシ ブ・マザーファ ンド | 53,017,014 | 1.9892 | 105,461,444 | 1.9824 | 105,100,928 | 2.73 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 外国リート・イン デックス・マ ザーファンド | 10,883,264 | 3.2211 | 35,056,081 | 2.9507 | 32,113,247 | 0.83 |
| アメリカ | 投資証 券 | iシェアーズ J.P.モルガ ン・米ドル建て エマージング・ マーケット債券 ETF | 207 | 11,945.33 | 2,472,682 | 11,759.42 | 2,434,200 | 0.06 |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2022年5月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 投資証券 | 14.88 |
| 親投資信託受益証券 | 83.81 |
| 合計 | 98.69 |

【投資不動産物件】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)

該当事項はありません。

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

該当事項はありません。

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

2022年5月31日現在

| 種類 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------|---------|---------|--------------|-------------|-------------|-----------------|
| 為替予約 取引 | アメリカ・ドル | 売建 | 2,938,000.00 | 382,366,891 | 376,372,490 | 4.16 |

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

2022年5月31日現在

| 種類 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------|---------|---------|--------------|-------------|-------------|-----------------|
| 為替予約 取引 | アメリカ・ドル | 売建 | 4,901,000.00 | 637,842,115 | 627,842,605 | 8.63 |

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

2022年5月31日現在

| 種類 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------|---------|---------|--------------|-------------|-------------|-----------------|
| 為替予約 取引 | アメリカ・ドル | 売建 | 3,442,000.00 | 447,897,085 | 440,937,410 | 11.46 |

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

| 年月日 | 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 (2016年 4月26日) | 13,358,665,467 | 13,358,665,467 | 9,514 | 9,514 |
| 第2期 (2017年 4月26日) | 48,551,937,727 | 48,551,937,727 | 9,992 | 9,992 |
| 第3期 (2018年 4月26日) | 30,744,053,222 | 30,744,053,222 | 9,815 | 9,815 |
| 第4期 (2019年 4月26日) | 21,753,606,702 | 21,753,606,702 | 10,029 | 10,029 |
| 第5期 (2020年 4月27日) | 13,719,895,964 | 13,719,895,964 | 9,846 | 9,846 |
| 第6期 (2021年 4月26日) | 11,087,292,976 | 11,087,292,976 | 10,684 | 10,684 |
| 第7期 (2022年 4月26日) | 9,293,380,144 | 9,293,380,144 | 10,221 | 10,221 |
| 2021年 5月末日 | 10,935,548,453 | - | 10,750 | - |
| 6月末日 | 10,777,724,903 | - | 10,847 | - |
| 7月末日 | 10,753,582,635 | - | 10,886 | - |
| 8月末日 | 10,626,756,029 | - | 10,915 | - |
| 9月末日 | 10,478,931,649 | - | 10,819 | - |
| 10月末日 | 10,426,527,427 | - | 10,848 | - |
| 11月末日 | 10,271,704,053 | - | 10,773 | - |
| 12月末日 | 10,144,320,214 | - | 10,888 | - |
| 2022年 1月末日 | 9,747,301,347 | - | 10,558 | - |
| 2月末日 | 9,545,388,741 | - | 10,368 | - |
| 3月末日 | 9,536,655,693 | - | 10,433 | - |
| 4月末日 | 9,293,208,485 | - | 10,221 | - |
| 5月末日 | 9,041,212,962 | - | 10,161 | - |

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

| 年月日 | 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 (2016年 4月26日) | 12,391,100,166 | 12,391,100,166 | 9,296 | 9,296 |
| 第2期 (2017年 4月26日) | 32,241,957,798 | 32,241,957,798 | 10,040 | 10,040 |
| 第3期 (2018年 4月26日) | 20,024,628,165 | 20,024,628,165 | 10,020 | 10,020 |
| 第4期 (2019年 4月26日) | 14,199,914,498 | 14,199,914,498 | 10,254 | 10,254 |
| 第5期 (2020年 4月27日) | 9,390,219,478 | 9,390,219,478 | 9,662 | 9,662 |
| 第6期 (2021年 4月26日) | 8,415,109,788 | 8,415,109,788 | 11,260 | 11,260 |
| 第7期 (2022年 4月26日) | 7,383,568,948 | 7,383,568,948 | 10,932 | 10,932 |
| 2021年 5月末日 | 8,400,516,454 | - | 11,379 | - |
| 6月末日 | 8,362,663,740 | - | 11,523 | - |
| 7月末日 | 8,282,317,230 | - | 11,512 | - |
| 8月末日 | 8,254,009,115 | - | 11,567 | - |
| 9月末日 | 8,121,456,369 | - | 11,469 | - |
| 10月末日 | 8,161,137,989 | - | 11,557 | - |
| 11月末日 | 7,963,172,323 | - | 11,391 | - |

| | | | | |
|------------|---------------|---|--------|---|
| 12月末日 | 8,083,455,046 | - | 11,613 | - |
| 2022年 1月末日 | 7,716,962,777 | - | 11,167 | - |
| 2月末日 | 7,540,089,228 | - | 10,960 | - |
| 3月末日 | 7,579,436,667 | - | 11,201 | - |
| 4月末日 | 7,374,710,589 | - | 10,929 | - |
| 5月末日 | 7,273,964,240 | - | 10,896 | - |

アセットアロケーション・ファンド(成長型)

| 年月日 | 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 (2016年 4月26日) | 12,509,183,920 | 12,509,183,920 | 9,159 | 9,159 |
| 第2期 (2017年 4月26日) | 27,043,239,176 | 27,043,239,176 | 10,069 | 10,069 |
| 第3期 (2018年 4月26日) | 14,776,735,458 | 14,776,735,458 | 10,111 | 10,111 |
| 第4期 (2019年 4月26日) | 10,908,544,788 | 10,908,544,788 | 10,362 | 10,362 |
| 第5期 (2020年 4月27日) | 5,612,179,736 | 5,612,179,736 | 9,482 | 9,482 |
| 第6期 (2021年 4月26日) | 4,420,068,155 | 4,420,068,155 | 11,544 | 11,544 |
| 第7期 (2022年 4月26日) | 3,876,188,991 | 3,876,188,991 | 11,299 | 11,299 |
| 2021年 5月末日 | 4,454,100,802 | - | 11,701 | - |
| 6月末日 | 4,490,939,584 | - | 11,886 | - |
| 7月末日 | 4,415,725,960 | - | 11,836 | - |
| 8月末日 | 4,399,866,094 | - | 11,910 | - |
| 9月末日 | 4,355,015,858 | - | 11,817 | - |
| 10月末日 | 4,295,147,760 | - | 11,937 | - |
| 11月末日 | 4,188,706,826 | - | 11,708 | - |
| 12月末日 | 4,232,218,961 | - | 12,007 | - |
| 2022年 1月末日 | 4,049,955,659 | - | 11,477 | - |
| 2月末日 | 3,923,047,102 | - | 11,242 | - |
| 3月末日 | 4,016,647,104 | - | 11,593 | - |
| 4月末日 | 3,874,421,819 | - | 11,289 | - |
| 5月末日 | 3,847,126,250 | - | 11,275 | - |

【分配の推移】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)

| | 計算期間 | 1万口当たり分配金(円) |
|-----|-------------------------|--------------|
| 第1期 | 2015年 4月17日～2016年 4月26日 | 0 |
| 第2期 | 2016年 4月27日～2017年 4月26日 | 0 |
| 第3期 | 2017年 4月27日～2018年 4月26日 | 0 |
| 第4期 | 2018年 4月27日～2019年 4月26日 | 0 |
| 第5期 | 2019年 4月27日～2020年 4月27日 | 0 |
| 第6期 | 2020年 4月28日～2021年 4月26日 | 0 |
| 第7期 | 2021年 4月27日～2022年 4月26日 | 0 |

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

| | 計算期間 | 1万口当たり分配金（円） |
|-----|-------------------------|--------------|
| 第1期 | 2015年 4月17日～2016年 4月26日 | 0 |
| 第2期 | 2016年 4月27日～2017年 4月26日 | 0 |
| 第3期 | 2017年 4月27日～2018年 4月26日 | 0 |
| 第4期 | 2018年 4月27日～2019年 4月26日 | 0 |
| 第5期 | 2019年 4月27日～2020年 4月27日 | 0 |
| 第6期 | 2020年 4月28日～2021年 4月26日 | 0 |
| 第7期 | 2021年 4月27日～2022年 4月26日 | 0 |

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

| | 計算期間 | 1万口当たり分配金（円） |
|-----|-------------------------|--------------|
| 第1期 | 2015年 4月17日～2016年 4月26日 | 0 |
| 第2期 | 2016年 4月27日～2017年 4月26日 | 0 |
| 第3期 | 2017年 4月27日～2018年 4月26日 | 0 |
| 第4期 | 2018年 4月27日～2019年 4月26日 | 0 |
| 第5期 | 2019年 4月27日～2020年 4月27日 | 0 |
| 第6期 | 2020年 4月28日～2021年 4月26日 | 0 |
| 第7期 | 2021年 4月27日～2022年 4月26日 | 0 |

【収益率の推移】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

| | 収益率（％） |
|-----|--------|
| 第1期 | 4.9 |
| 第2期 | 5.0 |
| 第3期 | 1.8 |
| 第4期 | 2.2 |
| 第5期 | 1.8 |
| 第6期 | 8.5 |
| 第7期 | 4.3 |

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

| | 収益率（％） |
|-----|--------|
| 第1期 | 7.0 |
| 第2期 | 8.0 |
| 第3期 | 0.2 |

| | |
|-----|------|
| 第4期 | 2.3 |
| 第5期 | 5.8 |
| 第6期 | 16.5 |
| 第7期 | 2.9 |

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

アセットアロケーション・ファンド(成長型)

| | 収益率(%) |
|-----|--------|
| 第1期 | 8.4 |
| 第2期 | 9.9 |
| 第3期 | 0.4 |
| 第4期 | 2.5 |
| 第5期 | 8.5 |
| 第6期 | 21.7 |
| 第7期 | 2.1 |

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

(4) 【設定及び解約の実績】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)

| | 設定口数(口) | 解約口数(口) |
|-----|----------------|----------------|
| 第1期 | 14,471,203,211 | 430,595,693 |
| 第2期 | 39,440,607,065 | 4,888,096,644 |
| 第3期 | 3,005,688,776 | 20,274,975,700 |
| 第4期 | 913,665,451 | 10,547,332,018 |
| 第5期 | 258,180,741 | 8,014,561,766 |
| 第6期 | 246,744,303 | 3,802,926,621 |
| 第7期 | 158,442,458 | 1,443,373,995 |

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

| | 設定口数(口) | 解約口数(口) |
|-----|----------------|----------------|
| 第1期 | 13,473,777,867 | 144,788,717 |
| 第2期 | 22,569,690,166 | 3,786,328,653 |
| 第3期 | 1,994,684,295 | 14,122,473,521 |
| 第4期 | 758,923,595 | 6,895,231,238 |
| 第5期 | 498,733,066 | 4,628,274,076 |
| 第6期 | 582,836,155 | 2,828,418,770 |
| 第7期 | 430,295,633 | 1,149,383,746 |

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

| | 設定口数（口） | 解約口数（口） |
|-----|----------------|----------------|
| 第1期 | 13,883,023,089 | 225,050,831 |
| 第2期 | 19,324,709,567 | 6,124,106,042 |
| 第3期 | 2,148,349,345 | 14,391,885,041 |
| 第4期 | 1,008,692,045 | 5,095,880,106 |
| 第5期 | 306,069,242 | 4,915,238,211 |
| 第6期 | 188,201,809 | 2,277,873,843 |
| 第7期 | 172,858,285 | 571,200,442 |

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

（参考）

（１）投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2022年5月31日現在

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計 （円） | 投資比率 （％） |
|---------------------|------|-----------------|-------------|
| 株式 | 日本 | 201,777,267,100 | 97.32 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 5,554,251,979 | 2.68 |
| 合計（純資産総額） | | 207,331,519,079 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 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 | 5,307,020,000 | 2.56 |
| 合計 | 買建 | - | 5,307,020,000 | 2.56 |

外国株式インデックス・マザーファンド

2022年5月31日現在

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計 （円） | 投資比率 （％） |
|-------|---------------|-----------------|-------------|
| 株式 | アメリカ | 247,291,519,268 | 65.34 |
| | イギリス | 16,000,428,092 | 4.23 |
| | カナダ | 14,454,844,359 | 3.82 |
| | スイス | 12,171,966,777 | 3.22 |
| | フランス | 11,352,386,744 | 3.00 |
| | ドイツ | 8,795,211,484 | 2.32 |
| | オーストラリア | 7,809,595,088 | 2.06 |
| | オランダ | 6,629,277,033 | 1.75 |
| | アイルランド | 6,498,707,869 | 1.72 |
| | スウェーデン | 3,537,238,996 | 0.93 |
| | デンマーク | 2,905,302,168 | 0.77 |
| | スペイン | 2,752,388,588 | 0.73 |
| | 香港 | 2,305,310,144 | 0.61 |
| イタリア | 1,959,943,706 | 0.52 | |

| | | | |
|---------------------|----------------|-----------------|--------|
| | ジャージー | 1,435,876,302 | 0.38 |
| | フィンランド | 1,327,513,091 | 0.35 |
| | シンガポール | 1,144,403,333 | 0.30 |
| | ベルギー | 888,473,396 | 0.23 |
| | ノルウェー | 830,347,507 | 0.22 |
| | ケイマン諸島 | 740,636,356 | 0.20 |
| | イスラエル | 731,055,471 | 0.19 |
| | バミューダ | 520,285,462 | 0.14 |
| | オランダ領キュ ラソー | 476,283,451 | 0.13 |
| | ルクセンブルグ | 340,486,198 | 0.09 |
| | ニュージーラン ド | 261,945,776 | 0.07 |
| | オーストリア | 222,997,637 | 0.06 |
| | ポルトガル | 189,455,080 | 0.05 |
| | リベリア | 88,705,819 | 0.02 |
| | パナマ | 86,251,908 | 0.02 |
| | マン島 | 70,407,838 | 0.02 |
| | 小計 | 353,819,244,941 | 93.48 |
| 投資証券 | アメリカ | 7,694,738,736 | 2.03 |
| | オーストラリア | 829,173,255 | 0.22 |
| | イギリス | 216,918,851 | 0.06 |
| | 香港 | 187,236,758 | 0.05 |
| | フランス | 160,517,781 | 0.04 |
| | シンガポール | 149,633,922 | 0.04 |
| | カナダ | 36,830,115 | 0.01 |
| | 小計 | 9,275,049,418 | 2.45 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 15,396,798,964 | 4.07 |
| 合計（純資産総額） | | 378,491,093,323 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 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 | イギリス | 712,240,603 | 0.19 |
| 株価指数先物取引 | 買建 | ドイツ | 2,290,563,072 | 0.61 |
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 11,641,870,258 | 3.08 |
| 株価指数先物取引 | 買建 | オーストラリア | 603,697,725 | 0.16 |
| 合計 | 買建 | - | 15,248,371,658 | 4.03 |

| 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 | - | 4,037,736,368 | 1.07 |
| 為替予約取引 | 売建 | - | 136,923,775 | 0.04 |

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2022年5月31日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 （円） | 投資比率 （％） |
|-------|------|-------------|-------------|
| | | | |

| | | | |
|---------------------|----------------|----------------|--------|
| 株式 | ケイマン諸島 | 2,709,966,366 | 12.92 |
| | 台湾 | 2,489,681,264 | 11.87 |
| | インド | 2,095,812,689 | 9.99 |
| | 韓国 | 2,044,746,095 | 9.75 |
| | 中国 | 1,147,906,939 | 5.47 |
| | ブラジル | 864,313,379 | 4.12 |
| | 南アフリカ | 587,959,431 | 2.80 |
| | タイ | 307,869,778 | 1.47 |
| | メキシコ | 295,480,729 | 1.41 |
| | インドネシア | 291,165,451 | 1.39 |
| | マレーシア | 239,772,887 | 1.14 |
| | 香港 | 186,367,790 | 0.89 |
| | フィリピン | 122,950,772 | 0.59 |
| | ポーランド | 101,503,878 | 0.48 |
| | チリ | 90,060,241 | 0.43 |
| | バミューダ | 77,387,049 | 0.37 |
| | アメリカ | 56,809,485 | 0.27 |
| | トルコ | 45,079,255 | 0.21 |
| | ギリシャ | 37,099,817 | 0.18 |
| | コロンビア | 36,337,838 | 0.17 |
| | ハンガリー | 25,622,167 | 0.12 |
| | チェコ | 24,768,357 | 0.12 |
| | ルクセンブルグ | 18,222,112 | 0.09 |
| | エジプト | 9,612,863 | 0.05 |
| | ペルー | 4,714,886 | 0.02 |
| | シンガポール | 3,649,346 | 0.02 |
| 小計 | 13,914,860,864 | 66.36 | |
| 投資信託受益証券 | 香港 | 788,034,960 | 3.76 |
| 投資証券 | アメリカ | 1,188,874,675 | 5.67 |
| | メキシコ | 82,421,236 | 0.39 |
| | ブラジル | 31,952,436 | 0.15 |
| | 南アフリカ | 6,788,923 | 0.03 |
| | 小計 | 1,310,037,270 | 6.25 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 4,956,211,942 | 23.63 |
| 合計（純資産総額） | | 20,969,145,036 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 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 | 4,947,900,833 | 23.60 |
| 合計 | 買建 | - | 4,947,900,833 | 23.60 |

| 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 | - | 3,307,112,238 | 15.77 |
| 為替予約取引 | 売建 | - | 2,984,707,640 | 14.23 |

Jリート・インデックス・マザーファンド

2022年5月31日現在

| 資産の種類 | 国 / 地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|--------|---------------|-------------|
| 投資証券 | 日本 | 8,739,372,400 | 99.00 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 87,957,282 | 1.00 |
| 合計（純資産総額） | | 8,827,329,682 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建 / 売建 | 国 / 地域 | 時価合計（円） | 投資比率 (%) |
|-----------|---------|--------|------------|-------------|
| リート指数先物取引 | 買建 | 日本 | 40,120,000 | 0.45 |
| 合計 | 買建 | - | 40,120,000 | 0.45 |

外国リート・インデックス・マザーファンド

2022年5月31日現在

| 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 | 16,935,422,797 | 75.24 |
| | オーストラリア | 1,481,331,580 | 6.58 |
| | イギリス | 1,182,693,356 | 5.25 |
| | シンガポール | 782,334,054 | 3.48 |
| | カナダ | 425,610,559 | 1.89 |
| | フランス | 401,106,617 | 1.78 |
| | 香港 | 348,402,509 | 1.55 |
| | ベルギー | 286,677,541 | 1.27 |
| | スペイン | 94,124,284 | 0.42 |
| | ニュージーランド | 77,509,164 | 0.34 |
| | 韓国 | 54,331,698 | 0.24 |
| | オランダ | 43,556,453 | 0.19 |
| | ガーンジー | 36,426,514 | 0.16 |
| | アイルランド | 26,075,131 | 0.12 |
| | イスラエル | 16,379,967 | 0.07 |
| | ドイツ | 13,018,339 | 0.06 |
| イタリア | 6,942,919 | 0.03 | |
| 小計 | | 22,211,943,482 | 98.69 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 295,589,559 | 1.31 |
| 合計（純資産総額） | | 22,507,533,041 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 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 | - | 93,110,563 | 0.41 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

2022年5月31日現在

| 資産の種類 | 国 / 地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|-------|--------|-------------|-------------|
|-------|--------|-------------|-------------|

| | | | |
|---------------------|------|-----------------|--------|
| 国債証券 | 日本 | 107,188,799,950 | 80.71 |
| 地方債証券 | 日本 | 9,950,931,800 | 7.49 |
| 特殊債証券 | 日本 | 9,322,365,332 | 7.02 |
| 社債証券 | 日本 | 5,367,473,900 | 4.04 |
| | フランス | 200,545,400 | 0.15 |
| | 小計 | 5,568,019,300 | 4.19 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 769,421,431 | 0.59 |
| 合計（純資産総額） | | 132,799,537,813 | 100.00 |

外国債券パッシブ・マザーファンド

2022年5月31日現在

| 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 | 76,016,801,067 | 48.96 |
| | フランス | 14,124,270,518 | 9.10 |
| | イタリア | 12,660,387,160 | 8.15 |
| | ドイツ | 10,443,803,674 | 6.73 |
| | スペイン | 8,320,790,788 | 5.36 |
| | イギリス | 8,066,461,008 | 5.20 |
| | ベルギー | 3,183,643,449 | 2.05 |
| | カナダ | 3,172,257,819 | 2.04 |
| | オランダ | 2,745,787,134 | 1.77 |
| | 中国 | 2,644,573,808 | 1.70 |
| | オーストラリア | 2,386,560,502 | 1.54 |
| | オーストリア | 1,919,401,607 | 1.24 |
| | メキシコ | 1,167,530,146 | 0.75 |
| | アイルランド | 1,110,130,143 | 0.72 |
| | フィンランド | 806,452,825 | 0.52 |
| | マレーシア | 761,745,051 | 0.49 |
| | シンガポール | 680,633,448 | 0.44 |
| | ポーランド | 670,107,906 | 0.43 |
| | イスラエル | 629,675,143 | 0.41 |
| | デンマーク | 610,779,043 | 0.39 |
| スウェーデン | 429,726,576 | 0.28 | |
| ノルウェー | 400,801,152 | 0.26 | |
| 小計 | | 152,952,319,967 | 98.52 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 2,301,882,931 | 1.48 |
| 合計（純資産総額） | | 155,254,202,898 | 100.00 |

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2022年5月31日現在

| 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 | 12,434,911,098 | 48.79 |
| | フランス | 2,304,744,293 | 9.04 |
| | イタリア | 2,076,530,594 | 8.15 |

| | | | |
|---------------------|---------|----------------|--------|
| | ドイツ | 1,703,947,502 | 6.69 |
| | スペイン | 1,370,165,106 | 5.38 |
| | イギリス | 1,320,318,782 | 5.18 |
| | カナダ | 519,594,452 | 2.04 |
| | ベルギー | 517,383,496 | 2.03 |
| | オランダ | 441,710,013 | 1.73 |
| | 中国 | 428,330,938 | 1.68 |
| | オーストラリア | 390,184,868 | 1.53 |
| | オーストリア | 326,649,610 | 1.28 |
| | シンガポール | 235,040,450 | 0.92 |
| | メキシコ | 194,480,063 | 0.76 |
| | アイルランド | 174,924,961 | 0.69 |
| | フィンランド | 136,471,021 | 0.54 |
| | ポーランド | 107,398,857 | 0.42 |
| | イスラエル | 100,924,707 | 0.40 |
| | デンマーク | 99,513,212 | 0.39 |
| | スウェーデン | 69,902,596 | 0.27 |
| | ノルウェー | 64,596,248 | 0.25 |
| | 小計 | 25,017,722,867 | 98.15 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 470,790,799 | 1.85 |
| 合計（純資産総額） | | 25,488,513,666 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建 / 売建 | 国 / 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------|---------|--------|----------------|---------|
| 為替予約取引 | 売建 | - | 25,214,546,389 | 98.93 |

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2022年5月31日現在

| 国 / 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿単価（円） | 帳簿価額（円） | 評価額単価（円） | 評価額（円） | 投資比率（％） |
|--------|----|-----------------------|--------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|---------|
| 日本 | 株式 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 3,797,800 | 2,006.07 | 7,618,660,331 | 2,122.50 | 8,060,830,500 | 3.89 |
| 日本 | 株式 | ソニーグループ | 電気機器 | 503,200 | 13,682.74 | 6,885,154,206 | 12,115.00 | 6,096,268,000 | 2.94 |
| 日本 | 株式 | キーエンス | 電気機器 | 72,800 | 69,170.69 | 5,035,626,505 | 51,590.00 | 3,755,752,000 | 1.81 |
| 日本 | 株式 | 三菱UFJ フィナンシャル・グループ | 銀行業 | 4,743,600 | 605.24 | 2,871,012,235 | 729.70 | 3,461,404,920 | 1.67 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 863,700 | 3,200.47 | 2,764,245,637 | 3,911.00 | 3,377,930,700 | 1.63 |
| 日本 | 株式 | 東京エレクトロン | 電気機器 | 50,900 | 59,615.38 | 3,034,422,752 | 58,980.00 | 3,002,082,000 | 1.45 |
| 日本 | 株式 | リクルートホールディングス | サービス業 | 564,000 | 6,854.83 | 3,866,124,244 | 4,734.00 | 2,669,976,000 | 1.29 |

| | | | | | | | | | |
|----|----|-----------------|--------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 日本 | 株式 | 任天堂 | その他製品 | 45,300 | 50,730.69 | 2,298,100,370 | 57,420.00 | 2,601,126,000 | 1.25 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 386,300 | 6,650.89 | 2,569,238,794 | 6,725.00 | 2,597,867,500 | 1.25 |
| 日本 | 株式 | KDDI | 情報・通信業 | 574,600 | 3,364.18 | 1,933,055,152 | 4,486.00 | 2,577,655,600 | 1.24 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 472,800 | 5,949.71 | 2,813,022,733 | 5,379.00 | 2,543,191,200 | 1.23 |
| 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 543,300 | 3,410.54 | 1,852,944,128 | 4,433.00 | 2,408,448,900 | 1.16 |
| 日本 | 株式 | 信越化学工業 | 化学 | 128,100 | 19,000.27 | 2,433,934,065 | 18,335.00 | 2,348,713,500 | 1.13 |
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 631,200 | 3,072.69 | 1,939,483,768 | 3,703.00 | 2,337,333,600 | 1.13 |
| 日本 | 株式 | HOYA | 精密機器 | 155,100 | 17,752.29 | 2,753,380,573 | 13,810.00 | 2,141,931,000 | 1.03 |
| 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 524,700 | 3,717.93 | 1,950,795,810 | 3,922.00 | 2,057,873,400 | 0.99 |
| 日本 | 株式 | 第一三共 | 医薬品 | 598,800 | 2,817.66 | 1,687,215,388 | 3,419.00 | 2,047,297,200 | 0.99 |
| 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 602,300 | 3,108.49 | 1,872,241,097 | 3,187.00 | 1,919,530,100 | 0.93 |
| 日本 | 株式 | ダイキン工業 | 機械 | 92,600 | 23,201.63 | 2,148,471,206 | 20,685.00 | 1,915,431,000 | 0.92 |
| 日本 | 株式 | 三井物産 | 卸売業 | 586,900 | 2,569.06 | 1,507,781,285 | 3,232.00 | 1,896,860,800 | 0.91 |
| 日本 | 株式 | 村田製作所 | 電気機器 | 224,700 | 8,384.68 | 1,884,038,082 | 8,300.00 | 1,865,010,000 | 0.90 |
| 日本 | 株式 | 伊藤忠商事 | 卸売業 | 500,300 | 3,277.13 | 1,639,547,830 | 3,695.00 | 1,848,608,500 | 0.89 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンク | 情報・通信業 | 1,194,200 | 1,555.67 | 1,857,778,972 | 1,480.00 | 1,767,416,000 | 0.85 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 231,600 | 5,747.18 | 1,331,047,059 | 7,466.00 | 1,729,125,600 | 0.83 |
| 日本 | 株式 | 日本電産 | 電気機器 | 188,400 | 12,934.05 | 2,436,775,025 | 8,679.00 | 1,635,123,600 | 0.79 |
| 日本 | 株式 | オリエンタルランド | サービス業 | 84,700 | 17,940.94 | 1,519,597,818 | 19,200.00 | 1,626,240,000 | 0.78 |
| 日本 | 株式 | S M C | 機械 | 23,500 | 72,197.01 | 1,696,629,733 | 66,610.00 | 1,565,335,000 | 0.75 |
| 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス | 小売業 | 280,100 | 4,585.67 | 1,284,445,490 | 5,410.00 | 1,515,341,000 | 0.73 |
| 日本 | 株式 | ファナック | 電気機器 | 70,500 | 22,181.65 | 1,563,806,349 | 21,105.00 | 1,487,902,500 | 0.72 |
| 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 969,000 | 1,407.87 | 1,364,222,621 | 1,519.00 | 1,471,911,000 | 0.71 |

□ 種類別・業種別投資比率

2022年5月31日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率(%) |
|--------|---------|---------|
| 株式(国内) | 水産・農林業 | 0.09 |
| | 鉱業 | 0.36 |
| | 建設業 | 2.07 |
| | 食料品 | 3.14 |
| | 繊維製品 | 0.43 |
| | パルプ・紙 | 0.18 |
| | 化学 | 6.22 |
| | 医薬品 | 5.05 |
| | 石油・石炭製品 | 0.51 |
| | ゴム製品 | 0.69 |

| | |
|------------|-------|
| ガラス・土石製品 | 0.70 |
| 鉄鋼 | 0.83 |
| 非鉄金属 | 0.74 |
| 金属製品 | 0.58 |
| 機械 | 5.26 |
| 電気機器 | 17.83 |
| 輸送用機器 | 7.76 |
| 精密機器 | 2.66 |
| その他製品 | 2.35 |
| 電気・ガス業 | 1.20 |
| 陸運業 | 2.87 |
| 海運業 | 0.67 |
| 空運業 | 0.42 |
| 倉庫・運輸関連業 | 0.19 |
| 情報・通信業 | 8.72 |
| 卸売業 | 5.56 |
| 小売業 | 3.98 |
| 銀行業 | 5.03 |
| 証券、商品先物取引業 | 0.72 |
| 保険業 | 2.20 |
| その他金融業 | 1.13 |
| 不動産業 | 1.93 |
| サービス業 | 5.26 |
| 合計 | 97.32 |

外国株式インデックス・マザーファンド
イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2022年5月31日現在

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 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 | 913,678 | 20,638.72 | 18,857,142,858 | 19,185.34 | 17,529,227,100 | 4.63 |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 397,289 | 43,006.96 | 17,086,193,973 | 35,032.10 | 13,917,868,135 | 3.68 |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC | 小売 | 25,433 | 454,729.53 | 11,565,136,205 | 295,258.66 | 7,509,313,380 | 1.98 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A | メディア・娯楽 | 16,778 | 372,521.72 | 6,250,169,433 | 288,001.97 | 4,832,097,040 | 1.28 |

| | | | | | | | | | |
|------|----|-----------------------------|------------------------|---------|------------|---------------|------------|---------------|------|
| アメリカ | 株式 | TESLA INC | 自動車・自動車部品 | 47,607 | 144,821.82 | 6,894,532,330 | 97,392.16 | 4,636,548,670 | 1.23 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C | メディア・娯楽 | 15,938 | 374,086.80 | 5,962,195,385 | 289,239.20 | 4,609,894,302 | 1.22 |
| アメリカ | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC | ヘルスケア機器・サービス | 52,588 | 58,316.46 | 3,066,746,106 | 65,016.57 | 3,419,091,546 | 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 | 146,998 | 20,597.32 | 3,027,764,140 | 23,217.55 | 3,412,933,253 | 0.90 |
| アメリカ | 株式 | NVIDIA CORP | 半導体・半導体製造装置 | 139,591 | 42,359.55 | 5,913,012,619 | 24,117.58 | 3,366,597,542 | 0.89 |
| アメリカ | 株式 | META PLATFORMS INC-CLASS A | メディア・娯楽 | 131,703 | 42,767.28 | 5,632,579,692 | 25,017.62 | 3,294,895,251 | 0.87 |
| アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 各種金融 | 72,810 | 36,574.93 | 2,663,020,760 | 40,913.09 | 2,978,882,308 | 0.79 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP | エネルギー | 235,630 | 7,992.20 | 1,883,203,133 | 12,512.01 | 2,948,205,835 | 0.78 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | 164,485 | 20,513.19 | 3,374,112,249 | 16,830.13 | 2,768,303,390 | 0.73 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | 家庭用品・パーソナル用品 | 135,224 | 19,148.53 | 2,589,340,160 | 19,067.39 | 2,578,368,907 | 0.68 |
| アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES | ソフトウェア・サービス | 93,345 | 25,359.88 | 2,367,218,097 | 27,293.34 | 2,547,697,270 | 0.67 |
| アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP | エネルギー | 107,292 | 14,971.78 | 1,606,351,863 | 22,857.28 | 2,452,403,157 | 0.65 |
| スイス | 株式 | NESTLE SA-REG | 食品・飲料・タバコ | 157,079 | 16,036.72 | 2,519,031,946 | 15,608.31 | 2,451,738,040 | 0.65 |
| アメリカ | 株式 | HOME DEPOT INC | 小売 | 58,403 | 51,559.25 | 3,011,215,094 | 39,547.66 | 2,309,701,788 | 0.61 |

| | | | | | | | | | |
|------|----|---------------------------------|--|---------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC - A | ソフト ウェ ア・ サービ ス | 48,852 | 41,675.17 | 2,035,915,587 | 45,870.97 | 2,240,888,812 | 0.59 |
| アメリカ | 株式 | PFIZER INC | 医薬 品・バ イオテ クノロ ジー・ ライフ サイエ ンス | 312,402 | 6,718.62 | 2,098,910,964 | 6,911.80 | 2,159,260,487 | 0.57 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP | 銀行 | 412,184 | 5,815.13 | 2,396,901,927 | 4,746.33 | 1,956,363,015 | 0.52 |
| アメリカ | 株式 | COCA-COLA CO/THE | 食品・ 飲料・ タバコ | 229,677 | 7,046.66 | 1,618,456,654 | 8,292.62 | 1,904,624,726 | 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 | 98,942 | 15,232.67 | 1,507,150,774 | 19,231.50 | 1,902,803,073 | 0.50 |
| アメリカ | 株式 | ELI LILLY & CO | 医薬 品・バ イオテ クノロ ジー・ ライフ サイエ ンス | 45,536 | 32,932.70 | 1,499,623,630 | 41,473.37 | 1,888,531,412 | 0.50 |
| オランダ | 株式 | ASML HOLDING NV | 半導 体・半 導体製 造装置 | 23,029 | 96,445.43 | 2,221,041,892 | 76,608.34 | 1,764,213,369 | 0.47 |
| スイス | 株式 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 医薬 品・バ イオテ クノロ ジー・ ライフ サイエ ンス | 39,103 | 47,798.76 | 1,869,074,861 | 44,131.92 | 1,725,690,272 | 0.46 |
| アメリカ | 株式 | BROADCOM INC | 半導 体・半 導体製 造装置 | 22,910 | 72,830.37 | 1,668,543,674 | 74,782.33 | 1,713,263,152 | 0.45 |
| アメリカ | 株式 | PEPSICO INC | 食品・ 飲料・ タバコ | 77,445 | 21,084.87 | 1,632,917,672 | 22,022.63 | 1,705,542,712 | 0.45 |

| | | | | | | | | | |
|------|----|---------------------|------------------------|---------|----------|---------------|-----------|---------------|------|
| アメリカ | 株式 | MERCK & CO. INC. | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 141,532 | 9,662.06 | 1,367,491,152 | 11,933.79 | 1,689,012,713 | 0.45 |
| イギリス | 株式 | SHELL PLC | エネルギー | 428,530 | 2,621.90 | 1,123,562,897 | 3,840.18 | 1,645,633,363 | 0.43 |

□ 種類別・業種別投資比率

2022年5月31日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率（％） |
|-------------|------------------------|---------|
| 株式（外国） | エネルギー | 5.31 |
| | 素材 | 4.42 |
| | 資本財 | 5.75 |
| | 商業・専門サービス | 1.12 |
| | 運輸 | 1.79 |
| | 自動車・自動車部品 | 2.03 |
| | 耐久消費財・アパレル | 1.55 |
| | 消費者サービス | 1.70 |
| | 小売 | 4.38 |
| | 食品・生活必需品小売り | 1.42 |
| | 食品・飲料・タバコ | 4.06 |
| | 家庭用品・パーソナル用品 | 1.65 |
| | ヘルスケア機器・サービス | 4.69 |
| | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 8.54 |
| | 銀行 | 5.88 |
| | 各種金融 | 4.54 |
| | 保険 | 3.06 |
| | 不動産 | 0.37 |
| | ソフトウェア・サービス | 10.41 |
| | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 6.06 |
| 半導体・半導体製造装置 | 4.54 | |
| 電気通信サービス | 1.56 | |
| 公益事業 | 3.14 | |
| メディア・娯楽 | 5.50 | |
| 投資証券 | - | 2.45 |
| 合計 | | 95.93 |

エマージング株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2022年5月31日現在

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿単価 （円） | 帳簿価額 （円） | 評価額 単価 （円） | 評価額 （円） | 投資 比率 （％） |
|----------|----|-----|----|----|-------------|-------------|------------------|------------|-----------------|
|----------|----|-----|----|----|-------------|-------------|------------------|------------|-----------------|

| | | | | | | | | | |
|--------|----------|-------------------------------|--------------------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 台湾 | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 半導体・半導体製造装置 | 452,000 | 2,630.90 | 1,189,165,115 | 2,421.08 | 1,094,326,668 | 5.22 |
| 香港 | 投資信託受益証券 | CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY | - | 1,000,000 | 942.1146 | 942,114,633 | 788.0350 | 788,034,960 | 3.76 |
| アメリカ | 投資証券 | ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF | - | 117,107 | 5,157.57 | 603,987,928 | 5,907.92 | 691,858,412 | 3.30 |
| 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 | 87,704 | 7,458.86 | 654,171,509 | 7,000.18 | 613,943,786 | 2.93 |
| ケイマン諸島 | 株式 | TENCENT HOLDINGS LTD | メディア・エンターテインメント | 105,800 | 7,286.23 | 770,883,618 | 5,715.50 | 604,699,900 | 2.88 |
| ケイマン諸島 | 株式 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 小売 | 279,000 | 2,078.54 | 579,913,747 | 1,549.72 | 432,371,043 | 2.06 |
| インド | 株式 | RELIANCE INDUSTRIES LTD | エネルギー | 52,588 | 4,037.37 | 212,317,301 | 4,423.57 | 232,626,593 | 1.11 |
| アメリカ | 投資証券 | ISHARES MSCI UAE ETF | - | 100,055 | 2,120.20 | 212,136,341 | 2,173.16 | 217,435,473 | 1.04 |
| ケイマン諸島 | 株式 | MEITUAN-CLASS B | 小売 | 75,100 | 3,877.42 | 291,194,237 | 2,859.38 | 214,739,663 | 1.02 |
| ブラジル | 株式 | VALE SA | 素材 | 75,688 | 1,964.24 | 148,669,685 | 2,336.75 | 176,864,025 | 0.84 |
| 中国 | 株式 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 銀行 | 1,764,000 | 84.03 | 148,220,347 | 95.20 | 167,939,679 | 0.80 |
| インド | 株式 | INFOSYS LTD | ソフトウェア・サービス | 62,021 | 2,823.01 | 175,085,934 | 2,534.49 | 157,191,480 | 0.75 |
| アメリカ | 投資証券 | ISHARES MSCI QATAR ETF | - | 53,189 | 2,622.18 | 139,471,163 | 2,939.86 | 156,367,963 | 0.75 |
| ケイマン諸島 | 株式 | JD.COM INC - CLASS A | 小売 | 36,885 | 5,385.74 | 198,652,847 | 3,638.32 | 134,199,580 | 0.64 |
| インド | 株式 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE | 銀行 | 31,758 | 4,451.77 | 141,379,393 | 3,929.64 | 124,797,348 | 0.60 |
| アメリカ | 投資証券 | ISHARES MSCI KUWAIT ETF | - | 25,744 | 4,457.41 | 114,751,564 | 4,786.08 | 123,212,825 | 0.59 |
| インド | 株式 | ICICI BANK LTD | 銀行 | 94,918 | 1,197.20 | 113,635,417 | 1,242.51 | 117,936,564 | 0.56 |
| 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 | 230,800 | 458.57 | 105,837,031 | 489.08 | 112,880,598 | 0.54 |
| 韓国 | 株式 | SK HYNIX INC | 半導体・半導体製造装置 | 10,083 | 12,036.08 | 121,359,831 | 11,063.80 | 111,556,295 | 0.53 |
| 台湾 | 株式 | MEDIATEK INC | 半導体・半導体製造装置 | 28,000 | 4,581.41 | 128,279,531 | 3,886.12 | 108,811,242 | 0.52 |

| | | | | | | | | | |
|--------|----|------------------------------|--------------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| ケイマン諸島 | 株式 | NETEASE INC | メディア・娯楽 | 38,000 | 2,833.82 | 107,685,244 | 2,727.11 | 103,630,180 | 0.49 |
| インド | 株式 | TATA CONSULTANCY SVCS LTD | ソフトウェア・サービス | 17,110 | 5,835.92 | 99,852,672 | 5,602.92 | 95,865,875 | 0.46 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 15,221 | 6,773.16 | 103,094,301 | 6,297.06 | 95,847,550 | 0.46 |
| 中国 | 株式 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 保険 | 117,000 | 910.64 | 106,545,105 | 808.34 | 94,575,195 | 0.45 |
| ケイマン諸島 | 株式 | BAIDU INC - SPON ADR | メディア・娯楽 | 5,110 | 19,288.36 | 98,563,542 | 17,832.73 | 91,125,244 | 0.43 |
| メキシコ | 株式 | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L | 電気通信サービス | 570,600 | 121.93 | 69,575,312 | 141.07 | 80,497,349 | 0.38 |
| 中国 | 株式 | IND & COMM BK OF CHINA-H | 銀行 | 1,047,000 | 68.72 | 71,945,233 | 76.42 | 80,016,346 | 0.38 |
| 中国 | 株式 | BANK OF CHINA LTD-H | 銀行 | 1,457,000 | 44.95 | 65,488,328 | 50.62 | 73,757,711 | 0.35 |
| ブラジル | 株式 | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | エネルギー | 88,400 | 808.42 | 71,464,286 | 808.76 | 71,494,500 | 0.34 |
| 中国 | 株式 | BYD CO LTD-H | 自動車・自動車部品 | 15,500 | 4,780.06 | 74,090,946 | 4,490.75 | 69,606,625 | 0.33 |

□ 種類別・業種別投資比率

2022年5月31日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率(%) |
|--------|------------------------|---------|
| 株式(外国) | エネルギー | 3.38 |
| | 素材 | 5.68 |
| | 資本財 | 1.99 |
| | 商業・専門サービス | 0.06 |
| | 運輸 | 1.43 |
| | 自動車・自動車部品 | 2.59 |
| | 耐久消費財・アパレル | 1.12 |
| | 消費者サービス | 0.70 |
| | 小売 | 4.99 |
| | 食品・生活必需品小売り | 0.95 |
| | 食品・飲料・タバコ | 2.11 |
| | 家庭用品・パーソナル用品 | 0.64 |
| | ヘルスケア機器・サービス | 0.52 |
| | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 1.78 |
| | 銀行 | 9.19 |
| | 各種金融 | 1.67 |
| 保険 | 1.94 | |

| | | |
|----------|--------------------|-------|
| | 不動産 | 1.21 |
| | ソフトウェア・サービス | 1.92 |
| | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 6.34 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 7.37 |
| | 電気通信サービス | 1.95 |
| | 公益事業 | 1.85 |
| | メディア・娯楽 | 5.00 |
| 投資信託受益証券 | - | 3.76 |
| 投資証券 | - | 6.25 |
| 合計 | | 76.36 |

Jリート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2022年5月31日現在

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----------|------|--------------------|-------|-------------|-------------|------------------|-------------|-----------------|
| 日本 | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人 | 917 | 655,932.85 | 601,490,424 | 700,000.00 | 641,900,000 | 7.27 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 787 | 610,906.40 | 480,783,340 | 639,000.00 | 502,893,000 | 5.70 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人 | 1,288 | 338,422.39 | 435,888,033 | 343,000.00 | 441,784,000 | 5.00 |
| 日本 | 投資証券 | 日本都市ファンド投資法人 | 3,974 | 93,375.40 | 371,073,830 | 108,900.00 | 432,768,600 | 4.90 |
| 日本 | 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 2,546 | 151,719.82 | 386,278,673 | 167,800.00 | 427,218,800 | 4.84 |
| 日本 | 投資証券 | GLP投資法人 | 2,550 | 170,298.82 | 434,261,985 | 165,700.00 | 422,535,000 | 4.79 |
| 日本 | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人 | 1,182 | 311,079.60 | 367,696,082 | 318,500.00 | 376,467,000 | 4.26 |
| 日本 | 投資証券 | オリックス不動産投資法人 | 1,569 | 159,679.03 | 250,536,399 | 186,200.00 | 292,147,800 | 3.31 |
| 日本 | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人 | 788 | 322,341.81 | 254,005,350 | 360,500.00 | 284,074,000 | 3.22 |
| 日本 | 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 1,773 | 131,707.14 | 233,516,757 | 143,800.00 | 254,957,400 | 2.89 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プライムリアルティ投資法人 | 538 | 372,994.16 | 200,670,859 | 410,500.00 | 220,849,000 | 2.50 |
| 日本 | 投資証券 | 産業ファンド投資法人 | 1,118 | 170,445.94 | 190,558,566 | 190,400.00 | 212,867,200 | 2.41 |
| 日本 | 投資証券 | 積水ハウス・リート投資法人 | 2,394 | 76,167.15 | 182,344,146 | 79,500.00 | 190,323,000 | 2.16 |
| 日本 | 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 273 | 603,542.41 | 164,767,079 | 670,000.00 | 182,910,000 | 2.07 |

| | | | | | | | | |
|----|------|-------------------------|-------|------------|-------------|------------|-------------|------|
| 日本 | 投資証券 | ラサールロジポート投資法人 | 965 | 166,384.24 | 160,560,787 | 183,100.00 | 176,691,500 | 2.00 |
| 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 | 311 | 530,134.42 | 164,871,806 | 556,000.00 | 172,916,000 | 1.96 |
| 日本 | 投資証券 | アクティブ・プロパティーズ投資法人 | 420 | 390,174.78 | 163,873,407 | 410,500.00 | 172,410,000 | 1.95 |
| 日本 | 投資証券 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 531 | 300,288.45 | 159,453,166 | 324,000.00 | 172,044,000 | 1.95 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 2,416 | 58,078.49 | 140,317,631 | 66,800.00 | 161,388,800 | 1.83 |
| 日本 | 投資証券 | ケネディクス・オフィス投資法人 | 243 | 675,066.10 | 164,041,062 | 662,000.00 | 160,866,000 | 1.82 |
| 日本 | 投資証券 | インヴィンシブル投資法人 | 3,472 | 38,524.67 | 133,757,651 | 42,800.00 | 148,601,600 | 1.68 |
| 日本 | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人 | 276 | 470,111.88 | 129,750,878 | 531,000.00 | 146,556,000 | 1.66 |
| 日本 | 投資証券 | イオンリート投資法人 | 928 | 141,457.94 | 131,272,965 | 154,100.00 | 143,004,800 | 1.62 |
| 日本 | 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人 | 928 | 137,868.34 | 127,941,820 | 152,200.00 | 141,241,600 | 1.60 |
| 日本 | 投資証券 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 367 | 308,710.36 | 113,296,703 | 339,000.00 | 124,413,000 | 1.41 |
| 日本 | 投資証券 | 大和証券リビング投資法人 | 1,048 | 105,554.54 | 110,621,157 | 118,000.00 | 123,664,000 | 1.40 |
| 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 | 564 | 190,951.53 | 107,696,664 | 214,100.00 | 120,752,400 | 1.37 |
| 日本 | 投資証券 | ヒューリックリート投資法人 | 733 | 155,530.35 | 114,003,749 | 162,100.00 | 118,819,300 | 1.35 |
| 日本 | 投資証券 | N T T都市開発リート投資法人 | 755 | 148,503.63 | 112,120,239 | 152,100.00 | 114,835,500 | 1.30 |
| 日本 | 投資証券 | 大和証券オフィス投資法人 | 164 | 693,689.74 | 113,765,118 | 695,000.00 | 113,980,000 | 1.29 |

□ 種類別投資比率

2022年5月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 99.00 |
| 合計 | 99.00 |

外国リート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2022年5月31日現在

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----------|------|---------------------------------|---------|-------------|---------------|------------------|---------------|-----------------|
| アメリカ | 投資証券 | PROLOGIS INC | 87,144 | 18,439.03 | 1,606,850,852 | 16,316.00 | 1,421,841,904 | 6.32 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUINIX INC | 10,621 | 90,388.92 | 960,020,684 | 88,936.71 | 944,596,826 | 4.20 |
| アメリカ | 投資証券 | PUBLIC STORAGE | 17,909 | 45,223.06 | 809,899,809 | 43,049.07 | 770,965,825 | 3.43 |
| アメリカ | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 33,555 | 17,255.77 | 579,017,389 | 18,143.00 | 608,788,267 | 2.70 |
| アメリカ | 投資証券 | REALTY INCOME CORP | 66,900 | 8,480.06 | 567,316,100 | 8,891.36 | 594,832,218 | 2.64 |
| アメリカ | 投資証券 | WELLTOWER INC | 51,097 | 10,657.60 | 544,571,499 | 11,560.70 | 590,716,868 | 2.62 |
| アメリカ | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP INC | 38,879 | 17,496.10 | 680,230,738 | 14,581.32 | 566,907,268 | 2.52 |
| アメリカ | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 16,245 | 30,316.75 | 492,495,683 | 27,040.77 | 439,277,326 | 1.95 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL | 40,221 | 10,859.09 | 436,763,636 | 10,017.05 | 402,895,659 | 1.79 |
| アメリカ | 投資証券 | VICI PROPERTIES INC | 98,121 | 3,608.01 | 354,021,890 | 3,957.84 | 388,347,483 | 1.73 |
| オーストラリア | 投資証券 | GOODMAN GROUP | 200,957 | 1,995.32 | 400,974,446 | 1,873.94 | 376,581,561 | 1.67 |
| アメリカ | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 17,293 | 24,334.51 | 420,816,648 | 21,614.92 | 373,786,879 | 1.66 |
| アメリカ | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC | 15,717 | 24,310.66 | 382,090,588 | 23,081.65 | 362,774,234 | 1.61 |
| アメリカ | 投資証券 | INVITATION HOMES INC | 69,588 | 4,787.39 | 333,145,214 | 4,941.21 | 343,849,158 | 1.53 |
| アメリカ | 投資証券 | VENTAS INC | 46,554 | 6,722.45 | 312,956,995 | 7,359.25 | 342,602,710 | 1.52 |
| アメリカ | 投資証券 | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 13,728 | 26,102.81 | 358,339,324 | 23,567.56 | 323,535,493 | 1.44 |
| アメリカ | 投資証券 | DUKE REALTY CORP | 44,708 | 6,766.19 | 302,502,870 | 6,848.98 | 306,204,117 | 1.36 |
| 香港 | 投資証券 | LINK REIT | 249,400 | 1,049.06 | 261,634,326 | 1,164.33 | 290,383,652 | 1.29 |
| アメリカ | 投資証券 | SUN COMMUNITIES INC | 13,507 | 23,024.68 | 310,994,368 | 21,304.66 | 287,761,984 | 1.28 |
| アメリカ | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 7,622 | 40,620.71 | 309,611,073 | 37,012.94 | 282,112,666 | 1.25 |
| イギリス | 投資証券 | SEGRO PLC | 140,177 | 1,988.03 | 278,675,818 | 1,826.27 | 256,001,105 | 1.14 |
| アメリカ | 投資証券 | WP CAREY INC | 22,375 | 9,781.65 | 218,864,439 | 10,917.08 | 244,269,698 | 1.09 |
| アメリカ | 投資証券 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 63,308 | 3,982.51 | 252,124,571 | 3,856.56 | 244,150,897 | 1.08 |
| アメリカ | 投資証券 | BOSTON PROPERTIES INC | 16,545 | 15,389.99 | 254,627,369 | 14,446.70 | 239,020,697 | 1.06 |

| | | | | | | | | |
|------|------|-----------------------------|--------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| アメリカ | 投資証券 | IRON MOUNTAIN INC | 33,329 | 5,910.68 | 196,997,121 | 7,043.86 | 234,764,723 | 1.04 |
| アメリカ | 投資証券 | KIMCO REALTY CORP | 73,890 | 3,045.24 | 225,012,625 | 3,043.71 | 224,899,392 | 1.00 |
| アメリカ | 投資証券 | UDR INC | 35,816 | 6,949.41 | 248,900,152 | 6,229.72 | 223,123,791 | 0.99 |
| アメリカ | 投資証券 | CAMDEN PROPERTY TRUST | 11,987 | 20,838.67 | 249,793,127 | 18,587.89 | 222,812,987 | 0.99 |
| アメリカ | 投資証券 | HOST HOTELS & RESORTS INC | 82,608 | 2,385.34 | 197,047,884 | 2,653.95 | 219,237,253 | 0.97 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 20,726 | 9,581.48 | 198,585,729 | 9,915.76 | 205,514,070 | 0.91 |

□ 種類別投資比率

2022年5月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 98.69 |
| 合計 | 98.69 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2022年5月31日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価(円) | 帳簿価額(円) | 評価額単価(円) | 評価額(円) | 利率(%) | 償還期限 | 投資比率(%) |
|------|------|--------------|---------------|---------|---------------|----------|---------------|-------|------------|---------|
| 日本 | 国債証券 | 435 2年国債 | 3,480,000,000 | 100.16 | 3,485,463,600 | 100.16 | 3,485,428,800 | 0.005 | 2024/04/01 | 2.62 |
| 日本 | 国債証券 | 150 5年国債 | 2,140,000,000 | 100.14 | 2,142,931,800 | 100.07 | 2,141,455,200 | 0.005 | 2026/12/20 | 1.61 |
| 日本 | 国債証券 | 146 5年国債 | 1,550,000,000 | 100.52 | 1,558,029,000 | 100.50 | 1,557,719,000 | 0.100 | 2025/12/20 | 1.17 |
| 日本 | 国債証券 | 147 5年国債 | 1,540,000,000 | 100.17 | 1,542,648,800 | 100.13 | 1,542,048,200 | 0.005 | 2026/03/20 | 1.16 |
| 日本 | 国債証券 | 366 10年国債 | 1,420,000,000 | 99.79 | 1,416,957,900 | 99.66 | 1,415,228,800 | 0.200 | 2032/03/20 | 1.07 |
| 日本 | 国債証券 | 361 10年国債 | 1,310,000,000 | 99.49 | 1,303,345,200 | 99.20 | 1,299,520,000 | 0.100 | 2030/12/20 | 0.98 |
| 日本 | 国債証券 | 149 5年国債 | 1,240,000,000 | 100.15 | 1,241,872,400 | 100.11 | 1,241,326,800 | 0.005 | 2026/09/20 | 0.93 |
| 日本 | 国債証券 | 359 10年国債 | 1,210,000,000 | 99.72 | 1,206,612,000 | 99.40 | 1,202,788,400 | 0.100 | 2030/06/20 | 0.91 |
| 日本 | 国債証券 | 362 10年国債 | 1,150,000,000 | 99.35 | 1,142,502,000 | 99.09 | 1,139,558,000 | 0.100 | 2031/03/20 | 0.86 |
| 日本 | 国債証券 | 434 2年国債 | 1,130,000,000 | 100.15 | 1,131,695,000 | 100.15 | 1,131,672,400 | 0.005 | 2024/03/01 | 0.85 |

| | | | | | | | | | | |
|----|----------|----------------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|-------|------------|------|
| 日本 | 国債 証券 | 3 5 8 1 0 年国 債 | 1,130,000,000 | 99.81 | 1,127,807,800 | 99.50 | 1,124,338,700 | 0.100 | 2030/03/20 | 0.85 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 6 0 1 0 年国 債 | 1,120,000,000 | 99.63 | 1,115,856,000 | 99.30 | 1,112,204,800 | 0.100 | 2030/09/20 | 0.84 |
| 日本 | 国債 証券 | 1 4 5 5 年国債 | 1,080,000,000 | 100.50 | 1,085,378,400 | 100.48 | 1,085,173,200 | 0.100 | 2025/09/20 | 0.82 |
| 日本 | 国債 証券 | 1 4 8 5 年国債 | 1,070,000,000 | 100.16 | 1,071,733,400 | 100.12 | 1,071,294,700 | 0.005 | 2026/06/20 | 0.81 |
| 日本 | 国債 証券 | 6 9 2 0 年国債 | 1,020,000,000 | 103.96 | 1,060,351,200 | 103.92 | 1,059,984,000 | 2.100 | 2024/03/20 | 0.80 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 6 5 1 0 年国 債 | 1,060,000,000 | 99.06 | 1,050,036,000 | 98.83 | 1,047,598,000 | 0.100 | 2031/12/20 | 0.79 |
| 日本 | 国債 証券 | 1 4 4 5 年国債 | 980,000,000 | 100.48 | 984,664,800 | 100.46 | 984,488,400 | 0.100 | 2025/06/20 | 0.74 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 6 4 1 0 年国 債 | 950,000,000 | 99.13 | 941,735,000 | 98.91 | 939,597,500 | 0.100 | 2031/09/20 | 0.71 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 5 6 1 0 年国 債 | 940,000,000 | 100.00 | 940,000,000 | 99.71 | 937,274,000 | 0.100 | 2029/09/20 | 0.71 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 5 7 1 0 年国 債 | 910,000,000 | 99.89 | 908,971,700 | 99.59 | 906,259,900 | 0.100 | 2029/12/20 | 0.68 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 5 5 1 0 年国 債 | 860,000,000 | 100.08 | 860,728,600 | 99.83 | 858,495,000 | 0.100 | 2029/06/20 | 0.65 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 3 3 1 0 年国 債 | 815,000,000 | 101.23 | 825,000,050 | 101.22 | 824,910,400 | 0.600 | 2024/03/20 | 0.62 |
| 日本 | 国債 証券 | 7 0 2 0 年国債 | 780,000,000 | 105.12 | 819,904,800 | 105.08 | 819,585,000 | 2.400 | 2024/06/20 | 0.62 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 3 8 1 0 年国 債 | 805,000,000 | 101.30 | 815,440,850 | 101.28 | 815,263,750 | 0.400 | 2025/03/20 | 0.61 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 4 4 1 0 年国 債 | 811,000,000 | 100.56 | 815,557,820 | 100.52 | 815,184,760 | 0.100 | 2026/09/20 | 0.61 |
| 日本 | 国債 証券 | 8 8 2 0 年国債 | 742,000,000 | 109.51 | 812,586,460 | 109.43 | 811,970,600 | 2.300 | 2026/06/20 | 0.61 |
| 日本 | 国債 証券 | 1 4 1 5 年国債 | 795,000,000 | 100.38 | 798,044,850 | 100.38 | 798,021,000 | 0.100 | 2024/09/20 | 0.60 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 3 9 1 0 年国 債 | 785,000,000 | 101.40 | 795,974,300 | 101.38 | 795,793,750 | 0.400 | 2025/06/20 | 0.60 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 6 3 1 0 年国 債 | 800,000,000 | 99.24 | 793,928,000 | 98.98 | 791,824,000 | 0.100 | 2031/06/20 | 0.60 |
| 日本 | 国債 証券 | 7 2 2 0 年国債 | 753,000,000 | 105.03 | 790,883,430 | 105.00 | 790,612,350 | 2.100 | 2024/09/20 | 0.60 |

□ 種類別投資比率

2022年5月31日現在

| 種類 | 投資比率（％） |
|-------|---------|
| 国債証券 | 80.71 |
| 地方債証券 | 7.49 |
| 特殊債券 | 7.02 |
| 社債券 | 4.19 |
| 合計 | 99.42 |

外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2022年5月31日現在

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|----------|----------|-----------------------------|------------|-------------|---------------|------------------|---------------|-----------|------------|-----------------|
| アメ リカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 14,950,000 | 13,075.37 | 1,954,767,611 | 12,294.06 | 1,837,961,506 | 1.625 | 2026/05/15 | 1.18 |
| アメ リカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 13,300,000 | 13,417.95 | 1,784,586,786 | 12,619.58 | 1,678,404,417 | 2.250 | 2026/03/31 | 1.08 |
| アメ リカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 9,000,000 | 14,055.92 | 1,265,032,684 | 12,873.05 | 1,158,574,793 | 2.875 | 2028/05/15 | 0.75 |
| アメ リカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 8,500,000 | 13,546.16 | 1,151,423,239 | 12,733.82 | 1,082,374,462 | 2.500 | 2026/02/28 | 0.70 |
| アメ リカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 8,000,000 | 12,730.23 | 1,018,418,185 | 12,521.50 | 1,001,720,115 | 0.125 | 2023/08/15 | 0.65 |
| アメ リカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 7,700,000 | 12,776.38 | 983,781,484 | 12,578.55 | 968,548,726 | 0.250 | 2023/06/15 | 0.62 |
| アメ リカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 8,500,000 | 12,535.48 | 1,065,515,488 | 11,236.84 | 955,131,165 | 1.125 | 2031/02/15 | 0.62 |
| アメ リカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 8,800,000 | 12,040.71 | 1,059,582,826 | 10,844.64 | 954,328,570 | 0.625 | 2030/08/15 | 0.61 |
| アメ リカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 7,700,000 | 12,668.69 | 975,488,862 | 12,348.16 | 950,808,437 | 0.125 | 2024/02/15 | 0.61 |
| アメ リカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 7,100,000 | 12,949.21 | 919,393,910 | 12,128.79 | 861,144,388 | 1.375 | 2026/08/31 | 0.55 |
| アメ リカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 6,500,000 | 13,223.07 | 859,499,326 | 12,760.87 | 829,456,518 | 2.125 | 2024/03/31 | 0.53 |
| アメ リカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 7,200,000 | 12,330.08 | 887,766,041 | 11,399.66 | 820,775,803 | 0.625 | 2027/12/31 | 0.53 |
| アメ リカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 7,500,000 | 12,066.74 | 905,005,542 | 10,907.85 | 818,088,778 | 0.625 | 2030/05/15 | 0.53 |
| アメ リカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 6,200,000 | 13,127.42 | 813,900,157 | 12,639.58 | 783,654,136 | 1.750 | 2024/06/30 | 0.50 |
| アメ リカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 7,000,000 | 12,280.08 | 859,605,740 | 11,046.06 | 773,224,253 | 0.875 | 2030/11/15 | 0.50 |
| ドイ ツ | 国債 証券 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5,800,000 | 14,288.05 | 828,707,127 | 12,769.25 | 740,616,495 | 0.000 | 2030/08/15 | 0.48 |
| アメ リカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 5,700,000 | 13,350.76 | 760,993,532 | 12,837.92 | 731,761,652 | 2.500 | 2024/05/15 | 0.47 |
| アメ リカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 5,600,000 | 13,344.35 | 747,283,780 | 12,782.92 | 715,843,611 | 2.375 | 2024/08/15 | 0.46 |

| | | | | | | | | | | |
|------|------|--------------------------------|------------|-----------|-------------|-----------|-------------|-------|------------|------|
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,700,000 | 12,711.25 | 724,541,377 | 12,454.32 | 709,896,205 | 0.125 | 2023/10/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 6,000,000 | 12,848.95 | 770,936,986 | 11,753.14 | 705,188,334 | 1.375 | 2028/10/31 | 0.45 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 36,000,000 | 1,927.75 | 693,990,177 | 1,932.12 | 695,564,521 | 2.690 | 2026/08/12 | 0.45 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,500,000 | 13,045.37 | 717,495,212 | 12,499.45 | 687,469,712 | 1.500 | 2024/10/31 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,900,000 | 12,554.45 | 740,712,633 | 11,518.26 | 679,577,233 | 1.000 | 2028/07/31 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,900,000 | 12,412.27 | 732,323,724 | 11,465.69 | 676,475,833 | 0.750 | 2028/01/31 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,100,000 | 13,387.30 | 682,752,482 | 12,906.13 | 658,212,703 | 2.750 | 2024/02/15 | 0.42 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE OAT. | 4,800,000 | 13,973.00 | 670,703,846 | 13,685.22 | 656,890,375 | 0.000 | 2024/03/25 | 0.42 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,100,000 | 13,320.76 | 679,358,891 | 12,716.77 | 648,555,028 | 2.250 | 2024/11/15 | 0.42 |
| イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4,400,000 | 16,858.79 | 741,786,904 | 14,681.08 | 645,967,660 | 3.500 | 2030/03/01 | 0.42 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,000,000 | 13,233.58 | 661,678,989 | 12,876.00 | 643,800,104 | 2.500 | 2023/08/15 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,500,000 | 12,686.30 | 697,746,673 | 11,693.14 | 643,122,514 | 1.625 | 2031/05/15 | 0.41 |

□ 種類別投資比率

2022年5月31日現在

| 種類 | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.52 |
| 合計 | 98.52 |

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2022年5月31日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|------|------|--------------------|-----------|-------------|-------------|------------------|-------------|-----------|------------|-----------------|
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,590,000 | 12,514.78 | 198,985,066 | 12,454.32 | 198,023,678 | 0.125 | 2023/10/15 | 0.78 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,300,000 | 12,832.74 | 166,825,660 | 11,693.14 | 152,010,776 | 1.625 | 2031/05/15 | 0.60 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,170,000 | 12,795.61 | 149,708,637 | 12,544.45 | 146,770,077 | 0.125 | 2023/07/15 | 0.58 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,190,000 | 12,016.10 | 142,991,595 | 11,365.56 | 135,250,164 | 1.375 | 2031/11/15 | 0.53 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,170,000 | 11,938.41 | 139,679,435 | 11,399.66 | 133,376,068 | 0.625 | 2027/12/31 | 0.52 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,050,000 | 12,639.64 | 132,716,246 | 12,348.16 | 129,655,695 | 0.125 | 2024/02/15 | 0.51 |

| | | | | | | | | | | |
|------|----------|-----------------------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|-------|------------|------|
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 1,000,000 | 12,826.01 | 128,260,082 | 12,853.95 | 128,539,499 | 2.500 | 2024/01/31 | 0.50 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 1,080,000 | 12,054.21 | 130,185,459 | 11,814.30 | 127,594,386 | 0.500 | 2026/02/28 | 0.50 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 980,000 | 12,651.72 | 123,986,883 | 12,513.42 | 122,631,557 | 0.750 | 2023/12/31 | 0.48 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 1,100,000 | 12,253.66 | 134,790,285 | 11,046.06 | 121,506,668 | 0.875 | 2030/11/15 | 0.48 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 1,030,000 | 12,396.52 | 127,684,138 | 11,785.19 | 121,387,471 | 0.375 | 2026/01/31 | 0.48 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 980,000 | 12,819.50 | 125,631,073 | 12,341.11 | 120,942,877 | 0.375 | 2024/04/15 | 0.47 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 950,000 | 13,096.45 | 124,416,286 | 12,721.77 | 120,856,771 | 1.375 | 2023/06/30 | 0.47 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 900,000 | 13,561.71 | 122,055,418 | 12,939.08 | 116,451,732 | 2.875 | 2023/11/30 | 0.46 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 980,000 | 12,393.38 | 121,455,152 | 11,874.43 | 116,369,370 | 1.875 | 2032/02/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 900,000 | 13,442.52 | 120,982,661 | 12,919.08 | 116,271,725 | 2.750 | 2023/07/31 | 0.46 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 900,000 | 13,519.14 | 121,672,291 | 12,911.13 | 116,200,184 | 2.750 | 2023/11/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 900,000 | 12,802.97 | 115,226,734 | 12,837.92 | 115,541,313 | 2.500 | 2024/05/15 | 0.45 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 1,040,000 | 12,029.69 | 125,108,783 | 10,844.64 | 112,784,285 | 0.625 | 2030/08/15 | 0.44 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 900,000 | 12,667.69 | 114,009,241 | 12,511.37 | 112,602,355 | 0.875 | 2024/01/31 | 0.44 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 990,000 | 12,568.53 | 124,428,435 | 11,274.40 | 111,616,587 | 1.250 | 2031/08/15 | 0.44 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 890,000 | 12,610.89 | 112,236,885 | 11,752.24 | 104,594,948 | 1.250 | 2028/04/30 | 0.41 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 850,000 | 12,236.80 | 104,012,819 | 12,128.28 | 103,090,391 | 1.875 | 2029/02/28 | 0.40 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 910,000 | 12,309.69 | 112,018,169 | 11,236.84 | 102,255,218 | 1.125 | 2031/02/15 | 0.40 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 900,000 | 13,469.87 | 121,228,805 | 11,248.38 | 101,235,385 | 2.375 | 2051/05/15 | 0.40 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 770,000 | 13,457.04 | 103,619,221 | 12,781.90 | 98,420,598 | 2.250 | 2024/04/30 | 0.39 |
| 中国 | 国債 証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 5,000,000 | 1,933.44 | 96,671,891 | 1,941.86 | 97,093,193 | 2.910 | 2028/10/14 | 0.38 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 750,000 | 13,027.86 | 97,708,915 | 12,712.79 | 95,345,930 | 1.625 | 2023/10/31 | 0.37 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 770,000 | 12,663.51 | 97,509,010 | 12,345.21 | 95,058,137 | 0.250 | 2024/03/15 | 0.37 |
| アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B | 870,000 | 12,003.01 | 104,426,209 | 10,907.85 | 94,898,298 | 0.625 | 2030/05/15 | 0.37 |

□ 種類別投資比率

2022年5月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.15 |
| 合計 | 98.15 |

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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

該当事項はありません。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2022年5月31日現在

| 種類 | 国/地域 | 取引所等 | 名称 | 買建/売建 | 数量 | 通貨 | 簿価(円) | 時価(円) | 投資比率(%) |
|----------|------|-------|---------------------|-------|-----|------|---------------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 日本 | 大阪取引所 | TOPIX先物0406月2022年6月 | 買建 | 278 | 日本・円 | 5,339,685,800 | 5,307,020,000 | 2.56 |

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

2022年5月31日現在

| 種類 | 国/地域 | 取引所等 | 名称 | 買建/売建 | 数量 | 通貨 | 帳簿価額 | 簿価(円) | 評価額 | 時価(円) | 投資比率(%) |
|----|------|------|----|-------|----|----|------|-------|-----|-------|---------|
|----|------|------|----|-------|----|----|------|-------|-----|-------|---------|

| | | | | | | | | | | | |
|----------------------|-----------------|---------------------------|--|----|-----|------------------------|---------------|----------------|---------------|----------------|------|
| 株価 指数 先物 取引 | イギリス | ICE EU | FTSE 100 INDEX JUN22 2022年6 月 | 買建 | 58 | イギリス・ポ ンド | 4,319,791.00 | 698,769,392 | 4,403,070.00 | 712,240,603 | 0.19 |
| | ドイツ | EU REX | EURO STOX 50 JUN22 2022年6 月 | 買建 | 433 | ユーロ | 16,003,236.00 | 2,204,605,791 | 16,627,200.00 | 2,290,563,072 | 0.61 |
| | アメリカ | シカ ゴ商 品取 引所 | S&P 500 EMIN I FUT JUN22 2022年6 月 | 買建 | 437 | アメリカ・ド ル | 90,590,048.50 | 11,614,550,118 | 90,803,137.50 | 11,641,870,258 | 3.08 |
| | オース トラ リア | シド ニー 先物 取引 所 | SPI 200 FUTU RES JUN22 2022 年6月 | 買建 | 36 | オース トラリ ア・ド ル | 6,488,937.00 | 596,657,757 | 6,565,500.00 | 603,697,725 | 0.16 |

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2022年5月31日現在

| 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 | 23,070,000.00 | 2,931,783,284 | 2,957,607,100 | 0.78 |
| | ユーロ | 買建 | 2,920,000.00 | 398,967,269 | 402,264,690 | 0.11 |
| | カナダ・ドル | 買建 | 1,590,000.00 | 158,518,959 | 160,737,807 | 0.04 |
| | イギリス・ポンド | 買建 | 870,000.00 | 139,533,347 | 140,725,980 | 0.04 |
| | スイス・フラン | 買建 | 960,000.00 | 127,255,848 | 128,114,032 | 0.03 |
| | オーストラリア・ドル | 買建 | 1,300,000.00 | 118,165,900 | 119,531,010 | 0.03 |
| | スウェーデン・クローナ | 買建 | 2,890,000.00 | 37,354,350 | 37,915,313 | 0.01 |
| | デンマーク・クローネ | 買建 | 1,720,000.00 | 31,528,208 | 31,854,400 | 0.01 |
| | 香港・ドル | 買建 | 1,390,000.00 | 22,492,841 | 22,698,700 | 0.01 |
| | シンガポール・ドル | 買建 | 170,000.00 | 15,760,731 | 15,907,480 | 0.00 |
| | ノルウェー・クローネ | 買建 | 750,000.00 | 10,027,591 | 10,184,199 | 0.00 |
| | イスラエル・シケル | 買建 | 200,000.00 | 7,576,060 | 7,682,774 | 0.00 |
| | ニュージーランド・ドル | 買建 | 30,000.00 | 2,484,194 | 2,512,883 | 0.00 |
| | カナダ・ドル | 売建 | 460,000.00 | 46,000,492 | 46,500,020 | 0.01 |
| | スイス・フラン | 売建 | 270,000.00 | 36,030,366 | 36,032,580 | 0.01 |
| 香港・ドル | 売建 | 1,080,000.00 | 17,572,628 | 17,636,400 | 0.00 | |

| | | | | | |
|-------------|----|------------|------------|------------|------|
| スウェーデン・クローナ | 売建 | 970,000.00 | 12,721,356 | 12,725,430 | 0.00 |
| デンマーク・クローネ | 売建 | 480,000.00 | 8,887,680 | 8,889,600 | 0.00 |
| イギリス・ポンド | 売建 | 30,000.00 | 4,851,510 | 4,851,720 | 0.00 |
| シンガポール・ドル | 売建 | 50,000.00 | 4,678,280 | 4,678,400 | 0.00 |
| ノルウェー・クローネ | 売建 | 210,000.00 | 2,850,435 | 2,851,380 | 0.00 |
| イスラエル・シケル | 売建 | 50,000.00 | 1,919,960 | 1,920,675 | 0.00 |
| ニュージーランド・ドル | 売建 | 10,000.00 | 837,601 | 837,570 | 0.00 |

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2022年5月31日現在

| 種類 | 国/地域 | 取引所等 | 名称 | 買建/売建 | 数量 | 通貨 | 帳簿価額 | 簿価(円) | 評価額 | 時価(円) | 投資比率(%) |
|----------|------|---------|----------------------|-------|-----|---------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | ICE-USA | MSCI EMI GKN JUNE 22 | 買建 | 736 | アメリカ・ドル | 38,574,176.00 | 4,945,595,104 | 38,592,160.00 | 4,947,900,833 | 23.60 |

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2022年5月31日現在

| 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 | 25,809,321.78 | 3,054,900,000 | 3,307,112,238 | 15.77 |
| | アメリカ・ドル | 売建 | 23,293,461.15 | 2,955,000,000 | 2,984,707,640 | 14.23 |

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

Jリート・インデックス・マザーファンド

2022年5月31日現在

| 種類 | 国/地域 | 取引所等 | 名称 | 買建/売建 | 数量 | 通貨 | 簿価(円) | 時価(円) | 投資比率(%) |
|-----------|------|-------|-----------------------|-------|----|------|------------|------------|---------|
| リート指数先物取引 | 日本 | 大阪取引所 | TREIT先物 0406月 2022年6月 | 買建 | 20 | 日本・円 | 37,204,400 | 40,120,000 | 0.45 |

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

2022年5月31日現在

| 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 | 577,113.10 | 73,300,000 | 73,987,166 | 0.33 |
| | オーストラリア・ドル | 買建 | 68,427.26 | 6,200,000 | 6,291,711 | 0.03 |
| | イギリス・ポンド | 買建 | 25,565.38 | 4,100,000 | 4,135,302 | 0.02 |
| | シンガポール・ドル | 買建 | 35,611.75 | 3,300,000 | 3,332,331 | 0.01 |

| | | | | | |
|--------|----|-----------|-----------|-----------|------|
| カナダ・ドル | 買建 | 22,084.12 | 2,200,000 | 2,232,564 | 0.01 |
| ユーロ | 買建 | 14,672.70 | 2,000,000 | 2,021,340 | 0.01 |
| 香港・ドル | 買建 | 67,982.23 | 1,100,000 | 1,110,149 | 0.00 |

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2022年5月31日現在

| 種類 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------|-----------------|-----------|---------------|----------------|----------------|-----------------|
| 為替予約 取引 | アメリカ・ドル | 売建 | 96,630,000.00 | 12,572,162,106 | 12,384,583,950 | 48.59 |
| | ユーロ | 売建 | 67,090,000.00 | 9,198,810,535 | 9,242,922,210 | 36.26 |
| | イギリス・ポンド | 売建 | 8,390,000.00 | 1,370,351,789 | 1,356,713,340 | 5.32 |
| | カナダ・ドル | 売建 | 5,160,000.00 | 521,595,504 | 521,474,760 | 2.05 |
| | オフショア・人民元 | 売建 | 22,530,000.00 | 437,852,526 | 431,656,776 | 1.69 |
| | オーストラリア・ドル | 売建 | 4,280,000.00 | 392,467,098 | 393,481,800 | 1.54 |
| | シンガポール・ドル | 売建 | 2,550,000.00 | 239,161,185 | 238,537,200 | 0.94 |
| | メキシコ・ペソ | 売建 | 29,930,000.00 | 189,195,910 | 195,478,816 | 0.77 |
| | ポーランド・ズロチ | 売建 | 3,630,000.00 | 105,860,093 | 108,890,199 | 0.43 |
| | イスラエル・シケル | 売建 | 2,710,000.00 | 105,526,585 | 104,095,978 | 0.41 |
| | デンマーク・クローネ | 売建 | 5,510,000.00 | 101,505,771 | 102,045,200 | 0.40 |
| | スウェーデン・クロー ナ | 売建 | 5,320,000.00 | 70,352,744 | 69,782,440 | 0.27 |
| | ノルウェー・クローネ | 売建 | 4,780,000.00 | 66,176,805 | 64,883,720 | 0.25 |

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

参考情報

基準日:2022年5月31日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

基準価額・純資産の推移

■安定型



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

分配の推移

| 決算期 | 分配金 |
|---------|-----|
| 2022年4月 | 0円 |
| 2021年4月 | 0円 |
| 2020年4月 | 0円 |
| 2019年4月 | 0円 |
| 2018年4月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

■安定成長型



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

| 決算期 | 分配金 |
|---------|-----|
| 2022年4月 | 0円 |
| 2021年4月 | 0円 |
| 2020年4月 | 0円 |
| 2019年4月 | 0円 |
| 2018年4月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

■成長型



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

| 決算期 | 分配金 |
|---------|-----|
| 2022年4月 | 0円 |
| 2021年4月 | 0円 |
| 2020年4月 | 0円 |
| 2019年4月 | 0円 |
| 2018年4月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

主要な資産の状況

■安定型

資産別構成

| 資産の種類 | 国・地域 | 比率(%) |
|---------------------|------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 92.93 |
| 投資証券 | アメリカ | 5.66 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 1.41 |
| 合計(純資産総額) | | 100.00 |

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 比率(%) |
|------|-----------|---------------------------|-------|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 49.04 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 27.93 |
| 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 | 6.16 |
| 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(B号) | 5.19 |
| アメリカ | 投資証券 | SPDR ブルームバーグ・ハイ・イールド債券ETF | 3.56 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | リート・インデックス・マザーファンド | 2.22 |
| アメリカ | 投資証券 | バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF | 2.03 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 1.12 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 0.82 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 0.45 |

■安定成長型

資産別構成

| 資産の種類 | 国・地域 | 比率(%) |
|---------------------|------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 87.60 |
| 投資証券 | アメリカ | 11.03 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 1.37 |
| 合計(純資産総額) | | 100.00 |

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 比率(%) |
|------|-----------|---------------------------|-------|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 36.80 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 18.56 |
| 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(B号) | 10.30 |
| 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 | 8.40 |
| アメリカ | 投資証券 | バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF | 5.57 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 5.45 |
| アメリカ | 投資証券 | SPDR ブルームバーグ・ハイ・イールド債券ETF | 5.40 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | リート・インデックス・マザーファンド | 5.37 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 2.07 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 0.64 |

■成長型

資産別構成

| 資産の種類 | 国・地域 | 比率(%) |
|---------------------|------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 83.81 |
| 投資証券 | アメリカ | 14.88 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 1.31 |
| 合計(純資産総額) | | 100.00 |

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 比率(%) |
|------|-----------|---------------------------|-------|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 28.10 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 13.97 |
| 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(B号) | 12.88 |
| 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 | 10.52 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | リート・インデックス・マザーファンド | 7.94 |
| アメリカ | 投資証券 | バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF | 7.76 |
| アメリカ | 投資証券 | SPDR ブルームバーグ・ハイ・イールド債券ETF | 7.06 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 6.83 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 2.73 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 0.83 |

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

▶ 投資対象とする投資信託の現況

■ 国内債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 利率(%) | 償還期限 | 比率(%) |
|------|------|-----------|-------|------------|-------|
| 日本 | 国債証券 | 435 2年国債 | 0.005 | 2024/04/01 | 2.62 |
| 日本 | 国債証券 | 150 5年国債 | 0.005 | 2026/12/20 | 1.61 |
| 日本 | 国債証券 | 146 5年国債 | 0.100 | 2025/12/20 | 1.17 |
| 日本 | 国債証券 | 147 5年国債 | 0.005 | 2026/03/20 | 1.16 |
| 日本 | 国債証券 | 366 10年国債 | 0.200 | 2032/03/20 | 1.07 |

■ 外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 利率(%) | 償還期限 | 比率(%) |
|------|------|-----------------|-------|------------|-------|
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1.625 | 2026/05/15 | 1.18 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 2.250 | 2026/03/31 | 1.08 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 2.875 | 2028/05/15 | 0.75 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 2.500 | 2026/02/28 | 0.70 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 0.125 | 2023/08/15 | 0.65 |

■ ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 利率(%) | 償還期限 | 比率(%) |
|------|------|-----------------|-------|------------|-------|
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 0.125 | 2023/10/15 | 0.78 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1.625 | 2031/05/15 | 0.60 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 0.125 | 2023/07/15 | 0.58 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1.375 | 2031/11/15 | 0.53 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 0.625 | 2027/12/31 | 0.52 |

■ 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

主要投資銘柄(上位5銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 比率(%) |
|------|----|-------------------|--------|-------|
| 日本 | 株式 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 3.89 |
| 日本 | 株式 | ソニーグループ | 電気機器 | 2.94 |
| 日本 | 株式 | キーエンス | 電気機器 | 1.81 |
| 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 1.67 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 1.63 |

*比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■外国株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 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 | 4.63 |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 3.68 |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC | 小売 | 1.98 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A | メディア・娯楽 | 1.28 |
| アメリカ | 株式 | TESLA INC | 自動車・自動車部品 | 1.23 |

■エマージング株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 比率(%) |
|--------|----------|-------------------------------|--------------------|-------|
| 台湾 | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 半導体・半導体製造装置 | 5.22 |
| 香港 | 投資信託受益証券 | CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY | — | 3.76 |
| アメリカ | 投資証券 | ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF | — | 3.30 |
| 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 | 2.93 |
| ケイマン諸島 | 株式 | TENCENT HOLDINGS LTD | メディア・娯楽 | 2.88 |

■Jリート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 比率(%) |
|------|------|-------------------|-------|
| 日本 | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人 | 7.27 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 5.70 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人 | 5.00 |
| 日本 | 投資証券 | 日本都市ファンド投資法人 | 4.90 |
| 日本 | 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 4.84 |

■外国リート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 比率(%) |
|------|------|--------------------------|-------|
| アメリカ | 投資証券 | PROLOGIS INC | 6.32 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUINIX INC | 4.20 |
| アメリカ | 投資証券 | PUBLIC STORAGE | 3.43 |
| アメリカ | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 2.70 |
| アメリカ | 投資証券 | REALTY INCOME CORP | 2.64 |

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

■安定型



■安定成長型



■成長型



※収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

※ファンドが設定された年の収益率は、設定日から年末までの騰落率です。

※2022年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ファンドにはベンチマークはありません。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

イ 申込方法

(イ) ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。

販売会社によっては、「スイッチング」（ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること）による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(ロ) 原則として午後3時までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。

なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させ

ていただく場合があります。

- (八) 当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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かかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

- (二) 申込不可日

上記にかかわらず、取得申込日が以下のいずれかに当たる場合には、ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。

- ・ニューヨークの取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日

- (ホ) 定時定額で取得申込みをする「定時定額購入サービス」（販売会社によっては、名称が異なる場合があります。）を利用する場合は、販売会社との間で「定時定額購入サービス」に関する契約を締結します。詳細については、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

- ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

- ハ 申込手数料

原則として、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に、1.1%（税抜き1.0%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

- ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

- ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

| 照会先の名称 | コールセンター | ホームページ |
|----------------------|--------------|---|
| 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 | 0120-88-2976 | https://www.smd-am.co.jp |

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

- ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

- ト 払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に申込手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した額を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求（一部解約の実行請求）により換金することができます。

お買付けの販売会社にお申し出ください。

ただし、以下のいずれかに当たる場合には、解約請求の受付は行いません。

- ・ニューヨークの取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時までに解約請求のお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みに制限を設ける場合があります。解約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かかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかか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または記録が行われます。

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

解約単位の詳細および一部解約価額につきましては、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、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。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、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入れ有価証券を除きます。）を法令およ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信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。投資対象とする投資信託証券は、原則として、基準価額計算日に知りうる直近の純資産価格（基準価額）で評価します。また、上場されている場合は、その主たる取引所における最終相場で評価します。投資対象とする親投資信託受益証券は、当該親投資信託受益証券の基準価額で評価します。

なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本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するものとします。また、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

< マザーファンドの主要投資対象の評価方法 >

| 主要投資対象 | 有価証券等の評価方法 |
|-------------|--|
| 株式、投資証券、債券等 | (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の最終相場で評価します。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 原則として、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価します。 |
| 市場デリバティブ取引 | 原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の発表する清算値段または最終相場で評価します。 |

国内で取引される資産については原則として基準価額計算日の値、外国で取引される資産については原則として基準価額計算日に知りうる直近の日の値で評価します。

□ 基準価額の算出頻度・照会方法

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。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「安定型」は「アセット安定」、「安定成長型」は「アセット安成」、「成長型」は「アセット成長」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

| 照会先の名称 | コールセンター | ホームページ |
|-----------------------|--------------|---|
| 三井住友D Sアセットマネジメント株式会社 | 0120-88-2976 | https://www.smd-am.co.jp |

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

（２）【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

（３）【信託期間】

2015年4月17日から2028年4月26日まで、もしくは下記「（５）その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

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

（４）【計算期間】

毎年4月27日から翌年4月26日までとすることを原則としますが、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するものとします。なお、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】

イ 信託の終了

（イ）信託契約の解約

a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、各ファンドにつき残存口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約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、当ファンドの知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
 - d. 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。
 - e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面また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、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。
- (ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令
- 委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。
- (ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い
- 委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。
- (ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い
- a. 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。また、受託会社はその任務に違反して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、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
 - b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
 - c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ロ 収益分配金、償還金の支払い
- (イ) 収益分配金
- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
 - b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載また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)に支払われます。
- ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。
- (ロ) 償還金
- 償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載また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かか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い前のため販売会社の名義で記載また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)に支払われます。

八 信託約款の変更等

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の事項(変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その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。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。)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、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およ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、当ファンドの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。
- (ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)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、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (ニ) 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(書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。)
- (ホ) 上記(ロ)から(ニ)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面また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。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、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、相手方とな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、併合を行うことはできません。

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの)は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれからも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社の事業の全部または一部の譲渡、もしくは分割承継により、当ファンドに関する事業が譲渡・承継されることがあります。

ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.smd-am.co.jp>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

チ 運用にかかる報告書の開示方法

委託会社は毎決算後、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書(全体版)および運用報告書(全体版)の記載事項のうち重要なものを記載した交付運用報告書を作成します。

交付運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられま

す。なお、運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページで閲覧できます。

4【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ロ 償還金請求権

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、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載また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かか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または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に支払われます。

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ハ 一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金(解約)手続等」の記載をご参照ください。

ニ 書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約(監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。)または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、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。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧また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)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期(2021年4月27日から2022年4月26日まで)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【財務諸表】

【アセットアロケーション・ファンド（安定型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第6期 （2021年 4月26日現在） | 第7期 （2022年 4月26日現在） |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 5,447,013 | 6,519,262 |
| 金銭信託 | 85,182,095 | 5,267,383 |
| コール・ローン | 195,472,043 | 265,682,946 |
| 投資証券 | 1,641,605,935 | 548,941,349 |
| 親投資信託受益証券 | 9,175,043,571 | 8,542,893,732 |
| 派生商品評価勘定 | 17,974,382 | 5,895,945 |
| 未収入金 | 252,000,000 | - |
| 流動資産合計 | 11,372,725,039 | 9,375,200,617 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 1,246 | 23,270,080 |
| 未払金 | 217,000,000 | - |
| 未払解約金 | 10,479,125 | 7,753,468 |
| 未払受託者報酬 | 1,857,160 | 1,628,047 |
| 未払委託者報酬 | 55,714,730 | 48,842,701 |
| 未払利息 | 565 | - |
| その他未払費用 | 379,237 | 326,177 |
| 流動負債合計 | 285,432,063 | 81,820,473 |
| 負債合計 | 285,432,063 | 81,820,473 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 10,377,601,105 | 9,092,669,568 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 709,691,871 | 200,710,576 |
| （分配準備積立金） | 939,762,037 | 888,061,340 |
| 元本等合計 | 11,087,292,976 | 9,293,380,144 |
| 純資産合計 | 11,087,292,976 | 9,293,380,144 |
| 負債純資産合計 | 11,372,725,039 | 9,375,200,617 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 第6期 | | 第7期 | |
|---|--------|----------------------------------|--------|----------------------------------|
| | 自 至 | 2020年 4月28日 2021年 4月26日 | 自 至 | 2021年 4月27日 2022年 4月26日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取配当金 | | 47,150,361 | | 45,310,452 |
| 受取利息 | | - | | 1,580 |
| 有価証券売買等損益 | | 1,086,789,809 | | 381,745,141 |
| 為替差損益 | | 8,297,126 | | 29,951,096 |
| 営業収益合計 | | 1,125,643,044 | | 306,482,013 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払利息 | | 218,406 | | 151,614 |
| 受託者報酬 | | 3,963,119 | | 3,406,397 |
| 委託者報酬 | | 118,893,464 | | 102,193,664 |
| その他費用 | | 1,063,181 | | 892,699 |
| 営業費用合計 | | 124,138,170 | | 106,644,374 |
| 営業利益又は営業損失() | | 1,001,504,874 | | 413,126,387 |
| 経常利益又は経常損失() | | 1,001,504,874 | | 413,126,387 |
| 当期純利益又は当期純損失() | | 1,001,504,874 | | 413,126,387 |
| 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() | | 143,423,979 | | 8,544,368 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | | 213,887,459 | | 709,691,871 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 65,498,435 | | 11,494,615 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 57,572,481 | | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 7,925,954 | | 11,494,615 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | - | | 98,805,155 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | - | | 98,805,155 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | - | | - |
| 分配金 | | - | | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | | 709,691,871 | | 200,710,576 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 第7期 | |
|----------------------------|--|--|
| | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 | |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> | |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> | |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> | |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第6期 | 第7期 |
|-----------------------|---|---|
| | (2021年4月26日現在) | (2022年4月26日現在) |
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 10,377,601,105口 | 9,092,669,568口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.0684円 (1万口当たりの純資産額10,684円) | 1口当たり純資産額 1.0221円 (1万口当たりの純資産額10,221円) |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 項目 | 第6期 | 第7期 |
|----------|---|--|
| | 自 2020年4月28日 至 2021年4月26日 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
| 分配金の計算過程 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（193,123,580円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（100,008,997円）、収益調整金（146,397,297円）、および分配準備積立金（646,629,460円）より、分配対象収益は1,086,159,334円（1万口当たり1,046.62円）であります。分配を行っておりません。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（78,167,127円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（142,046,902円）、および分配準備積立金（809,894,213円）より、分配対象収益は1,030,108,242円（1万口当たり1,132.90円）であります。分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 第7期 |
|------------------------|--|
| | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |

| | |
|----------------------------|--|
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| 4. 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。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

・金融商品の時価等に関する事項

| 項 目 | 第7期 (2022年4月26日現在) |
|--------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | <p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自 2020年4月28日 至 2021年4月26日）

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 投資証券 | 14,418,270円 |
| 親投資信託受益証券 | 560,583,034円 |
| 合計 | 575,001,304円 |

第7期（自 2021年4月27日 至 2022年4月26日）

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 投資証券 | 67,878,628円 |
| 親投資信託受益証券 | 290,586,290円 |
| 合計 | 358,464,918円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

第6期（2021年4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

| 区 分 | 種 類 | 契 約 額 等 | | 時 価 | 評 価 損 益 |
|-------------------|--------------|---------------|-----------|---------------|------------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 以外の取 引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 29,880,128 | - | 29,878,882 | 1,246 |
| | 小計 | 29,880,128 | - | 29,878,882 | 1,246 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 1,433,284,168 | - | 1,415,309,786 | 17,974,382 |
| | 小計 | 1,433,284,168 | - | 1,415,309,786 | 17,974,382 |
| 合 計 | | 1,463,164,296 | - | 1,445,188,668 | 17,973,136 |

第7期（2022年4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

| 区 分 | 種 類 | 契 約 額 等 | | 時 価 | 評 価 損 益 |
|-------------------|--------------|-------------|-----------|-------------|------------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 以外の取 引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 383,424,516 | - | 389,063,520 | 5,639,004 |
| | 小計 | 383,424,516 | - | 389,063,520 | 5,639,004 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 760,852,301 | - | 783,865,440 | 23,013,139 |
| | 小計 | 760,852,301 | - | 783,865,440 | 23,013,139 |

| | | | | |
|----|---------------|---|---------------|------------|
| 合計 | 1,144,276,817 | - | 1,172,928,960 | 17,374,135 |
|----|---------------|---|---------------|------------|

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| |
|---|
| <p>第7期 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日</p> |
| <p>市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。</p> |

(その他の注記)

| 項目 | 第6期 (2021年4月26日現在) | 第7期 (2022年4月26日現在) |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| 期首元本額 | 13,933,783,423円 | 10,377,601,105円 |
| 期中追加設定元本額 | 246,744,303円 | 158,442,458円 |
| 期中一部解約元本額 | 3,802,926,621円 | 1,443,373,995円 |

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 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 | iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF | 552.00 | 51,429.84 | |

| | | | | | |
|---------------|------|---------------------------------|---------------|--------------------------------|--|
| | | S P D R ブルームバーク・ハイ・イールド債券 E T F | 27,130.00 | 2,697,807.20 | |
| | | バンガード・米ドル建て新興国政府債券 E T F | 23,333.00 | 1,552,811.15 | |
| | | アメリカ・ドル小計 | 51,015.00 | 4,302,048.19 (548,941,349) | |
| 投資証券合計 | | | | 548,941,349 (548,941,349) | |
| 親投資信託 受益証券 | 日本・円 | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) | 146,334,176 | 465,269,512 | |
| | | 外国株式インデックス・マザーファンド | 96,142,646 | 580,047,811 | |
| | | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 3,296,843,012 | 4,530,191,982 | |
| | | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 53,018,449 | 105,464,298 | |
| | | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 2,027,250,671 | 2,543,996,867 | |
| | | Jリート・インデックス・マザーファンド | 74,332,453 | 197,902,722 | |
| | | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 14,691,068 | 47,321,399 | |
| | | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 44,385,580 | 72,699,141 | |
| | | 日本・円小計 | 5,752,998,055 | 8,542,893,732 | |
| 親投資信託受益証券合計 | | | | 8,542,893,732 (-) | |
| 合 計 | | | | 9,091,835,081 (548,941,349) | |

(注) 金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 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 3銘柄 | 5.9% | 100.0% |

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)」に記載しております。

【アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

| | 第6期 (2021年 4月26日現在) | 第7期 (2022年 4月26日現在) |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 6,526,646 | 7,264,186 |
| 金銭信託 | 64,878,915 | 4,590,506 |
| コール・ローン | 148,881,218 | 231,541,783 |
| 投資証券 | 1,853,956,374 | 847,995,902 |
| 親投資信託受益証券 | 6,355,229,990 | 6,369,966,615 |
| 派生商品評価勘定 | 20,250,051 | 5,379,306 |
| 未収入金 | 218,000,000 | - |
| 流動資産合計 | 8,667,723,194 | 7,466,738,298 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 1,507 | 30,235,672 |
| 未払金 | 183,000,000 | - |
| 未払解約金 | 26,624,924 | 12,921,447 |
| 未払受託者報酬 | 1,377,585 | 1,282,383 |
| 未払委託者報酬 | 41,327,467 | 38,472,889 |
| 未払利息 | 430 | - |
| その他未払費用 | 281,493 | 256,959 |
| 流動負債合計 | 252,613,406 | 83,169,350 |
| 負債合計 | | |
| | 252,613,406 | 83,169,350 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 7,473,130,169 | 6,754,042,056 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 941,979,619 | 629,526,892 |
| (分配準備積立金) | 1,091,458,270 | 1,016,786,295 |
| 元本等合計 | 8,415,109,788 | 7,383,568,948 |
| 純資産合計 | | |
| | 8,415,109,788 | 7,383,568,948 |
| 負債純資産合計 | | |
| | 8,667,723,194 | 7,466,738,298 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 第6期 | | 第7期 | |
|---|--|--|--|--|
| | 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 | | 自 2021年 4月27日 至 2022年 4月26日 | |
| 営業収益 | | | | |
| 受取配当金 | 56,990,267 | | 57,434,434 | |
| 受取利息 | - | | 1,308 | |
| 有価証券売買等損益 | 1,398,939,615 | | 227,907,788 | |
| 為替差損益 | 8,135,920 | | 38,708,008 | |
| 営業収益合計 | 1,447,793,962 | | 131,764,038 | |
| 営業費用 | | | | |
| 支払利息 | 165,025 | | 118,276 | |
| 受託者報酬 | 2,905,989 | | 2,653,024 | |
| 委託者報酬 | 87,179,688 | | 79,592,645 | |
| その他費用 | 876,752 | | 783,261 | |
| 営業費用合計 | 91,127,454 | | 83,147,206 | |
| 営業利益又は営業損失() | 1,356,666,508 | | 214,911,244 | |
| 経常利益又は経常損失() | 1,356,666,508 | | 214,911,244 | |
| 当期純利益又は当期純損失() | 1,356,666,508 | | 214,911,244 | |
| 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() | 214,465,398 | | 12,791,637 | |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 328,493,306 | | 941,979,619 | |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 128,271,815 | | 60,778,948 | |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 91,209,787 | | - | |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 37,062,028 | | 60,778,948 | |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | | 145,528,794 | |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | | 145,528,794 | |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | | - | |
| 分配金 | - | | - | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 941,979,619 | | 629,526,892 | |

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 第7期 | |
|----------------------------|--|--|
| | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 | |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> | |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> | |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> | |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第6期 | 第7期 |
|-----------------------|---|---|
| | (2021年4月26日現在) | (2022年4月26日現在) |
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 7,473,130,169口 | 6,754,042,056口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.1260円 (1万口当たりの純資産額11,260円) | 1口当たり純資産額 1.0932円 (1万口当たりの純資産額10,932円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項 目 | 第6期 | 第7期 |
|----------|---|--|
| | 自 2020年4月28日 至 2021年4月26日 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
| 分配金の計算過程 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（170,801,351円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（340,858,056円）、収益調整金（190,066,868円）、および分配準備積立金（579,798,863円）より、分配対象収益は1,281,525,138円（1万口当たり1,714.83円）であります。分配を行っておりません。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（88,539,085円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（230,995,369円）、および分配準備積立金（928,247,210円）より、分配対象収益は1,247,781,664円（1万口当たり1,847.46円）であります。分配を行っておりません。 |

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

| 項 目 | 第7期 自 2021年4月27日 至 2022年4月26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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |

| | |
|----------------------------|--|
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| 4. 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。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

・金融商品の時価等に関する事項

| 項 目 | 第7期 (2022年4月26日現在) |
|--------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | <p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自 2020年4月28日 至 2021年4月26日）

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 投資証券 | 42,203,053円 |
| 親投資信託受益証券 | 821,418,669円 |
| 合計 | 863,621,722円 |

第7期（自 2021年4月27日 至 2022年4月26日）

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 投資証券 | 116,327,820円 |
| 親投資信託受益証券 | 111,086,860円 |
| 合計 | 227,414,680円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

第6期（2021年4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

| 区 分 | 種 類 | 契 約 額 等 | | 時 価 | 評 価 損 益 |
|-------------------|--------------|---------------|-----------|---------------|------------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 以外の取 引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 36,136,617 | - | 36,135,110 | 1,507 |
| | 小計 | 36,136,617 | - | 36,135,110 | 1,507 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 1,616,990,449 | - | 1,596,740,398 | 20,250,051 |
| | 小計 | 1,616,990,449 | - | 1,596,740,398 | 20,250,051 |
| | 合 計 | 1,653,127,066 | - | 1,632,875,508 | 20,248,544 |

第7期（2022年4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

| 区 分 | 種 類 | 契 約 額 等 | | 時 価 | 評 価 損 益 |
|-------------------|--------------|-------------|-----------|---------------|------------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 以外の取 引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 359,140,754 | - | 364,324,640 | 5,183,886 |
| | 小計 | 359,140,754 | - | 364,324,640 | 5,183,886 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 993,180,228 | - | 1,023,220,480 | 30,040,252 |
| | 小計 | 993,180,228 | - | 1,023,220,480 | 30,040,252 |

| | | | | |
|----|---------------|---|---------------|------------|
| 合計 | 1,352,320,982 | - | 1,387,545,120 | 24,856,366 |
|----|---------------|---|---------------|------------|

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| |
|--|
| 第7期 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| 項目 | 第6期 (2021年4月26日現在) | 第7期 (2022年4月26日現在) |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| 期首元本額 | 9,718,712,784円 | 7,473,130,169円 |
| 期中追加設定元本額 | 582,836,155円 | 430,295,633円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,828,418,770円 | 1,149,383,746円 |

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 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 | iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF | 397.00 | 36,988.49 | |

| | | | | | |
|---------------|------|---------------------------------|---------------|--------------------------------|--|
| | | S P D R ブルームバーグ・ハイ・イールド債券 E T F | 32,498.00 | 3,231,601.12 | |
| | | バンガード・米ドル建て新興国政府債券 E T F | 50,746.00 | 3,377,146.30 | |
| | | アメリカ・ドル小計 | 83,641.00 | 6,645,735.91 (847,995,902) | |
| 投資証券合計 | | | | 847,995,902 (847,995,902) | |
| 親投資信託 受益証券 | 日本・円 | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) | 231,330,362 | 735,514,885 | |
| | | 外国株式インデックス・マザーファンド | 103,195,277 | 622,597,745 | |
| | | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 1,961,569,030 | 2,695,392,004 | |
| | | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 75,940,895 | 151,061,628 | |
| | | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 1,067,412,920 | 1,339,496,473 | |
| | | Jリート・インデックス・マザーファンド | 144,802,192 | 385,521,355 | |
| | | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 15,848,872 | 51,050,801 | |
| | | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 237,701,767 | 389,331,724 | |
| 日本・円小計 | | | 3,837,801,315 | 6,369,966,615 | |
| 親投資信託受益証券合計 | | | | 6,369,966,615 (-) | |
| 合 計 | | | | 7,217,962,517 (847,995,902) | |

(注) 金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 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 3銘柄 | 11.5% | 100.0% |

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)」に記載しております。

【アセットアロケーション・ファンド（成長型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第6期 （2021年 4月26日現在） | 第7期 （2022年 4月26日現在） |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 4,349,004 | 4,860,644 |
| 金銭信託 | 32,679,457 | 2,166,589 |
| コール・ローン | 74,991,350 | 109,281,183 |
| 投資証券 | 1,098,520,919 | 573,295,985 |
| 親投資信託受益証券 | 3,217,727,090 | 3,227,244,365 |
| 派生商品評価勘定 | 11,170,836 | 3,427,731 |
| 未収入金 | 115,000,000 | 13,877,636 |
| 流動資産合計 | 4,554,438,656 | 3,934,154,133 |
| 資産合計 | | |
| 4,554,438,656 | | |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 927 | 20,302,332 |
| 未払金 | 93,000,000 | - |
| 未払解約金 | 18,555,950 | 16,630,402 |
| 未払受託者報酬 | 731,097 | 674,070 |
| 未払委託者報酬 | 21,932,874 | 20,223,281 |
| 未払利息 | 217 | - |
| その他未払費用 | 149,436 | 135,057 |
| 流動負債合計 | 134,370,501 | 57,965,142 |
| 負債合計 | | |
| 134,370,501 | | |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 3,829,011,023 | 3,430,668,866 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 591,057,132 | 445,520,125 |
| （分配準備積立金） | 694,057,397 | 646,745,627 |
| 元本等合計 | 4,420,068,155 | 3,876,188,991 |
| 純資産合計 | | |
| 4,420,068,155 | | |
| 負債純資産合計 | | |
| 4,554,438,656 | | |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第6期 | | 第7期 | |
|--|--------|----------------------------|--------|----------------------------|
| | 自 至 | 2020年 4月28日 2021年 4月26日 | 自 至 | 2021年 4月27日 2022年 4月26日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取配当金 | | 37,795,984 | | 37,046,473 |
| 受取利息 | | - | | 692 |
| 有価証券売買等損益 | | 994,656,750 | | 98,097,219 |
| 為替差損益 | | 4,248,046 | | 26,757,148 |
| 営業収益合計 | | 1,028,204,688 | | 34,292,906 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払利息 | | 89,996 | | 63,013 |
| 受託者報酬 | | 1,615,399 | | 1,404,907 |
| 委託者報酬 | | 48,461,953 | | 42,148,686 |
| その他費用 | | 556,172 | | 447,800 |
| 営業費用合計 | | 50,723,520 | | 44,064,406 |
| 営業利益又は営業損失 () | | 977,481,168 | | 78,357,312 |
| 経常利益又は経常損失 () | | 977,481,168 | | 78,357,312 |
| 当期純利益又は当期純損失 () | | 977,481,168 | | 78,357,312 |
| 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 () | | 206,066,625 | | 8,809,801 |
| 期首剰余金又は期首欠損金 () | | 306,503,321 | | 591,057,132 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 126,145,910 | | 30,153,861 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 115,843,460 | | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 10,302,450 | | 30,153,861 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | - | | 88,523,755 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | - | | 88,523,755 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | - | | - |
| 分配金 | | - | | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金 () | | 591,057,132 | | 445,520,125 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 第7期 | |
|----------------------------|--|--|
| | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 | |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> | |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> | |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> | |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第6期 | 第7期 |
|-----------------------|---|---|
| | (2021年4月26日現在) | (2022年4月26日現在) |
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 3,829,011,023口 | 3,430,668,866口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.1544円 (1万口当たりの純資産額11,544円) | 1口当たり純資産額 1.1299円 (1万口当たりの純資産額11,299円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項 目 | 第6期 | 第7期 |
|----------|--|--|
| | 自 2020年4月28日 至 2021年4月26日 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
| 分配金の計算過程 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益(96,013,619円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(250,271,896円)、収益調整金(107,986,469円)、および分配準備積立金(347,771,882円)より、分配対象収益は802,043,866円(1万口当たり2,094.63円)ですが、分配を行っておりません。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益(53,742,686円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(126,127,297円)、および分配準備積立金(593,002,941円)より、分配対象収益は772,872,924円(1万口当たり2,252.83円)ですが、分配を行っておりません。 |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項 目 | 第7期 |
|------------------------|--|
| | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |

| | |
|----------------------------|--|
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| 4. 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。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

・金融商品の時価等に関する事項

| 項 目 | 第7期 (2022年4月26日現在) |
|--------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | <p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自 2020年4月28日 至 2021年4月26日）

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 投資証券 | 37,458,619円 |
| 親投資信託受益証券 | 559,237,924円 |
| 合計 | 596,696,543円 |

第7期（自 2021年4月27日 至 2022年4月26日）

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 投資証券 | 79,398,393円 |
| 親投資信託受益証券 | 11,794,368円 |
| 合計 | 91,192,761円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

第6期（2021年4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

| 区 分 | 種 類 | 契 約 額 等 | | 時 価 | 評 価 損 益 |
|-------------------|--------------|-------------|-----------|-------------|------------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 以外の取 引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 22,221,323 | - | 22,220,396 | 927 |
| | 小計 | 22,221,323 | - | 22,220,396 | 927 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 891,033,798 | - | 879,862,962 | 11,170,836 |
| | 小計 | 891,033,798 | - | 879,862,962 | 11,170,836 |
| 合 計 | | 913,255,121 | - | 902,083,358 | 11,169,909 |

第7期（2022年4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

| 区 分 | 種 類 | 契 約 額 等 | | 時 価 | 評 価 損 益 |
|-------------------|--------------|-------------|-----------|-------------|------------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 以外の取 引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 227,552,385 | - | 230,811,200 | 3,258,815 |
| | 小計 | 227,552,385 | - | 230,811,200 | 3,258,815 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 680,056,500 | - | 700,189,916 | 20,133,416 |
| | 小計 | 680,056,500 | - | 700,189,916 | 20,133,416 |

| | | | | |
|----|-------------|---|-------------|------------|
| 合計 | 907,608,885 | - | 931,001,116 | 16,874,601 |
|----|-------------|---|-------------|------------|

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| |
|--|
| 第7期 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| 項目 | 第6期 (2021年4月26日現在) | 第7期 (2022年4月26日現在) |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| 期首元本額 | 5,918,683,057円 | 3,829,011,023円 |
| 期中追加設定元本額 | 188,201,809円 | 172,858,285円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,277,873,843円 | 571,200,442円 |

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 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 | iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF | 207.00 | 19,286.19 | |

| | | | | | |
|---------------|------|---------------------------|---------------|--------------------------------|--|
| | | SPDR ブルームバーグ・ハイ・イールド債券ETF | 21,335.00 | 2,121,552.40 | |
| | | バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF | 35,343.00 | 2,352,076.65 | |
| | | アメリカ・ドル小計 | 56,885.00 | 4,492,915.24 (573,295,985) | |
| 投資証券合計 | | | | 573,295,985 (573,295,985) | |
| 親投資信託 受益証券 | 日本・円 | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) | 152,943,467 | 486,283,753 | |
| | | 外国株式インデックス・マザーファンド | 68,329,125 | 412,243,276 | |
| | | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 794,172,937 | 1,091,273,032 | |
| | | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 53,017,014 | 105,461,444 | |
| | | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 428,125,024 | 537,254,092 | |
| | | Jリート・インデックス・マザーファンド | 113,294,756 | 301,635,958 | |
| | | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 10,883,264 | 35,056,081 | |
| | | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 157,541,199 | 258,036,729 | |
| 日本・円小計 | | | 1,778,306,786 | 3,227,244,365 | |
| 親投資信託受益証券合計 | | | | 3,227,244,365 (-) | |
| 合計 | | | | 3,800,540,350 (573,295,985) | |

(注) 金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 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 3銘柄 | 14.8% | 100.0% |

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)」に記載しております。

(参考)

「アセットアロケーション・ファンド(安定型)」、「アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)」および「アセットアロケーション・ファンド(成長型)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リー

ト・インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」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た「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

(1) 貸借対照表

(単位 : 円)

| | (2021年4月26日現在) | (2022年4月26日現在) |
|--------------|------------------|------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | 727,633,001 | 38,460,616 |
| コール・ローン | 1,668,590,743 | 1,939,925,432 |
| 株式 | 187,837,731,440 | 196,699,150,170 |
| 派生商品評価勘定 | 1,611,200 | 10,660,800 |
| 未収配当金 | 1,741,114,046 | 2,368,445,415 |
| 前払金 | 83,065,000 | 120,890,000 |
| 差入委託証拠金 | 13,270,000 | 183,300,000 |
| 流動資産合計 | 192,073,015,430 | 201,360,832,433 |
| 資産合計 | 192,073,015,430 | 201,360,832,433 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 84,886,300 | 123,711,500 |
| 未払解約金 | 497,729,231 | 95,194,113 |
| 未払利息 | 4,829 | - |
| その他未払費用 | 57,245 | 4,482 |
| 流動負債合計 | 582,677,605 | 218,910,095 |
| 負債合計 | 582,677,605 | 218,910,095 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 60,391,040,010 | 63,261,805,196 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金 () | 131,099,297,815 | 137,880,117,142 |
| 元本等合計 | 191,490,337,825 | 201,141,922,338 |
| 純資産合計 | 191,490,337,825 | 201,141,922,338 |
| 負債純資産合計 | 192,073,015,430 | 201,360,832,433 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項 目 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
|--------------------|--------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 |

| | |
|----------------------|--|
| | <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に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によっております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2021年4月26日現在) | (2022年4月26日現在) |
|-----------------------|--|---|
| 1. 担保資産 | <p>デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券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>株式 3,306,000,000円</p> | |
| 2. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 60,391,040,010口 | 63,261,805,196口 |
| 3. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 3.1708円 (1万口当たりの純資産額31,708円) | 1口当たり純資産額 3.1795円 (1万口当たりの純資産額31,795円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
|-----------------|--|
| 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、当ファンドの信託約款に従い、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> |

| | |
|-------------------------------|--|
| <p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク</p> | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |
| <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |

| | |
|----------------------------|--|
| 4. 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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |
|----------------------------|--|

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2022年4月26日現在) |
|--------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(株式) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|----------------|---------------|-----------|---------------|------------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | TOPIX先物 | 3,747,610,100 | - | 3,664,335,000 | 83,275,100 |
| | 小計 | 3,747,610,100 | - | 3,664,335,000 | 83,275,100 |
| 合計 | | 3,747,610,100 | - | 3,664,335,000 | 83,275,100 |

(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|-------------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | TOPIX先物 0406 月 | 4,559,170,700 | - | 4,446,120,000 | 113,050,700 |
| | 小計 | 4,559,170,700 | - | 4,446,120,000 | 113,050,700 |

| | | | | |
|-----|---------------|---|---------------|-------------|
| 合 計 | 4,559,170,700 | - | 4,446,120,000 | 113,050,700 |
|-----|---------------|---|---------------|-------------|

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に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。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| |
|--|
| 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| (2021年4月26日現在) | |
|----------------------------------|-----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 66,420,614,464円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 10,321,155,755円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 16,350,730,209円 |
| 2021年4月26日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・日本株式インデックス年金ファンド | 9,377,992,498円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 882,687,081円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 4,279,019,277円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 3,170,940,243円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 121,064,129円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 4,744,492円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 20,265,196円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ) | 59,910,031円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 126,034,866円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 99,406,160円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 198,180,525円 |
| 国内株式指数ファンド(T O P I X) | 1,201,230,099円 |
| 三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド | 16,039,342,551円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 423,754,988円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 464,864,383円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 302,064,707円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 48,431,067円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050 | 23,321,027円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 134,683,136円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 112,157,344円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 371,384,457円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 185,233,234円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 216,782,444円 |

| | |
|--|-----------------|
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 24,448,491円 |
| 三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド | 223,855,528円 |
| 三井住友DS・年金バランス30(債券重点型) | 11,130,956円 |
| 三井住友DS・年金バランス50(標準型) | 50,852,277円 |
| 三井住友DS・年金バランス70(株式重点型) | 47,513,827円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 3,257,418円 |
| SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) | 3,065,048,127円 |
| バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 > | 18,087,538円 |
| SMAM・バランスファンドVA安定成長型 < 適格機関投資家限定 > | 129,489,749円 |
| SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 > | 2,117,958,002円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 > | 1,802,540,670円 |
| SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 > | 6,769,935,339円 |
| SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 > | 42,846,949円 |
| SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 > | 175,681,640円 |
| SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 > | 800,989,888円 |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型 < 適格機関投資家限定 > | 49,447,751円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 > | 279,517,682円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 > | 888,393,536円 |
| SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 > | 684,285,651円 |
| SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 > | 2,094,565,514円 |
| SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 > | 373,938円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 > | 45,653,025円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 > | 54,101,733円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 > | 35,991,493円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 > | 17,007,263円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 > | 132,156,315円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 > | 271,614,480円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 > | 72,269,436円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 < 適格機関投資家専用 > | 43,489,672円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 < 適格機関投資家専用 > | 7,479,610円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 < 適格機関投資家専用 > | 50,100,640円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 > | 670,876,217円 |
| SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用) | 175,567,216円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA < 適格機関投資家限定 > | 280,176,797円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA < 適格機関投資家限定 > | 127,955,140円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 > | 692,837,428円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 > | 74,013,645円 |
| SMAM・年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 > | 20,287,354円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04 < 適格機関投資家限定 > | 50,751,185円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 > | 42,473,420円 |
| SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 > | 382,523,535円 |
| 合計 | 60,391,040,010円 |

(2022年4月26日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額

60,391,040,010円

同期中における追加設定元本額

11,694,994,809円

同期中における一部解約元本額

8,824,229,623円

2022年4月26日現在の元本の内訳

| | |
|---|-----------------|
| 三井住友・日本株式インデックス年金ファンド | 9,498,830,729円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 981,562,776円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 4,546,847,970円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 3,448,440,778円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 129,139,788円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 4,784,541円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 20,168,646円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ) | 63,518,648円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 153,838,056円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 133,882,770円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 245,294,698円 |
| 国内株式指数ファンド(T O P I X) | 1,502,049,659円 |
| 三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド | 19,696,465,018円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 146,334,176円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 231,330,362円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 152,943,467円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050 | 32,080,235円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 182,885,633円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 166,474,648円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 591,913,486円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 322,705,825円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 368,867,306円 |
| 三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド | 41,699,673円 |
| 三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド | 551,666,449円 |
| 三井住友D S・年金バランス30(債券重点型) | 17,990,681円 |
| 三井住友D S・年金バランス50(標準型) | 90,470,993円 |
| 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型) | 95,218,221円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060 | 4,109,911円 |
| 日興F W S・日本株インデックス | 592,212,994円 |
| 三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド | 5,338,179円 |
| S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) | 2,749,396,476円 |
| バランスファンドV A(安定運用型) < 適格機関投資家限定 > | 18,579,823円 |
| S M A M・バランスファンドV A 安定成長型 < 適格機関投資家限定 > | 97,797,524円 |
| S M A M・バランスファンドV A 25 < 適格機関投資家専用 > | 1,766,376,348円 |
| S M A M・バランスファンドV A 37.5 < 適格機関投資家専用 > | 1,639,438,827円 |
| S M A M・バランスファンドV A 50 < 適格機関投資家専用 > | 6,218,766,294円 |
| S M A M・バランスファンドV L 30 < 適格機関投資家限定 > | 40,740,210円 |
| S M A M・バランスファンドV L 50 < 適格機関投資家限定 > | 159,471,500円 |
| S M A M・バランスファンドV A 75 < 適格機関投資家専用 > | 740,333,728円 |
| S M A M・バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 > | 46,826,720円 |
| S M A M・インデックス・バランスV A 25 < 適格機関投資家専用 > | 257,810,451円 |
| S M A M・インデックス・バランスV A 50 < 適格機関投資家専用 > | 839,187,037円 |
| S M A M・バランスファンドV A 40 < 適格機関投資家専用 > | 607,019,790円 |
| S M A M・バランスファンドV A 35 < 適格機関投資家専用 > | 1,875,496,934円 |
| S M A M・バランスV A 株40 T < 適格機関投資家限定 > | 374,931円 |

| | |
|---|-----------------|
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 42,725,221円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 47,564,568円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 34,436,924円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 16,874,370円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 113,224,715円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 245,176,007円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 60,459,399円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 41,090,482円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 7,630,596円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用> | 44,249,093円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 601,112,754円 |
| SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用) | 181,398,201円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定> | 222,266,350円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定> | 101,339,489円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 181,801,332円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定> | 55,617,287円 |
| SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 43,072,081円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 28,371,625円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 36,568,156円 |
| SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定> | 67,859,289円 |
| SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定> | 12,284,348円 |
| 合計 | 63,261,805,196円 |

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位:円)

| 銘柄 | 株数 | 評価額 | | 備考 |
|----------------|---------|-----------|-------------|----|
| | | 単価 | 金額 | |
| 極洋 | 3,700 | 3,265.000 | 12,080,500 | |
| 日本水産 | 102,500 | 567.000 | 58,117,500 | |
| マル八二チロ | 15,800 | 2,382.000 | 37,635,600 | |
| 雪国まいたけ | 8,300 | 1,070.000 | 8,881,000 | |
| カネコ種苗 | 5,000 | 1,684.000 | 8,420,000 | |
| サカタのタネ | 12,100 | 4,290.000 | 51,909,000 | |
| ホクト | 8,700 | 2,010.000 | 17,487,000 | |
| 日鉄鉱業 | 2,400 | 6,270.000 | 15,048,000 | |
| 三井松島ホールディングス | 4,800 | 2,016.000 | 9,676,800 | |
| INPEX | 396,200 | 1,465.000 | 580,433,000 | |
| 石油資源開発 | 12,300 | 2,467.000 | 30,344,100 | |
| K&Oエナジーグループ | 5,600 | 1,631.000 | 9,133,600 | |
| ヒノキヤグループ | 2,900 | 2,337.000 | 6,777,300 | |
| ショーボンドホールディングス | 14,700 | 5,380.000 | 79,086,000 | |
| ミライト・ホールディングス | 33,100 | 1,783.000 | 59,017,300 | |
| タマホーム | 6,300 | 2,541.000 | 16,008,300 | |
| ベステラ | 4,200 | 1,169.000 | 4,909,800 | |

| | | | |
|-----------------|---------|------------|-------------|
| Robot Home | 22,100 | 201.000 | 4,442,100 |
| 安藤・間 | 51,300 | 880.000 | 45,144,000 |
| 東急建設 | 32,200 | 594.000 | 19,126,800 |
| コムシスホールディングス | 33,100 | 2,658.000 | 87,979,800 |
| ビーアールホールディングス | 19,200 | 287.000 | 5,510,400 |
| 高松コンストラクショングループ | 6,900 | 2,154.000 | 14,862,600 |
| 東建コーポレーション | 2,900 | 8,500.000 | 24,650,000 |
| ヤマウラ | 4,000 | 918.000 | 3,672,000 |
| オリエンタル白石 | 38,500 | 227.000 | 8,739,500 |
| 大成建設 | 69,200 | 3,420.000 | 236,664,000 |
| 大林組 | 239,100 | 881.000 | 210,647,100 |
| 清水建設 | 224,100 | 686.000 | 153,732,600 |
| 飛島建設 | 9,200 | 1,006.000 | 9,255,200 |
| 長谷工コーポレーション | 70,500 | 1,394.000 | 98,277,000 |
| 松井建設 | 11,900 | 655.000 | 7,794,500 |
| 銭高組 | 1,800 | 3,885.000 | 6,993,000 |
| 鹿島建設 | 175,300 | 1,430.000 | 250,679,000 |
| 不動テトラ | 6,200 | 1,512.000 | 9,374,400 |
| 大末建設 | 4,100 | 1,282.000 | 5,256,200 |
| 鉄建建設 | 7,100 | 1,816.000 | 12,893,600 |
| 西松建設 | 14,700 | 3,750.000 | 55,125,000 |
| 三井住友建設 | 56,900 | 414.000 | 23,556,600 |
| 大豊建設 | 3,800 | 4,480.000 | 17,024,000 |
| 奥村組 | 14,000 | 3,005.000 | 42,070,000 |
| 東鉄工業 | 10,800 | 2,113.000 | 22,820,400 |
| 浅沼組 | 2,900 | 5,090.000 | 14,761,000 |
| 戸田建設 | 99,700 | 731.000 | 72,880,700 |
| 熊谷組 | 11,900 | 2,675.000 | 31,832,500 |
| 北野建設 | 3,000 | 2,088.000 | 6,264,000 |
| 矢作建設工業 | 12,900 | 795.000 | 10,255,500 |
| ピーエス三菱 | 9,900 | 557.000 | 5,514,300 |
| 日本ハウスホールディングス | 20,200 | 435.000 | 8,787,000 |
| 大東建託 | 24,500 | 12,270.000 | 300,615,000 |
| 新日本建設 | 10,900 | 689.000 | 7,510,100 |
| 東亜道路工業 | 1,600 | 4,860.000 | 7,776,000 |
| 日本道路 | 2,400 | 7,320.000 | 17,568,000 |
| 東亜建設工業 | 6,400 | 2,791.000 | 17,862,400 |
| 日本国土開発 | 24,000 | 537.000 | 12,888,000 |
| 若築建設 | 5,200 | 1,872.000 | 9,734,400 |
| 五洋建設 | 95,400 | 618.000 | 58,957,200 |
| 世紀東急工業 | 13,000 | 717.000 | 9,321,000 |
| 福田組 | 2,800 | 4,500.000 | 12,600,000 |
| 住友林業 | 61,100 | 2,031.000 | 124,094,100 |
| 日本基礎技術 | 8,100 | 761.000 | 6,164,100 |
| 巴コーポレーション | 14,600 | 459.000 | 6,701,400 |
| 大和ハウス工業 | 221,600 | 3,075.000 | 681,420,000 |
| ライト工業 | 14,700 | 1,896.000 | 27,871,200 |
| 積水ハウス | 260,300 | 2,233.500 | 581,380,050 |

| | | | |
|-----------------|---------|-----------|-------------|
| 北陸電気工事 | 6,600 | 763.000 | 5,035,800 |
| ユアテック | 14,900 | 663.000 | 9,878,700 |
| 日本リーテック | 6,100 | 1,181.000 | 7,204,100 |
| 四電工 | 3,000 | 1,710.000 | 5,130,000 |
| 中電工 | 10,900 | 2,041.000 | 22,246,900 |
| 関電工 | 37,500 | 808.000 | 30,300,000 |
| きんでん | 52,900 | 1,520.000 | 80,408,000 |
| 東京エネシス | 9,700 | 954.000 | 9,253,800 |
| トーエネック | 2,900 | 3,215.000 | 9,323,500 |
| 住友電設 | 6,300 | 2,137.000 | 13,463,100 |
| 日本電設工業 | 12,700 | 1,581.000 | 20,078,700 |
| エクシオグループ | 35,500 | 2,109.000 | 74,869,500 |
| 新日本空調 | 6,800 | 1,817.000 | 12,355,600 |
| 九電工 | 18,500 | 2,887.000 | 53,409,500 |
| 三機工業 | 15,000 | 1,430.000 | 21,450,000 |
| 日揮ホールディングス | 73,900 | 1,419.000 | 104,864,100 |
| 中外炉工業 | 3,900 | 1,445.000 | 5,635,500 |
| ヤマト | 9,800 | 805.000 | 7,889,000 |
| 太平電業 | 5,700 | 2,665.000 | 15,190,500 |
| 高砂熱学工業 | 21,100 | 1,656.000 | 34,941,600 |
| 朝日工業社 | 4,600 | 1,541.000 | 7,088,600 |
| 明星工業 | 17,400 | 676.000 | 11,762,400 |
| 大気社 | 11,700 | 3,105.000 | 36,328,500 |
| ダイダン | 5,700 | 2,058.000 | 11,730,600 |
| 日比谷総合設備 | 8,100 | 1,888.000 | 15,292,800 |
| テスホールディングス | 5,900 | 1,342.000 | 7,917,800 |
| インフロニア・ホールディングス | 102,000 | 945.000 | 96,390,000 |
| 東洋エンジニアリング | 12,400 | 601.000 | 7,452,400 |
| レイズネクスト | 11,800 | 1,053.000 | 12,425,400 |
| ニッポン | 20,900 | 1,682.000 | 35,153,800 |
| 日清製粉グループ本社 | 86,300 | 1,735.000 | 149,730,500 |
| 昭和産業 | 7,100 | 2,621.000 | 18,609,100 |
| 鳥越製粉 | 4,900 | 653.000 | 3,199,700 |
| 中部飼料 | 9,400 | 1,020.000 | 9,588,000 |
| フィード・ワン | 11,400 | 669.000 | 7,626,600 |
| 日本甜菜製糖 | 5,300 | 1,621.000 | 8,591,300 |
| D M三井製糖ホールディングス | 6,400 | 1,945.000 | 12,448,000 |
| 日新製糖 | 4,400 | 1,677.000 | 7,378,800 |
| 森永製菓 | 18,100 | 4,010.000 | 72,581,000 |
| 中村屋 | 3,200 | 3,185.000 | 10,192,000 |
| 江崎グリコ | 21,100 | 3,760.000 | 79,336,000 |
| 名糖産業 | 5,100 | 1,634.000 | 8,333,400 |
| 井村屋グループ | 4,900 | 2,264.000 | 11,093,600 |
| 不二家 | 4,400 | 2,393.000 | 10,529,200 |
| 山崎製パン | 58,000 | 1,604.000 | 93,032,000 |
| モロゾフ | 3,000 | 2,986.000 | 8,958,000 |
| 亀田製菓 | 4,400 | 4,095.000 | 18,018,000 |
| 寿スピリッツ | 7,400 | 6,780.000 | 50,172,000 |

| | | | |
|--------------------------|---------|-----------|-------------|
| カルビー | 35,100 | 2,308.000 | 81,010,800 |
| 森永乳業 | 14,300 | 5,180.000 | 74,074,000 |
| 六甲バター | 6,600 | 1,512.000 | 9,979,200 |
| ヤクルト本社 | 57,000 | 6,640.000 | 378,480,000 |
| 明治ホールディングス | 50,600 | 6,440.000 | 325,864,000 |
| 雪印メグミルク | 18,700 | 1,937.000 | 36,221,900 |
| プリマハム | 9,100 | 2,145.000 | 19,519,500 |
| 日本ハム | 29,300 | 4,125.000 | 120,862,500 |
| 丸大食品 | 8,400 | 1,490.000 | 12,516,000 |
| S Foods | 6,800 | 2,986.000 | 20,304,800 |
| 柿安本店 | 3,000 | 2,328.000 | 6,984,000 |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 45,600 | 652.000 | 29,731,200 |
| サッポロホールディングス | 26,100 | 2,485.000 | 64,858,500 |
| アサヒグループホールディングス | 180,900 | 4,616.000 | 835,034,400 |
| キリンホールディングス | 282,700 | 1,832.000 | 517,906,400 |
| 宝ホールディングス | 52,100 | 1,076.000 | 56,059,600 |
| オエノンホールディングス | 25,700 | 307.000 | 7,889,900 |
| 養命酒製造 | 3,800 | 1,745.000 | 6,631,000 |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス | 54,100 | 1,466.000 | 79,310,600 |
| サントリー食品インターナショナル | 51,300 | 5,070.000 | 260,091,000 |
| ダイドーグループホールディングス | 3,900 | 4,950.000 | 19,305,000 |
| 伊藤園 | 23,300 | 5,270.000 | 122,791,000 |
| キーコーヒー | 7,700 | 2,004.000 | 15,430,800 |
| 日清オイリオグループ | 9,000 | 2,923.000 | 26,307,000 |
| 不二製油グループ本社 | 16,900 | 1,790.000 | 30,251,000 |
| かどや製油 | 1,400 | 3,540.000 | 4,956,000 |
| J - オイルミルズ | 7,700 | 1,570.000 | 12,089,000 |
| キッコーマン | 55,300 | 8,470.000 | 468,391,000 |
| 味の素 | 169,700 | 3,376.000 | 572,907,200 |
| ブルドックソース | 4,200 | 1,974.000 | 8,290,800 |
| キューピー | 40,400 | 2,177.000 | 87,950,800 |
| ハウス食品グループ本社 | 28,600 | 2,974.000 | 85,056,400 |
| カゴメ | 29,300 | 3,235.000 | 94,785,500 |
| 焼津水産化学工業 | 6,500 | 895.000 | 5,817,500 |
| アリアケジャパン | 7,100 | 5,060.000 | 35,926,000 |
| ニチレイ | 35,100 | 2,322.000 | 81,502,200 |
| 東洋水産 | 36,900 | 3,975.000 | 146,677,500 |
| イト Андホールディングス | 3,900 | 2,154.000 | 8,400,600 |
| 日清食品ホールディングス | 30,100 | 9,020.000 | 271,502,000 |
| 永谷園ホールディングス | 4,200 | 1,948.000 | 8,181,600 |
| 一正蒲鉾 | 3,100 | 817.000 | 2,532,700 |
| フジッコ | 7,700 | 2,006.000 | 15,446,200 |
| ロック・フィールド | 8,200 | 1,485.000 | 12,177,000 |
| 日本たばこ産業 | 412,300 | 2,191.500 | 903,555,450 |
| ケンコーマヨネーズ | 5,500 | 1,406.000 | 7,733,000 |
| わらべや日洋ホールディングス | 5,400 | 1,639.000 | 8,850,600 |
| なとり | 5,200 | 1,981.000 | 10,301,200 |

| | | | |
|---------------|---------|-----------|-------------|
| ピクルスコーポレーション | 4,200 | 1,280.000 | 5,376,000 |
| ファーマフーズ | 7,400 | 1,868.000 | 13,823,200 |
| ユーグレナ | 39,700 | 871.000 | 34,578,700 |
| 紀文食品 | 5,400 | 1,020.000 | 5,508,000 |
| ミヨシ油脂 | 5,300 | 1,116.000 | 5,914,800 |
| 理研ビタミン | 8,100 | 1,710.000 | 13,851,000 |
| 片倉工業 | 8,700 | 2,368.000 | 20,601,600 |
| グンゼ | 5,100 | 3,715.000 | 18,946,500 |
| 東洋紡 | 30,400 | 1,045.000 | 31,768,000 |
| ユニチカ | 24,300 | 274.000 | 6,658,200 |
| 富士紡ホールディングス | 3,600 | 3,075.000 | 11,070,000 |
| 倉敷紡績 | 7,100 | 1,734.000 | 12,311,400 |
| シキボウ | 8,500 | 873.000 | 7,420,500 |
| 日本毛織 | 22,700 | 957.000 | 21,723,900 |
| 帝国繊維 | 8,900 | 1,595.000 | 14,195,500 |
| 帝人 | 70,000 | 1,368.000 | 95,760,000 |
| 東レ | 541,100 | 613.900 | 332,181,290 |
| 住江織物 | 2,600 | 1,876.000 | 4,877,600 |
| アツギ | 10,200 | 521.000 | 5,314,200 |
| ダイニック | 7,400 | 729.000 | 5,394,600 |
| セーレン | 15,500 | 2,032.000 | 31,496,000 |
| 小松マテーレ | 13,000 | 1,445.000 | 18,785,000 |
| ワコールホールディングス | 19,500 | 1,841.000 | 35,899,500 |
| ホギメディカル | 10,200 | 3,200.000 | 32,640,000 |
| T S Iホールディングス | 29,400 | 295.000 | 8,673,000 |
| マツオカコーポレーション | 3,500 | 1,086.000 | 3,801,000 |
| ワールド | 11,000 | 1,241.000 | 13,651,000 |
| オンワードホールディングス | 47,400 | 245.000 | 11,613,000 |
| ゴールドウイン | 13,500 | 6,210.000 | 83,835,000 |
| デサント | 14,500 | 2,573.000 | 37,308,500 |
| 特種東海製紙 | 4,800 | 3,435.000 | 16,488,000 |
| 王子ホールディングス | 313,700 | 615.000 | 192,925,500 |
| 日本製紙 | 36,700 | 1,028.000 | 37,727,600 |
| 北越コーポレーション | 49,800 | 660.000 | 32,868,000 |
| 大王製紙 | 37,000 | 1,505.000 | 55,685,000 |
| レンゴー | 72,300 | 775.000 | 56,032,500 |
| トーモク | 5,800 | 1,496.000 | 8,676,800 |
| ザ・パックス | 6,200 | 2,444.000 | 15,152,800 |
| 北の達人コーポレーション | 28,600 | 173.000 | 4,947,800 |
| クラレ | 109,000 | 1,020.000 | 111,180,000 |
| 旭化成 | 497,600 | 1,043.500 | 519,245,600 |
| 昭和電工 | 65,000 | 2,414.000 | 156,910,000 |
| 住友化学 | 548,700 | 539.000 | 295,749,300 |
| 住友精化 | 3,700 | 3,015.000 | 11,155,500 |
| 日産化学 | 40,800 | 6,840.000 | 279,072,000 |
| クレハ | 5,800 | 9,590.000 | 55,622,000 |
| 多木化学 | 3,100 | 5,080.000 | 15,748,000 |
| テイカ | 6,300 | 1,181.000 | 7,440,300 |

| | | | |
|----------------|---------|------------|---------------|
| 石原産業 | 12,800 | 984.000 | 12,595,200 |
| 日本曹達 | 9,500 | 3,335.000 | 31,682,500 |
| 東ソー | 107,700 | 1,737.000 | 187,074,900 |
| トクヤマ | 24,100 | 1,653.000 | 39,837,300 |
| セントラル硝子 | 12,000 | 2,359.000 | 28,308,000 |
| 東亜合成 | 42,100 | 1,066.000 | 44,878,600 |
| 大阪ソーダ | 6,900 | 3,150.000 | 21,735,000 |
| 関東電化工業 | 16,700 | 974.000 | 16,265,800 |
| デンカ | 27,400 | 3,355.000 | 91,927,000 |
| 信越化学工業 | 128,900 | 17,725.000 | 2,284,752,500 |
| 堺化学工業 | 5,600 | 1,812.000 | 10,147,200 |
| 第一稀元素化学工業 | 8,400 | 963.000 | 8,089,200 |
| エア・ウォーター | 71,200 | 1,650.000 | 117,480,000 |
| 日本酸素ホールディングス | 72,100 | 2,206.000 | 159,052,600 |
| 日本化学工業 | 2,800 | 2,202.000 | 6,165,600 |
| 日本パーカライジング | 37,400 | 892.000 | 33,360,800 |
| 高压ガス工業 | 13,900 | 630.000 | 8,757,000 |
| 四国化成工業 | 10,000 | 1,303.000 | 13,030,000 |
| ステラ ケミファ | 4,100 | 2,389.000 | 9,794,900 |
| 保土谷化学工業 | 2,600 | 3,595.000 | 9,347,000 |
| 日本触媒 | 12,700 | 5,170.000 | 65,659,000 |
| 大日精化工業 | 6,400 | 1,947.000 | 12,460,800 |
| カネカ | 19,300 | 3,415.000 | 65,909,500 |
| 三菱瓦斯化学 | 69,500 | 1,837.000 | 127,671,500 |
| 三井化学 | 67,700 | 2,899.000 | 196,262,300 |
| J S R | 69,900 | 3,370.000 | 235,563,000 |
| 東京応化工業 | 12,200 | 6,840.000 | 83,448,000 |
| 大阪有機化学工業 | 6,400 | 2,750.000 | 17,600,000 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 502,400 | 773.000 | 388,355,200 |
| K Hネオケム | 12,300 | 2,387.000 | 29,360,100 |
| ダイセル | 108,600 | 772.000 | 83,839,200 |
| 住友ベークライト | 11,800 | 4,280.000 | 50,504,000 |
| 積水化学工業 | 156,500 | 1,668.000 | 261,042,000 |
| 日本ゼオン | 67,800 | 1,287.000 | 87,258,600 |
| アイカ工業 | 21,100 | 2,942.000 | 62,076,200 |
| U B E | 35,100 | 1,954.000 | 68,585,400 |
| 積水樹脂 | 11,300 | 1,759.000 | 19,876,700 |
| タキロンシーアイ | 17,600 | 543.000 | 9,556,800 |
| 旭有機材 | 4,900 | 1,853.000 | 9,079,700 |
| ニチバン | 5,600 | 1,710.000 | 9,576,000 |
| リケンテクノス | 20,300 | 446.000 | 9,053,800 |
| 大倉工業 | 4,500 | 1,835.000 | 8,257,500 |
| 群栄化学工業 | 2,300 | 2,782.000 | 6,398,600 |
| ミライアル | 3,100 | 1,635.000 | 5,068,500 |
| ダイキョーニシカワ | 17,700 | 502.000 | 8,885,400 |
| 森六ホールディングス | 5,000 | 1,754.000 | 8,770,000 |
| 恵和 | 2,100 | 4,800.000 | 10,080,000 |
| 日本化薬 | 59,800 | 1,109.000 | 66,318,200 |

| | | | |
|------------------|---------|------------|-------------|
| カーリットホールディングス | 9,600 | 631.000 | 6,057,600 |
| 日本精化 | 6,300 | 2,036.000 | 12,826,800 |
| 扶桑化学工業 | 6,700 | 3,720.000 | 24,924,000 |
| トリケミカル研究所 | 7,700 | 2,473.000 | 19,042,100 |
| A D E K A | 34,400 | 2,496.000 | 85,862,400 |
| 日油 | 25,600 | 4,775.000 | 122,240,000 |
| 新日本理化 | 20,100 | 261.000 | 5,246,100 |
| ハリマ化成グループ | 8,000 | 784.000 | 6,272,000 |
| 花王 | 169,800 | 5,201.000 | 883,129,800 |
| 第一工業製薬 | 3,100 | 2,560.000 | 7,936,000 |
| 石原ケミカル | 5,000 | 1,268.000 | 6,340,000 |
| ニイタカ | 2,400 | 2,389.000 | 5,733,600 |
| 三洋化成工業 | 4,300 | 4,825.000 | 20,747,500 |
| 大日本塗料 | 12,000 | 770.000 | 9,240,000 |
| 日本ペイントホールディングス | 282,400 | 1,022.000 | 288,612,800 |
| 関西ペイント | 78,000 | 1,727.000 | 134,706,000 |
| 中国塗料 | 18,800 | 930.000 | 17,484,000 |
| 日本特殊塗料 | 7,600 | 805.000 | 6,118,000 |
| 藤倉化成 | 12,900 | 435.000 | 5,611,500 |
| 太陽ホールディングス | 11,000 | 3,070.000 | 33,770,000 |
| D I C | 31,700 | 2,412.000 | 76,460,400 |
| サカタインクス | 15,100 | 942.000 | 14,224,200 |
| 東洋インキS Cホールディングス | 14,800 | 1,915.000 | 28,342,000 |
| T & K T O K A | 8,700 | 783.000 | 6,812,100 |
| 富士フイルムホールディングス | 134,900 | 7,175.000 | 967,907,500 |
| 資生堂 | 142,900 | 5,988.000 | 855,685,200 |
| ライオン | 93,200 | 1,329.000 | 123,862,800 |
| 高砂香料工業 | 5,400 | 2,587.000 | 13,969,800 |
| マンダム | 16,600 | 1,290.000 | 21,414,000 |
| ミルボン | 9,600 | 5,370.000 | 51,552,000 |
| ファンケル | 31,100 | 2,503.000 | 77,843,300 |
| コーセー | 14,500 | 12,720.000 | 184,440,000 |
| コタ | 6,400 | 1,398.000 | 8,947,200 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 33,000 | 1,512.000 | 49,896,000 |
| ノエビアホールディングス | 6,600 | 5,000.000 | 33,000,000 |
| エステー | 6,100 | 1,454.000 | 8,869,400 |
| コニシ | 12,900 | 1,522.000 | 19,633,800 |
| 長谷川香料 | 13,300 | 2,506.000 | 33,329,800 |
| 小林製薬 | 21,500 | 9,360.000 | 201,240,000 |
| 荒川化学工業 | 7,900 | 1,040.000 | 8,216,000 |
| メック | 5,800 | 2,547.000 | 14,772,600 |
| タカラバイオ | 20,100 | 2,125.000 | 42,712,500 |
| J C U | 8,500 | 3,220.000 | 27,370,000 |
| O A Tアグリオ | 4,200 | 1,122.000 | 4,712,400 |
| デクセリアルズ | 20,000 | 2,845.000 | 56,900,000 |
| アース製薬 | 6,300 | 5,380.000 | 33,894,000 |
| 北興化学工業 | 8,100 | 978.000 | 7,921,800 |
| 大成ラミック | 3,500 | 2,591.000 | 9,068,500 |

| | | | |
|-----------------|---------|-----------|---------------|
| クミアイ化学工業 | 29,000 | 877.000 | 25,433,000 |
| 日本農薬 | 16,600 | 593.000 | 9,843,800 |
| アキレス | 6,800 | 1,288.000 | 8,758,400 |
| 有沢製作所 | 12,300 | 898.000 | 11,045,400 |
| 日東電工 | 46,200 | 8,740.000 | 403,788,000 |
| レック | 11,600 | 861.000 | 9,987,600 |
| 藤森工業 | 6,700 | 3,510.000 | 23,517,000 |
| 前澤化成工業 | 6,900 | 1,275.000 | 8,797,500 |
| 未来工業 | 4,000 | 1,467.000 | 5,868,000 |
| J S P | 5,400 | 1,494.000 | 8,067,600 |
| エフピコ | 14,600 | 2,880.000 | 42,048,000 |
| 天馬 | 6,100 | 2,156.000 | 13,151,600 |
| 信越ポリマー | 13,700 | 1,092.000 | 14,960,400 |
| 東リ | 29,700 | 217.000 | 6,444,900 |
| ニフコ | 25,700 | 2,611.000 | 67,102,700 |
| バルカー | 6,200 | 2,520.000 | 15,624,000 |
| ユニ・チャーム | 147,700 | 4,453.000 | 657,708,100 |
| 協和キリン | 89,600 | 2,692.000 | 241,203,200 |
| 武田薬品工業 | 602,300 | 3,692.000 | 2,223,691,600 |
| アステラス製薬 | 664,300 | 2,042.000 | 1,356,500,600 |
| 住友ファーマ | 47,500 | 1,115.000 | 52,962,500 |
| 塩野義製薬 | 96,300 | 7,086.000 | 682,381,800 |
| 日本新薬 | 20,100 | 8,730.000 | 175,473,000 |
| 中外製薬 | 239,600 | 3,860.000 | 924,856,000 |
| 科研製薬 | 12,300 | 3,850.000 | 47,355,000 |
| エーザイ | 91,600 | 5,604.000 | 513,326,400 |
| ロート製薬 | 39,300 | 3,395.000 | 133,423,500 |
| 小野薬品工業 | 175,800 | 3,230.000 | 567,834,000 |
| 久光製薬 | 20,300 | 3,435.000 | 69,730,500 |
| 持田製薬 | 9,900 | 3,580.000 | 35,442,000 |
| 参天製薬 | 142,700 | 1,039.000 | 148,265,300 |
| 扶桑薬品工業 | 3,600 | 2,074.000 | 7,466,400 |
| 日本ケミファ | 2,500 | 1,963.000 | 4,907,500 |
| ツムラ | 23,900 | 3,125.000 | 74,687,500 |
| 日医工 | 25,100 | 765.000 | 19,201,500 |
| キッセイ薬品工業 | 13,300 | 2,530.000 | 33,649,000 |
| 生化学工業 | 13,400 | 824.000 | 11,041,600 |
| 栄研化学 | 13,300 | 1,710.000 | 22,743,000 |
| 鳥居薬品 | 4,300 | 3,165.000 | 13,609,500 |
| J C Rファーマ | 22,000 | 2,374.000 | 52,228,000 |
| 東和薬品 | 10,900 | 2,615.000 | 28,503,500 |
| 富士製薬工業 | 6,800 | 936.000 | 6,364,800 |
| ゼリア新薬工業 | 13,900 | 1,933.000 | 26,868,700 |
| 第一三共 | 602,300 | 2,952.500 | 1,778,290,750 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 15,000 | 1,835.000 | 27,525,000 |
| 大幸薬品 | 13,400 | 617.000 | 8,267,800 |
| ダイト | 5,100 | 2,568.000 | 13,096,800 |
| 大塚ホールディングス | 159,200 | 4,280.000 | 681,376,000 |

| | | | |
|------------------|-----------|------------|---------------|
| 大正製薬ホールディングス | 18,100 | 4,895.000 | 88,599,500 |
| ペプチドリーム | 40,600 | 2,107.000 | 85,544,200 |
| あすか製薬ホールディングス | 9,500 | 1,178.000 | 11,191,000 |
| サワイグループホールディングス | 16,800 | 4,290.000 | 72,072,000 |
| 日本コークス工業 | 75,000 | 135.000 | 10,125,000 |
| ニチレキ | 10,500 | 1,162.000 | 12,201,000 |
| ユシロ化学工業 | 7,200 | 1,010.000 | 7,272,000 |
| 富士石油 | 18,000 | 279.000 | 5,022,000 |
| MORESCO | 5,800 | 1,164.000 | 6,751,200 |
| 出光興産 | 84,500 | 3,335.000 | 281,807,500 |
| ENEOSホールディングス | 1,148,900 | 445.500 | 511,834,950 |
| コスモエネルギーホールディングス | 22,100 | 3,075.000 | 67,957,500 |
| 横浜ゴム | 43,500 | 1,728.000 | 75,168,000 |
| TOYO TIRE | 40,200 | 1,475.000 | 59,295,000 |
| ブリヂストン | 220,700 | 4,767.000 | 1,052,076,900 |
| 住友ゴム工業 | 68,800 | 1,142.000 | 78,569,600 |
| 藤倉コンポジット | 7,400 | 679.000 | 5,024,600 |
| オカモト | 4,700 | 3,950.000 | 18,565,000 |
| ニッタ | 7,700 | 2,697.000 | 20,766,900 |
| 住友理工 | 16,600 | 547.000 | 9,080,200 |
| 三ツ星ベルト | 9,400 | 1,932.000 | 18,160,800 |
| バンドー化学 | 13,500 | 816.000 | 11,016,000 |
| 日東紡績 | 11,700 | 2,433.000 | 28,466,100 |
| AGC | 70,200 | 4,860.000 | 341,172,000 |
| 日本電気硝子 | 31,000 | 2,603.000 | 80,693,000 |
| オハラ | 4,300 | 1,083.000 | 4,656,900 |
| 住友大阪セメント | 14,600 | 3,800.000 | 55,480,000 |
| 太平洋セメント | 43,600 | 2,043.000 | 89,074,800 |
| 日本ヒューム | 12,500 | 682.000 | 8,525,000 |
| 日本コンクリート工業 | 22,900 | 301.000 | 6,892,900 |
| 三谷セキサン | 3,700 | 5,300.000 | 19,610,000 |
| アジアパイルホールディングス | 17,100 | 421.000 | 7,199,100 |
| 東海カーボン | 64,500 | 1,063.000 | 68,563,500 |
| 日本カーボン | 4,000 | 4,115.000 | 16,460,000 |
| 東洋炭素 | 5,100 | 2,838.000 | 14,473,800 |
| ノリタケカンパニーリミテド | 4,400 | 4,005.000 | 17,622,000 |
| TOTO | 54,700 | 4,335.000 | 237,124,500 |
| 日本碍子 | 82,500 | 1,682.000 | 138,765,000 |
| 日本特殊陶業 | 58,300 | 1,940.000 | 113,102,000 |
| MARUWA | 2,600 | 14,380.000 | 37,388,000 |
| 品川リフラクトリーズ | 2,000 | 3,560.000 | 7,120,000 |
| 黒崎播磨 | 1,600 | 4,000.000 | 6,400,000 |
| ヨータイ | 5,800 | 1,321.000 | 7,661,800 |
| 東京窯業 | 16,100 | 289.000 | 4,652,900 |
| フジインコーポレーテッド | 6,100 | 5,580.000 | 34,038,000 |
| ニチアス | 17,500 | 2,305.000 | 40,337,500 |
| ニチハ | 10,700 | 2,292.000 | 24,524,400 |
| 日本製鉄 | 339,000 | 2,012.500 | 682,237,500 |

| | | | |
|--------------------|---------|-----------|-------------|
| 神戸製鋼所 | 139,700 | 551.000 | 76,974,700 |
| 中山製鋼所 | 14,900 | 420.000 | 6,258,000 |
| 合同製鐵 | 5,500 | 1,284.000 | 7,062,000 |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 204,000 | 1,560.000 | 318,240,000 |
| 東京製鐵 | 25,700 | 1,283.000 | 32,973,100 |
| 共英製鋼 | 9,100 | 1,306.000 | 11,884,600 |
| 大和工業 | 14,500 | 3,775.000 | 54,737,500 |
| 東京鐵鋼 | 4,900 | 1,263.000 | 6,188,700 |
| 大阪製鐵 | 4,800 | 1,431.000 | 6,868,800 |
| 淀川製鋼所 | 9,700 | 2,545.000 | 24,686,500 |
| 丸一鋼管 | 24,000 | 2,754.000 | 66,096,000 |
| モリ工業 | 2,800 | 2,518.000 | 7,050,400 |
| 大同特殊鋼 | 12,500 | 3,435.000 | 42,937,500 |
| 日本冶金工業 | 5,700 | 2,482.000 | 14,147,400 |
| 山陽特殊製鋼 | 7,900 | 1,932.000 | 15,262,800 |
| 愛知製鋼 | 4,800 | 2,258.000 | 10,838,400 |
| 日立金属 | 81,600 | 1,965.000 | 160,344,000 |
| 大平洋金属 | 4,900 | 3,495.000 | 17,125,500 |
| 新日本電工 | 49,600 | 304.000 | 15,078,400 |
| 栗本鐵工所 | 5,000 | 1,588.000 | 7,940,000 |
| 三菱製鋼 | 6,300 | 1,029.000 | 6,482,700 |
| 日本精線 | 1,500 | 4,220.000 | 6,330,000 |
| エンビプロ・ホールディングス | 5,800 | 1,007.000 | 5,840,600 |
| 大紀アルミニウム工業所 | 11,300 | 1,429.000 | 16,147,700 |
| 日本輕金属ホールディングス | 19,300 | 1,615.000 | 31,169,500 |
| 三井金属鋳業 | 20,200 | 3,190.000 | 64,438,000 |
| 東邦垂鉛 | 4,600 | 2,723.000 | 12,525,800 |
| 三菱マテリアル | 50,000 | 1,999.000 | 99,950,000 |
| 住友金属鋳山 | 96,900 | 5,468.000 | 529,849,200 |
| DOWAホールディングス | 20,500 | 5,450.000 | 111,725,000 |
| 古河機械金属 | 12,500 | 1,250.000 | 15,625,000 |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 11,000 | 1,332.000 | 14,652,000 |
| 東邦チタニウム | 14,400 | 1,432.000 | 20,620,800 |
| UACJ | 11,300 | 2,106.000 | 23,797,800 |
| CKサンエツ | 1,900 | 4,100.000 | 7,790,000 |
| 古河電気工業 | 23,700 | 2,086.000 | 49,438,200 |
| 住友電気工業 | 283,500 | 1,366.500 | 387,402,750 |
| フジクラ | 84,100 | 561.000 | 47,180,100 |
| 昭和電線ホールディングス | 6,900 | 1,673.000 | 11,543,700 |
| タツタ電線 | 15,600 | 457.000 | 7,129,200 |
| 平河ヒューテック | 5,400 | 1,074.000 | 5,799,600 |
| リョービ | 10,200 | 1,029.000 | 10,495,800 |
| アサヒホールディングス | 30,200 | 2,119.000 | 63,993,800 |
| 宮地エンジニアリンググループ | 2,700 | 3,460.000 | 9,342,000 |
| トーカロ | 19,400 | 1,250.000 | 24,250,000 |
| アルファ | 5,600 | 947.000 | 5,303,200 |
| SUMCO | 116,600 | 1,913.000 | 223,055,800 |
| 川田テクノロジーズ | 2,100 | 3,520.000 | 7,392,000 |

| | | | |
|------------------|---------|------------|-------------|
| RS TECHNOLOGIES | 2,500 | 5,770.000 | 14,425,000 |
| 東洋製罐グループホールディングス | 48,600 | 1,400.000 | 68,040,000 |
| ホッカンホールディングス | 6,300 | 1,264.000 | 7,963,200 |
| 横河ブリッジホールディングス | 12,900 | 1,852.000 | 23,890,800 |
| 駒井ハルテック | 2,100 | 1,951.000 | 4,097,100 |
| 三和ホールディングス | 71,500 | 1,142.000 | 81,653,000 |
| 文化シャッター | 24,200 | 947.000 | 22,917,400 |
| 三協立山 | 12,000 | 586.000 | 7,032,000 |
| アルインコ | 8,600 | 846.000 | 7,275,600 |
| LIXIL | 119,200 | 2,241.000 | 267,127,200 |
| ノーリツ | 14,600 | 1,481.000 | 21,622,600 |
| 長府製作所 | 8,400 | 1,847.000 | 15,514,800 |
| リンナイ | 14,300 | 8,180.000 | 116,974,000 |
| 日東精工 | 13,000 | 497.000 | 6,461,000 |
| 岡部 | 17,100 | 665.000 | 11,371,500 |
| ジーテクト | 9,300 | 1,259.000 | 11,708,700 |
| 東プレ | 14,200 | 1,085.000 | 15,407,000 |
| 高周波熱錬 | 15,700 | 574.000 | 9,011,800 |
| 東京製綱 | 6,500 | 835.000 | 5,427,500 |
| サンコール | 9,900 | 489.000 | 4,841,100 |
| パイオラックス | 11,000 | 1,499.000 | 16,489,000 |
| エイチワン | 10,100 | 583.000 | 5,888,300 |
| 日本発条 | 70,200 | 827.000 | 58,055,400 |
| 立川ブラインド工業 | 5,000 | 1,058.000 | 5,290,000 |
| 三益半導体工業 | 5,800 | 2,294.000 | 13,305,200 |
| 日本製鋼所 | 23,100 | 3,505.000 | 80,965,500 |
| 三浦工業 | 32,900 | 2,677.000 | 88,073,300 |
| タクマ | 25,700 | 1,400.000 | 35,980,000 |
| ツガミ | 17,400 | 1,185.000 | 20,619,000 |
| オークマ | 8,700 | 4,570.000 | 39,759,000 |
| 芝浦機械 | 8,600 | 3,075.000 | 26,445,000 |
| アマダ | 118,500 | 995.000 | 117,907,500 |
| アイダエンジニアリング | 19,700 | 949.000 | 18,695,300 |
| FUJII | 34,700 | 2,135.000 | 74,084,500 |
| 牧野フライス製作所 | 8,100 | 3,875.000 | 31,387,500 |
| オーエスジー | 35,400 | 1,585.000 | 56,109,000 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 21,700 | 558.000 | 12,108,600 |
| D M G 森精機 | 44,700 | 1,603.000 | 71,654,100 |
| ソディック | 17,300 | 702.000 | 12,144,600 |
| ディスコ | 11,200 | 32,100.000 | 359,520,000 |
| 日東工器 | 5,300 | 1,451.000 | 7,690,300 |
| 日進工具 | 6,500 | 1,388.000 | 9,022,000 |
| 石川製作所 | 2,500 | 1,331.000 | 3,327,500 |
| 島精機製作所 | 11,400 | 1,773.000 | 20,212,200 |
| オプトラン | 9,700 | 1,900.000 | 18,430,000 |
| N C ホールディングス | 3,000 | 1,675.000 | 5,025,000 |
| フリュー | 7,400 | 1,027.000 | 7,599,800 |
| ヤマシンフィルタ | 18,900 | 351.000 | 6,633,900 |

| | | | |
|----------------|---------|------------|---------------|
| 日阪製作所 | 11,600 | 766.000 | 8,885,600 |
| やまびこ | 14,700 | 1,375.000 | 20,212,500 |
| 野村マイクロ・サイエンス | 2,200 | 3,545.000 | 7,799,000 |
| 平田機工 | 3,600 | 4,715.000 | 16,974,000 |
| マルマエ | 3,500 | 2,167.000 | 7,584,500 |
| タツモ | 4,500 | 1,470.000 | 6,615,000 |
| ナブテスコ | 43,200 | 3,040.000 | 131,328,000 |
| 三井海洋開発 | 8,800 | 1,174.000 | 10,331,200 |
| レオン自動機 | 9,400 | 1,041.000 | 9,785,400 |
| S M C | 22,500 | 63,580.000 | 1,430,550,000 |
| ホソカワミクロン | 5,400 | 2,404.000 | 12,981,600 |
| ユニオンツール | 3,000 | 3,625.000 | 10,875,000 |
| オイレス工業 | 10,500 | 1,466.000 | 15,393,000 |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 2,900 | 2,946.000 | 8,543,400 |
| サトーホールディングス | 10,100 | 1,733.000 | 17,503,300 |
| 技研製作所 | 6,700 | 3,435.000 | 23,014,500 |
| 日本エアーテック | 4,900 | 1,031.000 | 5,051,900 |
| 日精樹脂工業 | 6,900 | 944.000 | 6,513,600 |
| ワイエイシイホールディングス | 3,900 | 1,570.000 | 6,123,000 |
| 小松製作所 | 347,500 | 2,928.000 | 1,017,480,000 |
| 住友重機械工業 | 43,600 | 2,660.000 | 115,976,000 |
| 日立建機 | 30,700 | 3,135.000 | 96,244,500 |
| 日工 | 14,300 | 601.000 | 8,594,300 |
| 巴工業 | 3,800 | 2,275.000 | 8,645,000 |
| 井関農機 | 7,900 | 1,198.000 | 9,464,200 |
| T O W A | 6,700 | 2,085.000 | 13,969,500 |
| 北川鉄工所 | 4,900 | 1,252.000 | 6,134,800 |
| ローツェ | 3,800 | 11,450.000 | 43,510,000 |
| クボタ | 371,200 | 2,170.500 | 805,689,600 |
| 荏原実業 | 4,000 | 2,304.000 | 9,216,000 |
| 三菱化工機 | 3,200 | 1,902.000 | 6,086,400 |
| 月島機械 | 14,300 | 1,003.000 | 14,342,900 |
| 帝国電機製作所 | 6,200 | 1,610.000 | 9,982,000 |
| 新東工業 | 18,900 | 678.000 | 12,814,200 |
| 澁谷工業 | 6,700 | 2,289.000 | 15,336,300 |
| アイチコーポレーション | 12,200 | 865.000 | 10,553,000 |
| 小森コーポレーション | 21,000 | 708.000 | 14,868,000 |
| 鶴見製作所 | 6,600 | 1,848.000 | 12,196,800 |
| 荏原製作所 | 31,400 | 5,950.000 | 186,830,000 |
| 西島製作所 | 10,000 | 1,264.000 | 12,640,000 |
| 北越工業 | 9,300 | 837.000 | 7,784,100 |
| ダイキン工業 | 97,700 | 20,200.000 | 1,973,540,000 |
| オルガノ | 2,100 | 8,790.000 | 18,459,000 |
| トーヨーカネツ | 3,500 | 2,372.000 | 8,302,000 |
| 栗田工業 | 41,500 | 4,325.000 | 179,487,500 |
| 椿本チエイン | 9,600 | 2,895.000 | 27,792,000 |
| 大同工業 | 5,300 | 895.000 | 4,743,500 |
| 木村化工機 | 7,500 | 806.000 | 6,045,000 |

| | | | |
|-----------------|---------|-----------|-------------|
| アネスト岩田 | 13,800 | 807.000 | 11,136,600 |
| ダイフク | 42,100 | 8,010.000 | 337,221,000 |
| サムコ | 2,400 | 2,417.000 | 5,800,800 |
| タダノ | 41,200 | 909.000 | 37,450,800 |
| フジテック | 28,600 | 2,815.000 | 80,509,000 |
| C K D | 22,300 | 1,672.000 | 37,285,600 |
| キトー | 7,200 | 1,649.000 | 11,872,800 |
| 平和 | 21,500 | 1,910.000 | 41,065,000 |
| 理想科学工業 | 6,700 | 2,251.000 | 15,081,700 |
| S A N K Y O | 16,700 | 3,700.000 | 61,790,000 |
| 日本金銭機械 | 10,800 | 704.000 | 7,603,200 |
| マースグループホールディングス | 6,400 | 1,706.000 | 10,918,400 |
| フクシマガリレイ | 5,300 | 3,700.000 | 19,610,000 |
| ダイコク電機 | 5,600 | 1,244.000 | 6,966,400 |
| 竹内製作所 | 11,400 | 2,312.000 | 26,356,800 |
| アマノ | 20,400 | 2,183.000 | 44,533,200 |
| J U K I | 11,800 | 817.000 | 9,640,600 |
| ジャノメ | 8,100 | 672.000 | 5,443,200 |
| マックス | 10,300 | 1,533.000 | 15,789,900 |
| グローリー | 19,800 | 2,052.000 | 40,629,600 |
| 新晃工業 | 7,300 | 1,586.000 | 11,577,800 |
| 大和冷機工業 | 11,000 | 1,086.000 | 11,946,000 |
| セガサミーホールディングス | 76,200 | 2,220.000 | 169,164,000 |
| 日本ピストンリング | 4,400 | 1,260.000 | 5,544,000 |
| リケン | 3,800 | 2,364.000 | 8,983,200 |
| T P R | 10,200 | 1,233.000 | 12,576,600 |
| ツバキ・ナカシマ | 17,100 | 929.000 | 15,885,900 |
| ホシザキ | 22,400 | 7,990.000 | 178,976,000 |
| 大豊工業 | 8,200 | 639.000 | 5,239,800 |
| 日本精工 | 144,000 | 709.000 | 102,096,000 |
| N T N | 163,900 | 205.000 | 33,599,500 |
| ジェイテクト | 72,800 | 882.000 | 64,209,600 |
| 不二越 | 6,300 | 3,665.000 | 23,089,500 |
| 日本トムソン | 22,700 | 498.000 | 11,304,600 |
| T H K | 43,300 | 2,538.000 | 109,895,400 |
| ユーシン精機 | 9,000 | 630.000 | 5,670,000 |
| 前澤給装工業 | 7,800 | 932.000 | 7,269,600 |
| イーグル工業 | 10,500 | 991.000 | 10,405,500 |
| 日本ピラー工業 | 7,700 | 2,583.000 | 19,889,100 |
| キッツ | 26,500 | 641.000 | 16,986,500 |
| マキタ | 93,300 | 3,723.000 | 347,355,900 |
| 日立造船 | 64,800 | 685.000 | 44,388,000 |
| 三菱重工業 | 120,200 | 4,293.000 | 516,018,600 |
| I H I | 47,800 | 2,937.000 | 140,388,600 |
| スター精密 | 11,800 | 1,412.000 | 16,661,600 |
| 日清紡ホールディングス | 47,100 | 950.000 | 44,745,000 |
| イビデン | 40,200 | 5,280.000 | 212,256,000 |
| コニカミノルタ | 168,500 | 485.000 | 81,722,500 |

| | | | |
|-------------------|---------|------------|---------------|
| ブラザー工業 | 93,500 | 2,212.000 | 206,822,000 |
| ミネベアミツミ | 131,600 | 2,538.000 | 334,000,800 |
| 日立製作所 | 368,800 | 5,908.000 | 2,178,870,400 |
| 東芝 | 133,900 | 5,342.000 | 715,293,800 |
| 三菱電機 | 766,800 | 1,354.000 | 1,038,247,200 |
| 富士電機 | 46,100 | 5,620.000 | 259,082,000 |
| 安川電機 | 82,400 | 4,460.000 | 367,504,000 |
| シンフォニア テクノロジー | 10,400 | 1,245.000 | 12,948,000 |
| 明電舎 | 13,100 | 2,315.000 | 30,326,500 |
| オリジン | 4,700 | 1,386.000 | 6,514,200 |
| 山洋電気 | 3,500 | 4,530.000 | 15,855,000 |
| デンヨー | 7,600 | 1,605.000 | 12,198,000 |
| PHCホールディングス | 9,000 | 1,828.000 | 16,452,000 |
| 東芝テック | 8,300 | 4,440.000 | 36,852,000 |
| 芝浦メカトロニクス | 1,400 | 7,330.000 | 10,262,000 |
| マブチモーター | 17,800 | 3,580.000 | 63,724,000 |
| 日本電産 | 198,600 | 8,371.000 | 1,662,480,600 |
| トレックス・セミコンダクター | 4,200 | 2,279.000 | 9,571,800 |
| 東光高岳 | 5,200 | 1,547.000 | 8,044,400 |
| ダイヘン | 8,200 | 3,610.000 | 29,602,000 |
| ヤーマン | 13,500 | 1,180.000 | 15,930,000 |
| JVCケンウッド | 67,700 | 184.000 | 12,456,800 |
| ミマキエンジニアリング | 9,300 | 649.000 | 6,035,700 |
| I - P E X | 4,300 | 1,393.000 | 5,989,900 |
| 日新電機 | 17,800 | 1,348.000 | 23,994,400 |
| 大崎電気工業 | 19,000 | 490.000 | 9,310,000 |
| オムロン | 63,800 | 7,646.000 | 487,814,800 |
| 日東工業 | 10,100 | 1,495.000 | 15,099,500 |
| I D E C | 9,800 | 2,230.000 | 21,854,000 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 25,200 | 2,221.000 | 55,969,200 |
| メルコホールディングス | 2,000 | 3,800.000 | 7,600,000 |
| 日本電気 | 97,400 | 5,150.000 | 501,610,000 |
| 富士通 | 69,000 | 19,110.000 | 1,318,590,000 |
| 沖電気工業 | 31,300 | 832.000 | 26,041,600 |
| 電気興業 | 4,700 | 2,358.000 | 11,082,600 |
| サンケン電気 | 7,300 | 4,825.000 | 35,222,500 |
| アイホン | 5,000 | 1,987.000 | 9,935,000 |
| ルネサスエレクトロニクス | 416,000 | 1,359.000 | 565,344,000 |
| セイコーエプソン | 95,100 | 1,791.000 | 170,324,100 |
| ワコム | 59,400 | 919.000 | 54,588,600 |
| アルバック | 15,300 | 5,070.000 | 77,571,000 |
| アクセル | 4,300 | 954.000 | 4,102,200 |
| E I Z O | 6,000 | 3,320.000 | 19,920,000 |
| 日本信号 | 20,100 | 910.000 | 18,291,000 |
| 京三製作所 | 20,100 | 429.000 | 8,622,900 |
| 能美防災 | 10,300 | 1,890.000 | 19,467,000 |
| ホーチキ | 6,900 | 1,181.000 | 8,148,900 |
| エレコム | 17,600 | 1,498.000 | 26,364,800 |

| | | | |
|---------------------|---------|------------|---------------|
| パナソニック ホールディングス | 818,100 | 1,141.500 | 933,861,150 |
| シャープ | 87,300 | 1,095.000 | 95,593,500 |
| アンリツ | 49,800 | 1,620.000 | 80,676,000 |
| 富士通ゼネラル | 21,300 | 2,335.000 | 49,735,500 |
| ソニーグループ | 480,200 | 11,070.000 | 5,315,814,000 |
| T D K | 110,900 | 3,945.000 | 437,500,500 |
| 帝国通信工業 | 5,000 | 1,400.000 | 7,000,000 |
| タムラ製作所 | 30,100 | 554.000 | 16,675,400 |
| アルプスアルパイン | 68,600 | 1,168.000 | 80,124,800 |
| 日本電波工業 | 7,700 | 1,178.000 | 9,070,600 |
| メイコー | 6,200 | 3,395.000 | 21,049,000 |
| 日本トリム | 2,200 | 2,335.000 | 5,137,000 |
| ローランド ディー . ジー . | 4,800 | 3,250.000 | 15,600,000 |
| フォスター電機 | 10,300 | 679.000 | 6,993,700 |
| S M K | 2,600 | 2,115.000 | 5,499,000 |
| ヨコオ | 5,700 | 2,404.000 | 13,702,800 |
| ホシデン | 18,300 | 1,213.000 | 22,197,900 |
| ヒロセ電機 | 11,800 | 16,190.000 | 191,042,000 |
| 日本航空電子工業 | 17,500 | 1,990.000 | 34,825,000 |
| T O A | 10,500 | 684.000 | 7,182,000 |
| マクセル | 15,400 | 1,140.000 | 17,556,000 |
| 古野電気 | 10,400 | 919.000 | 9,557,600 |
| ユニデンホールディングス | 2,200 | 3,435.000 | 7,557,000 |
| スミダコーポレーション | 8,100 | 832.000 | 6,739,200 |
| アイコム | 3,700 | 2,339.000 | 8,654,300 |
| リオン | 3,600 | 2,205.000 | 7,938,000 |
| 横河電機 | 76,700 | 2,077.000 | 159,305,900 |
| 新電元工業 | 3,200 | 2,879.000 | 9,212,800 |
| アズビル | 45,000 | 3,900.000 | 175,500,000 |
| 東亜ディーケーケー | 6,100 | 880.000 | 5,368,000 |
| 日本光電工業 | 32,000 | 3,090.000 | 98,880,000 |
| 共和電業 | 17,600 | 347.000 | 6,107,200 |
| 日本電子材料 | 4,400 | 1,996.000 | 8,782,400 |
| 堀場製作所 | 14,200 | 6,140.000 | 87,188,000 |
| アドバンテスト | 56,900 | 8,520.000 | 484,788,000 |
| エスペック | 6,500 | 1,671.000 | 10,861,500 |
| キーエンス | 69,500 | 50,590.000 | 3,516,005,000 |
| 日置電機 | 3,700 | 7,690.000 | 28,453,000 |
| シスメックス | 64,800 | 8,715.000 | 564,732,000 |
| 日本マイクロニクス | 13,500 | 1,513.000 | 20,425,500 |
| メガチップス | 7,200 | 3,325.000 | 23,940,000 |
| O B A R A G R O U P | 3,900 | 2,845.000 | 11,095,500 |
| コーセル | 11,000 | 741.000 | 8,151,000 |
| イリソ電子工業 | 6,600 | 2,991.000 | 19,740,600 |
| オプテックスグループ | 12,900 | 1,673.000 | 21,581,700 |
| 千代田インテグレ | 4,200 | 2,131.000 | 8,950,200 |
| レーザーテック | 33,700 | 18,035.000 | 607,779,500 |
| スタンレー電気 | 53,400 | 2,159.000 | 115,290,600 |

| | | | |
|---------------------|-----------|------------|---------------|
| 岩崎電気 | 3,600 | 2,314.000 | 8,330,400 |
| ウシオ電機 | 39,700 | 1,682.000 | 66,775,400 |
| 日本セラミック | 7,400 | 2,320.000 | 17,168,000 |
| 遠藤照明 | 5,300 | 868.000 | 4,600,400 |
| 古河電池 | 6,000 | 1,180.000 | 7,080,000 |
| 山一電機 | 6,100 | 1,638.000 | 9,991,800 |
| 図研 | 5,200 | 2,925.000 | 15,210,000 |
| 日本電子 | 16,000 | 5,950.000 | 95,200,000 |
| カシオ計算機 | 55,900 | 1,336.000 | 74,682,400 |
| ファナック | 67,300 | 20,710.000 | 1,393,783,000 |
| 日本シイエムケイ | 17,100 | 521.000 | 8,909,100 |
| エンプラス | 2,400 | 2,703.000 | 6,487,200 |
| 大真空 | 11,000 | 1,181.000 | 12,991,000 |
| ローム | 34,300 | 9,120.000 | 312,816,000 |
| 浜松ホトニクス | 54,900 | 5,730.000 | 314,577,000 |
| 三井ハイテック | 7,500 | 11,060.000 | 82,950,000 |
| 新光電気工業 | 22,500 | 5,750.000 | 129,375,000 |
| 京セラ | 107,900 | 6,753.000 | 728,648,700 |
| 太陽誘電 | 37,100 | 5,140.000 | 190,694,000 |
| 村田製作所 | 225,200 | 7,725.000 | 1,739,670,000 |
| 双葉電子工業 | 17,500 | 670.000 | 11,725,000 |
| 北陸電気工業 | 4,700 | 1,122.000 | 5,273,400 |
| ニチコン | 24,200 | 1,159.000 | 28,047,800 |
| 日本ケミコン | 7,700 | 1,757.000 | 13,528,900 |
| K O A | 11,800 | 1,412.000 | 16,661,600 |
| 市光工業 | 11,300 | 369.000 | 4,169,700 |
| 小糸製作所 | 41,900 | 4,620.000 | 193,578,000 |
| ミツバ | 16,500 | 338.000 | 5,577,000 |
| S C R E E Nホールディングス | 13,300 | 10,700.000 | 142,310,000 |
| キャノン電子 | 7,800 | 1,473.000 | 11,489,400 |
| キャノン | 380,800 | 2,947.000 | 1,122,217,600 |
| リコー | 213,200 | 920.000 | 196,144,000 |
| 象印マホービン | 21,000 | 1,338.000 | 28,098,000 |
| 東京エレクトロン | 48,600 | 55,630.000 | 2,703,618,000 |
| トヨタ紡織 | 31,300 | 1,885.000 | 59,000,500 |
| ユニプレス | 13,800 | 729.000 | 10,060,200 |
| 豊田自動織機 | 61,800 | 7,700.000 | 475,860,000 |
| モリタホールディングス | 13,100 | 1,218.000 | 15,955,800 |
| 三櫻工業 | 11,300 | 699.000 | 7,898,700 |
| デンソー | 168,900 | 7,374.000 | 1,245,468,600 |
| 東海理化電機製作所 | 19,300 | 1,442.000 | 27,830,600 |
| 川崎重工業 | 55,900 | 2,277.000 | 127,284,300 |
| 日本車輛製造 | 3,700 | 2,085.000 | 7,714,500 |
| 三菱ロジスネクスト | 10,900 | 737.000 | 8,033,300 |
| 日産自動車 | 905,100 | 509.300 | 460,967,430 |
| いすゞ自動車 | 240,200 | 1,529.000 | 367,265,800 |
| トヨタ自動車 | 3,883,000 | 2,180.000 | 8,464,940,000 |
| 日野自動車 | 96,000 | 685.000 | 65,760,000 |

| | | | |
|-------------|---------|------------|---------------|
| 三菱自動車工業 | 284,500 | 308.000 | 87,626,000 |
| 武蔵精密工業 | 17,100 | 1,324.000 | 22,640,400 |
| 日産車体 | 13,500 | 553.000 | 7,465,500 |
| 新明和工業 | 21,700 | 895.000 | 19,421,500 |
| 極東開発工業 | 14,300 | 1,273.000 | 18,203,900 |
| トピー工業 | 8,300 | 1,001.000 | 8,308,300 |
| ティラド | 2,700 | 2,248.000 | 6,069,600 |
| 曙ブレーキ工業 | 50,300 | 149.000 | 7,494,700 |
| タチエス | 14,400 | 990.000 | 14,256,000 |
| N O K | 37,800 | 1,086.000 | 41,050,800 |
| フタバ産業 | 21,800 | 328.000 | 7,150,400 |
| K Y B | 7,800 | 2,855.000 | 22,269,000 |
| 大同メタル工業 | 18,700 | 547.000 | 10,228,900 |
| プレス工業 | 39,700 | 366.000 | 14,530,200 |
| ミクニ | 12,800 | 377.000 | 4,825,600 |
| 太平洋工業 | 16,300 | 875.000 | 14,262,500 |
| アイシン | 55,800 | 3,865.000 | 215,667,000 |
| マツダ | 240,500 | 901.000 | 216,690,500 |
| 本田技研工業 | 603,900 | 3,399.000 | 2,052,656,100 |
| スズキ | 175,500 | 4,008.000 | 703,404,000 |
| S U B A R U | 219,900 | 1,946.000 | 427,925,400 |
| 安永 | 5,900 | 724.000 | 4,271,600 |
| ヤマハ発動機 | 99,600 | 2,694.000 | 268,322,400 |
| T B K | 17,300 | 346.000 | 5,985,800 |
| エクセディ | 11,400 | 1,513.000 | 17,248,200 |
| 豊田合成 | 24,900 | 1,818.000 | 45,268,200 |
| 愛三工業 | 13,700 | 665.000 | 9,110,500 |
| ヨロズ | 9,300 | 778.000 | 7,235,400 |
| エフ・シー・シー | 12,300 | 1,263.000 | 15,534,900 |
| シマノ | 30,700 | 25,900.000 | 795,130,000 |
| テイ・エス テック | 32,700 | 1,333.000 | 43,589,100 |
| ジャムコ | 5,500 | 789.000 | 4,339,500 |
| テルモ | 217,100 | 3,880.000 | 842,348,000 |
| 日機装 | 23,200 | 794.000 | 18,420,800 |
| 日本エム・ディ・エム | 5,100 | 1,567.000 | 7,991,700 |
| 島津製作所 | 98,400 | 4,215.000 | 414,756,000 |
| J M S | 9,600 | 580.000 | 5,568,000 |
| 長野計器 | 6,200 | 1,088.000 | 6,745,600 |
| ブイ・テクノロジ | 3,500 | 2,951.000 | 10,328,500 |
| 東京計器 | 6,800 | 1,108.000 | 7,534,400 |
| インターアクション | 4,100 | 1,873.000 | 7,679,300 |
| 東京精密 | 12,800 | 4,410.000 | 56,448,000 |
| マニー | 31,300 | 1,503.000 | 47,043,900 |
| ニコン | 117,200 | 1,457.000 | 170,760,400 |
| トプコン | 36,500 | 1,671.000 | 60,991,500 |
| オリンパス | 402,400 | 2,370.000 | 953,688,000 |
| 理研計器 | 6,200 | 4,130.000 | 25,606,000 |
| タムロン | 5,900 | 2,239.000 | 13,210,100 |

| | | | |
|-------------------|---------|------------|---------------|
| HOYA | 149,600 | 12,845.000 | 1,921,612,000 |
| ノーリツ鋼機 | 7,100 | 2,147.000 | 15,243,700 |
| A & Dホールディングス | 7,600 | 880.000 | 6,688,000 |
| 朝日インテック | 84,300 | 2,579.000 | 217,409,700 |
| シチズン時計 | 88,800 | 481.000 | 42,712,800 |
| リズム | 3,800 | 1,642.000 | 6,239,600 |
| メニコン | 25,700 | 2,742.000 | 70,469,400 |
| 松風 | 4,100 | 1,603.000 | 6,572,300 |
| セイコーホールディングス | 10,700 | 2,141.000 | 22,908,700 |
| ニプロ | 58,200 | 1,008.000 | 58,665,600 |
| スノーピーク | 9,900 | 2,611.000 | 25,848,900 |
| パラマウントベッドホールディングス | 14,700 | 2,103.000 | 30,914,100 |
| トランザクション | 5,700 | 1,013.000 | 5,774,100 |
| ニホンフラッシュ | 7,600 | 955.000 | 7,258,000 |
| 前田工織 | 8,500 | 2,852.000 | 24,242,000 |
| 永大産業 | 20,600 | 286.000 | 5,891,600 |
| アートネイチャー | 9,300 | 704.000 | 6,547,200 |
| バンダイナムコホールディングス | 68,600 | 8,873.000 | 608,687,800 |
| SHOEI | 7,200 | 4,840.000 | 34,848,000 |
| フランスベッドホールディングス | 12,700 | 866.000 | 10,998,200 |
| パイロットコーポレーション | 13,100 | 5,220.000 | 68,382,000 |
| 萩原工業 | 6,600 | 1,046.000 | 6,903,600 |
| フジシールインターナショナル | 18,700 | 1,701.000 | 31,808,700 |
| タカラトミー | 31,800 | 1,218.000 | 38,732,400 |
| 広済堂ホールディングス | 6,500 | 786.000 | 5,109,000 |
| プロネクサス | 7,800 | 1,018.000 | 7,940,400 |
| 大建工業 | 4,900 | 2,081.000 | 10,196,900 |
| 凸版印刷 | 116,100 | 2,127.000 | 246,944,700 |
| 大日本印刷 | 90,300 | 2,675.000 | 241,552,500 |
| 共同印刷 | 3,000 | 2,717.000 | 8,151,000 |
| NISSHA | 15,900 | 1,377.000 | 21,894,300 |
| TAKARA & COMPANY | 5,700 | 1,858.000 | 10,590,600 |
| アシックス | 67,900 | 2,134.000 | 144,898,600 |
| ローランド | 5,500 | 4,425.000 | 24,337,500 |
| ヤマハ | 44,400 | 5,110.000 | 226,884,000 |
| 河合楽器製作所 | 2,500 | 2,942.000 | 7,355,000 |
| ピジョン | 45,600 | 2,057.000 | 93,799,200 |
| キングジム | 9,600 | 942.000 | 9,043,200 |
| リンテック | 16,700 | 2,386.000 | 39,846,200 |
| イトーキ | 20,200 | 339.000 | 6,847,800 |
| 任天堂 | 43,300 | 61,400.000 | 2,658,620,000 |
| 三菱鉛筆 | 12,700 | 1,234.000 | 15,671,800 |
| タカラスタANDARD | 15,700 | 1,285.000 | 20,174,500 |
| コクヨ | 37,400 | 1,675.000 | 62,645,000 |
| ナカバヤシ | 11,400 | 488.000 | 5,563,200 |
| グローブライド | 6,900 | 2,645.000 | 18,250,500 |
| オカムラ | 26,300 | 1,178.000 | 30,981,400 |
| 美津濃 | 7,800 | 2,095.000 | 16,341,000 |

| | | | |
|----------------|---------|------------|---------------|
| 東京電力ホールディングス | 573,900 | 454.000 | 260,550,600 |
| 中部電力 | 232,900 | 1,311.000 | 305,331,900 |
| 関西電力 | 289,200 | 1,203.000 | 347,907,600 |
| 中国電力 | 118,400 | 860.000 | 101,824,000 |
| 北陸電力 | 72,100 | 536.000 | 38,645,600 |
| 東北電力 | 178,000 | 726.000 | 129,228,000 |
| 四国電力 | 69,300 | 760.000 | 52,668,000 |
| 九州電力 | 156,300 | 824.000 | 128,791,200 |
| 北海道電力 | 67,700 | 491.000 | 33,240,700 |
| 沖縄電力 | 16,300 | 1,292.000 | 21,059,600 |
| 電源開発 | 65,400 | 1,787.000 | 116,869,800 |
| エフオン | 7,600 | 538.000 | 4,088,800 |
| イーレックス | 11,600 | 1,905.000 | 22,098,000 |
| レノバ | 15,200 | 1,526.000 | 23,195,200 |
| 東京瓦斯 | 146,500 | 2,293.000 | 335,924,500 |
| 大阪瓦斯 | 137,900 | 2,130.000 | 293,727,000 |
| 東邦瓦斯 | 34,900 | 2,532.000 | 88,366,800 |
| 北海道瓦斯 | 5,600 | 1,482.000 | 8,299,200 |
| 広島ガス | 20,900 | 313.000 | 6,541,700 |
| 西部ガスホールディングス | 8,900 | 1,939.000 | 17,257,100 |
| 静岡ガス | 19,700 | 879.000 | 17,316,300 |
| メタウォーター | 8,500 | 1,948.000 | 16,558,000 |
| SBSホールディングス | 5,500 | 3,010.000 | 16,555,000 |
| 東武鉄道 | 74,300 | 2,982.000 | 221,562,600 |
| 相鉄ホールディングス | 25,000 | 2,297.000 | 57,425,000 |
| 東急 | 192,200 | 1,617.000 | 310,787,400 |
| 京浜急行電鉄 | 98,600 | 1,316.000 | 129,757,600 |
| 小田急電鉄 | 113,800 | 2,036.000 | 231,696,800 |
| 京王電鉄 | 39,700 | 5,020.000 | 199,294,000 |
| 京成電鉄 | 53,300 | 3,395.000 | 180,953,500 |
| 富士急行 | 9,200 | 4,040.000 | 37,168,000 |
| 新京成電鉄 | 3,800 | 2,248.000 | 8,542,400 |
| 東日本旅客鉄道 | 134,900 | 6,878.000 | 927,842,200 |
| 西日本旅客鉄道 | 92,900 | 4,987.000 | 463,292,300 |
| 東海旅客鉄道 | 63,800 | 16,250.000 | 1,036,750,000 |
| 西武ホールディングス | 100,200 | 1,309.000 | 131,161,800 |
| 鴻池運輸 | 12,300 | 1,125.000 | 13,837,500 |
| 西日本鉄道 | 21,500 | 2,631.000 | 56,566,500 |
| ハマキョウレックス | 5,400 | 2,840.000 | 15,336,000 |
| サカイ引越センター | 3,400 | 4,345.000 | 14,773,000 |
| 近鉄グループホールディングス | 72,100 | 3,740.000 | 269,654,000 |
| 阪急阪神ホールディングス | 90,200 | 3,475.000 | 313,445,000 |
| 南海電気鉄道 | 32,600 | 2,374.000 | 77,392,400 |
| 京阪ホールディングス | 32,400 | 2,841.000 | 92,048,400 |
| 神戸電鉄 | 2,800 | 3,215.000 | 9,002,000 |
| 名古屋鉄道 | 59,800 | 2,088.000 | 124,862,400 |
| 山陽電気鉄道 | 6,700 | 2,027.000 | 13,580,900 |
| アルプス物流 | 5,700 | 1,032.000 | 5,882,400 |

| | | | |
|------------------------|---------|-----------|-------------|
| ヤマトホールディングス | 101,700 | 2,431.000 | 247,232,700 |
| 山九 | 19,000 | 3,925.000 | 74,575,000 |
| 丸全昭和運輸 | 6,000 | 3,135.000 | 18,810,000 |
| センコーグループホールディングス | 35,000 | 868.000 | 30,380,000 |
| トナミホールディングス | 2,000 | 3,750.000 | 7,500,000 |
| ニッコンホールディングス | 24,600 | 1,899.000 | 46,715,400 |
| 福山通運 | 11,700 | 3,600.000 | 42,120,000 |
| セイノーホールディングス | 49,200 | 1,042.000 | 51,266,400 |
| 神奈川中央交通 | 2,600 | 3,250.000 | 8,450,000 |
| 日立物流 | 14,000 | 8,330.000 | 116,620,000 |
| 丸和運輸機関 | 15,400 | 1,471.000 | 22,653,400 |
| C & F ロジホールディングス | 7,800 | 1,108.000 | 8,642,400 |
| 九州旅客鉄道 | 56,300 | 2,571.000 | 144,747,300 |
| S Gホールディングス | 137,000 | 2,267.000 | 310,579,000 |
| NIPPON EXPRESSホールディングス | 24,900 | 7,440.000 | 185,256,000 |
| 日本郵船 | 60,600 | 9,310.000 | 564,186,000 |
| 商船三井 | 120,300 | 3,010.000 | 362,103,000 |
| 川崎汽船 | 22,300 | 6,810.000 | 151,863,000 |
| NSユナイテッド海運 | 4,100 | 3,710.000 | 15,211,000 |
| 明治海運 | 10,400 | 730.000 | 7,592,000 |
| 飯野海運 | 35,200 | 743.000 | 26,153,600 |
| 乾汽船 | 5,500 | 1,665.000 | 9,157,500 |
| 日本航空 | 166,300 | 2,173.000 | 361,369,900 |
| ANAホールディングス | 185,300 | 2,433.000 | 450,834,900 |
| トランコム | 2,100 | 6,920.000 | 14,532,000 |
| 日新 | 6,400 | 1,540.000 | 9,856,000 |
| 三菱倉庫 | 22,900 | 2,999.000 | 68,677,100 |
| 三井倉庫ホールディングス | 7,600 | 2,354.000 | 17,890,400 |
| 住友倉庫 | 24,900 | 2,156.000 | 53,684,400 |
| 澁澤倉庫 | 4,900 | 2,271.000 | 11,127,900 |
| 東陽倉庫 | 21,100 | 308.000 | 6,498,800 |
| 日本トランスシティ | 17,000 | 590.000 | 10,030,000 |
| 川西倉庫 | 3,800 | 1,100.000 | 4,180,000 |
| 安田倉庫 | 8,500 | 978.000 | 8,313,000 |
| 東洋埠頭 | 5,400 | 1,468.000 | 7,927,200 |
| 上組 | 39,200 | 2,195.000 | 86,044,000 |
| 近鉄エクスプレス | 13,500 | 3,100.000 | 41,850,000 |
| エーアイティー | 5,500 | 1,527.000 | 8,398,500 |
| 内外トランスライン | 3,500 | 1,775.000 | 6,212,500 |
| 日本コンセプト | 3,600 | 1,316.000 | 4,737,600 |
| NEC ネットスアイ | 24,400 | 1,754.000 | 42,797,600 |
| クロスキャット | 5,400 | 954.000 | 5,151,600 |
| システナ | 105,700 | 403.000 | 42,597,100 |
| デジタルアーツ | 4,100 | 7,520.000 | 30,832,000 |
| 日鉄ソリューションズ | 10,700 | 3,880.000 | 41,516,000 |
| コア | 4,100 | 1,570.000 | 6,437,000 |
| 手間いらず | 1,300 | 4,695.000 | 6,103,500 |

| | | | |
|---------------------------|---------|------------|-------------|
| ラクーンホールディングス | 7,300 | 1,417.000 | 10,344,100 |
| ソリトンシステムズ | 4,900 | 1,488.000 | 7,291,200 |
| ソフトクリエイティブホールディングス | 3,500 | 4,085.000 | 14,297,500 |
| T I S | 71,600 | 2,872.000 | 205,635,200 |
| グリー | 34,900 | 1,056.000 | 36,854,400 |
| コーエーテクモホールディングス | 24,100 | 3,920.000 | 94,472,000 |
| 三菱総合研究所 | 3,100 | 3,810.000 | 11,811,000 |
| ファインデックス | 8,000 | 649.000 | 5,192,000 |
| ブレインパッド | 7,100 | 1,129.000 | 8,015,900 |
| K L a b | 16,500 | 459.000 | 7,573,500 |
| ポルトゥウィンホールディングス | 11,800 | 977.000 | 11,528,600 |
| ネクソン | 169,900 | 2,932.000 | 498,146,800 |
| エムアップホールディングス | 9,400 | 1,025.000 | 9,635,000 |
| エイチーム | 7,100 | 741.000 | 5,261,100 |
| エニグモ | 9,500 | 525.000 | 4,987,500 |
| コロブラ | 25,300 | 646.000 | 16,343,800 |
| ブロードリーフ | 38,900 | 366.000 | 14,237,400 |
| デジタルハーツホールディングス | 4,200 | 1,781.000 | 7,480,200 |
| システム情報 | 6,700 | 943.000 | 6,318,100 |
| メディアドゥ | 3,000 | 1,773.000 | 5,319,000 |
| じげん | 26,100 | 307.000 | 8,012,700 |
| ブイキューブ | 8,800 | 956.000 | 8,412,800 |
| フィックスターズ | 10,400 | 826.000 | 8,590,400 |
| C A R T A H O L D I N G S | 3,700 | 2,436.000 | 9,013,200 |
| オブティム | 6,700 | 885.000 | 5,929,500 |
| セレス | 3,300 | 1,500.000 | 4,950,000 |
| S H I F T | 3,800 | 24,760.000 | 94,088,000 |
| ティーガイア | 7,000 | 1,618.000 | 11,326,000 |
| テクマトリックス | 13,000 | 2,058.000 | 26,754,000 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 19,800 | 2,628.000 | 52,034,400 |
| G M O ペイメントゲートウェイ | 14,600 | 10,960.000 | 160,016,000 |
| システムリサーチ | 3,100 | 1,907.000 | 5,911,700 |
| インターネットイニシアティブ | 20,200 | 4,005.000 | 80,901,000 |
| さくらインターネット | 11,000 | 536.000 | 5,896,000 |
| G M O グローバルサイン・ホールディングス | 1,900 | 5,590.000 | 10,621,000 |
| S R A ホールディングス | 4,200 | 2,761.000 | 11,596,200 |
| e B A S E | 11,200 | 440.000 | 4,928,000 |
| アバント | 8,700 | 1,150.000 | 10,005,000 |
| アドソル日進 | 3,800 | 1,545.000 | 5,871,000 |
| フリービット | 5,700 | 849.000 | 4,839,300 |
| コムチュア | 8,400 | 2,835.000 | 23,814,000 |
| アステリア | 6,500 | 978.000 | 6,357,000 |
| アイル | 4,600 | 1,350.000 | 6,210,000 |
| マークライnz | 4,300 | 2,618.000 | 11,257,400 |
| メディカル・データ・ビジョン | 10,500 | 1,025.000 | 10,762,500 |
| g u m i | 12,200 | 564.000 | 6,880,800 |

| | | | |
|----------------------|-----------|------------|-------------|
| テラスカイ | 3,500 | 1,364.000 | 4,774,000 |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジ | 4,400 | 1,190.000 | 5,236,000 |
| P C Iホールディングス | 4,900 | 988.000 | 4,841,200 |
| パイブドHD | 1,900 | 2,365.000 | 4,493,500 |
| P R T I M E S | 1,800 | 2,173.000 | 3,911,400 |
| ラクス | 26,200 | 1,695.000 | 44,409,000 |
| ダブルスタンダード | 2,700 | 1,861.000 | 5,024,700 |
| オープンドア | 5,100 | 2,006.000 | 10,230,600 |
| アカツキ | 3,600 | 3,020.000 | 10,872,000 |
| U B I C O Mホールディングス | 2,500 | 2,805.000 | 7,012,500 |
| カナミックネットワーク | 12,100 | 489.000 | 5,916,900 |
| チェンジ | 13,900 | 1,839.000 | 25,562,100 |
| オークネット | 5,000 | 1,539.000 | 7,695,000 |
| マクロミル | 17,200 | 1,212.000 | 20,846,400 |
| オロ | 2,800 | 2,021.000 | 5,658,800 |
| ユーザーローカル | 3,400 | 1,749.000 | 5,946,600 |
| マネーフォワード | 11,500 | 4,525.000 | 52,037,500 |
| 電算システムホールディングス | 3,300 | 2,538.000 | 8,375,400 |
| プロトコーポレーション | 8,800 | 1,000.000 | 8,800,000 |
| 野村総合研究所 | 145,200 | 4,045.000 | 587,334,000 |
| 日本システム技術 | 2,000 | 2,479.000 | 4,958,000 |
| インテージホールディングス | 9,200 | 1,585.000 | 14,582,000 |
| ソースネクスト | 39,100 | 189.000 | 7,389,900 |
| インフォコム | 8,400 | 2,190.000 | 18,396,000 |
| シンプレクス・ホールディングス | 8,800 | 1,729.000 | 15,215,200 |
| H E R O Z | 2,600 | 961.000 | 2,498,600 |
| ラクスル | 8,500 | 2,812.000 | 23,902,000 |
| I P S | 2,700 | 2,076.000 | 5,605,200 |
| イーソル | 6,700 | 636.000 | 4,261,200 |
| アルテリア・ネットワークス | 10,100 | 1,316.000 | 13,291,600 |
| ウイングアーク1st | 5,200 | 1,263.000 | 6,567,600 |
| サーバーワークス | 1,600 | 1,979.000 | 3,166,400 |
| S a n s a n | 27,200 | 1,348.000 | 36,665,600 |
| ギフティ | 7,900 | 1,112.000 | 8,784,800 |
| ベース | 1,600 | 6,220.000 | 9,952,000 |
| J M D C | 7,100 | 6,560.000 | 46,576,000 |
| フォーカスシステムズ | 6,800 | 903.000 | 6,140,400 |
| クレスコ | 6,100 | 1,833.000 | 11,181,300 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 71,700 | 1,110.000 | 79,587,000 |
| オービック | 23,700 | 18,820.000 | 446,034,000 |
| ジャストシステム | 10,700 | 5,530.000 | 59,171,000 |
| T D Cソフト | 7,800 | 1,119.000 | 8,728,200 |
| Zホールディングス | 1,082,700 | 519.200 | 562,137,840 |
| トレンドマイクロ | 40,200 | 7,110.000 | 285,822,000 |
| 日本オラクル | 12,200 | 8,510.000 | 103,822,000 |
| アルファシステムズ | 2,300 | 3,625.000 | 8,337,500 |
| フューチャー | 15,700 | 1,498.000 | 23,518,600 |

| | | | |
|--------------------------------|-----------|------------|---------------|
| CAC HOLDINGS | 5,400 | 1,365.000 | 7,371,000 |
| S Bテクノロジー | 3,700 | 2,517.000 | 9,312,900 |
| オービックビジネスコンサルタント | 7,100 | 4,765.000 | 33,831,500 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 34,200 | 3,060.000 | 104,652,000 |
| アイティフォー | 10,900 | 801.000 | 8,730,900 |
| 東計電算 | 1,200 | 5,260.000 | 6,312,000 |
| 大塚商会 | 40,700 | 4,255.000 | 173,178,500 |
| サイボウズ | 10,700 | 1,294.000 | 13,845,800 |
| 電通国際情報サービス | 10,700 | 3,735.000 | 39,964,500 |
| ACCESS | 11,400 | 562.000 | 6,406,800 |
| デジタルガレージ | 12,400 | 4,320.000 | 53,568,000 |
| イーエムシステムズ | 14,800 | 865.000 | 12,802,000 |
| ウェザーニューズ | 2,600 | 7,000.000 | 18,200,000 |
| C I J | 8,700 | 752.000 | 6,542,400 |
| WOWOW | 4,200 | 1,483.000 | 6,228,600 |
| スカラ | 9,600 | 744.000 | 7,142,400 |
| IMAGICA GROUP | 8,000 | 706.000 | 5,648,000 |
| ネットワンシステムズ | 28,800 | 3,110.000 | 89,568,000 |
| アルゴグラフィックス | 6,000 | 2,955.000 | 17,730,000 |
| マーベラス | 14,300 | 750.000 | 10,725,000 |
| エイベックス | 13,500 | 1,414.000 | 19,089,000 |
| B I P R O G Y | 23,600 | 3,240.000 | 76,464,000 |
| 兼松エレクトロニクス | 4,100 | 3,785.000 | 15,518,500 |
| 都築電気 | 4,500 | 1,469.000 | 6,610,500 |
| T B Sホールディングス | 45,900 | 1,704.000 | 78,213,600 |
| 日本テレビホールディングス | 63,100 | 1,232.000 | 77,739,200 |
| 朝日放送グループホールディングス | 9,800 | 707.000 | 6,928,600 |
| テレビ朝日ホールディングス | 18,200 | 1,460.000 | 26,572,000 |
| スカパーJ S A Tホールディングス | 63,100 | 405.000 | 25,555,500 |
| テレビ東京ホールディングス | 5,900 | 2,010.000 | 11,859,000 |
| ビジョン | 13,600 | 1,285.000 | 17,476,000 |
| USEN - N E X T H O L D I N G S | 7,300 | 2,185.000 | 15,950,500 |
| コネクシオ | 6,000 | 1,376.000 | 8,256,000 |
| 日本通信 | 68,900 | 186.000 | 12,815,400 |
| 日本電信電話 | 786,800 | 3,763.000 | 2,960,728,400 |
| K D D I | 548,400 | 4,269.000 | 2,341,119,600 |
| ソフトバンク | 1,138,800 | 1,480.500 | 1,685,993,400 |
| 光通信 | 8,700 | 14,760.000 | 128,412,000 |
| エムティーアイ | 10,700 | 484.000 | 5,178,800 |
| G M Oインターネット | 26,800 | 2,576.000 | 69,036,800 |
| ファイバーゲート | 4,600 | 1,157.000 | 5,322,200 |
| K A D O K A W A | 41,000 | 3,185.000 | 130,585,000 |
| 学研ホールディングス | 11,100 | 852.000 | 9,457,200 |
| ゼンリン | 13,600 | 920.000 | 12,512,000 |
| アイネット | 5,700 | 1,219.000 | 6,948,300 |
| 松竹 | 5,100 | 12,980.000 | 66,198,000 |
| 東宝 | 44,400 | 4,750.000 | 210,900,000 |
| 東映 | 2,500 | 17,010.000 | 42,525,000 |

| | | | |
|----------------------|---------|-----------|---------------|
| エヌ・ティ・ティ・データ | 199,500 | 2,385.000 | 475,807,500 |
| ピー・シー・エー | 5,100 | 1,505.000 | 7,675,500 |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 3,400 | 1,380.000 | 4,692,000 |
| D T S | 13,600 | 2,789.000 | 37,930,400 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 35,100 | 5,130.000 | 180,063,000 |
| シーイーシー | 9,000 | 1,177.000 | 10,593,000 |
| カプコン | 71,000 | 3,145.000 | 223,295,000 |
| アイ・エス・ピー | 4,700 | 1,100.000 | 5,170,000 |
| ジャステック | 5,900 | 1,117.000 | 6,590,300 |
| S C S K | 51,800 | 2,072.000 | 107,329,600 |
| 日本システムウエア | 3,300 | 2,269.000 | 7,487,700 |
| アイネス | 7,800 | 1,461.000 | 11,395,800 |
| T K C | 12,400 | 3,340.000 | 41,416,000 |
| 富士ソフト | 7,900 | 6,830.000 | 53,957,000 |
| N S D | 23,500 | 2,265.000 | 53,227,500 |
| コナミホールディングス | 27,300 | 8,060.000 | 220,038,000 |
| 福井コンピュータホールディングス | 3,900 | 3,165.000 | 12,343,500 |
| J B C Cホールディングス | 5,900 | 1,450.000 | 8,555,000 |
| ミロク情報サービス | 7,900 | 1,292.000 | 10,206,800 |
| ソフトバンクグループ | 451,000 | 5,195.000 | 2,342,945,000 |
| 高千穂交易 | 3,900 | 1,494.000 | 5,826,600 |
| 伊藤忠食品 | 2,100 | 4,965.000 | 10,426,500 |
| エレマテック | 7,200 | 1,167.000 | 8,402,400 |
| あらた | 6,000 | 3,410.000 | 20,460,000 |
| トーマンデバイス | 1,200 | 5,940.000 | 7,128,000 |
| 東京エレクトロン デバイス | 2,300 | 4,955.000 | 11,396,500 |
| フィールズ | 8,000 | 865.000 | 6,920,000 |
| 双日 | 83,100 | 1,942.000 | 161,380,200 |
| アルフレッサ ホールディングス | 84,100 | 1,740.000 | 146,334,000 |
| 横浜冷凍 | 22,900 | 861.000 | 19,716,900 |
| アルコニックス | 10,000 | 1,364.000 | 13,640,000 |
| 神戸物産 | 58,700 | 3,300.000 | 193,710,000 |
| あい ホールディングス | 11,000 | 1,675.000 | 18,425,000 |
| ダイワボウホールディングス | 36,900 | 1,577.000 | 58,191,300 |
| マクニカ・富士エレホールディングス | 17,700 | 2,583.000 | 45,719,100 |
| ラクト・ジャパン | 3,200 | 1,993.000 | 6,377,600 |
| グリムス | 3,700 | 1,586.000 | 5,868,200 |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 15,500 | 768.000 | 11,904,000 |
| 八洲電機 | 8,400 | 924.000 | 7,761,600 |
| レスターホールディングス | 7,100 | 1,983.000 | 14,079,300 |
| ジュテックホールディングス | 3,000 | 1,123.000 | 3,369,000 |
| T O K A Iホールディングス | 35,900 | 860.000 | 30,874,000 |
| 三洋貿易 | 8,900 | 962.000 | 8,561,800 |
| ビューティガレージ | 1,600 | 2,815.000 | 4,504,000 |
| ウイン・パートナーズ | 6,000 | 970.000 | 5,820,000 |
| シップヘルスケアホールディングス | 24,700 | 2,143.000 | 52,932,100 |

| | | | |
|------------------|---------|-----------|---------------|
| コメダホールディングス | 17,200 | 2,208.000 | 37,977,600 |
| フルサト・マルカホールディングス | 7,500 | 3,285.000 | 24,637,500 |
| ヤマエグループホールディングス | 6,200 | 1,039.000 | 6,441,800 |
| 小野建 | 7,700 | 1,498.000 | 11,534,600 |
| 佐島電機 | 6,400 | 1,196.000 | 7,654,400 |
| 伯東 | 4,800 | 2,286.000 | 10,972,800 |
| コンドーテック | 7,600 | 1,055.000 | 8,018,000 |
| ナガイレーベン | 10,500 | 1,885.000 | 19,792,500 |
| 三菱食品 | 7,000 | 3,135.000 | 21,945,000 |
| 松田産業 | 5,800 | 2,226.000 | 12,910,800 |
| 第一興商 | 14,800 | 3,465.000 | 51,282,000 |
| メディパルホールディングス | 81,300 | 2,044.000 | 166,177,200 |
| S P K | 5,300 | 1,306.000 | 6,921,800 |
| 萩原電気ホールディングス | 3,700 | 1,882.000 | 6,963,400 |
| アズワン | 11,000 | 6,800.000 | 74,800,000 |
| 尾家産業 | 5,000 | 943.000 | 4,715,000 |
| シモジマ | 6,500 | 906.000 | 5,889,000 |
| ドウシシャ | 7,600 | 1,491.000 | 11,331,600 |
| 高速 | 5,500 | 1,464.000 | 8,052,000 |
| 丸文 | 8,900 | 663.000 | 5,900,700 |
| ハピネット | 7,100 | 1,495.000 | 10,614,500 |
| 日本ライフライン | 22,900 | 1,079.000 | 24,709,100 |
| タカショー | 8,400 | 697.000 | 5,854,800 |
| I D O M | 23,800 | 611.000 | 14,541,800 |
| 進和 | 5,200 | 1,950.000 | 10,140,000 |
| ダイトロン | 3,800 | 1,808.000 | 6,870,400 |
| シークス | 11,400 | 980.000 | 11,172,000 |
| オーハシテクニカ | 5,600 | 1,267.000 | 7,095,200 |
| 白銅 | 2,900 | 2,422.000 | 7,023,800 |
| 伊藤忠商事 | 527,800 | 3,878.000 | 2,046,808,400 |
| 丸紅 | 743,800 | 1,395.500 | 1,037,972,900 |
| 長瀬産業 | 41,300 | 1,826.000 | 75,413,800 |
| 蝶理 | 4,800 | 1,731.000 | 8,308,800 |
| 豊田通商 | 75,500 | 4,600.000 | 347,300,000 |
| 三共生興 | 14,300 | 527.000 | 7,536,100 |
| 兼松 | 26,900 | 1,309.000 | 35,212,100 |
| 三井物産 | 586,000 | 3,101.000 | 1,817,186,000 |
| 日本紙パルプ商事 | 4,000 | 3,820.000 | 15,280,000 |
| カメイ | 9,500 | 1,018.000 | 9,671,000 |
| スターゼン | 6,000 | 1,964.000 | 11,784,000 |
| 山善 | 30,800 | 939.000 | 28,921,200 |
| 椿本興業 | 1,900 | 3,580.000 | 6,802,000 |
| 住友商事 | 475,900 | 2,015.000 | 958,938,500 |
| 内田洋行 | 3,400 | 4,735.000 | 16,099,000 |
| 三菱商事 | 565,500 | 4,304.000 | 2,433,912,000 |
| 第一実業 | 3,600 | 3,665.000 | 13,194,000 |
| キャノンマーケティングジャパン | 19,100 | 2,740.000 | 52,334,000 |
| 西華産業 | 5,200 | 1,603.000 | 8,335,600 |

| | | | |
|---------------------|--------|-----------|------------|
| 佐藤商事 | 7,100 | 1,108.000 | 7,866,800 |
| 菱洋エレクトロ | 5,200 | 2,001.000 | 10,405,200 |
| 東京産業 | 8,500 | 698.000 | 5,933,000 |
| ユアサ商事 | 6,900 | 2,855.000 | 19,699,500 |
| 神鋼商事 | 2,000 | 3,255.000 | 6,510,000 |
| 阪和興業 | 14,800 | 3,065.000 | 45,362,000 |
| 正栄食品工業 | 4,900 | 3,960.000 | 19,404,000 |
| カナデン | 8,100 | 917.000 | 7,427,700 |
| 菱電商事 | 6,800 | 1,635.000 | 11,118,000 |
| 岩谷産業 | 18,200 | 5,060.000 | 92,092,000 |
| ナイス | 3,100 | 1,864.000 | 5,778,400 |
| 極東貿易 | 2,700 | 2,060.000 | 5,562,000 |
| アステナホールディングス | 13,500 | 423.000 | 5,710,500 |
| 三愛オブリ | 18,900 | 930.000 | 17,577,000 |
| 稲畑産業 | 16,300 | 2,082.000 | 33,936,600 |
| G S Iクレオス | 4,700 | 1,186.000 | 5,574,200 |
| 明和産業 | 7,500 | 885.000 | 6,637,500 |
| ワキタ | 17,000 | 1,046.000 | 17,782,000 |
| 東邦ホールディングス | 25,100 | 2,070.000 | 51,957,000 |
| サンゲツ | 20,200 | 1,523.000 | 30,764,600 |
| ミツウロコグループホールディングス | 11,800 | 1,006.000 | 11,870,800 |
| シナネンホールディングス | 3,200 | 3,330.000 | 10,656,000 |
| 伊藤忠エネクス | 15,800 | 1,051.000 | 16,605,800 |
| サンリオ | 23,100 | 2,740.000 | 63,294,000 |
| サンワ テクノス | 5,400 | 1,309.000 | 7,068,600 |
| リョーサン | 8,600 | 2,254.000 | 19,384,400 |
| 新光商事 | 13,300 | 933.000 | 12,408,900 |
| トーヨー | 5,400 | 1,135.000 | 6,129,000 |
| 三信電気 | 4,900 | 1,521.000 | 7,452,900 |
| 東陽テクニカ | 9,100 | 1,015.000 | 9,236,500 |
| モスフードサービス | 9,900 | 2,942.000 | 29,125,800 |
| 加賀電子 | 6,800 | 2,960.000 | 20,128,000 |
| ソーダニッカ | 9,900 | 669.000 | 6,623,100 |
| 立花エレテック | 6,500 | 1,610.000 | 10,465,000 |
| P A L T A C | 10,700 | 4,605.000 | 49,273,500 |
| 太平洋興発 | 7,300 | 608.000 | 4,438,400 |
| 西本Wismettacホールディングス | 2,200 | 2,597.000 | 5,713,400 |
| 国際紙パルプ商事 | 19,400 | 291.000 | 5,645,400 |
| ヤマタネ | 5,200 | 1,680.000 | 8,736,000 |
| 日鉄物産 | 5,100 | 5,170.000 | 26,367,000 |
| 泉州電業 | 2,200 | 5,040.000 | 11,088,000 |
| トラスコ中山 | 15,500 | 2,039.000 | 31,604,500 |
| オートバックスセブン | 26,300 | 1,346.000 | 35,399,800 |
| モリト | 7,800 | 749.000 | 5,842,200 |
| 加藤産業 | 10,600 | 3,315.000 | 35,139,000 |
| イノテック | 5,500 | 1,311.000 | 7,210,500 |
| イエローハット | 12,900 | 1,580.000 | 20,382,000 |

| | | | |
|--------------------|---------|-----------|-------------|
| J Kホールディングス | 6,800 | 1,085.000 | 7,378,000 |
| 日伝 | 6,500 | 2,169.000 | 14,098,500 |
| 杉本商事 | 4,200 | 2,026.000 | 8,509,200 |
| 因幡電機産業 | 19,400 | 2,518.000 | 48,849,200 |
| 東テク | 3,100 | 2,590.000 | 8,029,000 |
| ミスミグループ本社 | 94,600 | 3,225.000 | 305,085,000 |
| タキヒヨー | 4,400 | 1,074.000 | 4,725,600 |
| スズケン | 29,700 | 3,780.000 | 112,266,000 |
| ジェコス | 7,500 | 779.000 | 5,842,500 |
| ローソン | 16,900 | 4,780.000 | 80,782,000 |
| サンエー | 5,500 | 4,065.000 | 22,357,500 |
| カワチ薬品 | 5,900 | 2,045.000 | 12,065,500 |
| エービーシー・マート | 11,800 | 5,210.000 | 61,478,000 |
| アスクル | 17,200 | 1,602.000 | 27,554,400 |
| ゲオホールディングス | 10,300 | 1,257.000 | 12,947,100 |
| アダストリア | 8,200 | 2,111.000 | 17,310,200 |
| くら寿司 | 8,000 | 3,350.000 | 26,800,000 |
| キャンドウ | 3,900 | 2,300.000 | 8,970,000 |
| パルグループホールディングス | 7,400 | 1,386.000 | 10,256,400 |
| エディオン | 33,300 | 1,096.000 | 36,496,800 |
| サーラコーポレーション | 17,100 | 606.000 | 10,362,600 |
| ハローズ | 3,700 | 3,020.000 | 11,174,000 |
| フジオフードグループ本社 | 7,900 | 1,334.000 | 10,538,600 |
| あみやき亭 | 2,800 | 2,882.000 | 8,069,600 |
| 大黒天物産 | 2,500 | 4,780.000 | 11,950,000 |
| ハニーズホールディングス | 7,700 | 1,052.000 | 8,100,400 |
| アルペン | 6,000 | 1,915.000 | 11,490,000 |
| クオールホールディングス | 10,000 | 1,065.000 | 10,650,000 |
| ジンズホールディングス | 5,300 | 4,390.000 | 23,267,000 |
| ビックカメラ | 43,800 | 1,075.000 | 47,085,000 |
| D C Mホールディングス | 45,900 | 1,041.000 | 47,781,900 |
| MonotaRO | 95,500 | 2,276.000 | 217,358,000 |
| アークランドサービスホールディングス | 6,100 | 2,201.000 | 13,426,100 |
| J . フロント リテイリング | 90,700 | 954.000 | 86,527,800 |
| ドトール・日レスホールディングス | 12,700 | 1,463.000 | 18,580,100 |
| マツキヨココカラ&カンパニー | 46,400 | 4,245.000 | 196,968,000 |
| broncoビリー | 5,200 | 2,305.000 | 11,986,000 |
| Z O Z O | 52,200 | 3,210.000 | 167,562,000 |
| 物語コーポレーション | 3,800 | 5,240.000 | 19,912,000 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 132,100 | 953.000 | 125,891,300 |
| H a m e e | 3,900 | 1,079.000 | 4,208,100 |
| ウエルシアホールディングス | 40,100 | 2,553.000 | 102,375,300 |
| クリエイトS Dホールディングス | 10,800 | 2,900.000 | 31,320,000 |
| チムニー | 5,100 | 1,145.000 | 5,839,500 |
| シュッピン | 7,200 | 1,242.000 | 8,942,400 |
| オイシックス・ラ・大地 | 10,900 | 2,840.000 | 30,956,000 |
| ネクステージ | 15,300 | 1,915.000 | 29,299,500 |
| ジョイフル本田 | 22,400 | 1,507.000 | 33,756,800 |

| | | | |
|-------------------------------------|---------|------------|---------------|
| 鳥貴族ホールディングス | 3,700 | 1,790.000 | 6,623,000 |
| ホットランド | 7,800 | 1,336.000 | 10,420,800 |
| すかいらーくホールディングス | 97,800 | 1,532.000 | 149,829,600 |
| S F Pホールディングス | 5,500 | 1,391.000 | 7,650,500 |
| 綿半ホールディングス | 7,000 | 1,316.000 | 9,212,000 |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 20,600 | 1,073.000 | 22,103,800 |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 5,300 | 1,009.000 | 5,347,700 |
| B E E N O S | 4,400 | 1,899.000 | 8,355,600 |
| あさひ | 6,400 | 1,316.000 | 8,422,400 |
| 日本調剤 | 5,500 | 1,222.000 | 6,721,000 |
| コスモス薬品 | 7,600 | 11,600.000 | 88,160,000 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 295,500 | 5,674.000 | 1,676,667,000 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス | 40,700 | 769.000 | 31,298,300 |
| ツルハホールディングス | 16,500 | 6,490.000 | 107,085,000 |
| サンマルクホールディングス | 8,000 | 1,469.000 | 11,752,000 |
| トリドールホールディングス | 18,800 | 2,372.000 | 44,593,600 |
| T O K Y O B A S E | 9,200 | 342.000 | 3,146,400 |
| J Mホールディングス | 5,900 | 1,616.000 | 9,534,400 |
| アレンザホールディングス | 6,600 | 971.000 | 6,408,600 |
| 串カツ田中ホールディングス | 2,600 | 1,733.000 | 4,505,800 |
| バロックジャパンリミテッド | 7,700 | 777.000 | 5,982,900 |
| クスリのアオキホールディングス | 7,600 | 5,710.000 | 43,396,000 |
| F O O D & L I F E C O M P A N I E S | 44,200 | 3,110.000 | 137,462,000 |
| メディカルシステムネットワーク | 9,000 | 504.000 | 4,536,000 |
| ノジマ | 12,000 | 2,499.000 | 29,988,000 |
| カッパ・クリエイト | 11,800 | 1,322.000 | 15,599,600 |
| 良品計画 | 86,800 | 1,145.000 | 99,386,000 |
| アドヴァングループ | 9,900 | 809.000 | 8,009,100 |
| アルビス | 3,400 | 2,221.000 | 7,551,400 |
| G - 7ホールディングス | 8,900 | 1,547.000 | 13,768,300 |
| イオン北海道 | 13,500 | 1,025.000 | 13,837,500 |
| コジマ | 14,000 | 608.000 | 8,512,000 |
| コーナン商事 | 10,700 | 3,645.000 | 39,001,500 |
| エコス | 3,300 | 1,943.000 | 6,411,900 |
| ワタミ | 10,800 | 911.000 | 9,838,800 |
| 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 | 151,100 | 1,952.000 | 294,947,200 |
| 西松屋チェーン | 16,400 | 1,589.000 | 26,059,600 |
| ゼンショーホールディングス | 36,900 | 2,971.000 | 109,629,900 |
| 幸楽苑ホールディングス | 6,800 | 1,246.000 | 8,472,800 |
| サイゼリヤ | 11,500 | 2,344.000 | 26,956,000 |
| V Tホールディングス | 28,400 | 450.000 | 12,780,000 |
| フジ・コーポレーション | 5,600 | 1,076.000 | 6,025,600 |
| ユナイテッドアローズ | 8,300 | 1,771.000 | 14,699,300 |
| ハイデイ日高 | 10,700 | 1,821.000 | 19,484,700 |

| | | | |
|-------------------|---------|------------|-------------|
| コロワイド | 31,400 | 1,647.000 | 51,715,800 |
| 壱番屋 | 5,300 | 4,720.000 | 25,016,000 |
| スギホールディングス | 15,200 | 5,450.000 | 82,840,000 |
| 薬王堂ホールディングス | 4,000 | 1,738.000 | 6,952,000 |
| スクロール | 12,300 | 788.000 | 9,692,400 |
| ヨンドシーホールディングス | 7,700 | 1,665.000 | 12,820,500 |
| 木曽路 | 10,700 | 2,034.000 | 21,763,800 |
| S R Sホールディングス | 14,900 | 803.000 | 11,964,700 |
| 千趣会 | 17,900 | 393.000 | 7,034,700 |
| リテールパートナーズ | 9,800 | 1,113.000 | 10,907,400 |
| ケーヨー | 15,800 | 895.000 | 14,141,000 |
| 上新電機 | 8,200 | 1,943.000 | 15,932,600 |
| 日本瓦斯 | 36,900 | 1,517.000 | 55,977,300 |
| ロイヤルホールディングス | 13,300 | 2,050.000 | 27,265,000 |
| いなげや | 9,700 | 1,345.000 | 13,046,500 |
| チヨダ | 12,200 | 695.000 | 8,479,000 |
| ライフコーポレーション | 7,000 | 2,878.000 | 20,146,000 |
| リンガーハット | 10,000 | 2,213.000 | 22,130,000 |
| Mr Max HD | 12,200 | 587.000 | 7,161,400 |
| A O K Iホールディングス | 16,300 | 598.000 | 9,747,400 |
| オークワ | 12,900 | 859.000 | 11,081,100 |
| コメリ | 11,400 | 2,580.000 | 29,412,000 |
| 青山商事 | 17,700 | 655.000 | 11,593,500 |
| しまむら | 8,800 | 11,210.000 | 98,648,000 |
| 高島屋 | 55,900 | 1,160.000 | 64,844,000 |
| 松屋 | 17,000 | 716.000 | 12,172,000 |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 34,800 | 858.000 | 29,858,400 |
| 近鉄百貨店 | 3,500 | 2,555.000 | 8,942,500 |
| 丸井グループ | 59,600 | 2,229.000 | 132,848,400 |
| アクシアル リテイリング | 5,900 | 3,360.000 | 19,824,000 |
| イオン | 290,700 | 2,483.500 | 721,953,450 |
| イズミ | 13,900 | 2,746.000 | 38,169,400 |
| 平和堂 | 13,400 | 1,939.000 | 25,982,600 |
| フジ | 20,600 | 2,209.000 | 45,505,400 |
| ヤオコー | 8,700 | 6,710.000 | 58,377,000 |
| ゼビオホールディングス | 11,400 | 902.000 | 10,282,800 |
| ケーズホールディングス | 69,400 | 1,260.000 | 87,444,000 |
| 日産東京販売ホールディングス | 22,300 | 219.000 | 4,883,700 |
| Genky Drug Stores | 3,400 | 3,630.000 | 12,342,000 |
| ブックオフグループホールディングス | 5,600 | 999.000 | 5,594,400 |
| ギフトホールディングス | 1,800 | 2,342.000 | 4,215,600 |
| アインホールディングス | 10,200 | 5,750.000 | 58,650,000 |
| 元気寿司 | 2,900 | 2,457.000 | 7,125,300 |
| ヤマダホールディングス | 274,900 | 376.000 | 103,362,400 |
| アークランドサカモト | 12,000 | 1,482.000 | 17,784,000 |
| ニトリホールディングス | 29,900 | 13,535.000 | 404,696,500 |
| グルメ杵屋 | 10,800 | 995.000 | 10,746,000 |
| 吉野家ホールディングス | 26,500 | 2,333.000 | 61,824,500 |

| | | | |
|---------------------|-----------|------------|---------------|
| 松屋フーズホールディングス | 3,800 | 3,685.000 | 14,003,000 |
| サガミホールディングス | 13,900 | 1,093.000 | 15,192,700 |
| 関西フードマーケット | 6,300 | 1,252.000 | 7,887,600 |
| 王将フードサービス | 4,900 | 5,980.000 | 29,302,000 |
| プレナス | 8,700 | 1,869.000 | 16,260,300 |
| ミニストップ | 7,000 | 1,380.000 | 9,660,000 |
| アークス | 13,900 | 2,002.000 | 27,827,800 |
| バローホールディングス | 16,200 | 2,017.000 | 32,675,400 |
| ベルク | 3,400 | 5,290.000 | 17,986,000 |
| ファーストリテイリング | 10,100 | 61,240.000 | 618,524,000 |
| サンドラッグ | 28,600 | 2,957.000 | 84,570,200 |
| ベルーナ | 17,100 | 724.000 | 12,380,400 |
| めぶきフィナンシャルグループ | 390,200 | 255.000 | 99,501,000 |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 9,800 | 1,720.000 | 16,856,000 |
| 九州フィナンシャルグループ | 150,200 | 390.000 | 58,578,000 |
| ゆうちょ銀行 | 178,300 | 981.000 | 174,912,300 |
| 富山第一銀行 | 9,800 | 314.000 | 3,077,200 |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 429,200 | 468.000 | 200,865,600 |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 49,600 | 776.000 | 38,489,600 |
| 三十三フィナンシャルグループ | 7,700 | 1,418.000 | 10,918,600 |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 12,400 | 2,488.000 | 30,851,200 |
| ひろぎんホールディングス | 111,700 | 635.000 | 70,929,500 |
| おきなわフィナンシャルグループ | 7,000 | 2,140.000 | 14,980,000 |
| 十六フィナンシャルグループ | 10,500 | 2,124.000 | 22,302,000 |
| 北國フィナンシャルホールディングス | 7,400 | 3,315.000 | 24,531,000 |
| プロクレアホールディングス | 7,600 | 1,754.000 | 13,330,400 |
| 新生銀行 | 49,400 | 2,262.000 | 111,742,800 |
| あおぞら銀行 | 41,500 | 2,569.000 | 106,613,500 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 4,741,100 | 744.200 | 3,528,326,620 |
| りそなホールディングス | 857,600 | 560.200 | 480,427,520 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 142,800 | 3,987.000 | 569,343,600 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 523,400 | 3,896.000 | 2,039,166,400 |
| 千葉銀行 | 251,700 | 749.000 | 188,523,300 |
| 群馬銀行 | 140,200 | 362.000 | 50,752,400 |
| 武蔵野銀行 | 11,600 | 1,748.000 | 20,276,800 |
| 筑波銀行 | 26,300 | 193.000 | 5,075,900 |
| 七十七銀行 | 23,700 | 1,559.000 | 36,948,300 |
| 秋田銀行 | 4,300 | 1,664.000 | 7,155,200 |
| 山形銀行 | 10,600 | 838.000 | 8,882,800 |
| 岩手銀行 | 6,000 | 1,851.000 | 11,106,000 |
| 東邦銀行 | 73,100 | 201.000 | 14,693,100 |
| 東北銀行 | 2,000 | 990.000 | 1,980,000 |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 63,300 | 2,373.000 | 150,210,900 |
| 静岡銀行 | 183,800 | 839.000 | 154,208,200 |
| スルガ銀行 | 67,500 | 406.000 | 27,405,000 |
| 八十二銀行 | 168,500 | 418.000 | 70,433,000 |
| 山梨中央銀行 | 10,800 | 970.000 | 10,476,000 |

| | | | |
|----------------------|-----------|-----------|---------------|
| 大垣共立銀行 | 15,100 | 1,889.000 | 28,523,900 |
| 福井銀行 | 8,000 | 1,347.000 | 10,776,000 |
| 清水銀行 | 4,400 | 1,557.000 | 6,850,800 |
| 富山銀行 | 2,400 | 2,043.000 | 4,903,200 |
| 滋賀銀行 | 14,300 | 2,350.000 | 33,605,000 |
| 南都銀行 | 12,200 | 1,997.000 | 24,363,400 |
| 百五銀行 | 73,900 | 338.000 | 24,978,200 |
| 京都銀行 | 27,000 | 5,330.000 | 143,910,000 |
| 紀陽銀行 | 25,800 | 1,394.000 | 35,965,200 |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 47,600 | 850.000 | 40,460,000 |
| 山陰合同銀行 | 45,900 | 642.000 | 29,467,800 |
| 中国銀行 | 59,800 | 926.000 | 55,374,800 |
| 伊予銀行 | 99,300 | 619.000 | 61,466,700 |
| 百十四銀行 | 9,200 | 1,656.000 | 15,235,200 |
| 四国銀行 | 13,400 | 757.000 | 10,143,800 |
| 阿波銀行 | 11,800 | 2,122.000 | 25,039,600 |
| 大分銀行 | 5,500 | 1,816.000 | 9,988,000 |
| 宮崎銀行 | 5,400 | 2,034.000 | 10,983,600 |
| 佐賀銀行 | 4,500 | 1,409.000 | 6,340,500 |
| 琉球銀行 | 18,200 | 790.000 | 14,378,000 |
| セブン銀行 | 224,400 | 238.000 | 53,407,200 |
| みずほフィナンシャルグループ | 967,400 | 1,565.500 | 1,514,464,700 |
| 山口フィナンシャルグループ | 88,700 | 708.000 | 62,799,600 |
| 名古屋銀行 | 5,800 | 2,916.000 | 16,912,800 |
| 北洋銀行 | 115,700 | 241.000 | 27,883,700 |
| 愛知銀行 | 2,900 | 4,565.000 | 13,238,500 |
| 中京銀行 | 4,000 | 1,672.000 | 6,688,000 |
| 愛媛銀行 | 13,100 | 891.000 | 11,672,100 |
| 京葉銀行 | 33,500 | 490.000 | 16,415,000 |
| 栃木銀行 | 43,200 | 236.000 | 10,195,200 |
| 東和銀行 | 17,400 | 525.000 | 9,135,000 |
| トモニホールディングス | 60,300 | 319.000 | 19,235,700 |
| フィデアホールディングス | 8,500 | 1,275.000 | 10,837,500 |
| 池田泉州ホールディングス | 94,200 | 174.000 | 16,390,800 |
| F P G | 27,600 | 732.000 | 20,203,200 |
| ジャパンインベストメントアドバイザー | 6,900 | 1,161.000 | 8,010,900 |
| S B Iホールディングス | 92,700 | 2,865.000 | 265,585,500 |
| ジャフコ グループ | 29,300 | 1,587.000 | 46,499,100 |
| 大和証券グループ本社 | 566,100 | 637.700 | 361,001,970 |
| 野村ホールディングス | 1,153,500 | 504.400 | 581,825,400 |
| 岡三証券グループ | 62,200 | 356.000 | 22,143,200 |
| 丸三証券 | 22,100 | 473.000 | 10,453,300 |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 85,100 | 399.000 | 33,954,900 |
| 水戸証券 | 26,100 | 261.000 | 6,812,100 |
| いちよし証券 | 17,300 | 583.000 | 10,085,900 |
| 松井証券 | 37,500 | 828.000 | 31,050,000 |
| マネックスグループ | 62,000 | 606.000 | 37,572,000 |

| | | | |
|-----------------------------------|---------|-----------|---------------|
| 極東証券 | 10,300 | 698.000 | 7,189,400 |
| 岩井コスモホールディングス | 8,300 | 1,249.000 | 10,366,700 |
| アイザワ証券グループ | 14,200 | 675.000 | 9,585,000 |
| スパークス・グループ | 41,100 | 261.000 | 10,727,100 |
| かんぼ生命保険 | 76,300 | 2,096.000 | 159,924,800 |
| S O M P Oホールディングス | 123,900 | 5,129.000 | 635,483,100 |
| アニコム ホールディングス | 26,500 | 604.000 | 16,006,000 |
| M S & A Dインシュアランスグループ ホールディングス | 169,100 | 3,781.000 | 639,367,100 |
| 第一生命ホールディングス | 371,800 | 2,527.000 | 939,538,600 |
| 東京海上ホールディングス | 249,000 | 6,787.000 | 1,689,963,000 |
| T & Dホールディングス | 195,800 | 1,639.000 | 320,916,200 |
| アドバンスクリエイト | 5,500 | 907.000 | 4,988,500 |
| 全国保証 | 18,200 | 4,475.000 | 81,445,000 |
| ジェイリース | 2,900 | 1,566.000 | 4,541,400 |
| 日本モーゲージサービス | 4,100 | 953.000 | 3,907,300 |
| アルヒ | 12,400 | 1,009.000 | 12,511,600 |
| プレミアグループ | 4,200 | 3,785.000 | 15,897,000 |
| ネットプロテクションズホールディング ス | 18,200 | 675.000 | 12,285,000 |
| クレディセゾン | 48,200 | 1,488.000 | 71,721,600 |
| 芙蓉総合リース | 7,800 | 7,020.000 | 54,756,000 |
| みずほリース | 11,700 | 2,994.000 | 35,029,800 |
| 東京センチュリー | 14,500 | 4,000.000 | 58,000,000 |
| 日本証券金融 | 31,600 | 926.000 | 29,261,600 |
| アイフル | 129,000 | 371.000 | 47,859,000 |
| リコーリース | 7,100 | 3,350.000 | 23,785,000 |
| イオンフィナンシャルサービス | 40,500 | 1,184.000 | 47,952,000 |
| アコム | 151,100 | 335.000 | 50,618,500 |
| ジャックス | 8,600 | 3,260.000 | 28,036,000 |
| オリエントコーポレーション | 208,600 | 123.000 | 25,657,800 |
| オリックス | 449,500 | 2,338.500 | 1,051,155,750 |
| 三菱H Cキャピタル | 277,000 | 578.000 | 160,106,000 |
| 日本取引所グループ | 188,700 | 2,014.000 | 380,041,800 |
| イー・ギャランティ | 11,300 | 2,129.000 | 24,057,700 |
| N E Cキャピタルソリューション | 4,000 | 2,060.000 | 8,240,000 |
| いちご | 89,600 | 287.000 | 25,715,200 |
| 日本駐車場開発 | 101,600 | 154.000 | 15,646,400 |
| スター・マイカ・ホールディングス | 6,800 | 1,556.000 | 10,580,800 |
| S R Eホールディングス | 2,600 | 2,891.000 | 7,516,600 |
| ヒューリック | 180,900 | 1,087.000 | 196,638,300 |
| 三栄建築設計 | 4,300 | 1,661.000 | 7,142,300 |
| 野村不動産ホールディングス | 39,000 | 2,968.000 | 115,752,000 |
| 三重交通グループホールディングス | 20,700 | 456.000 | 9,439,200 |
| サムティ | 10,100 | 2,101.000 | 21,220,100 |
| ディア・ライフ | 13,800 | 506.000 | 6,982,800 |
| 地主 | 6,500 | 1,871.000 | 12,161,500 |
| プレサンスコーポレーション | 11,200 | 1,542.000 | 17,270,400 |

| | | | |
|---------------------|---------|-----------|-------------|
| 日本管理センター | 6,700 | 979.000 | 6,559,300 |
| フージャースホールディングス | 13,300 | 634.000 | 8,432,200 |
| オープンハウスグループ | 24,000 | 4,995.000 | 119,880,000 |
| 東急不動産ホールディングス | 223,200 | 667.000 | 148,874,400 |
| 飯田グループホールディングス | 63,000 | 2,110.000 | 132,930,000 |
| And Doホールディングス | 5,700 | 897.000 | 5,112,900 |
| シーアールイー | 4,100 | 1,621.000 | 6,646,100 |
| ケイアイスター不動産 | 3,900 | 5,380.000 | 20,982,000 |
| グッドコムアセット | 5,500 | 1,073.000 | 5,901,500 |
| ジェイ・エス・ピー | 2,100 | 3,365.000 | 7,066,500 |
| パーク24 | 41,000 | 1,829.000 | 74,989,000 |
| パラカ | 4,400 | 1,711.000 | 7,528,400 |
| 宮越ホールディングス | 4,500 | 839.000 | 3,775,500 |
| 三井不動産 | 344,400 | 2,677.000 | 921,958,800 |
| 三菱地所 | 497,700 | 1,857.500 | 924,477,750 |
| 平和不動産 | 13,500 | 4,000.000 | 54,000,000 |
| 東京建物 | 74,800 | 1,791.000 | 133,966,800 |
| 京阪神ビルディング | 13,200 | 1,316.000 | 17,371,200 |
| 住友不動産 | 159,000 | 3,385.000 | 538,215,000 |
| テーオーシー | 16,900 | 668.000 | 11,289,200 |
| 東京楽天地 | 1,600 | 3,930.000 | 6,288,000 |
| スターツコーポレーション | 11,200 | 2,324.000 | 26,028,800 |
| フジ住宅 | 12,900 | 613.000 | 7,907,700 |
| 空港施設 | 13,200 | 532.000 | 7,022,400 |
| ゴールドクレスト | 7,700 | 1,653.000 | 12,728,100 |
| 日神グループホールディングス | 17,300 | 455.000 | 7,871,500 |
| 日本エスコン | 16,100 | 800.000 | 12,880,000 |
| タカラレーベン | 41,800 | 296.000 | 12,372,800 |
| A V A N T I A | 7,900 | 830.000 | 6,557,000 |
| イオンモール | 38,400 | 1,559.000 | 59,865,600 |
| カチタス | 19,500 | 3,170.000 | 61,815,000 |
| トーセイ | 12,200 | 1,073.000 | 13,090,600 |
| サンフロンティア不動産 | 12,800 | 1,046.000 | 13,388,800 |
| F Jネクストホールディングス | 9,500 | 988.000 | 9,386,000 |
| 日本空港ビルデング | 29,000 | 5,420.000 | 157,180,000 |
| 日本工営 | 4,900 | 2,824.000 | 13,837,600 |
| L I F U L L | 30,100 | 227.000 | 6,832,700 |
| ミクシィ | 17,000 | 2,256.000 | 38,352,000 |
| ジェイエイシーリクルートメント | 6,600 | 1,800.000 | 11,880,000 |
| 日本M & Aセンターホールディングス | 120,700 | 1,649.000 | 199,034,300 |
| メンバーズ | 2,600 | 3,220.000 | 8,372,000 |
| UTグループ | 10,600 | 2,928.000 | 31,036,800 |
| アイティメディア | 4,300 | 1,688.000 | 7,258,400 |
| E・Jホールディングス | 5,200 | 1,137.000 | 5,912,400 |
| 夢真ビーネックスグループ | 23,900 | 1,512.000 | 36,136,800 |
| コシダカホールディングス | 20,500 | 778.000 | 15,949,000 |
| パソナグループ | 7,900 | 2,061.000 | 16,281,900 |
| リンクアンドモチベーション | 18,800 | 466.000 | 8,760,800 |

| | | | |
|----------------------|---------|------------|---------------|
| エス・エム・エス | 25,200 | 3,160.000 | 79,632,000 |
| パーソルホールディングス | 73,200 | 2,570.000 | 188,124,000 |
| リニカル | 7,000 | 793.000 | 5,551,000 |
| クックパッド | 30,300 | 279.000 | 8,453,700 |
| スタジオアリス | 4,200 | 2,274.000 | 9,550,800 |
| シミックホールディングス | 5,400 | 1,487.000 | 8,029,800 |
| 総合警備保障 | 29,300 | 3,570.000 | 104,601,000 |
| カカクコム | 54,100 | 2,731.000 | 147,747,100 |
| アイロムグループ | 3,500 | 1,984.000 | 6,944,000 |
| ルネサンス | 6,700 | 925.000 | 6,197,500 |
| ディップ | 12,900 | 4,100.000 | 52,890,000 |
| デジタルホールディングス | 5,700 | 1,438.000 | 8,196,600 |
| 新日本科学 | 9,700 | 1,427.000 | 13,841,900 |
| ベネフィット・ワン | 26,900 | 2,070.000 | 55,683,000 |
| エムスリー | 129,300 | 4,394.000 | 568,144,200 |
| アウトソーシング | 42,300 | 1,267.000 | 53,594,100 |
| ウェルネット | 15,500 | 488.000 | 7,564,000 |
| ワールドホールディングス | 3,300 | 2,378.000 | 7,847,400 |
| ディー・エヌ・エー | 28,500 | 1,870.000 | 53,295,000 |
| 博報堂D Yホールディングス | 102,000 | 1,525.000 | 155,550,000 |
| ぐるなび | 16,300 | 436.000 | 7,106,800 |
| タカミヤ | 15,600 | 344.000 | 5,366,400 |
| ジャパンベストレスキューシステム | 6,000 | 978.000 | 5,868,000 |
| ファンコミュニケーションズ | 24,200 | 429.000 | 10,381,800 |
| ライク | 3,200 | 2,144.000 | 6,860,800 |
| エスプール | 21,000 | 1,377.000 | 28,917,000 |
| WDBホールディングス | 3,700 | 2,720.000 | 10,064,000 |
| アドウェイズ | 12,000 | 805.000 | 9,660,000 |
| バリューコマース | 5,700 | 3,605.000 | 20,548,500 |
| インフォマート | 81,600 | 659.000 | 53,774,400 |
| J Pホールディングス | 27,600 | 210.000 | 5,796,000 |
| プレステージ・インターナショナル | 28,400 | 624.000 | 17,721,600 |
| アミューズ | 4,800 | 1,924.000 | 9,235,200 |
| ドリームインキュベータ | 2,700 | 1,908.000 | 5,151,600 |
| クイック | 6,100 | 1,509.000 | 9,204,900 |
| 電通グループ | 75,500 | 4,750.000 | 358,625,000 |
| ぴあ | 2,900 | 3,155.000 | 9,149,500 |
| イオンファンタジー | 3,800 | 2,206.000 | 8,382,800 |
| シーティーエス | 10,000 | 844.000 | 8,440,000 |
| H . U . グループホールディングス | 19,500 | 2,896.000 | 56,472,000 |
| アルプス技研 | 7,300 | 1,943.000 | 14,183,900 |
| 日本空調サービス | 10,600 | 794.000 | 8,416,400 |
| オリエンタルランド | 86,600 | 22,490.000 | 1,947,634,000 |
| ダスキン | 17,600 | 2,734.000 | 48,118,400 |
| 明光ネットワークジャパン | 13,700 | 569.000 | 7,795,300 |
| ファルコホールディングス | 4,500 | 2,100.000 | 9,450,000 |
| ラウンドワン | 20,700 | 1,445.000 | 29,911,500 |
| リゾートトラスト | 34,000 | 2,167.000 | 73,678,000 |

| | | | |
|------------------------|---------|------------|---------------|
| ビー・エム・エル | 9,400 | 3,275.000 | 30,785,000 |
| りらいあコミュニケーションズ | 11,900 | 1,041.000 | 12,387,900 |
| リソー教育 | 36,500 | 370.000 | 13,505,000 |
| ユー・エス・エス | 82,300 | 2,119.000 | 174,393,700 |
| 東京個別指導学院 | 9,200 | 571.000 | 5,253,200 |
| サイバーエージェント | 180,900 | 1,370.000 | 247,833,000 |
| 楽天グループ | 377,100 | 944.000 | 355,982,400 |
| クリーク・アンド・リバー社 | 4,500 | 2,125.000 | 9,562,500 |
| モーニングスター | 16,200 | 545.000 | 8,829,000 |
| 山田コンサルティンググループ | 5,000 | 1,183.000 | 5,915,000 |
| セントラルスポーツ | 3,900 | 2,361.000 | 9,207,900 |
| フルキャストホールディングス | 6,400 | 2,412.000 | 15,436,800 |
| エン・ジャパン | 11,800 | 3,165.000 | 37,347,000 |
| テクノプロ・ホールディングス | 44,000 | 3,230.000 | 142,120,000 |
| アイ・アールジャパンホールディングス | 3,600 | 4,305.000 | 15,498,000 |
| Ke e P e r 技研 | 5,100 | 2,634.000 | 13,433,400 |
| Gunosy | 5,200 | 1,135.000 | 5,902,000 |
| イー・ガーディアン | 3,400 | 2,969.000 | 10,094,600 |
| ジャパンマテリアル | 22,500 | 1,888.000 | 42,480,000 |
| ベクトル | 11,200 | 1,286.000 | 14,403,200 |
| チャーム・ケア・コーポレーション | 6,100 | 1,225.000 | 7,472,500 |
| キャリアリンク | 3,300 | 1,403.000 | 4,629,900 |
| I B J | 8,000 | 722.000 | 5,776,000 |
| アサンテ | 5,200 | 1,442.000 | 7,498,400 |
| バリューHR | 7,000 | 1,366.000 | 9,562,000 |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 6,100 | 3,990.000 | 24,339,000 |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 3,900 | 1,134.000 | 4,422,600 |
| E R Iホールディングス | 2,900 | 1,340.000 | 3,886,000 |
| シグマクシス・ホールディングス | 9,600 | 1,060.000 | 10,176,000 |
| ウィルグループ | 6,100 | 1,103.000 | 6,728,300 |
| メドピア | 5,800 | 3,200.000 | 18,560,000 |
| リクルートホールディングス | 565,300 | 4,877.000 | 2,756,968,100 |
| エラン | 12,100 | 1,009.000 | 12,208,900 |
| 日本郵政 | 955,900 | 891.500 | 852,184,850 |
| ベルシステム24ホールディングス | 10,800 | 1,499.000 | 16,189,200 |
| 鎌倉新書 | 11,000 | 621.000 | 6,831,000 |
| エアトリ | 5,000 | 3,280.000 | 16,400,000 |
| アトラエ | 5,600 | 1,812.000 | 10,147,200 |
| ストライク | 3,300 | 4,060.000 | 13,398,000 |
| ソラスト | 18,400 | 854.000 | 15,713,600 |
| インソース | 7,400 | 2,337.000 | 17,293,800 |
| ベイカレント・コンサルティング | 5,200 | 40,500.000 | 210,600,000 |
| Orchestra Holdings | 1,800 | 2,621.000 | 4,717,800 |
| ジャパンエレベーターサービスホールディングス | 23,300 | 1,581.000 | 36,837,300 |
| ウェルビー | 6,000 | 978.000 | 5,868,000 |
| エル・ティー・エス | 1,500 | 2,898.000 | 4,347,000 |

| | | | | |
|---------------------------------|------------|-----------|-----------------|--|
| ミダックホールディングス | 3,600 | 2,168.000 | 7,804,800 | |
| 日総工産 | 7,300 | 667.000 | 4,869,100 | |
| キュービーネットホールディングス | 4,500 | 1,378.000 | 6,201,000 | |
| R P Aホールディングス | 14,400 | 352.000 | 5,068,800 | |
| スプリックス | 3,000 | 1,202.000 | 3,606,000 | |
| マネジメントソリューションズ | 3,800 | 4,665.000 | 17,727,000 | |
| カーブスホールディングス | 21,000 | 755.000 | 15,855,000 | |
| F A S T F I T N E S S J A P A N | 1,500 | 1,833.000 | 2,749,500 | |
| ダイレクトマーケティングミックス | 9,400 | 1,572.000 | 14,776,800 | |
| ポピンズ | 2,200 | 2,025.000 | 4,455,000 | |
| L I T A L I C O | 6,200 | 2,703.000 | 16,758,600 | |
| アドバンテッジリスクマネジメント | 6,000 | 513.000 | 3,078,000 | |
| リロググループ | 40,600 | 1,872.000 | 76,003,200 | |
| 東祥 | 6,400 | 1,698.000 | 10,867,200 | |
| T R Eホールディングス | 10,300 | 2,010.000 | 20,703,000 | |
| 人・夢・技術グループ | 3,600 | 2,083.000 | 7,498,800 | |
| エイチ・アイ・エス | 16,500 | 2,251.000 | 37,141,500 | |
| ラックランド | 3,600 | 2,939.000 | 10,580,400 | |
| 共立メンテナンス | 13,000 | 4,630.000 | 60,190,000 | |
| イチネンホールディングス | 8,500 | 1,232.000 | 10,472,000 | |
| 建設技術研究所 | 4,900 | 2,311.000 | 11,323,900 | |
| 燦ホールディングス | 4,400 | 1,516.000 | 6,670,400 | |
| 東京テアトル | 6,100 | 1,224.000 | 7,466,400 | |
| ナガワ | 2,300 | 9,110.000 | 20,953,000 | |
| 東京都競馬 | 5,600 | 4,415.000 | 24,724,000 | |
| カナモト | 12,700 | 1,932.000 | 24,536,400 | |
| 西尾レントオール | 6,700 | 2,725.000 | 18,257,500 | |
| トランス・コスモス | 9,400 | 3,090.000 | 29,046,000 | |
| 乃村工藝社 | 31,600 | 874.000 | 27,618,400 | |
| 日本管財 | 7,600 | 2,756.000 | 20,945,600 | |
| トーカイ | 6,900 | 1,681.000 | 11,598,900 | |
| セコム | 72,200 | 8,928.000 | 644,601,600 | |
| セントラル警備保障 | 4,000 | 2,054.000 | 8,216,000 | |
| 丹青社 | 16,300 | 783.000 | 12,762,900 | |
| メイテック | 9,100 | 6,890.000 | 62,699,000 | |
| 応用地質 | 8,300 | 1,947.000 | 16,160,100 | |
| 船井総研ホールディングス | 15,200 | 2,144.000 | 32,588,800 | |
| オオバ | 8,100 | 784.000 | 6,350,400 | |
| ベネッセホールディングス | 25,100 | 2,212.000 | 55,521,200 | |
| イオンディライト | 9,000 | 2,696.000 | 24,264,000 | |
| ダイセキ | 13,300 | 4,500.000 | 59,850,000 | |
| 合 計 | 82,877,500 | | 196,699,150,170 | |

(b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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)」に記載しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

| | (2021年4月26日現在) | (2022年4月26日現在) |
|--------------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 1,942,451,000 | 3,823,150,343 |
| 金銭信託 | 302,937,580 | 3,335,998 |
| コール・ローン | 695,167,542 | 168,265,306 |
| 株式 | 283,850,458,884 | 367,861,655,320 |
| 投資証券 | 6,801,473,940 | 10,140,612,029 |
| 派生商品評価勘定 | 59,535,179 | 23,850,169 |
| 未収入金 | 45,617,843 | 9,336,624 |
| 未収配当金 | 309,276,064 | 411,028,428 |
| 差入委託証拠金 | 1,650,022,983 | 1,745,293,514 |
| 流動資産合計 | 295,656,941,015 | 384,186,527,731 |
| 資産合計 | 295,656,941,015 | 384,186,527,731 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 372,922 | 134,319,687 |
| 前受金 | 59,485,972 | - |
| 未払解約金 | 1,041,495,833 | 600,406,328 |
| 未払利息 | 2,012 | - |
| その他未払費用 | 20,043 | 1,452 |
| 流動負債合計 | 1,101,376,782 | 734,727,467 |
| 負債合計 | 1,101,376,782 | 734,727,467 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 57,943,987,779 | 63,556,720,108 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 236,611,576,454 | 319,895,080,156 |
| 元本等合計 | 294,555,564,233 | 383,451,800,264 |
| 純資産合計 | 294,555,564,233 | 383,451,800,264 |
| 負債純資産合計 | 295,656,941,015 | 384,186,527,731 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
|--------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 |

| | |
|----------------------------|---|
| | <p>(2) 金融商品取引所等の上場されていない有価証券</p> <p>金融商品取引所等の上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2021年4月26日現在) | (2022年4月26日現在) |
|-----------------------|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 57,943,987,779口 | 63,556,720,108口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 5.0835円 (1万口当たりの純資産額50,835円) | 1口当たり純資産額 6.0332円 (1万口当たりの純資産額60,332円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
|-----------------|--|
| 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、当ファンドの信託約款に従い、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> |

| | |
|-------------------------------|---|
| <p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク</p> | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |
| <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っております。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |

| | |
|----------------------------|--|
| 4. 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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |
|----------------------------|--|

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2022年4月26日現在) |
|--------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(株式、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|----------------|---------------|-----------|---------------|------------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | SPMINI 2106 | 2,876,715,575 | - | 2,925,410,377 | 48,694,802 |
| | SPI200 2106 | 145,020,124 | - | 146,917,795 | 1,897,671 |
| | FTSE 2106 | 174,694,085 | - | 175,703,670 | 1,009,585 |
| | DJ EUR 2106 | 618,765,224 | - | 626,649,138 | 7,883,914 |
| | 小計 | 3,815,195,008 | - | 3,874,680,980 | 59,485,972 |
| | 合計 | 3,815,195,008 | - | 3,874,680,980 | 59,485,972 |

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|--------------|------------|-------------|-----------|-------------|--------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 為替予約取引 売建 | アメリカ・ドル | 169,433,700 | - | 169,385,320 | 48,380 |
| | イギリス・ポンド | 8,965,740 | - | 8,987,382 | 21,642 |
| | イスラエル・シェケル | 330,160 | - | 331,894 | 1,734 |
| | | | | | |

| | | | | | |
|-------------------|-----------------|-------------|---|-------------|---------|
| 市場取引 以外の取 引 | オーストラリア・ ドル | 4,159,600 | - | 4,184,500 | 24,900 |
| | カナダ・ドル | 15,563,400 | - | 15,580,614 | 17,214 |
| | シンガポール・ド ル | 811,440 | - | 813,690 | 2,250 |
| | スイス・フラン | 11,771,100 | - | 11,813,200 | 42,100 |
| | スウェーデン・ク ローナ | 2,690,100 | - | 2,702,700 | 12,600 |
| | デンマーク・ク ローネ | 1,046,580 | - | 1,053,600 | 7,020 |
| | ニュージーラン ド・ドル | 772,557 | - | 776,893 | 4,336 |
| | ノルウェー・ク ローネ | 387,150 | - | 390,600 | 3,450 |
| | ユーロ | 50,680,070 | - | 50,915,339 | 235,269 |
| | 香港・ドル | 834,420 | - | 834,000 | 420 |
| | 小計 | 267,446,017 | - | 267,769,732 | 323,715 |
| | 合 計 | 267,446,017 | - | 267,769,732 | 323,715 |

(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区 分 | 種 類 | 契 約 額 等 | | 時 価 | 評 価 損 益 |
|------|----------------------------|---------------|--------------|---------------|-------------|
| | | | う ち 1 年 超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | S&P 500 EMINI FUT JUN22 | 4,122,572,256 | - | 4,025,998,515 | 96,573,741 |
| | SPI 200 FUTURES JUN22 | 205,615,274 | - | 201,609,513 | 4,005,761 |
| | FTSE 100 IDX FUT JUN22 | 241,938,385 | - | 239,617,512 | 2,320,873 |
| | EURO STOXX 50 JUN22 | 756,038,201 | - | 741,472,116 | 14,566,085 |
| | 小計 | 5,326,164,116 | - | 5,208,697,656 | 117,466,460 |
| | 合 計 | 5,326,164,116 | - | 5,208,697,656 | 117,466,460 |

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に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。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

| 区 分 | 種 類 | 契 約 額 等 | | 時 価 | 評 価 損 益 |
|-------------------|-----------------|-------------|-----------|-------------|-----------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 以外の取 引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | | | | |
| | スウェーデン・ク ローナ | 135,101 | - | 131,500 | 3,601 |
| | 小計 | 135,101 | - | 131,500 | 3,601 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 448,816,113 | - | 446,564,421 | 2,251,692 |
| | カナダ・ドル | 25,292,154 | - | 25,049,920 | 242,234 |
| | オーストラリア・ ドル | 13,173,611 | - | 12,847,550 | 326,061 |
| | 香港・ドル | 6,537,970 | - | 6,503,796 | 34,174 |
| | シンガポール・ド ル | 3,743,098 | - | 3,718,220 | 24,878 |
| | ニュージーラン ド・ドル | 863,930 | - | 845,570 | 18,360 |
| | イギリス・ポンド | 42,843,978 | - | 42,284,300 | 559,678 |
| | イスラエル・シュ ケル | 1,570,470 | - | 1,554,316 | 16,154 |
| | スイス・フラン | 45,708,002 | - | 45,326,920 | 381,082 |
| | デンマーク・ク ローネ | 5,753,758 | - | 5,704,369 | 49,389 |
| | ノルウェー・ク ローネ | 3,111,615 | - | 3,081,875 | 29,740 |
| | スウェーデン・ク ローナ | 6,680,540 | - | 6,575,000 | 105,540 |
| | ユーロ | 168,588,696 | - | 165,627,135 | 2,961,561 |
| | 小計 | 772,683,935 | - | 765,683,392 | 7,000,543 |
| | 合 計 | 772,819,036 | - | 765,814,892 | 6,996,942 |

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| |
|--|
| 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| (2021年4月26日現在) | |
|-----------------------------------|-----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 58,066,751,593円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 16,895,224,068円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 17,017,987,882円 |
| 2021年4月26日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・DC外国株式インデックスファンドS | 28,763,062,087円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 278,659,320円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 1,185,860,476円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 826,468,614円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 68,282,666円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 1,307,216円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 6,153,493円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ) | 17,918,101円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 44,256,436円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 43,724,486円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 93,759,250円 |
| 外国株式指数ファンド | 597,608,127円 |
| 三井住友・DCつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド | 9,332,591,971円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 226,710,914円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 247,923,480円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 161,310,710円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 53,042,866円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050 | 13,361,494円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 93,387,800円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 79,384,983円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 253,475,380円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 124,628,072円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 143,424,749円 |
| 三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド | 31,364,778円 |
| 三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド | 185,695,612円 |
| 三井住友D S・年金バランス30(債券重点型) | 3,502,496円 |
| 三井住友D S・年金バランス50(標準型) | 13,766,131円 |
| 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型) | 11,897,831円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060 | 1,957,599円 |
| S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ) | 36,164,679円 |
| S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) | 765,606,897円 |

| | |
|--|-----------------|
| バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 > | 5,449,180円 |
| SMAM・バランスファンドVA安定成長型 < 適格機関投資家限定 > | 42,227,299円 |
| SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 > | 890,427,813円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 > | 1,017,321,892円 |
| SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 > | 4,322,684,584円 |
| SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 > | 13,987,860円 |
| SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 > | 76,827,086円 |
| SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 > | 582,908,081円 |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型 < 適格機関投資家限定 > | 46,776,376円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 > | 123,376,353円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 > | 563,978,699円 |
| SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 > | 436,244,612円 |
| SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 > | 1,003,186,093円 |
| SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 > | 241,876円 |
| 三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 249,141,886円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 > | 90,384,153円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 > | 11,959,916円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 > | 9,138,921円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 > | 4,880,615円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 > | 27,135,381円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 > | 73,803,151円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA < 適格機関投資家限定 > | 168,068,608円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA < 適格機関投資家限定 > | 80,082,212円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 > | 2,365,412,561円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 > | 154,088,266円 |
| SMAM・外国株式インデックスファンドSA < 適格機関投資家限定 > | 1,460,825,276円 |
| SMAM・年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 > | 12,940,494円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04 < 適格機関投資家限定 > | 34,488,574円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 > | 28,712,764円 |
| SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 > | 341,028,483円 |
| 合計 | 57,943,987,779円 |

(2022年4月26日現在)

開示対象ファンドの

| | |
|-------------------|-----------------|
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 57,943,987,779円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 15,824,942,750円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 10,212,210,421円 |

2022年4月26日現在の元本の内訳

| | |
|---------------------------------|-----------------|
| 三井住友・DC外国株式インデックスファンドS | 32,824,989,661円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 257,317,370円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 1,047,578,763円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 747,973,617円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 60,989,172円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 1,125,866円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 5,363,638円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ) | 16,244,720円 |

| | |
|--|-----------------|
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 43,713,957円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 47,361,014円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 93,028,840円 |
| 外国株式指数ファンド | 854,964,510円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド | 14,459,619,207円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 96,142,646円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 103,195,277円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 68,329,125円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050 | 15,569,633円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 120,600,881円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 105,362,465円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 367,489,080円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 193,274,372円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 223,259,235円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 43,921,433円 |
| 三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド | 772,040,864円 |
| 三井住友D S・年金バランス30(債券重点型) | 4,693,304円 |
| 三井住友D S・年金バランス50(標準型) | 20,205,997円 |
| 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型) | 19,677,700円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060 | 1,976,165円 |
| S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ) | 178,127,088円 |
| 日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり) | 162,944,584円 |
| 日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし) | 556,407,030円 |
| 三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド | 20,929,896円 |
| S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) | 502,987,590円 |
| バランスファンドV A(安定運用型) < 適格機関投資家限定 > | 4,946,844円 |
| S M A M・バランスファンドV A安定成長型 < 適格機関投資家限定 > | 25,733,245円 |
| S M A M・バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 > | 622,840,510円 |
| S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 > | 760,966,204円 |
| S M A M・バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 > | 3,294,948,550円 |
| S M A M・バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 > | 10,889,499円 |
| S M A M・バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 > | 56,580,424円 |
| S M A M・バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 > | 444,174,100円 |
| S M A M・バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 > | 37,545,497円 |
| S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 > | 93,355,655円 |
| S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 > | 445,662,014円 |
| S M A M・バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 > | 324,389,117円 |
| S M A M・バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 > | 750,605,330円 |
| S M A M・バランスV A株4 0 T < 適格機関投資家限定 > | 200,225円 |
| 三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用) | 208,063,748円 |
| S M A M・グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 > | 67,237,428円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 > | 8,668,847円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 > | 7,431,222円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 > | 3,930,927円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 > | 20,254,181円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 > | 55,967,394円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 > | 114,373,759円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 > | 52,566,720円 |

| | |
|--|-----------------|
| S M A M ・世界バランスファンドV A <適格機関投資家限定> | 494,019,000円 |
| S M A M ・世界バランスファンドV A 2 <適格機関投資家限定> | 93,680,381円 |
| S M A M ・外国株式インデックスファンドS A <適格機関投資家限定> | 1,402,985,029円 |
| S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 22,195,395円 |
| S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 14,310,453円 |
| S M A M ・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 18,636,428円 |
| S M A M ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定> | 62,157,282円 |
| 合 計 | 63,556,720,108円 |

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

| 通貨 | 銘柄 | 株数 | 評価額 | | 備考 |
|------------------------------|------------------------------|---------|--------------|---------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| アメリカ・ドル | BAKER HUGHES CO | 48,147 | 30.740 | 1,480,038.78 | |
| | CHENIERE ENERGY INC | 13,763 | 131.130 | 1,804,742.19 | |
| | CHEVRON CORP | 109,842 | 157.490 | 17,299,016.58 | |
| | CONOCOPHILLIPS | 75,728 | 91.660 | 6,941,228.48 | |
| | COTERRA ENERGY INC | 40,261 | 28.660 | 1,153,880.26 | |
| | DEVON ENERGY CORP | 36,196 | 56.180 | 2,033,491.28 | |
| | DIAMONDBACK ENERGY INC | 9,236 | 125.820 | 1,162,073.52 | |
| | EOG RESOURCES INC | 33,177 | 111.770 | 3,708,193.29 | |
| | EXXON MOBIL CORP | 240,058 | 82.260 | 19,747,171.08 | |
| | HALLIBURTON CO | 48,780 | 35.330 | 1,723,397.40 | |
| | HESS CORP | 15,806 | 102.620 | 1,622,011.72 | |
| | KINDER MORGAN INC | 115,515 | 18.610 | 2,149,734.15 | |
| | MARATHON PETROLEUM CORP | 33,933 | 84.260 | 2,859,194.58 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 54,615 | 54.920 | 2,999,455.80 | |
| | ONEOK INC | 24,725 | 66.300 | 1,639,267.50 | |
| | PHILLIPS 66 | 28,293 | 81.020 | 2,292,298.86 | |
| | PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 13,151 | 231.140 | 3,039,722.14 | |
| | SCHLUMBERGER LTD | 77,056 | 38.690 | 2,981,296.64 | |
| | VALERO ENERGY CORP | 23,182 | 100.880 | 2,338,600.16 | |
| | WILLIAMS COS INC | 71,708 | 33.900 | 2,430,901.20 | |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 12,372 | 242.760 | 3,003,426.72 | | |
| ALBEMARLE CORP | 6,560 | 198.460 | 1,301,897.60 | | |
| AMCOR PLC | 82,302 | 11.650 | 958,818.30 | | |
| AVERY DENNISON CORP | 4,232 | 168.690 | 713,896.08 | | |
| BALL CORP | 19,410 | 85.960 | 1,668,483.60 | | |
| CELANESE CORP | 6,643 | 141.910 | 942,708.13 | | |

| | | | | |
|---------------------------------|--------|---------|--------------|--|
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 12,002 | 94.450 | 1,133,588.90 | |
| CORTEVA INC | 41,332 | 57.300 | 2,368,323.60 | |
| CROWN HOLDINGS INC | 6,863 | 116.610 | 800,294.43 | |
| DOW INC | 41,516 | 68.070 | 2,825,994.12 | |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 27,944 | 67.800 | 1,894,603.20 | |
| EASTMAN CHEMICAL CO | 7,027 | 105.860 | 743,878.22 | |
| ECOLAB INC | 14,157 | 175.610 | 2,486,110.77 | |
| FMC CORP | 6,676 | 131.650 | 878,895.40 | |
| FREEMONT-MCMORAN INC | 85,156 | 41.650 | 3,546,747.40 | |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 19,140 | 47.490 | 908,958.60 | |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 13,922 | 123.070 | 1,713,380.54 | |
| LINDE PLC | 29,358 | 313.990 | 9,218,118.42 | |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 16,010 | 105.210 | 1,684,412.10 | |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 3,559 | 360.800 | 1,284,087.20 | |
| MOSAIC CO/THE | 22,416 | 63.610 | 1,425,881.76 | |
| NEWMONT CORP | 46,400 | 72.610 | 3,369,104.00 | |
| NUCOR CORP | 16,292 | 158.560 | 2,583,259.52 | |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 5,988 | 162.290 | 971,792.52 | |
| PPG INDUSTRIES INC | 13,502 | 129.340 | 1,746,348.68 | |
| RPM INTERNATIONAL INC | 7,696 | 84.580 | 650,927.68 | |
| SEALED AIR CORP | 7,895 | 65.370 | 516,096.15 | |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 14,500 | 248.020 | 3,596,290.00 | |
| STEEL DYNAMICS INC | 10,191 | 89.330 | 910,362.03 | |
| VULCAN MATERIALS CO | 7,555 | 176.010 | 1,329,755.55 | |
| WESTROCK CO | 13,034 | 49.740 | 648,311.16 | |
| 3M CO | 32,676 | 148.600 | 4,855,653.60 | |
| AERCAP HOLDINGS NV | 8,330 | 50.150 | 417,749.50 | |
| ALLEGION PLC | 4,764 | 114.720 | 546,526.08 | |
| AMETEK INC | 13,117 | 127.650 | 1,674,385.05 | |
| BOEING CO/THE | 32,149 | 175.910 | 5,655,330.59 | |
| CARRIER GLOBAL CORP | 46,600 | 41.960 | 1,955,336.00 | |
| CATERPILLAR INC | 31,095 | 216.700 | 6,738,286.50 | |
| CUMMINS INC | 8,207 | 196.150 | 1,609,803.05 | |
| DEERE & CO | 16,702 | 385.510 | 6,438,788.02 | |
| DOVER CORP | 8,225 | 142.240 | 1,169,924.00 | |
| EATON CORP PLC | 23,221 | 147.070 | 3,415,112.47 | |
| EMERSON ELECTRIC CO | 34,129 | 92.210 | 3,147,035.09 | |
| FASTENAL CO | 32,763 | 56.950 | 1,865,852.85 | |
| FORTIVE CORP | 18,373 | 57.850 | 1,062,878.05 | |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI | 7,166 | 73.150 | 524,192.90 | |
| GENERAC HOLDINGS INC | 3,300 | 245.340 | 809,622.00 | |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 13,847 | 239.180 | 3,311,925.46 | |

| | | | | |
|---------------------------------|--------|---------|--------------|--|
| GENERAL ELECTRIC CO | 63,295 | 89.880 | 5,688,954.60 | |
| HEICO CORP | 1,888 | 145.840 | 275,345.92 | |
| HEICO CORP-CLASS A | 4,570 | 119.360 | 545,475.20 | |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 39,519 | 191.820 | 7,580,534.58 | |
| HOWMET AEROSPACE INC | 19,024 | 34.820 | 662,415.68 | |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 2,107 | 218.530 | 460,442.71 | |
| IDEX CORP | 3,839 | 191.710 | 735,974.69 | |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 18,247 | 204.120 | 3,724,577.64 | |
| INGERSOLL-RAND INC | 21,013 | 45.670 | 959,663.71 | |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD | 11,500 | 54.870 | 631,005.00 | |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 38,803 | 62.710 | 2,433,336.13 | |
| KORNIT DIGITAL LTD | 3,043 | 70.110 | 213,344.73 | |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 11,079 | 242.920 | 2,691,310.68 | |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 2,104 | 238.940 | 502,729.76 | |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 14,287 | 442.890 | 6,327,569.43 | |
| MASCO CORP | 14,885 | 52.220 | 777,294.70 | |
| NORDSON CORP | 2,884 | 220.820 | 636,844.88 | |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 8,540 | 444.020 | 3,791,930.80 | |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 22,881 | 74.600 | 1,706,922.60 | |
| OWENS CORNING | 5,205 | 88.000 | 458,040.00 | |
| PACCAR INC | 20,753 | 86.350 | 1,792,021.55 | |
| PARKER HANNIFIN CORP | 7,329 | 278.260 | 2,039,367.54 | |
| PENTAIR PLC | 8,220 | 52.770 | 433,769.40 | |
| PLUG POWER INC | 28,584 | 22.750 | 650,286.00 | |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP | 85,821 | 99.610 | 8,548,629.81 | |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 6,219 | 261.310 | 1,625,086.89 | |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 6,180 | 455.270 | 2,813,568.60 | |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 7,600 | 48.730 | 370,348.00 | |
| SMITH (A.O.) CORP | 7,157 | 64.630 | 462,556.91 | |
| SNAP-ON INC | 3,106 | 223.260 | 693,445.56 | |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 9,129 | 141.480 | 1,291,570.92 | |
| SUNRUN INC | 10,669 | 20.550 | 219,247.95 | |
| TEXTRON INC | 11,803 | 68.330 | 806,498.99 | |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 12,759 | 149.440 | 1,906,704.96 | |
| TRANSDIGM GROUP INC | 3,010 | 626.640 | 1,886,186.40 | |
| UNITED RENTALS INC | 4,113 | 313.280 | 1,288,520.64 | |
| WABTEC CORP | 9,231 | 89.250 | 823,866.75 | |
| WW GRAINGER INC | 2,390 | 492.190 | 1,176,334.10 | |

| | | | | |
|---------------------------------|---------|---------|--------------|--|
| XYLEM INC | 10,225 | 84.050 | 859,411.25 | |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 8,029 | 87.370 | 701,493.73 | |
| CINTAS CORP | 5,169 | 409.960 | 2,119,083.24 | |
| CLARIVATE PLC | 19,939 | 16.430 | 327,597.77 | |
| COPART INC | 12,238 | 118.210 | 1,446,653.98 | |
| COSTAR GROUP INC | 23,804 | 62.650 | 1,491,320.60 | |
| EQUIFAX INC | 6,841 | 213.400 | 1,459,869.40 | |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 6,927 | 140.350 | 972,204.45 | |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 6,947 | 107.170 | 744,509.99 | |
| REPUBLIC SERVICES INC | 12,824 | 132.450 | 1,698,538.80 | |
| ROBERT HALF INTL INC | 5,555 | 112.180 | 623,159.90 | |
| ROLLINS INC | 11,493 | 33.400 | 383,866.20 | |
| TRANSUNION | 11,233 | 92.780 | 1,042,197.74 | |
| VERISK ANALYTICS INC | 8,757 | 213.850 | 1,872,684.45 | |
| WASTE CONNECTIONS INC | 15,445 | 136.250 | 2,104,381.25 | |
| WASTE MANAGEMENT INC | 23,720 | 155.960 | 3,699,371.20 | |
| AMERCO | 650 | 550.350 | 357,727.50 | |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 6,925 | 103.170 | 714,452.25 | |
| CSX CORP | 128,276 | 34.640 | 4,443,480.64 | |
| DELTA AIR LINES INC | 8,299 | 43.270 | 359,097.73 | |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 8,689 | 100.700 | 874,982.30 | |
| FEDEX CORP | 14,310 | 205.400 | 2,939,274.00 | |
| GRAB HOLDINGS LTD - CL A | 65,402 | 2.860 | 187,049.72 | |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 4,411 | 174.050 | 767,734.55 | |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION | 7,940 | 49.790 | 395,332.60 | |
| LYFT INC-A | 13,145 | 33.910 | 445,746.95 | |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 13,579 | 259.740 | 3,527,009.46 | |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 5,539 | 279.820 | 1,549,922.98 | |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 7,076 | 46.430 | 328,538.68 | |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 85,141 | 32.440 | 2,761,974.04 | |
| UNION PACIFIC CORP | 36,797 | 236.420 | 8,699,546.74 | |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 41,784 | 189.640 | 7,923,917.76 | |
| APTIV PLC | 15,307 | 107.630 | 1,647,492.41 | |
| BORGWARNER INC | 12,075 | 37.720 | 455,469.00 | |
| FORD MOTOR CO | 218,306 | 15.190 | 3,316,068.14 | |
| GENERAL MOTORS CO | 72,747 | 39.820 | 2,896,785.54 | |
| LEAR CORP | 3,736 | 129.480 | 483,737.28 | |
| LUCID GROUP INC | 21,730 | 19.330 | 420,040.90 | |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A | 9,269 | 33.900 | 314,219.10 | |

| | | | | |
|----------------------------------|--------|-----------|---------------|--|
| TESLA INC | 48,490 | 998.020 | 48,393,989.80 | |
| DR HORTON INC | 18,162 | 74.190 | 1,347,438.78 | |
| GARMIN LTD | 8,444 | 112.810 | 952,567.64 | |
| HASBRO INC | 7,491 | 89.540 | 670,744.14 | |
| LENNAR CORP-A | 14,494 | 79.600 | 1,153,722.40 | |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 6,481 | 368.090 | 2,385,591.29 | |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 2,863 | 128.140 | 366,864.82 | |
| NEWELL BRANDS INC | 17,587 | 23.270 | 409,249.49 | |
| NIKE INC -CL B | 73,154 | 127.940 | 9,359,322.76 | |
| NVR INC | 173 | 4,353.280 | 753,117.44 | |
| PELOTON INTERACTIVE INC-A | 15,071 | 20.410 | 307,599.11 | |
| PULTEGROUP INC | 13,075 | 43.670 | 570,985.25 | |
| VF CORP | 20,583 | 54.310 | 1,117,862.73 | |
| WHIRLPOOL CORP | 3,212 | 178.870 | 574,530.44 | |
| AIRBNB INC-CLASS A | 17,263 | 158.390 | 2,734,286.57 | |
| ARAMARK | 13,242 | 37.990 | 503,063.58 | |
| BOOKING HOLDINGS INC | 2,368 | 2,246.040 | 5,318,622.72 | |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC | 13,336 | 68.500 | 913,516.00 | |
| CARNIVAL CORP | 48,156 | 18.880 | 909,185.28 | |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 1,586 | 1,516.000 | 2,404,376.00 | |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 7,606 | 138.130 | 1,050,616.78 | |
| DOMINO'S PIZZA INC | 2,121 | 378.160 | 802,077.36 | |
| DRAFTKINGS INC - CL A | 16,742 | 14.680 | 245,772.56 | |
| EXPEDIA GROUP INC | 8,061 | 186.770 | 1,505,552.97 | |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 15,836 | 155.940 | 2,469,465.84 | |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 17,634 | 36.290 | 639,937.86 | |
| MARRIOTT INTERNATIONAL - CL A | 15,697 | 182.480 | 2,864,388.56 | |
| MCDONALD'S CORP | 42,751 | 252.880 | 10,810,872.88 | |
| MELCO RESORTS & ENTERT- ADR | 9,746 | 6.190 | 60,327.74 | |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 22,198 | 42.030 | 932,981.94 | |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 11,890 | 82.380 | 979,498.20 | |
| STARBUCKS CORP | 67,557 | 77.980 | 5,268,094.86 | |
| VAIL RESORTS INC | 2,038 | 263.520 | 537,053.76 | |
| WYNN RESORTS LTD | 4,913 | 72.210 | 354,767.73 | |
| YUM! BRANDS INC | 17,414 | 121.270 | 2,111,795.78 | |
| ADVANCE AUTO PARTS INC | 3,426 | 223.870 | 766,978.62 | |
| AMAZON.COM INC | 25,910 | 2,921.480 | 75,695,546.80 | |
| AUTOZONE INC | 1,235 | 2,195.680 | 2,711,664.80 | |
| BATH & BODY WORKS INC | 15,400 | 54.100 | 833,140.00 | |

| | | | | |
|---------------------------------|---------|-----------|---------------|--|
| BEST BUY CO INC | 12,132 | 93.070 | 1,129,125.24 | |
| BURLINGTON STORES INC | 3,391 | 209.250 | 709,566.75 | |
| CARMAX INC | 8,427 | 90.450 | 762,222.15 | |
| CARVANA CO | 4,496 | 81.210 | 365,120.16 | |
| CHEWY INC - CLASS A | 3,969 | 34.660 | 137,565.54 | |
| DOLLAR GENERAL CORP | 13,651 | 248.490 | 3,392,136.99 | |
| DOLLAR TREE INC | 12,839 | 169.850 | 2,180,704.15 | |
| DOORDASH INC - A | 5,953 | 91.250 | 543,211.25 | |
| EBAY INC | 35,551 | 53.630 | 1,906,600.13 | |
| ETSY INC | 7,168 | 102.060 | 731,566.08 | |
| FIVERR INTERNATIONAL LTD | 1,931 | 57.890 | 111,785.59 | |
| GENUINE PARTS CO | 7,406 | 134.160 | 993,588.96 | |
| HOME DEPOT INC | 59,526 | 304.940 | 18,151,858.44 | |
| LKQ CORP | 15,922 | 49.870 | 794,030.14 | |
| LOWE'S COS INC | 38,668 | 200.380 | 7,748,293.84 | |
| MERCADOLIBRE INC | 2,654 | 1,041.920 | 2,765,255.68 | |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 3,958 | 713.420 | 2,823,716.36 | |
| POOL CORP | 2,107 | 427.640 | 901,037.48 | |
| ROSS STORES INC | 21,189 | 105.610 | 2,237,770.29 | |
| TARGET CORP | 27,611 | 241.660 | 6,672,474.26 | |
| TJX COMPANIES INC | 66,779 | 63.390 | 4,233,120.81 | |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 6,117 | 209.960 | 1,284,325.32 | |
| ULTA BEAUTY INC | 2,765 | 418.140 | 1,156,157.10 | |
| WAYFAIR INC- CLASS A | 3,756 | 83.930 | 315,241.08 | |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 25,216 | 568.210 | 14,327,983.36 | |
| KROGER CO | 38,955 | 56.690 | 2,208,358.95 | |
| SYSCO CORP | 30,220 | 89.740 | 2,711,942.80 | |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 40,703 | 45.390 | 1,847,509.17 | |
| WALMART INC | 87,595 | 156.940 | 13,747,159.30 | |
| ALTRIA GROUP INC | 105,961 | 55.230 | 5,852,226.03 | |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 32,763 | 90.960 | 2,980,122.48 | |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 16,130 | 66.930 | 1,079,580.90 | |
| BUNGE LTD | 7,174 | 116.390 | 834,981.86 | |
| CAMPBELL SOUP CO | 10,638 | 46.830 | 498,177.54 | |
| COCA-COLA CO/THE | 234,195 | 65.940 | 15,442,818.30 | |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE | 13,567 | 52.300 | 709,554.10 | |
| CONAGRA BRANDS INC | 24,639 | 36.110 | 889,714.29 | |
| CONSTELLATION BRANDS INC- A | 8,881 | 248.740 | 2,209,059.94 | |
| GENERAL MILLS INC | 34,440 | 72.200 | 2,486,568.00 | |
| HERSHEY CO/THE | 8,265 | 224.980 | 1,859,459.70 | |
| HORMEL FOODS CORP | 14,939 | 53.560 | 800,132.84 | |

| | | | | |
|---------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| JM SMUCKER CO/THE | 5,768 | 142.210 | 820,267.28 | |
| KELLOGG CO | 12,949 | 69.260 | 896,847.74 | |
| KEURIG DR PEPPER INC | 38,244 | 37.300 | 1,426,501.20 | |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 38,438 | 43.040 | 1,654,371.52 | |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 13,084 | 102.370 | 1,339,409.08 | |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO - B | 9,629 | 54.440 | 524,202.76 | |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 80,596 | 65.780 | 5,301,604.88 | |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 22,202 | 86.680 | 1,924,469.36 | |
| PEPSICO INC | 78,962 | 173.740 | 13,718,857.88 | |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 89,277 | 102.530 | 9,153,570.81 | |
| TYSON FOODS INC-CL A | 16,951 | 94.510 | 1,602,039.01 | |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 14,330 | 104.030 | 1,490,749.90 | |
| CLOROX COMPANY | 6,542 | 152.290 | 996,281.18 | |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 46,642 | 81.810 | 3,815,782.02 | |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 12,953 | 268.220 | 3,474,253.66 | |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 19,856 | 143.480 | 2,848,938.88 | |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 137,834 | 162.550 | 22,404,916.70 | |
| ABBOTT LABORATORIES | 101,062 | 120.010 | 12,128,450.62 | |
| ABIOMED INC | 2,288 | 302.140 | 691,296.32 | |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 4,154 | 368.860 | 1,532,244.44 | |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 9,459 | 158.470 | 1,498,967.73 | |
| ANTHEM INC | 13,954 | 506.870 | 7,072,863.98 | |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 29,602 | 72.910 | 2,158,281.82 | |
| BECTON DICKINSON AND CO | 15,743 | 258.460 | 4,068,935.78 | |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 79,811 | 44.590 | 3,558,772.49 | |
| CARDINAL HEALTH INC | 15,114 | 61.240 | 925,581.36 | |
| CENTENE CORP | 31,798 | 84.860 | 2,698,378.28 | |
| CERNER CORP | 15,537 | 93.810 | 1,457,525.97 | |
| CIGNA CORP | 19,185 | 254.360 | 4,879,896.60 | |
| COOPER COS INC/THE | 2,771 | 394.060 | 1,091,940.26 | |
| CVS HEALTH CORP | 75,780 | 101.770 | 7,712,130.60 | |
| DAVITA INC | 4,138 | 112.540 | 465,690.52 | |
| DENTSPLY SIRONA INC | 11,864 | 41.530 | 492,711.92 | |
| DEXCOM INC | 5,440 | 442.490 | 2,407,145.60 | |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 36,200 | 119.800 | 4,336,760.00 | |
| HCA HEALTHCARE INC | 13,853 | 210.500 | 2,916,056.50 | |
| HENRY SCHEIN INC | 7,559 | 87.990 | 665,116.41 | |
| HOLOGIC INC | 13,592 | 72.730 | 988,546.16 | |
| HUMANA INC | 7,201 | 441.530 | 3,179,457.53 | |

| | | | | |
|---------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| IDEXX LABORATORIES INC | 4,980 | 472.270 | 2,351,904.60 | |
| INMODE LTD | 4,416 | 28.320 | 125,061.12 | |
| INSULET CORP | 4,263 | 251.390 | 1,071,675.57 | |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 20,553 | 255.120 | 5,243,481.36 | |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 5,783 | 264.100 | 1,527,290.30 | |
| MASIMO CORP | 2,941 | 123.790 | 364,066.39 | |
| MCKESSON CORP | 8,411 | 317.310 | 2,668,894.41 | |
| MEDTRONIC PLC | 77,105 | 109.480 | 8,441,455.40 | |
| MOLINA HEALTHCARE INC | 3,428 | 326.720 | 1,119,996.16 | |
| NOVOCURE LTD | 4,517 | 83.330 | 376,401.61 | |
| QUEST DIAGNOSTICS INC | 6,814 | 136.620 | 930,928.68 | |
| RESMED INC | 8,650 | 225.950 | 1,954,467.50 | |
| STERIS PLC | 5,282 | 238.160 | 1,257,961.12 | |
| STRYKER CORP | 18,845 | 253.830 | 4,783,426.35 | |
| TELADOC HEALTH INC | 7,496 | 60.560 | 453,957.76 | |
| TELEFLEX INC | 2,340 | 326.350 | 763,659.00 | |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 53,590 | 524.270 | 28,095,629.30 | |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 4,203 | 138.760 | 583,208.28 | |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A | 7,675 | 184.100 | 1,412,967.50 | |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 12,580 | 127.810 | 1,607,849.80 | |
| 10X GENOMICS INC-CLASS A | 3,814 | 55.050 | 209,960.70 | |
| ABBVIE INC | 100,824 | 156.300 | 15,758,791.20 | |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 16,873 | 121.450 | 2,049,225.85 | |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 6,810 | 162.070 | 1,103,696.70 | |
| AMGEN INC | 32,328 | 252.170 | 8,152,151.76 | |
| AVANTOR INC | 30,428 | 30.390 | 924,706.92 | |
| BIOGEN INC | 7,987 | 214.540 | 1,713,530.98 | |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 9,080 | 81.880 | 743,470.40 | |
| BIO-RAD LABORATORIES-A | 1,220 | 529.950 | 646,539.00 | |
| BIO-TECHNE CORP | 1,991 | 400.910 | 798,211.81 | |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 127,148 | 76.050 | 9,669,605.40 | |
| CATALENT INC | 8,935 | 90.140 | 805,400.90 | |
| CHARLES RIVER LABORATORIES | 2,577 | 253.340 | 652,857.18 | |
| DANAHER CORP | 36,787 | 260.460 | 9,581,542.02 | |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC | 20,811 | 25.740 | 535,675.14 | |
| ELI LILLY & CO | 46,434 | 285.200 | 13,242,976.80 | |
| EXACT SCIENCES CORP | 9,771 | 62.640 | 612,055.44 | |
| GILEAD SCIENCES INC | 72,708 | 62.650 | 4,555,156.20 | |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC | 11,582 | 106.700 | 1,235,799.40 | |

| | | | | |
|---------------------------------|---------|-----------|---------------|--|
| ILLUMINA INC | 8,237 | 319.100 | 2,628,426.70 | |
| INCYTE CORP | 9,243 | 76.560 | 707,644.08 | |
| IQVIA HOLDINGS INC | 10,637 | 219.860 | 2,338,650.82 | |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 4,089 | 166.140 | 679,346.46 | |
| JOHNSON & JOHNSON | 149,808 | 186.010 | 27,865,786.08 | |
| MERCK & CO. INC. | 144,374 | 85.440 | 12,335,314.56 | |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 1,258 | 1,302.590 | 1,638,658.22 | |
| MODERNA INC | 20,087 | 150.410 | 3,021,285.67 | |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 4,186 | 93.760 | 392,479.36 | |
| NOVAVAX INC | 3,601 | 50.210 | 180,806.21 | |
| PERKINELMER INC | 6,979 | 149.530 | 1,043,569.87 | |
| PFIZER INC | 320,083 | 48.950 | 15,668,062.85 | |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 5,867 | 690.330 | 4,050,166.11 | |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A | 18,344 | 42.310 | 776,134.64 | |
| SEAGEN INC | 7,790 | 138.540 | 1,079,226.60 | |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR | 60,344 | 9.130 | 550,940.72 | |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 22,503 | 544.160 | 12,245,232.48 | |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 14,163 | 271.680 | 3,847,803.84 | |
| VIATRIS INC | 63,072 | 10.390 | 655,318.08 | |
| WATERS CORP | 3,425 | 296.200 | 1,014,485.00 | |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 4,241 | 348.950 | 1,479,896.95 | |
| ZOETIS INC | 27,326 | 180.300 | 4,926,877.80 | |
| BANK OF AMERICA CORP | 419,938 | 37.290 | 15,659,488.02 | |
| CITIGROUP INC | 114,274 | 51.130 | 5,842,829.62 | |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 25,225 | 41.680 | 1,051,378.00 | |
| FIFTH THIRD BANCORP | 37,150 | 38.800 | 1,441,420.00 | |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A | 670 | 639.500 | 428,465.00 | |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 9,688 | 156.440 | 1,515,590.72 | |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 75,817 | 13.900 | 1,053,856.30 | |
| JPMORGAN CHASE & CO | 168,263 | 126.770 | 21,330,700.51 | |
| KEYCORP | 51,128 | 20.630 | 1,054,770.64 | |
| M & T BANK CORP | 10,715 | 174.000 | 1,864,410.00 | |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 24,474 | 172.500 | 4,221,765.00 | |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 58,274 | 21.600 | 1,258,718.40 | |
| SIGNATURE BANK | 3,256 | 261.060 | 850,011.36 | |
| SVB FINANCIAL GROUP | 3,496 | 543.310 | 1,899,411.76 | |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 74,318 | 50.840 | 3,778,327.12 | |

| | | | | |
|----------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| US BANCORP | 78,364 | 50.840 | 3,984,025.76 | |
| WEBSTER FINANCIAL CORP | 9,600 | 50.080 | 480,768.00 | |
| WELLS FARGO & CO | 228,028 | 45.830 | 10,450,523.24 | |
| ALLY FINANCIAL INC | 20,139 | 42.040 | 846,643.56 | |
| AMERICAN EXPRESS CO | 37,834 | 184.100 | 6,965,239.40 | |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 6,380 | 280.960 | 1,792,524.80 | |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 19,982 | 54.390 | 1,086,820.98 | |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 44,547 | 44.370 | 1,976,550.39 | |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 74,178 | 336.950 | 24,994,277.10 | |
| BLACKROCK INC | 8,737 | 668.280 | 5,838,762.36 | |
| BLACKSTONE INC | 38,948 | 112.520 | 4,382,428.96 | |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 23,654 | 136.460 | 3,227,824.84 | |
| CARLYLE GROUP INC/THE | 10,094 | 40.650 | 410,321.10 | |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 5,661 | 115.270 | 652,543.47 | |
| CME GROUP INC | 20,739 | 221.560 | 4,594,932.84 | |
| COINBASE GLOBAL INC - CLASS A | 2,027 | 135.140 | 273,928.78 | |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 16,425 | 112.640 | 1,850,112.00 | |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 22,820 | 30.190 | 688,935.80 | |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 1,939 | 429.040 | 831,908.56 | |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 14,298 | 26.630 | 380,755.74 | |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR | 3,159 | 32.100 | 101,403.90 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 19,406 | 321.420 | 6,237,476.52 | |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 32,658 | 116.850 | 3,816,087.30 | |
| INVESCO LTD | 18,328 | 20.790 | 381,039.12 | |
| KKR & CO INC | 28,569 | 53.000 | 1,514,157.00 | |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 1,912 | 267.950 | 512,320.40 | |
| MOODY'S CORP | 9,247 | 325.510 | 3,009,990.97 | |
| MORGAN STANLEY | 77,387 | 85.050 | 6,581,764.35 | |
| MSCI INC | 4,862 | 462.300 | 2,247,702.60 | |
| NASDAQ INC | 6,509 | 166.640 | 1,084,659.76 | |
| NORTHERN TRUST CORP | 11,023 | 105.760 | 1,165,792.48 | |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 9,639 | 103.970 | 1,002,166.83 | |
| ROBINHOOD MARKETS INC - A | 9,737 | 10.390 | 101,167.43 | |
| S&P GLOBAL INC | 20,313 | 381.220 | 7,743,721.86 | |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 83,280 | 70.310 | 5,855,416.80 | |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 5,481 | 56.900 | 311,868.90 | |

| | | | | |
|----------------------------------|--------|-----------|--------------|--|
| SOFI TECHNOLOGIES INC | 27,739 | 6.550 | 181,690.45 | |
| STATE STREET CORP | 20,939 | 70.950 | 1,485,622.05 | |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 32,112 | 38.290 | 1,229,568.48 | |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 12,314 | 137.190 | 1,689,357.66 | |
| TRADEWEB MARKETS INC- CLASS A | 5,220 | 79.740 | 416,242.80 | |
| UPSTART HOLDINGS INC | 1,590 | 79.590 | 126,548.10 | |
| AFLAC INC | 34,185 | 62.400 | 2,133,144.00 | |
| ALLEGHANY CORP | 689 | 837.000 | 576,693.00 | |
| ALLSTATE CORP | 16,419 | 131.820 | 2,164,352.58 | |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 3,539 | 143.770 | 508,802.03 | |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 48,577 | 59.680 | 2,899,075.36 | |
| AON PLC-CLASS A | 12,782 | 321.440 | 4,108,646.08 | |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 20,476 | 46.730 | 956,843.48 | |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 12,291 | 178.890 | 2,198,736.99 | |
| ASSURANT INC | 3,114 | 187.160 | 582,816.24 | |
| BROWN & BROWN INC | 14,273 | 68.450 | 976,986.85 | |
| CHUBB LTD | 24,864 | 207.320 | 5,154,804.48 | |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 9,371 | 136.080 | 1,275,205.68 | |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 1,288 | 173.810 | 223,867.28 | |
| EVEREST RE GROUP LTD | 2,065 | 284.240 | 586,955.60 | |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL | 13,937 | 40.960 | 570,859.52 | |
| GLOBE LIFE INC | 6,373 | 102.030 | 650,237.19 | |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 18,331 | 71.400 | 1,308,833.40 | |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 8,677 | 64.310 | 558,017.87 | |
| LOEWS CORP | 12,727 | 64.680 | 823,182.36 | |
| MARKEL CORP | 702 | 1,451.370 | 1,018,861.74 | |
| MARSH & MCLENNAN COS | 28,143 | 171.700 | 4,832,153.10 | |
| METLIFE INC | 39,703 | 69.080 | 2,742,683.24 | |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 14,124 | 71.850 | 1,014,809.40 | |
| PROGRESSIVE CORP | 32,839 | 110.560 | 3,630,679.84 | |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 20,728 | 113.990 | 2,362,784.72 | |
| TRAVELERS COS INC/THE | 14,464 | 174.440 | 2,523,100.16 | |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 6,823 | 241.060 | 1,644,752.38 | |
| WR BERKLEY CORP | 11,142 | 67.900 | 756,541.80 | |
| CBRE GROUP INC - A | 18,244 | 84.660 | 1,544,537.04 | |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 79,100 | 4.600 | 363,860.00 | |
| ZILLOW GROUP INC - A | 3,154 | 42.210 | 133,130.34 | |
| ZILLOW GROUP INC - C | 10,672 | 43.940 | 468,927.68 | |

| | | | | |
|---------------------------------|--------|---------|---------------|--|
| ACCENTURE PLC-CL A | 36,095 | 316.820 | 11,435,617.90 | |
| ADOBE INC | 27,186 | 413.950 | 11,253,644.70 | |
| AFFIRM HOLDINGS INC | 9,077 | 32.470 | 294,730.19 | |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC | 8,321 | 118.760 | 988,201.96 | |
| ANSYS INC | 4,983 | 282.160 | 1,406,003.28 | |
| ASANA INC - CL A | 4,435 | 30.540 | 135,444.90 | |
| AUTODESK INC | 12,331 | 191.150 | 2,357,070.65 | |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 23,443 | 227.060 | 5,322,967.58 | |
| AVALARA INC | 4,319 | 83.860 | 362,191.34 | |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B | 8,808 | 43.320 | 381,562.56 | |
| BILL.COM HOLDINGS INC | 4,158 | 182.900 | 760,498.20 | |
| BLACK KNIGHT INC | 7,623 | 67.460 | 514,247.58 | |
| BLOCK INC | 29,496 | 107.380 | 3,167,280.48 | |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 5,889 | 151.040 | 889,474.56 | |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 15,400 | 151.100 | 2,326,940.00 | |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC | 6,979 | 58.600 | 408,969.40 | |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH | 5,880 | 138.860 | 816,496.80 | |
| CITRIX SYSTEMS INC | 6,490 | 101.290 | 657,372.10 | |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A | 14,179 | 98.710 | 1,399,609.09 | |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS- A | 29,348 | 84.460 | 2,478,732.08 | |
| COUPA SOFTWARE INC | 3,490 | 92.760 | 323,732.40 | |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 10,656 | 214.580 | 2,286,564.48 | |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 2,795 | 164.670 | 460,252.65 | |
| DATADOG INC - CLASS A | 11,914 | 121.680 | 1,449,695.52 | |
| DOCUSIGN INC | 12,031 | 89.950 | 1,082,188.45 | |
| DROPBOX INC-CLASS A | 16,584 | 22.550 | 373,969.20 | |
| DYNATRACE INC | 9,587 | 41.020 | 393,258.74 | |
| EPAM SYSTEMS INC | 3,095 | 280.070 | 866,816.65 | |
| FAIR ISAAC CORP | 1,494 | 386.500 | 577,431.00 | |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV | 33,940 | 99.220 | 3,367,526.80 | |
| FISERV INC | 33,818 | 97.950 | 3,312,473.10 | |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 4,371 | 251.880 | 1,100,967.48 | |
| FORTINET INC | 8,155 | 323.490 | 2,638,060.95 | |
| GARTNER INC | 4,568 | 298.200 | 1,362,177.60 | |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 17,139 | 135.730 | 2,326,276.47 | |
| GODADDY INC - CLASS A | 8,905 | 87.410 | 778,386.05 | |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC | 4,731 | 90.860 | 429,858.66 | |
| HUBSPOT INC | 2,561 | 401.300 | 1,027,729.30 | |

| | | | | |
|--------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 51,574 | 139.100 | 7,173,943.40 | |
| INTUIT INC | 15,449 | 446.930 | 6,904,621.57 | |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 3,915 | 197.450 | 773,016.75 | |
| MASTERCARD INC - A | 50,005 | 354.600 | 17,731,773.00 | |
| MICROSOFT CORP | 404,747 | 280.720 | 113,620,577.84 | |
| MONGODB INC | 3,155 | 381.740 | 1,204,389.70 | |
| NORTONLIFELOCK INC | 31,347 | 25.870 | 810,946.89 | |
| OKTA INC | 8,044 | 138.400 | 1,113,289.60 | |
| ORACLE CORP | 94,141 | 76.980 | 7,246,974.18 | |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A | 98,735 | 12.110 | 1,195,680.85 | |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 5,746 | 599.730 | 3,446,048.58 | |
| PAYCHEX INC | 17,729 | 132.250 | 2,344,660.25 | |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 3,007 | 303.460 | 912,504.22 | |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 64,104 | 87.780 | 5,627,049.12 | |
| PTC INC | 5,462 | 99.900 | 545,653.80 | |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A | 3,992 | 92.430 | 368,980.56 | |
| SALESFORCE INC | 55,955 | 174.570 | 9,768,064.35 | |
| SERVICENOW INC | 11,453 | 472.270 | 5,408,908.31 | |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A | 11,562 | 186.940 | 2,161,400.28 | |
| SPLUNK INC | 9,792 | 129.000 | 1,263,168.00 | |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 11,546 | 68.890 | 795,403.94 | |
| SYNOPSIS INC | 8,565 | 290.920 | 2,491,729.80 | |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A | 24,100 | 63.020 | 1,518,782.00 | |
| TWILIO INC - A | 8,993 | 128.070 | 1,151,733.51 | |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 2,406 | 396.450 | 953,858.70 | |
| UNITY SOFTWARE INC | 2,853 | 79.420 | 226,585.26 | |
| VERISIGN INC | 5,227 | 211.170 | 1,103,785.59 | |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 95,103 | 209.950 | 19,966,874.85 | |
| VMWARE INC-CLASS A | 12,723 | 110.170 | 1,401,692.91 | |
| WESTERN UNION CO | 21,840 | 19.130 | 417,799.20 | |
| WIX.COM LTD | 3,194 | 82.830 | 264,559.02 | |
| WORKDAY INC-CLASS A | 10,736 | 209.130 | 2,245,219.68 | |
| ZENDESK INC | 6,067 | 121.970 | 739,991.99 | |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A | 12,049 | 102.440 | 1,234,299.56 | |
| ZSCALER INC | 4,551 | 216.790 | 986,611.29 | |
| AMPHENOL CORP-CL A | 35,157 | 70.710 | 2,485,951.47 | |
| APPLE INC | 930,837 | 162.880 | 151,614,730.56 | |
| ARISTA NETWORKS INC | 12,952 | 118.940 | 1,540,510.88 | |
| ARROW ELECTRONICS INC | 4,130 | 114.590 | 473,256.70 | |

| | | | | |
|----------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| CDW CORP/DE | 7,404 | 170.650 | 1,263,492.60 | |
| CISCO SYSTEMS INC | 240,838 | 51.940 | 12,509,125.72 | |
| COGNEX CORP | 8,698 | 70.750 | 615,383.50 | |
| CORNING INC | 45,688 | 34.420 | 1,572,580.96 | |
| DELL TECHNOLOGIES -C | 14,550 | 47.270 | 687,778.50 | |
| F5 INC | 3,921 | 203.000 | 795,963.00 | |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 71,283 | 15.590 | 1,111,301.97 | |
| HP INC | 65,388 | 37.000 | 2,419,356.00 | |
| IPG PHOTONICS CORP | 1,776 | 96.850 | 172,005.60 | |
| JUNIPER NETWORKS INC | 17,460 | 34.620 | 604,465.20 | |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN | 11,039 | 146.960 | 1,622,291.44 | |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 9,212 | 225.050 | 2,073,160.60 | |
| NETAPP INC | 13,273 | 77.400 | 1,027,330.20 | |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS | 11,800 | 82.540 | 973,972.00 | |
| TE CONNECTIVITY LTD | 19,220 | 124.400 | 2,390,968.00 | |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 2,844 | 468.680 | 1,332,925.92 | |
| TRIMBLE INC | 12,759 | 68.470 | 873,608.73 | |
| WESTERN DIGITAL CORP | 18,492 | 51.010 | 943,276.92 | |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP- CL A | 3,257 | 388.940 | 1,266,777.58 | |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 93,559 | 90.690 | 8,484,865.71 | |
| ANALOG DEVICES INC | 30,985 | 158.920 | 4,924,136.20 | |
| APPLIED MATERIALS INC | 51,912 | 114.470 | 5,942,366.64 | |
| BROADCOM INC | 23,489 | 587.880 | 13,808,713.32 | |
| ENPHASE ENERGY INC | 7,293 | 157.600 | 1,149,376.80 | |
| ENTEGRIS INC | 7,892 | 114.590 | 904,344.28 | |
| INTEL CORP | 232,509 | 47.060 | 10,941,873.54 | |
| KLA CORP | 8,854 | 331.210 | 2,932,533.34 | |
| LAM RESEARCH CORP | 7,779 | 476.420 | 3,706,071.18 | |
| MARVELL TECHNOLOGY INC | 45,111 | 60.690 | 2,737,786.59 | |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 30,238 | 68.100 | 2,059,207.80 | |
| MICRON TECHNOLOGY INC | 64,636 | 70.120 | 4,532,276.32 | |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 2,676 | 420.170 | 1,124,374.92 | |
| NVIDIA CORP | 142,103 | 199.020 | 28,281,339.06 | |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 14,457 | 172.840 | 2,498,747.88 | |
| ON SEMICONDUCTOR | 24,630 | 53.480 | 1,317,212.40 | |
| QORVO INC | 6,042 | 114.610 | 692,473.62 | |
| QUALCOMM INC | 64,123 | 136.560 | 8,756,636.88 | |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 8,757 | 117.880 | 1,032,275.16 | |
| SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC | 2,634 | 253.490 | 667,692.66 | |

| | | | | |
|---------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| TERADYNE INC | 8,542 | 112.570 | 961,572.94 | |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 52,879 | 173.910 | 9,196,186.89 | |
| AT&T INC | 408,894 | 19.510 | 7,977,521.94 | |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C | 21,079 | 24.980 | 526,553.42 | |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 8,432 | 23.980 | 202,199.36 | |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC | 49,758 | 10.870 | 540,869.46 | |
| T-MOBILE US INC | 36,145 | 128.810 | 4,655,837.45 | |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 236,606 | 50.280 | 11,896,549.68 | |
| AES CORP | 33,656 | 22.080 | 743,124.48 | |
| ALLIANT ENERGY CORP | 13,644 | 62.070 | 846,883.08 | |
| AMEREN CORPORATION | 14,760 | 95.920 | 1,415,779.20 | |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 27,967 | 100.500 | 2,810,683.50 | |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 10,241 | 160.810 | 1,646,855.21 | |
| ATMOS ENERGY CORP | 6,965 | 117.700 | 819,780.50 | |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 37,091 | 31.750 | 1,177,639.25 | |
| CMS ENERGY CORP | 16,996 | 70.590 | 1,199,747.64 | |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 21,051 | 96.050 | 2,021,948.55 | |
| CONSTELLATION ENERGY | 18,329 | 62.270 | 1,141,346.83 | |
| DOMINION ENERGY INC | 47,030 | 84.560 | 3,976,856.80 | |
| DTE ENERGY COMPANY | 10,536 | 135.700 | 1,429,735.20 | |
| DUKE ENERGY CORP | 44,466 | 113.770 | 5,058,896.82 | |
| EDISON INTERNATIONAL | 21,701 | 71.270 | 1,546,630.27 | |
| ENERGY CORP | 10,866 | 122.240 | 1,328,259.84 | |
| ESSENTIAL UTILITIES INC | 13,909 | 47.510 | 660,816.59 | |
| EVERGY INC | 14,377 | 70.100 | 1,007,827.70 | |
| EVERSOURCE ENERGY | 19,764 | 90.690 | 1,792,397.16 | |
| EXELON CORP | 54,987 | 48.770 | 2,681,715.99 | |
| FIRSTENERGY CORP | 31,966 | 45.440 | 1,452,535.04 | |
| NEXTERA ENERGY INC | 112,369 | 74.040 | 8,319,800.76 | |
| NISOURCE INC | 18,919 | 30.580 | 578,543.02 | |
| NRG ENERGY INC | 13,547 | 37.610 | 509,502.67 | |
| P G & E CORP | 76,538 | 11.820 | 904,679.16 | |
| PPL CORP | 39,561 | 29.760 | 1,177,335.36 | |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 27,231 | 72.640 | 1,978,059.84 | |
| SEMPRA ENERGY | 18,666 | 165.380 | 3,086,983.08 | |
| SOUTHERN CO/THE | 61,390 | 74.970 | 4,602,408.30 | |
| UGI CORP | 10,588 | 36.290 | 384,238.52 | |
| VISTRA CORP | 25,777 | 25.010 | 644,682.77 | |
| WEC ENERGY GROUP INC | 18,827 | 102.910 | 1,937,486.57 | |
| XCEL ENERGY INC | 29,237 | 73.700 | 2,154,766.90 | |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 43,065 | 78.050 | 3,361,223.25 | |

| | | | | |
|----------------------------------|------------|-----------|---------------------------------------|--|
| ALPHABET INC-CL A | 17,091 | 2,461.480 | 42,069,154.68 | |
| ALPHABET INC-CL C | 16,249 | 2,465.000 | 40,053,785.00 | |
| AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A | 27,658 | 16.960 | 469,079.68 | |
| CABLE ONE INC | 246 | 1,356.120 | 333,605.52 | |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 7,002 | 506.970 | 3,549,803.94 | |
| COMCAST CORP-CLASS A | 260,545 | 45.710 | 11,909,511.95 | |
| DISH NETWORK CORP-A | 12,937 | 31.490 | 407,386.13 | |
| ELECTRONIC ARTS INC | 15,352 | 128.150 | 1,967,358.80 | |
| FOX CORP - CLASS A | 16,962 | 37.990 | 644,386.38 | |
| FOX CORP - CLASS B | 8,773 | 35.180 | 308,634.14 | |
| IAC/INTERACTIVECORP | 3,974 | 89.580 | 355,990.92 | |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 19,626 | 35.080 | 688,480.08 | |
| LIBERTY BROADBAND-A | 1,312 | 123.050 | 161,441.60 | |
| LIBERTY BROADBAND-C | 8,196 | 128.160 | 1,050,399.36 | |
| LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C | 10,288 | 66.630 | 685,489.44 | |
| LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM A | 4,141 | 43.790 | 181,334.39 | |
| LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM C | 7,648 | 43.830 | 335,211.84 | |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | 8,770 | 109.680 | 961,893.60 | |
| MATCH GROUP INC | 15,249 | 82.480 | 1,257,737.52 | |
| META PLATFORMS INC-CLASS A | 134,599 | 186.990 | 25,168,667.01 | |
| NETFLIX INC | 25,368 | 209.910 | 5,324,996.88 | |
| NEWS CORP - CLASS A | 23,102 | 20.880 | 482,369.76 | |
| OMNICOM GROUP | 12,545 | 79.100 | 992,309.50 | |
| PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B | 32,381 | 31.200 | 1,010,287.20 | |
| PINTEREST INC- CLASS A | 28,563 | 20.000 | 571,260.00 | |
| ROKU INC | 6,012 | 101.410 | 609,676.92 | |
| SEA LTD-ADR | 18,531 | 89.520 | 1,658,895.12 | |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 67,656 | 6.170 | 417,437.52 | |
| SNAP INC - A | 64,099 | 29.910 | 1,917,201.09 | |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 7,149 | 132.960 | 950,531.04 | |
| TWITTER INC | 45,558 | 51.700 | 2,355,348.60 | |
| WALT DISNEY CO/THE | 103,753 | 119.950 | 12,445,172.35 | |
| WARNER BROS DISCOVERY INC | 123,410 | 21.500 | 2,653,315.00 | |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC | 15,382 | 50.940 | 783,559.08 | |
| アメリカ・ドル小計 | 18,020,800 | | 2,118,946,404.42 (270,377,561,204) | |

| | | | | | |
|-------------------------------|---------------------------------|---------|--------------|--------------|--|
| カナダ・ ドル | CAMECO CORP | 18,890 | 34.340 | 648,682.60 | |
| | CANADIAN NATURAL RESOURCES | 68,240 | 78.050 | 5,326,132.00 | |
| | CENOVUS ENERGY INC | 75,060 | 20.940 | 1,571,756.40 | |
| | ENBRIDGE INC | 116,715 | 56.180 | 6,557,048.70 | |
| | IMPERIAL OIL LTD | 12,999 | 59.400 | 772,140.60 | |
| | KEYERA CORP | 11,374 | 31.630 | 359,759.62 | |
| | PARKLAND CORP | 7,666 | 34.000 | 260,644.00 | |
| | PEMBINA PIPELINE CORP | 32,172 | 47.950 | 1,542,647.40 | |
| | SUNCOR ENERGY INC | 85,505 | 39.780 | 3,401,388.90 | |
| | TC ENERGY CORP | 53,918 | 71.160 | 3,836,804.88 | |
| | TOURMALINE OIL CORP | 16,638 | 63.250 | 1,052,353.50 | |
| | AGNICO EAGLE MINES LTD | 27,243 | 73.140 | 1,992,553.02 | |
| | BARRICK GOLD CORP | 102,105 | 28.940 | 2,954,918.70 | |
| | CCL INDUSTRIES INC - CL B | 8,705 | 56.520 | 492,006.60 | |
| | FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 31,672 | 35.370 | 1,120,238.64 | |
| | FRANCO-NEVADA CORP | 11,432 | 198.040 | 2,263,993.28 | |
| | IVANHOE MINES LTD-CL A | 32,698 | 10.610 | 346,925.78 | |
| | KINROSS GOLD CORP | 63,501 | 6.750 | 428,631.75 | |
| | LUNDIN MINING CORP | 46,446 | 12.010 | 557,816.46 | |
| | NUTRIEN LTD | 33,270 | 126.710 | 4,215,641.70 | |
| | PAN AMERICAN SILVER CORP | 11,763 | 32.420 | 381,356.46 | |
| | TECK RESOURCES LTD-CLS B | 24,814 | 45.670 | 1,133,255.38 | |
| | WEST FRASER TIMBER CO LTD | 4,438 | 110.700 | 491,286.60 | |
| | WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 24,335 | 59.280 | 1,442,578.80 | |
| | BALLARD POWER SYSTEMS INC | 17,008 | 11.570 | 196,782.56 | |
| | CAE INC | 17,963 | 33.750 | 606,251.25 | |
| | TOROMONT INDUSTRIES LTD | 3,843 | 119.760 | 460,237.68 | |
| | WSP GLOBAL INC | 6,141 | 155.770 | 956,583.57 | |
| | GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | 9,913 | 39.320 | 389,779.16 | |
| | RITCHIE BROS AUCTIONEERS | 5,667 | 71.840 | 407,117.28 | |
| | THOMSON REUTERS CORP | 9,710 | 131.950 | 1,281,234.50 | |
| | AIR CANADA | 12,083 | 24.220 | 292,650.26 | |
| | CANADIAN NATL RAILWAY CO | 40,807 | 158.090 | 6,451,178.63 | |
| | CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 53,134 | 94.880 | 5,041,353.92 | |
| TFI INTERNATIONAL INC | 5,097 | 109.420 | 557,713.74 | | |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 16,331 | 79.430 | 1,297,171.33 | | |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 9,066 | 45.350 | 411,143.10 | | |
| RESTAURANT BRANDS INTERN | 17,686 | 74.720 | 1,321,497.92 | | |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A | 3,001 | 182.400 | 547,382.40 | | |

| | | | | |
|----------------------------------|---------|-----------|---------------|--|
| DOLLARAMA INC | 17,025 | 74.630 | 1,270,575.75 | |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 48,248 | 56.970 | 2,748,688.56 | |
| EMPIRE CO LTD 'A' | 9,148 | 42.770 | 391,259.96 | |
| LOBLAW COMPANIES LTD | 8,683 | 117.150 | 1,017,213.45 | |
| METRO INC/CN | 13,109 | 70.240 | 920,776.16 | |
| WESTON (GEORGE) LTD | 4,984 | 159.000 | 792,456.00 | |
| SAPUTO INC | 13,425 | 30.190 | 405,300.75 | |
| BAUSCH HEALTH COS INC | 16,447 | 27.320 | 449,332.04 | |
| CANOPY GROWTH CORP | 11,251 | 7.070 | 79,544.57 | |
| BANK OF MONTREAL | 36,684 | 141.440 | 5,188,584.96 | |
| BANK OF NOVA SCOTIA | 68,902 | 84.930 | 5,851,846.86 | |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 26,066 | 143.830 | 3,749,072.78 | |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 19,626 | 92.190 | 1,809,320.94 | |
| ROYAL BANK OF CANADA | 80,808 | 131.600 | 10,634,332.80 | |
| TORONTO-DOMINION BANK | 104,525 | 93.060 | 9,727,096.50 | |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE- CL A | 80,030 | 65.940 | 5,277,178.20 | |
| IGM FINANCIAL INC | 4,949 | 41.470 | 205,235.03 | |
| ONEX CORPORATION | 4,217 | 77.560 | 327,070.52 | |
| TMX GROUP LTD | 3,142 | 131.090 | 411,884.78 | |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 1,393 | 681.020 | 948,660.86 | |
| GREAT-WEST LIFECO INC | 14,200 | 36.170 | 513,614.00 | |
| IA FINANCIAL CORP INC | 4,851 | 71.710 | 347,865.21 | |
| INTACT FINANCIAL CORP | 10,095 | 179.990 | 1,816,999.05 | |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 110,844 | 25.760 | 2,855,341.44 | |
| POWER CORP OF CANADA | 31,768 | 38.290 | 1,216,396.72 | |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 33,220 | 66.040 | 2,193,848.80 | |
| FIRSTSERVICE CORP | 2,516 | 166.660 | 419,316.56 | |
| BLACKBERRY LTD | 25,993 | 7.730 | 200,925.89 | |
| CGI INC | 11,493 | 103.020 | 1,184,008.86 | |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 1,098 | 2,144.640 | 2,354,814.72 | |
| LIGHTSPEED COMMERCE INC | 6,363 | 29.650 | 188,662.95 | |
| NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG | 5,042 | 77.380 | 390,149.96 | |
| OPEN TEXT CORP | 15,337 | 53.040 | 813,474.48 | |
| SHOPIFY INC - CLASS A | 6,582 | 584.240 | 3,845,467.68 | |
| BCE INC | 5,509 | 71.570 | 394,279.13 | |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B | 20,818 | 73.280 | 1,525,543.04 | |
| TELUS CORP | 15,222 | 33.310 | 507,044.82 | |

| | | | | | |
|------------------------------|------------------------------|-----------|--------------|------------------------------------|--|
| | ALGONQUIN POWER & UTILITIES | 44,154 | 19.220 | 848,639.88 | |
| | ALTAGAS LTD | 17,347 | 29.540 | 512,430.38 | |
| | BROOKFIELD RENEWABLE COR-A | 6,336 | 47.290 | 299,629.44 | |
| | CANADIAN UTILITIES LTD-A | 7,344 | 39.260 | 288,325.44 | |
| | EMERA INC | 14,279 | 63.820 | 911,285.78 | |
| | FORTIS INC | 25,895 | 63.360 | 1,640,707.20 | |
| | HYDRO ONE LTD | 18,821 | 35.810 | 673,980.01 | |
| | NORTHLAND POWER INC | 10,870 | 39.800 | 432,626.00 | |
| | QUEBECOR INC -CL B | 9,953 | 32.390 | 322,377.67 | |
| | SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 27,232 | 38.780 | 1,056,056.96 | |
| | カナダ・ドル小計 | 2,224,893 | | 143,327,882.61 (14,362,887,116) | |
| オーストラリア・ドル | AMPOL LTD | 10,927 | 32.840 | 358,842.68 | |
| | SANTOS LTD | 182,883 | 8.150 | 1,490,496.45 | |
| | WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 14,025 | 27.220 | 381,760.50 | |
| | WOODSIDE PETROLEUM LTD | 54,981 | 32.070 | 1,763,240.67 | |
| | BHP GROUP LTD | 287,051 | 48.490 | 13,919,102.99 | |
| | BLUESCOPE STEEL LTD | 25,462 | 21.970 | 559,400.14 | |
| | EVOLUTION MINING LTD | 84,420 | 4.170 | 352,031.40 | |
| | FORTESCUE METALS GROUP LTD | 88,448 | 21.220 | 1,876,866.56 | |
| | JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI | 26,108 | 41.000 | 1,070,428.00 | |
| | MINERAL RESOURCES LTD | 11,662 | 60.700 | 707,883.40 | |
| | NEWCREST MINING LTD | 54,082 | 28.290 | 1,529,979.78 | |
| | NORTHERN STAR RESOURCES LTD | 65,844 | 10.730 | 706,506.12 | |
| | ORICA LTD | 17,981 | 16.540 | 297,405.74 | |
| | RIO TINTO LTD | 21,049 | 113.600 | 2,391,166.40 | |
| | SOUTH32 LTD | 276,348 | 4.840 | 1,337,524.32 | |
| | REECE LTD | 19,309 | 17.280 | 333,659.52 | |
| | BRAMBLES LTD | 74,638 | 10.730 | 800,865.74 | |
| | AURIZON HOLDINGS LTD | 94,440 | 3.900 | 368,316.00 | |
| | QANTAS AIRWAYS LTD | 45,831 | 5.640 | 258,486.84 | |
| | ARISTOCRAT LEISURE LTD | 30,749 | 32.660 | 1,004,262.34 | |
| CROWN RESORTS LTD | 21,863 | 12.840 | 280,720.92 | | |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | 3,794 | 80.910 | 306,972.54 | | |
| IDP EDUCATION LTD | 10,940 | 27.360 | 299,318.40 | | |
| TABCORP HOLDINGS LTD | 139,785 | 5.400 | 754,839.00 | | |
| WESFARMERS LTD | 65,345 | 49.300 | 3,221,508.50 | | |
| COLES GROUP LTD | 79,056 | 18.830 | 1,488,624.48 | | |

| | | | | | |
|-------|------------------------------|-----------|---------|-----------------|--|
| | ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI | 65,607 | 7.740 | 507,798.18 | |
| | WOOLWORTHS GROUP LTD | 69,646 | 39.320 | 2,738,480.72 | |
| | TREASURY WINE ESTATES LTD | 36,464 | 11.140 | 406,208.96 | |
| | COCHLEAR LTD | 4,095 | 233.170 | 954,831.15 | |
| | RAMSAY HEALTH CARE LTD | 9,446 | 84.370 | 796,959.02 | |
| | SONIC HEALTHCARE LTD | 24,258 | 36.410 | 883,233.78 | |
| | CSL LTD | 27,463 | 270.860 | 7,438,628.18 | |
| | AUST AND NZ BANKING GROUP | 156,874 | 27.780 | 4,357,959.72 | |
| | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 97,957 | 105.370 | 10,321,729.09 | |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 187,025 | 33.140 | 6,198,008.50 | |
| | WESTPAC BANKING CORP | 213,258 | 24.210 | 5,162,976.18 | |
| | ASX LTD | 11,180 | 82.530 | 922,685.40 | |
| | MACQUARIE GROUP LTD | 18,953 | 207.600 | 3,934,642.80 | |
| | INSURANCE AUSTRALIA GROUP | 117,187 | 4.450 | 521,482.15 | |
| | MEDIBANK PRIVATE LTD | 128,724 | 3.190 | 410,629.56 | |
| | QBE INSURANCE GROUP LTD | 80,863 | 12.120 | 980,059.56 | |
| | SUNCORP GROUP LTD | 63,933 | 11.210 | 716,688.93 | |
| | COMPUTERSHARE LTD | 33,563 | 25.300 | 849,143.90 | |
| | WISETECH GLOBAL LTD | 7,909 | 45.860 | 362,706.74 | |
| | XERO LTD | 7,459 | 97.840 | 729,788.56 | |
| | TELSTRA CORP LTD | 254,603 | 4.050 | 1,031,142.15 | |
| | ORIGIN ENERGY LTD | 117,278 | 6.720 | 788,108.16 | |
| | REA GROUP LTD | 2,833 | 125.740 | 356,221.42 | |
| | SEEK LTD | 17,266 | 27.570 | 476,023.62 | |
| | オーストラリア・ドル小計 | 3,560,865 | | 89,706,345.86 | |
| | | | | (8,232,351,360) | |
| 香港・ドル | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 153,924 | 55.850 | 8,596,655.40 | |
| | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 83,000 | 104.100 | 8,640,300.00 | |
| | XINYI GLASS HOLDINGS LTD | 94,000 | 16.240 | 1,526,560.00 | |
| | MTR CORP | 84,500 | 42.100 | 3,557,450.00 | |
| | SITC INTERNATIONAL HOLDINGS | 70,000 | 26.450 | 1,851,500.00 | |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 118,000 | 43.200 | 5,097,600.00 | |
| | SANDS CHINA LTD | 142,400 | 16.500 | 2,349,600.00 | |
| | CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU | 117,000 | 12.480 | 1,460,160.00 | |
| | BUDWEISER BREWING CO APAC LT | 89,600 | 19.800 | 1,774,080.00 | |
| | WH GROUP LTD | 581,500 | 5.360 | 3,116,840.00 | |

| | | | | | |
|-----------|------------------------------|-----------|---------|-----------------------------------|--|
| | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 187,500 | 29.100 | 5,456,250.00 | |
| | HANG SENG BANK LTD | 48,200 | 152.300 | 7,340,860.00 | |
| | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 67,100 | 323.400 | 21,700,140.00 | |
| | AIA GROUP LTD | 694,800 | 75.000 | 52,110,000.00 | |
| | CK ASSET HOLDINGS LTD | 126,924 | 53.550 | 6,796,780.20 | |
| | ESR CAYMAN LTD | 102,000 | 24.900 | 2,539,800.00 | |
| | HANG LUNG PROPERTIES LTD | 98,000 | 16.400 | 1,607,200.00 | |
| | HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 83,384 | 32.800 | 2,734,995.20 | |
| | NEW WORLD DEVELOPMENT | 84,833 | 30.700 | 2,604,373.10 | |
| | SINO LAND CO | 248,200 | 10.680 | 2,650,776.00 | |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 68,000 | 93.400 | 6,351,200.00 | |
| | SWIRE PACIFIC LTD - CL A | 27,000 | 43.800 | 1,182,600.00 | |
| | SWIRE PROPERTIES LTD | 53,000 | 19.580 | 1,037,740.00 | |
| | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 91,000 | 37.550 | 3,417,050.00 | |
| | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 41,000 | 54.000 | 2,214,000.00 | |
| | CLP HOLDINGS LTD | 94,100 | 77.650 | 7,306,865.00 | |
| | HONG KONG & CHINA GAS | 606,389 | 8.860 | 5,372,606.54 | |
| | POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 71,500 | 53.450 | 3,821,675.00 | |
| | 香港・ドル小計 | 4,326,854 | | 174,215,656.44 (2,832,746,574) | |
| シンガポール・ドル | KEPPEL CORP LTD | 70,500 | 6.690 | 471,645.00 | |
| | SINGAPORE TECH ENGINEERING | 108,600 | 4.150 | 450,690.00 | |
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 77,966 | 5.530 | 431,151.98 | |
| | GENTING SINGAPORE LTD | 327,500 | 0.810 | 265,275.00 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 103,200 | 4.470 | 461,304.00 | |
| | DBS GROUP HOLDINGS LTD | 102,000 | 33.400 | 3,406,800.00 | |
| | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 202,300 | 11.990 | 2,425,577.00 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 64,700 | 30.780 | 1,991,466.00 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 42,800 | 9.850 | 421,580.00 | |
| | CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI | 136,600 | 4.060 | 554,596.00 | |
| | CITY DEVELOPMENTS LTD | 25,800 | 8.480 | 218,784.00 | |
| | UOL GROUP LTD | 30,900 | 7.120 | 220,008.00 | |
| | VENTURE CORP LTD | 15,700 | 17.000 | 266,900.00 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 439,815 | 2.690 | 1,183,102.35 | |
| | シンガポール・ドル小計 | 1,748,381 | | 12,768,879.33 (1,186,995,023) | |

| | | | | | |
|---------------------------------|---------------------------------|-----------|--------------|--------------|---------------|
| ニュー ジーラン ド・ドル | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 70,711 | 7.850 | 555,081.35 | |
| | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 31,250 | 22.290 | 696,562.50 | |
| | RYMAN HEALTHCARE LTD | 24,028 | 9.200 | 221,057.60 | |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 113,841 | 4.920 | 560,097.72 | |
| | MERCURY NZ LTD | 26,913 | 5.910 | 159,055.83 | |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 66,454 | 4.830 | 320,972.82 | |
| ニュージーランド・ドル 小計 | | 333,197 | | 2,512,827.82 | (212,484,719) |
| イギリ ス・ボン ド | BP PLC | 1,097,928 | 3.688 | 4,049,158.46 | |
| | SHELL PLC | 439,968 | 20.745 | 9,127,136.16 | |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 70,253 | 32.235 | 2,264,605.45 | |
| | ANTOFAGASTA PLC | 19,439 | 14.450 | 280,893.55 | |
| | CRODA INTERNATIONAL PLC | 7,838 | 75.600 | 592,552.80 | |
| | GLENCORE PLC | 576,604 | 4.493 | 2,590,681.77 | |
| | JOHNSON MATTHEY PLC | 10,074 | 18.365 | 185,009.01 | |
| | MONDI PLC | 25,128 | 14.855 | 373,276.44 | |
| | RIO TINTO PLC | 64,866 | 53.720 | 3,484,601.52 | |
| | ASHTREAD GROUP PLC | 23,686 | 43.940 | 1,040,762.84 | |
| | BAE SYSTEMS PLC | 189,839 | 7.322 | 1,390,001.15 | |
| | BUNZL PLC | 17,064 | 30.380 | 518,404.32 | |
| | DCC PLC | 5,954 | 59.300 | 353,072.20 | |
| | FERGUSON PLC | 12,017 | 102.050 | 1,226,334.85 | |
| | MELROSE INDUSTRIES PLC | 221,714 | 1.203 | 266,721.94 | |
| | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 494,144 | 0.868 | 428,916.99 | |
| | SMITHS GROUP PLC | 24,369 | 14.500 | 353,350.50 | |
| | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 4,459 | 122.650 | 546,896.35 | |
| | EXPERIAN PLC | 54,749 | 27.530 | 1,507,239.97 | |
| | INTERTEK GROUP PLC | 8,184 | 50.660 | 414,601.44 | |
| | RELX PLC | 106,284 | 24.050 | 2,556,130.20 | |
| | RENTOKIL INITIAL PLC | 112,603 | 5.324 | 599,498.37 | |
| | BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 64,766 | 5.102 | 330,436.13 | |
| | BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE | 6,637 | 40.810 | 270,855.97 | |
| | BURBERRY GROUP PLC | 26,233 | 15.580 | 408,710.14 | |
| | PERSIMMON PLC | 16,916 | 21.940 | 371,137.04 | |
| | TAYLOR WIMPEY PLC | 225,588 | 1.280 | 288,752.64 | |
| COMPASS GROUP PLC | 97,177 | 16.995 | 1,651,523.11 | | |
| ENTAIN PLC | 37,600 | 14.690 | 552,344.00 | | |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 9,587 | 50.680 | 485,869.16 | | |
| WHITBREAD PLC | 11,282 | 27.900 | 314,767.80 | | |
| JD SPORTS FASHION PLC | 144,300 | 1.404 | 202,597.20 | | |

| | | | | |
|---------------------------------|-----------|---------|--------------|--|
| KINGFISHER PLC | 109,678 | 2.559 | 280,666.00 | |
| NEXT PLC | 6,860 | 61.280 | 420,380.80 | |
| OCADO GROUP PLC | 27,379 | 10.360 | 283,646.44 | |
| SAINSBURY (J) PLC | 113,480 | 2.434 | 276,210.32 | |
| TESCO PLC | 439,670 | 2.686 | 1,180,953.62 | |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 16,771 | 16.300 | 273,367.30 | |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 125,847 | 32.770 | 4,124,006.19 | |
| COCA-COLA HBC AG-DI | 8,704 | 16.385 | 142,615.04 | |
| DIAGEO PLC | 134,031 | 39.390 | 5,279,481.09 | |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 50,003 | 16.225 | 811,298.67 | |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 40,047 | 63.160 | 2,529,368.52 | |
| UNILEVER PLC | 147,693 | 36.065 | 5,326,548.04 | |
| NMC HEALTH PLC | 3,940 | 0.010 | 39.40 | |
| SMITH & NEPHEW PLC | 44,355 | 12.665 | 561,756.07 | |
| ASTRAZENECA PLC | 88,548 | 102.340 | 9,062,002.32 | |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 289,657 | 17.392 | 5,037,714.54 | |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 7,581 | 20.390 | 154,576.59 | |
| BARCLAYS PLC | 904,741 | 1.441 | 1,303,731.78 | |
| HSBC HOLDINGS PLC | 1,167,394 | 5.016 | 5,855,648.30 | |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 4,178,120 | 0.454 | 1,896,866.48 | |
| NATWEST GROUP PLC | 316,287 | 2.182 | 690,138.23 | |
| STANDARD CHARTERED PLC | 146,561 | 4.973 | 728,847.85 | |
| 3I GROUP PLC | 49,338 | 13.185 | 650,521.53 | |
| ABRDN PLC | 123,263 | 1.915 | 236,048.64 | |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 19,572 | 9.788 | 191,570.73 | |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP | 17,716 | 80.680 | 1,429,326.88 | |
| M&G PLC | 133,064 | 2.114 | 281,297.29 | |
| SCHRODERS PLC | 6,213 | 29.660 | 184,277.58 | |
| ST JAMES' S PLACE PLC | 33,823 | 13.165 | 445,279.79 | |
| ADMIRAL GROUP PLC | 11,535 | 25.090 | 289,413.15 | |
| AVIVA PLC | 229,027 | 4.288 | 982,067.77 | |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 313,637 | 2.525 | 791,933.42 | |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | 36,851 | 6.110 | 225,159.61 | |
| PRUDENTIAL PLC | 161,840 | 9.892 | 1,600,921.28 | |
| AVEVA GROUP PLC | 6,037 | 23.810 | 143,740.97 | |
| SAGE GROUP PLC/THE | 55,987 | 7.258 | 406,353.64 | |
| HALMA PLC | 24,375 | 24.770 | 603,768.75 | |
| BT GROUP PLC | 545,432 | 1.882 | 1,026,503.02 | |
| VODAFONE GROUP PLC | 1,546,057 | 1.267 | 1,958,854.21 | |

| | | | | | |
|----------------------------|------------------------------|------------|------------|------------------------------------|--|
| | NATIONAL GRID PLC | 199,260 | 11.810 | 2,353,260.60 | |
| | SEVERN TRENT PLC | 12,418 | 30.530 | 379,121.54 | |
| | SSE PLC | 64,516 | 18.275 | 1,179,029.90 | |
| | UNITED UTILITIES GROUP PLC | 42,035 | 11.325 | 476,046.37 | |
| | AUTO TRADER GROUP PLC | 51,319 | 6.324 | 324,541.35 | |
| | INFORMA PLC | 78,152 | 5.848 | 457,032.89 | |
| | PEARSON PLC | 39,623 | 7.874 | 311,991.50 | |
| | WPP PLC | 63,987 | 10.005 | 640,189.93 | |
| | イギリス・ポンド小計 | 16,459,674 | | 102,814,955.40 (16,721,824,346) | |
| イスラエル・シュケル | ICL GROUP LTD | 41,773 | 36.920 | 1,542,259.16 | |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 1,389 | 721.500 | 1,002,163.50 | |
| | BANK HAPOALIM BM | 66,403 | 30.970 | 2,056,500.91 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 77,079 | 35.420 | 2,730,138.18 | |
| | ISRAEL DISCOUNT BANK-A | 54,674 | 19.500 | 1,066,143.00 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 9,249 | 122.900 | 1,136,702.10 | |
| | AZRIELI GROUP LTD | 2,140 | 288.100 | 616,534.00 | |
| | NICE LTD | 3,251 | 669.100 | 2,175,244.10 | |
| | イスラエル・シュケル小計 | 255,958 | | 12,325,684.95 (478,884,907) | |
| スイス・フラン | CLARIANT AG-REG | 10,101 | 15.460 | 156,161.46 | |
| | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 356 | 854.500 | 304,202.00 | |
| | GIVAUDAN-REG | 521 | 3,866.000 | 2,014,186.00 | |
| | HOLCIM LTD | 31,603 | 48.280 | 1,525,792.84 | |
| | SIKA AG-REG | 7,800 | 299.500 | 2,336,100.00 | |
| | ABB LTD-REG | 96,015 | 29.250 | 2,808,438.75 | |
| | GEBERIT AG-REG | 1,986 | 554.200 | 1,100,641.20 | |
| | SCHINDLER HOLDING AG-REG | 941 | 187.400 | 176,343.40 | |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 2,132 | 188.500 | 401,882.00 | |
| | VAT GROUP AG | 1,436 | 316.600 | 454,637.60 | |
| | ADECCO GROUP AG-REG | 9,118 | 39.130 | 356,787.34 | |
| | SGS SA-REG | 374 | 2,520.000 | 942,480.00 | |
| | KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG | 2,981 | 277.600 | 827,525.60 | |
| | CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 30,335 | 110.100 | 3,339,883.50 | |
| | SWATCH GROUP AG/THE-BR | 1,716 | 245.100 | 420,591.60 | |
| | SWATCH GROUP AG/THE-REG | 2,516 | 47.200 | 118,755.20 | |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG | 216 | 2,240.000 | 483,840.00 | | |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC | 59 | 10,780.000 | 636,020.00 | | |

| | | | | | |
|--------------------|------------------------------|---------|---------------|-----------------------------------|--|
| | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG | 6 | 112,100.000 | 672,600.00 | |
| | NESTLE SA-REG | 160,218 | 125.860 | 20,165,037.48 | |
| | ALCON INC | 29,513 | 73.900 | 2,181,010.70 | |
| | SONOVA HOLDING AG-REG | 3,269 | 354.400 | 1,158,533.60 | |
| | STRAUMANN HOLDING AG-REG | 5,310 | 118.550 | 629,500.50 | |
| | BACHEM HOLDING AG-REG B | 322 | 440.000 | 141,680.00 | |
| | LONZA GROUP AG-REG | 4,343 | 592.000 | 2,571,056.00 | |
| | NOVARTIS AG-REG | 125,305 | 85.920 | 10,766,205.60 | |
| | ROCHE HOLDING AG-BR | 1,921 | 392.800 | 754,568.80 | |
| | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 40,075 | 364.300 | 14,599,322.50 | |
| | VIFOR PHARMA AG | 2,638 | 171.350 | 452,021.30 | |
| | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 145,488 | 6.726 | 978,552.28 | |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 12,550 | 45.970 | 576,923.50 | |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 1,203 | 1,076.500 | 1,295,029.50 | |
| | UBS GROUP AG-REG | 204,228 | 16.240 | 3,316,662.72 | |
| | BALOISE HOLDING AG - REG | 2,475 | 168.100 | 416,047.50 | |
| | SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 1,834 | 595.000 | 1,091,230.00 | |
| | SWISS RE AG | 16,690 | 78.900 | 1,316,841.00 | |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 8,712 | 436.700 | 3,804,530.40 | |
| | SWISS PRIME SITE-REG | 3,906 | 95.200 | 371,851.20 | |
| | TEMENOS AG - REG | 3,743 | 87.080 | 325,940.44 | |
| | LOGITECH INTERNATIONAL-REG | 10,426 | 63.420 | 661,216.92 | |
| | SWISSCOM AG-REG | 1,399 | 561.000 | 784,839.00 | |
| | スイス・フラン小計 | 985,780 | | 87,435,469.43 (11,656,022,430) | |
| デンマーク・クローネ | CHR HANSEN HOLDING A/S | 5,509 | 539.400 | 2,971,554.60 | |
| | NOVOZYMES A/S-B SHARES | 11,512 | 457.800 | 5,270,193.60 | |
| | ROCKWOOL A/S-B SHS | 513 | 1,985.000 | 1,018,305.00 | |
| | VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 60,424 | 189.680 | 11,461,224.32 | |
| | AP MOLLER-MAERSK A/S-A | 168 | 17,740.000 | 2,980,320.00 | |
| | AP MOLLER-MAERSK A/S-B | 311 | 18,155.000 | 5,646,205.00 | |
| | DSV A/S | 11,866 | 1,129.500 | 13,402,647.00 | |
| | PANDORA A/S | 5,888 | 635.200 | 3,740,057.60 | |
| | CARLSBERG AS-B | 5,585 | 879.800 | 4,913,683.00 | |
| | AMBU A/S-B | 8,356 | 102.300 | 854,818.80 | |
| | COLOPLAST-B | 6,399 | 1,001.500 | 6,408,598.50 | |
| | DEMANT A/S | 8,178 | 298.000 | 2,437,044.00 | |
| | GN STORE NORD A/S | 6,484 | 275.600 | 1,786,990.40 | |
| | GENMAB A/S | 3,688 | 2,504.000 | 9,234,752.00 | |
| NOVO NORDISK A/S-B | 96,328 | 778.100 | 74,952,816.80 | | |

| | | | | | |
|---------------------------|----------------------------|---------|--------------|-----------------|--|
| | DANSKE BANK A/S | 39,103 | 117.000 | 4,575,051.00 | |
| | TRYG A/S | 16,989 | 168.000 | 2,854,152.00 | |
| | ORSTED A/S | 10,423 | 836.600 | 8,719,881.80 | |
| | デンマーク・クローネ小計 | 297,724 | | 163,228,295.42 | |
| | | | | (3,003,400,636) | |
| ノルウェー・クローネ | AKER BP ASA | 6,316 | 330.000 | 2,084,280.00 | |
| | EQUINOR ASA | 55,409 | 313.800 | 17,387,344.20 | |
| | NORSK HYDRO ASA | 83,294 | 76.400 | 6,363,661.60 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 9,005 | 462.500 | 4,164,812.50 | |
| | MOWI ASA | 23,318 | 253.800 | 5,918,108.40 | |
| | ORKLA ASA | 46,955 | 75.780 | 3,558,249.90 | |
| | DNB BANK ASA | 52,746 | 195.500 | 10,311,843.00 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 11,412 | 213.000 | 2,430,756.00 | |
| | TELENOR ASA | 40,694 | 131.000 | 5,330,914.00 | |
| | ADEVINTA ASA | 15,540 | 70.250 | 1,091,685.00 | |
| | SCHIBSTED ASA-B SHS | 5,480 | 178.500 | 978,180.00 | |
| | SCHIBSTED ASA-CL A | 3,338 | 196.600 | 656,250.80 | |
| | ノルウェー・クローネ小計 | 353,507 | | 60,276,085.40 | |
| | | | | (844,467,956) | |
| スウェーデン・クローナ | LUNDIN ENERGY AB | 13,316 | 400.500 | 5,333,058.00 | |
| | BOLIDEN AB | 15,297 | 430.000 | 6,577,710.00 | |
| | SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B | 34,370 | 185.650 | 6,380,790.50 | |
| | ALFA LAVAL AB | 18,697 | 310.700 | 5,809,157.90 | |
| | ASSA ABLOY AB-B | 60,292 | 251.100 | 15,139,321.20 | |
| | ATLAS COPCO AB-A SHS | 37,342 | 462.600 | 17,274,409.20 | |
| | ATLAS COPCO AB-B SHS | 22,320 | 402.500 | 8,983,800.00 | |
| | EPIROC AB-A | 34,230 | 198.650 | 6,799,789.50 | |
| | EPIROC AB-B | 19,836 | 168.150 | 3,335,423.40 | |
| | HUSQVARNA AB-B SHS | 18,593 | 89.980 | 1,672,998.14 | |
| | INVESTMENT AB LATOUR-B SHS | 8,223 | 265.800 | 2,185,673.40 | |
| | LIFCO AB-B SHS | 15,149 | 210.100 | 3,182,804.90 | |
| | NIBE INDUSTRIER AB-B SHS | 89,271 | 102.000 | 9,105,642.00 | |
| | SANDVIK AB | 61,070 | 194.550 | 11,881,168.50 | |
| | SKANSKA AB-B SHS | 17,183 | 192.500 | 3,307,727.50 | |
| | SKF AB-B SHARES | 20,607 | 157.500 | 3,245,602.50 | |
| | VOLVO AB-A SHS | 13,283 | 163.400 | 2,170,442.20 | |
| | VOLVO AB-B SHS | 80,338 | 158.920 | 12,767,314.96 | |
| | SECURITAS AB-B SHS | 16,123 | 115.250 | 1,858,175.75 | |
| | ELECTROLUX AB-B | 11,555 | 153.320 | 1,771,612.60 | |
| EVOLUTION AB | 10,669 | 925.800 | 9,877,360.20 | | |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS | 40,148 | 125.620 | 5,043,391.76 | | |

| | | | | | |
|-----|---------------------------------|-----------|---------|-----------------|--|
| | SWEDISH MATCH AB | 84,640 | 75.880 | 6,422,483.20 | |
| | ESSITY AKTIEBOLAG-B | 36,076 | 260.600 | 9,401,405.60 | |
| | GETINGE AB-B SHS | 13,151 | 343.900 | 4,522,628.90 | |
| | NORDEA BANK ABP | 184,357 | 99.000 | 18,251,343.00 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 100,891 | 106.800 | 10,775,158.80 | |
| | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 77,668 | 93.580 | 7,268,171.44 | |
| | SWEDBANK AB - A SHARES | 57,603 | 156.700 | 9,026,390.10 | |
| | EQT AB | 15,443 | 323.000 | 4,988,089.00 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-A SHS | 7,211 | 245.700 | 1,771,742.70 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 10,642 | 239.000 | 2,543,438.00 | |
| | INVESTOR AB-A SHS | 27,415 | 204.400 | 5,603,626.00 | |
| | INVESTOR AB-B SHS | 101,275 | 190.740 | 19,317,193.50 | |
| | KINNEVIK AB - B | 12,465 | 191.950 | 2,392,656.75 | |
| | LUNDBERGS AB-B SHS | 3,368 | 450.800 | 1,518,294.40 | |
| | FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS | 5,323 | 491.400 | 2,615,722.20 | |
| | SAGAX AB-B | 9,651 | 247.300 | 2,386,692.30 | |
| | SINCH AB | 27,690 | 51.420 | 1,423,819.80 | |
| | ERICSSON LM-B SHS | 159,685 | 81.450 | 13,006,343.25 | |
| | HEXAGON AB-B SHS | 117,010 | 124.450 | 14,561,894.50 | |
| | TELE2 AB-B SHS | 25,537 | 149.250 | 3,811,397.25 | |
| | TELIA CO AB | 143,404 | 38.920 | 5,581,283.68 | |
| | EMBRACER GROUP AB | 30,012 | 68.820 | 2,065,425.84 | |
| | スウェーデン・クローナ 小計 | 1,908,429 | | 292,958,574.32 | |
| | | | | (3,852,405,252) | |
| ユーロ | ENI SPA | 146,752 | 12.930 | 1,897,503.36 | |
| | GALP ENERGIA SGPS SA | 25,920 | 10.650 | 276,048.00 | |
| | NESTE OYJ | 23,055 | 42.630 | 982,834.65 | |
| | OMV AG | 8,389 | 44.020 | 369,283.78 | |
| | REPSOL SA | 79,358 | 12.605 | 1,000,307.59 | |
| | TENARIS SA | 25,963 | 13.590 | 352,837.17 | |
| | TOTALENERGIES SE | 142,236 | 44.030 | 6,262,651.08 | |
| | AIR LIQUIDE SA | 26,340 | 159.340 | 4,197,015.60 | |
| | AKZO NOBEL N.V. | 9,886 | 82.600 | 816,583.60 | |
| | ARCELORMITTAL | 37,054 | 26.920 | 997,493.68 | |
| | ARKEMA | 3,250 | 109.150 | 354,737.50 | |
| | BASF SE | 53,726 | 51.730 | 2,779,245.98 | |
| | COVESTRO AG | 11,797 | 41.110 | 484,974.67 | |
| | CRH PLC | 43,426 | 37.570 | 1,631,514.82 | |
| | EVONIK INDUSTRIES AG | 10,952 | 24.760 | 271,171.52 | |
| | FUCHS PETROLUB SE-PREF | 3,370 | 30.820 | 103,863.40 | |

| | | | | |
|---------------------------------|--------|---------|--------------|--|
| HEIDELBERGCEMENT AG | 8,677 | 53.960 | 468,210.92 | |
| KONINKLIJKE DSM NV | 10,433 | 153.700 | 1,603,552.10 | |
| LANXESS AG | 4,409 | 36.840 | 162,427.56 | |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 12,921 | 39.120 | 505,469.52 | |
| SOLVAY SA | 4,802 | 88.620 | 425,553.24 | |
| STORA ENSO OYJ-R SHS | 30,234 | 17.455 | 527,734.47 | |
| SYMRISE AG | 6,785 | 109.250 | 741,261.25 | |
| UMICORE | 10,288 | 35.690 | 367,178.72 | |
| UPM-KYMMENE OYJ | 33,126 | 31.600 | 1,046,781.60 | |
| VOESTALPINE AG | 7,382 | 23.980 | 177,020.36 | |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 13,189 | 24.360 | 321,284.04 | |
| AIRBUS SE | 34,199 | 103.000 | 3,522,497.00 | |
| ALSTOM | 17,665 | 21.860 | 386,156.90 | |
| BOUYGUES SA | 11,049 | 32.570 | 359,865.93 | |
| BRENNTAG SE | 9,920 | 73.340 | 727,532.80 | |
| CNH INDUSTRIAL NV | 54,775 | 13.300 | 728,507.50 | |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN | 29,471 | 54.490 | 1,605,874.79 | |
| DAIMLER TRUCK HOLDING AG | 23,340 | 25.500 | 595,170.00 | |
| DASSAULT AVIATION SA | 1,720 | 157.300 | 270,556.00 | |
| EIFFAGE | 4,989 | 94.580 | 471,859.62 | |
| FERROVIAL SA | 24,693 | 24.310 | 600,286.83 | |
| GEA GROUP AG | 8,178 | 37.030 | 302,831.34 | |
| IMCD NV | 3,214 | 150.900 | 484,992.60 | |
| KINGSPAN GROUP PLC | 8,978 | 87.020 | 781,265.56 | |
| KION GROUP AG | 3,179 | 56.700 | 180,249.30 | |
| KNORR-BREMSE AG | 3,881 | 67.660 | 262,588.46 | |
| KONE OYJ-B | 20,623 | 45.400 | 936,284.20 | |
| LEGRAND SA | 15,079 | 83.860 | 1,264,524.94 | |
| MTU AERO ENGINES AG | 2,957 | 189.050 | 559,020.85 | |
| PRYSMIAN SPA | 17,186 | 30.270 | 520,220.22 | |
| RATIONAL AG | 350 | 606.000 | 212,100.00 | |
| SAFRAN SA | 20,172 | 104.060 | 2,099,098.32 | |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 31,211 | 139.020 | 4,338,953.22 | |
| SIEMENS AG-REG | 44,055 | 115.980 | 5,109,498.90 | |
| SIEMENS ENERGY AG | 19,855 | 18.765 | 372,579.07 | |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE | 11,482 | 15.570 | 178,774.74 | |
| THALES SA | 5,403 | 123.450 | 667,000.35 | |
| VINCI SA | 29,309 | 94.100 | 2,757,976.90 | |
| WARTSILA OYJ ABP | 26,753 | 8.206 | 219,535.11 | |
| BUREAU VERITAS SA | 17,817 | 26.740 | 476,426.58 | |
| RANDSTAD NV | 6,241 | 52.520 | 327,777.32 | |
| TELEPERFORMANCE | 3,420 | 341.000 | 1,166,220.00 | |

| | | | | |
|----------------------------------|---------|-----------|--------------|--|
| WOLTERS KLUWER | 14,578 | 95.580 | 1,393,365.24 | |
| ADP | 1,346 | 141.350 | 190,257.10 | |
| AENA SME SA | 4,377 | 147.100 | 643,856.70 | |
| ATLANTIA SPA | 26,501 | 22.770 | 603,427.77 | |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 33,148 | 7.205 | 238,831.34 | |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 54,453 | 41.220 | 2,244,552.66 | |
| GETLINK SE | 22,311 | 17.675 | 394,346.92 | |
| INPOST SA | 10,902 | 5.840 | 63,667.68 | |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 17,873 | 77.470 | 1,384,621.31 | |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF | 2,564 | 69.350 | 177,813.40 | |
| CONTINENTAL AG | 5,578 | 65.300 | 364,243.40 | |
| FAURECIA | 6,090 | 22.910 | 139,521.90 | |
| FERRARI NV | 6,949 | 195.600 | 1,359,224.40 | |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG | 49,868 | 63.830 | 3,183,074.44 | |
| MICHELIN (CGDE) | 9,617 | 116.950 | 1,124,708.15 | |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PRF | 7,765 | 79.260 | 615,453.90 | |
| RENAULT SA | 8,830 | 23.115 | 204,105.45 | |
| STELLANTIS NV | 118,658 | 12.800 | 1,518,822.40 | |
| VALEO | 14,444 | 17.260 | 249,303.44 | |
| VOLKSWAGEN AG | 1,960 | 209.900 | 411,404.00 | |
| VOLKSWAGEN AG-PREF | 10,563 | 149.020 | 1,574,098.26 | |
| ADIDAS AG | 11,195 | 192.240 | 2,152,126.80 | |
| ESSILORLUXOTTICA | 16,375 | 163.900 | 2,683,862.50 | |
| HERMES INTERNATIONAL | 1,777 | 1,179.000 | 2,095,083.00 | |
| KERING | 4,123 | 506.200 | 2,087,062.60 | |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 15,873 | 615.600 | 9,771,418.80 | |
| MONCLER SPA | 12,209 | 47.680 | 582,125.12 | |
| PUMA SE | 6,459 | 71.360 | 460,914.24 | |
| SEB SA | 1,127 | 120.600 | 135,916.20 | |
| ACCOR SA | 10,451 | 30.350 | 317,187.85 | |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI | 8,869 | 96.760 | 858,164.44 | |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM | 5,785 | 34.860 | 201,665.10 | |
| SODEXO SA | 4,760 | 72.340 | 344,338.40 | |
| DELIVERY HERO SE | 8,530 | 31.250 | 266,562.50 | |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL | 58,328 | 20.250 | 1,181,142.00 | |
| JUST EAT TAKEAWAY | 9,307 | 25.295 | 235,420.56 | |
| PROSUS NV | 54,174 | 42.675 | 2,311,875.45 | |
| ZALANDO SE | 12,367 | 39.500 | 488,496.50 | |

| | | | | |
|----------------------------------|--------|---------|--------------|--|
| CARREFOUR SA | 35,990 | 19.800 | 712,602.00 | |
| COLRUYT SA | 2,164 | 34.980 | 75,696.72 | |
| HELLOFRESH SE | 9,790 | 35.730 | 349,796.70 | |
| JERONIMO MARTINS | 12,978 | 20.300 | 263,453.40 | |
| KESKO OYJ-B SHS | 13,402 | 23.720 | 317,895.44 | |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 55,657 | 28.105 | 1,564,239.98 | |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 49,732 | 54.760 | 2,723,324.32 | |
| DANONE | 37,154 | 56.180 | 2,087,311.72 | |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV | 28,021 | 10.630 | 297,863.23 | |
| HEINEKEN HOLDING NV | 6,168 | 75.100 | 463,216.80 | |
| HEINEKEN NV | 14,659 | 94.480 | 1,384,982.32 | |
| JDE PEET'S NV | 6,660 | 27.440 | 182,750.40 | |
| KERRY GROUP PLC-A | 8,193 | 101.600 | 832,408.80 | |
| PERNOD RICARD SA | 11,879 | 192.350 | 2,284,925.65 | |
| REMY COINTREAU | 1,273 | 186.300 | 237,159.90 | |
| BEIERSDORF AG | 5,138 | 96.640 | 496,536.32 | |
| HENKEL AG & CO KGAA | 5,974 | 60.650 | 362,323.10 | |
| HENKEL AG & CO KGAA VOR- PREF | 11,499 | 61.580 | 708,108.42 | |
| L'OREAL | 14,230 | 341.900 | 4,865,237.00 | |
| AMPLIFON SPA | 7,567 | 38.140 | 288,605.38 | |
| BIOMERIEUX | 2,791 | 91.100 | 254,260.10 | |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR | 2,161 | 126.250 | 272,826.25 | |
| DIASORIN SPA | 1,313 | 124.000 | 162,812.00 | |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & | 11,118 | 60.400 | 671,527.20 | |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 26,317 | 33.660 | 885,830.22 | |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 52,727 | 24.975 | 1,316,856.82 | |
| ORPEA | 2,695 | 34.450 | 92,842.75 | |
| SARTORIUS AG-VORZUG | 1,308 | 367.300 | 480,428.40 | |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 16,426 | 54.000 | 887,004.00 | |
| ARGENX SE | 2,644 | 293.400 | 775,749.60 | |
| BAYER AG-REG | 55,293 | 64.430 | 3,562,527.99 | |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 7,010 | 91.120 | 638,751.20 | |
| GRIFOLS SA | 15,169 | 17.000 | 257,873.00 | |
| IPSEN | 1,498 | 109.800 | 164,480.40 | |
| MERCK KGAA | 7,777 | 171.650 | 1,334,922.05 | |
| ORION OYJ-CLASS B | 6,261 | 40.120 | 251,191.32 | |
| QIAGEN N.V. | 12,543 | 41.990 | 526,680.57 | |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA | 4,578 | 45.670 | 209,077.26 | |
| SANOFI | 65,399 | 100.900 | 6,598,759.10 | |

| | | | | |
|---------------------------------|---------|---------|--------------|--|
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 1,555 | 310.100 | 482,205.50 | |
| UCB SA | 6,623 | 108.500 | 718,595.50 | |
| ABN AMRO BANK NV-CVA | 28,787 | 11.500 | 331,050.50 | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 378,832 | 4.810 | 1,822,181.92 | |
| BANCO ESPIRITO SANTO-REG | 187,906 | 0.010 | 1,879.06 | |
| BANCO SANTANDER SA | 983,269 | 3.054 | 3,002,903.52 | |
| BNP PARIBAS | 65,416 | 50.850 | 3,326,403.60 | |
| CAIXABANK SA | 277,723 | 3.023 | 839,556.62 | |
| COMMERZBANK AG | 46,644 | 6.338 | 295,629.67 | |
| CREDIT AGRICOLE SA | 73,102 | 10.432 | 762,600.06 | |
| ERSTE GROUP BANK AG | 19,383 | 30.930 | 599,516.19 | |
| FINECOBANK SPA | 32,034 | 13.410 | 429,575.94 | |
| ING GROEP NV | 230,297 | 9.373 | 2,158,573.78 | |
| INTESA SANPAOLO | 977,250 | 1.948 | 1,903,683.00 | |
| KBC GROUP NV | 13,092 | 64.440 | 843,648.48 | |
| MEDIOBANCA SPA | 31,303 | 9.230 | 288,926.69 | |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA | 7,066 | 10.610 | 74,970.26 | |
| SOCIETE GENERALE SA | 41,025 | 23.465 | 962,651.62 | |
| UNICREDIT SPA | 112,845 | 9.139 | 1,031,290.45 | |
| AMUNDI SA | 3,955 | 58.550 | 231,565.25 | |
| DEUTSCHE BANK AG- REGISTERED | 113,478 | 10.392 | 1,179,263.37 | |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 10,701 | 163.950 | 1,754,428.95 | |
| EURAZEO SE | 1,792 | 75.500 | 135,296.00 | |
| EURONEXT NV | 5,502 | 77.720 | 427,615.44 | |
| EXOR NV | 6,204 | 66.900 | 415,047.60 | |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 5,914 | 90.480 | 535,098.72 | |
| SOFINA | 804 | 301.000 | 242,004.00 | |
| WENDEL | 1,082 | 93.550 | 101,221.10 | |
| AEGON NV | 91,609 | 5.012 | 459,144.30 | |
| AGEAS | 11,247 | 46.570 | 523,772.79 | |
| ALLIANZ SE-REG | 23,552 | 212.650 | 5,008,332.80 | |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 64,729 | 18.120 | 1,172,889.48 | |
| AXA SA | 113,586 | 25.775 | 2,927,679.15 | |
| CNP ASSURANCES | 8,978 | 21.800 | 195,720.40 | |
| HANNOVER RUECK SE | 3,598 | 145.000 | 521,710.00 | |
| MUENCHENER RUECKVER AG- REG | 8,295 | 228.000 | 1,891,260.00 | |
| NN GROUP NV | 14,069 | 46.030 | 647,596.07 | |
| POSTE ITALIANE SPA | 26,562 | 9.428 | 250,426.53 | |
| SAMPO OYJ-A SHS | 28,454 | 46.400 | 1,320,265.60 | |
| AROUNDTOWN SA | 52,560 | 4.893 | 257,176.08 | |

| | | | | |
|---------------------------------|---------|-----------|---------------|--|
| LEG IMMOBILIEN SE | 3,680 | 98.200 | 361,376.00 | |
| VONOVIA SE | 43,654 | 39.360 | 1,718,221.44 | |
| ADYEN NV | 1,069 | 1,609.600 | 1,720,662.40 | |
| AMADEUS IT GROUP SA | 24,570 | 59.660 | 1,465,846.20 | |
| BECHTLE AG | 4,305 | 43.620 | 187,784.10 | |
| CAPGEMINI SE | 8,961 | 188.000 | 1,684,668.00 | |
| DASSAULT SYSTEMES SE | 39,595 | 39.875 | 1,578,850.62 | |
| EDENRED | 16,042 | 48.610 | 779,801.62 | |
| NEMETSCHEK SE | 3,011 | 76.600 | 230,642.60 | |
| NEXI SPA | 30,853 | 8.972 | 276,813.11 | |
| SAP SE | 60,055 | 95.740 | 5,749,665.70 | |
| WORLDLINE SA | 12,774 | 35.180 | 449,389.32 | |
| NOKIA OYJ | 296,676 | 4.815 | 1,428,494.94 | |
| ASM INTERNATIONAL NV | 2,455 | 303.800 | 745,829.00 | |
| ASML HOLDING NV | 23,576 | 547.700 | 12,912,575.20 | |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 71,533 | 27.885 | 1,994,697.70 | |
| STMICROELECTRONICS NV | 37,804 | 35.275 | 1,333,536.10 | |
| CELLNEX TELECOM SA | 29,081 | 45.480 | 1,322,603.88 | |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 188,344 | 17.152 | 3,230,476.28 | |
| ELISA OYJ | 8,681 | 55.020 | 477,628.62 | |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | 15,804 | 10.130 | 160,094.52 | |
| KONINKLIJKE KPN NV | 173,603 | 3.262 | 566,292.98 | |
| ORANGE | 116,269 | 11.136 | 1,294,771.58 | |
| PROXIMUS | 10,895 | 16.965 | 184,833.67 | |
| TELECOM ITALIA SPA | 696,355 | 0.280 | 194,979.40 | |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 46,895 | 2.837 | 133,041.11 | |
| TELEFONICA SA | 316,236 | 4.798 | 1,517,300.32 | |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 5,269 | 30.790 | 162,232.51 | |
| E.ON SE | 126,998 | 10.260 | 1,302,999.48 | |
| EDF | 32,658 | 9.032 | 294,967.05 | |
| EDP RENOVAVEIS SA | 14,791 | 23.000 | 340,193.00 | |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 170,355 | 4.684 | 797,942.82 | |
| ELIA GROUP SA/NV | 2,106 | 149.000 | 313,794.00 | |
| ENAGAS SA | 14,471 | 20.520 | 296,944.92 | |
| ENDESA SA | 14,104 | 20.020 | 282,362.08 | |
| ENEL SPA | 475,178 | 6.103 | 2,900,011.33 | |
| ENGIE | 110,679 | 11.560 | 1,279,449.24 | |
| FORTUM OYJ | 24,312 | 16.080 | 390,936.96 | |
| IBERDROLA SA | 337,074 | 10.585 | 3,567,928.29 | |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 12,930 | 29.040 | 375,487.20 | |

| | | | | |
|--------------------------------|------------|--------|--------------------------------------|--|
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 23,632 | 18.705 | 442,036.56 | |
| RWE AG | 34,673 | 40.080 | 1,389,693.84 | |
| SNAM SPA | 106,707 | 5.204 | 555,303.22 | |
| TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE | 75,662 | 7.772 | 588,045.06 | |
| UNIPER SE | 4,697 | 24.120 | 113,291.64 | |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 36,122 | 28.660 | 1,035,256.52 | |
| VERBUND AG | 3,190 | 98.650 | 314,693.50 | |
| BOLLORE SE | 39,433 | 4.550 | 179,420.15 | |
| PUBLICIS GROUPE | 13,301 | 56.960 | 757,624.96 | |
| SCOUT24 SE | 4,671 | 58.940 | 275,308.74 | |
| UBISOFT ENTERTAINMENT | 4,745 | 42.080 | 199,669.60 | |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP NV | 44,422 | 23.435 | 1,041,029.57 | |
| VIVENDI SE | 38,496 | 11.535 | 444,051.36 | |
| ユーロ小計 | 10,772,399 | | 249,120,571.28 (34,099,623,797) | |
| 合計 | 61,248,461 | | 367,861,655,320 (367,861,655,320) | |

(注)金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 通貨 | 銘柄数 | | 組入株式時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|-------------|-----|-------|----------|------------|
| アメリカ・ドル | 株式 | 605銘柄 | 70.5% | 73.5% |
| カナダ・ドル | 株式 | 86銘柄 | 3.7% | 3.9% |
| オーストラリア・ドル | 株式 | 50銘柄 | 2.1% | 2.2% |
| 香港・ドル | 株式 | 28銘柄 | 0.7% | 0.8% |
| シンガポール・ドル | 株式 | 14銘柄 | 0.3% | 0.3% |
| ニュージーランド・ドル | 株式 | 6銘柄 | 0.1% | 0.1% |
| イギリス・ポンド | 株式 | 79銘柄 | 4.4% | 4.5% |
| イスラエル・シェケル | 株式 | 8銘柄 | 0.1% | 0.1% |
| スイス・フラン | 株式 | 41銘柄 | 3.0% | 3.2% |
| デンマーク・クローネ | 株式 | 18銘柄 | 0.8% | 0.8% |
| ノルウェー・クローネ | 株式 | 12銘柄 | 0.2% | 0.2% |
| スウェーデン・クローナ | 株式 | 44銘柄 | 1.0% | 1.0% |
| ユーロ | 株式 | 228銘柄 | 8.9% | 9.3% |

(b)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 | AGNC INVESTMENT CORP | 25,432.00 | 296,791.44 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 8,490.00 | 1,638,570.00 | |
| | | AMERICAN TOWER CORP | 26,197.00 | 6,798,645.44 | |

| | | | | |
|----------------|---------------------------------|------------|----------------------------------|--|
| | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 90,010.00 | 587,765.30 | |
| | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 8,302.00 | 2,062,382.84 | |
| | BOSTON PROPERTIES INC | 7,835.00 | 985,799.70 | |
| | CAMDEN PROPERTY TRUST | 6,009.00 | 986,677.80 | |
| | CROWN CASTLE INTL CORP | 25,016.00 | 4,824,835.92 | |
| | DIGITAL REALTY TRUST INC | 16,754.00 | 2,539,236.24 | |
| | DUKE REALTY CORP | 21,667.00 | 1,285,503.11 | |
| | EQUINIX INC | 5,232.00 | 3,937,184.64 | |
| | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 8,664.00 | 708,022.08 | |
| | EQUITY RESIDENTIAL | 21,246.00 | 1,918,088.88 | |
| | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 3,691.00 | 1,284,800.19 | |
| | EXTRA SPACE STORAGE INC | 7,376.00 | 1,538,191.04 | |
| | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 28,756.00 | 985,755.68 | |
| | HOST HOTELS & RESORTS INC | 37,569.00 | 786,319.17 | |
| | INVITATION HOMES INC | 32,632.00 | 1,396,975.92 | |
| | IRON MOUNTAIN INC | 15,785.00 | 879,540.20 | |
| | KIMCO REALTY CORP | 35,169.00 | 901,029.78 | |
| | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 31,858.00 | 590,647.32 | |
| | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 6,678.00 | 1,369,123.56 | |
| | PROLOGIS INC | 42,504.00 | 7,129,195.92 | |
| | PUBLIC STORAGE | 8,778.00 | 3,502,422.00 | |
| | REALTY INCOME CORP | 31,385.00 | 2,283,258.75 | |
| | REGENCY CENTERS CORP | 8,289.00 | 581,887.80 | |
| | SBA COMMUNICATIONS CORP | 5,916.00 | 2,129,405.04 | |
| | SIMON PROPERTY GROUP INC | 18,517.00 | 2,338,511.93 | |
| | SUN COMMUNITIES INC | 6,088.00 | 1,150,632.00 | |
| | UDR INC | 16,633.00 | 961,387.40 | |
| | VENTAS INC | 23,363.00 | 1,360,193.86 | |
| | VICI PROPERTIES INC | 36,025.00 | 1,081,830.75 | |
| | VORNADO REALTY TRUST | 8,706.00 | 360,515.46 | |
| | WELLTOWER INC | 24,682.00 | 2,358,611.92 | |
| | WEYERHAEUSER CO | 44,952.00 | 1,870,902.24 | |
| | WP CAREY INC | 11,067.00 | 937,042.89 | |
| | アメリカ・ドル小計 | 757,273.00 | 66,347,684.21 (8,465,964,505) | |
| カナ ダ・ド ル | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 3,971.00 | 204,744.76 | |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 7,441.00 | 182,750.96 | |
| | カナダ・ドル小計 | 11,412.00 | 387,495.72 (38,830,946) | |
| | APA GROUP | 68,281.00 | 781,134.64 | |

| | | | | |
|--------------|------------------------------|--------------|------------------------------------|--|
| オーストラリア・ドル | DEXUS/AU | 72,475.00 | 789,977.50 | |
| | GOODMAN GROUP | 95,350.00 | 2,252,167.00 | |
| | GPT GROUP | 121,221.00 | 615,802.68 | |
| | LENLEASE GROUP | 36,263.00 | 426,452.88 | |
| | MIRVAC GROUP | 200,053.00 | 480,127.20 | |
| | SCENTRE GROUP | 275,200.00 | 806,336.00 | |
| | STOCKLAND | 127,393.00 | 528,680.95 | |
| | TRANSURBAN GROUP | 176,197.00 | 2,464,996.03 | |
| | VICINITY CENTRES | 241,241.00 | 451,120.67 | |
| オーストラリア・ドル小計 | | 1,413,674.00 | 9,596,795.55 (880,697,928) | |
| 香港・ドル | HK ELECTRIC INVESTMENTS - SS | 193,500.00 | 1,488,015.00 | |
| | HKT TRUST AND HKT LTD-SS | 197,000.00 | 2,163,060.00 | |
| | LINK REIT | 110,100.00 | 7,486,800.00 | |
| 香港・ドル小計 | | 500,600.00 | 11,137,875.00 (181,101,848) | |
| シンガポール・ドル | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 170,500.00 | 487,630.00 | |
| | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | 259,616.00 | 602,309.12 | |
| | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 112,400.00 | 214,684.00 | |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 208,100.00 | 374,580.00 | |
| シンガポール・ドル小計 | | 750,616.00 | 1,679,203.12 (156,098,722) | |
| イギリス・ポンド | BRITISH LAND CO PLC | 62,406.00 | 316,273.60 | |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 39,861.00 | 300,392.49 | |
| | SEGRO PLC | 68,623.00 | 934,988.37 | |
| イギリス・ポンド小計 | | 170,890.00 | 1,551,654.46 (252,361,080) | |
| ユーロ | COVIVIO | 2,388.00 | 164,294.40 | |
| | GECINA SA | 2,189.00 | 240,352.20 | |
| | KLEPIERRE | 13,600.00 | 311,984.00 | |
| | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 7,024.00 | 492,874.08 | |
| ユーロ小計 | | 25,201.00 | 1,209,504.68 (165,557,001) | |
| 投資証券合計 | | | 10,140,612,029 (10,140,612,029) | |
| 合 計 | | | 10,140,612,029 (10,140,612,029) | |

(注) 金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 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 | 36銘柄 | 2.2% | 83.5% |
| カナダ・ドル | 投資証券 | 2銘柄 | 0.0% | 0.4% |
| オーストラリア・ドル | 投資証券 | 10銘柄 | 0.2% | 8.7% |
| 香港・ドル | 投資証券 | 3銘柄 | 0.0% | 1.8% |
| シンガポール・ドル | 投資証券 | 4銘柄 | 0.0% | 1.5% |
| イギリス・ポンド | 投資証券 | 3銘柄 | 0.1% | 2.5% |
| ユーロ | 投資証券 | 4銘柄 | 0.0% | 1.6% |

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)」に記載しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

| | (2021年4月26日現在) | (2022年4月26日現在) |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 251,077,719 | 1,420,250,939 |
| 金銭信託 | 762,512,013 | 35,129,306 |
| コール・ローン | 1,749,778,290 | 1,771,896,597 |
| 株式 | 9,586,932,925 | 13,549,402,847 |
| 投資信託受益証券 | 497,674,247 | 752,699,820 |
| 投資証券 | 912,831,155 | 1,401,586,708 |
| 派生商品評価勘定 | 16,583,310 | 245,941,843 |
| 未収入金 | 16,081,391 | 121,741 |
| 未収配当金 | 12,315,820 | 31,232,619 |
| 差入委託証拠金 | 785,870,472 | 844,604,732 |
| 流動資産合計 | 14,591,657,342 | 20,052,867,152 |
| 資産合計 | 14,591,657,342 | 20,052,867,152 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 33,807,564 | 62,722,219 |
| 前受金 | 121,915 | - |
| 未払解約金 | 290,000 | 22,441,148 |
| 未払利息 | 5,064 | - |
| その他未払費用 | 64,023 | 4,032 |
| 流動負債合計 | 34,288,566 | 85,167,399 |
| 負債合計 | 34,288,566 | 85,167,399 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 8,325,755,557 | 12,191,357,761 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 6,231,613,219 | 7,776,341,992 |
| 元本等合計 | 14,557,368,776 | 19,967,699,753 |
| 純資産合計 | 14,557,368,776 | 19,967,699,753 |
| 負債純資産合計 | 14,591,657,342 | 20,052,867,152 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に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によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2021年4月26日現在) | (2022年4月26日現在) |
|-----------------------|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 8,325,755,557口 | 12,191,357,761口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.7485円 (1万口当たりの純資産額17,485円) | 1口当たり純資産額 1.6379円 (1万口当たりの純資産額16,379円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項 目 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、社債券、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |

| | |
|-----------------------------------|--|
| <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| <p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</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。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2022年4月26日現在) |
|---------------------------|---|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> | <p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> |
| <p>2. 時価の算定方法</p> | <p>(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区 分 | 種 類 | 契 約 額 等 | | 時 価 | 評 価 損 益 |
|------|----------------|---------------|--------------|---------------|---------|
| | | | う ち 1 年 超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | MSCIE 2106 | 3,557,460,207 | - | 3,557,582,122 | 121,915 |
| | 小計 | 3,557,460,207 | - | 3,557,582,122 | 121,915 |
| 合 計 | | 3,557,460,207 | - | 3,557,582,122 | 121,915 |

(単位：円)

| 区 分 | 種 類 | 契 約 額 等 | | 時 価 | 評 価 損 益 |
|-------------------|--------------|---------------|--------------|---------------|------------|
| | | | う ち 1 年 超 | | |
| 市場取引 以外の取 引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 2,684,900,000 | - | 2,664,838,702 | 20,061,298 |
| | 小計 | 2,684,900,000 | - | 2,664,838,702 | 20,061,298 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 157,000,000 | - | 154,284,871 | 2,715,129 |
| | 小計 | 157,000,000 | - | 154,284,871 | 2,715,129 |
| 合 計 | | 2,841,900,000 | - | 2,819,123,573 | 17,346,169 |

(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区 分 | 種 類 | 契 約 額 等 | | 時 価 | 評 価 損 益 |
|------|----------------------|---------------|--------------|---------------|------------|
| | | | う ち 1 年 超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | MSCI EMGMKT JUN22 | 4,275,648,872 | - | 4,259,752,464 | 15,896,408 |
| | 小計 | 4,275,648,872 | - | 4,259,752,464 | 15,896,408 |
| 合 計 | | 4,275,648,872 | - | 4,259,752,464 | 15,896,408 |

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に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。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位:円)

| 区 分 | 種 類 | 契 約 額 等 | | 時 価 | 評 価 損 益 |
|-------------------|--------------|---------------|--------------|---------------|-------------|
| | | | う ち 1 年 超 | | |
| 市場取引 以外の取 引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 2,737,900,000 | - | 2,974,595,381 | 236,695,381 |
| | 小計 | 2,737,900,000 | - | 2,974,595,381 | 236,695,381 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 952,000,000 | - | 989,579,349 | 37,579,349 |
| | 小計 | 952,000,000 | - | 989,579,349 | 37,579,349 |
| 合 計 | | 3,689,900,000 | - | 3,964,174,730 | 199,116,032 |

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| |
|--|
| 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| (2021年4月26日現在) | |
|--------------------------------|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 5,713,549,870円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 4,826,668,980円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 2,214,463,293円 |
| 2021年4月26日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド | 4,212,467,456円 |
| 三井住友・DC新興国株式インデックスファンド | 2,168,457,848円 |

| | |
|-------------------------------------|----------------|
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 423,316,544円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 466,719,046円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 305,570,265円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 36,830,971円 |
| 三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2050 | 19,428,099円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 51,180,927円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 38,730,510円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 184,820,124円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 125,451,007円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 215,280,733円 |
| 三井住友・D CつみたてN I S A・世界分散ファンド | 45,405,336円 |
| 三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2060 | 2,767,956円 |
| S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 29,328,735円 |
| 合計 | 8,325,755,557円 |

(2022年4月26日現在)

| | |
|-------------------------------------|-----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 8,325,755,557円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 6,016,733,591円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 2,151,131,387円 |
| 2022年4月26日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・D CつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド | 6,746,739,785円 |
| 三井住友・D C新興国株式インデックスファンド | 2,714,636,324円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 44,385,580円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 237,701,767円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 157,541,199円 |
| 三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2050 | 28,182,083円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 90,118,390円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 65,071,224円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 259,245,317円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 214,464,764円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 348,547,103円 |
| 三井住友・D CつみたてN I S A・世界分散ファンド | 78,602,899円 |
| 三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2060 | 3,563,961円 |
| 日興F W S・新興国株インデックス(為替ヘッジあり) | 430,155,490円 |
| 日興F W S・新興国株インデックス(為替ヘッジなし) | 711,584,443円 |
| 三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド | 5,814,304円 |
| S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 55,003,128円 |
| 合計 | 12,191,357,761円 |

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

| | | | |
|--|--|--|-----|
| | | | 評価額 |
|--|--|--|-----|

| 通貨 | 銘柄 | 株数 | 単価 | 金額 | 備考 |
|---------------------------------|---------------------------------|---------|------------|------------|----|
| アメリカ・ドル | CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR | 4,068 | 8.890 | 36,164.52 | |
| | SOUTHERN COPPER CORP | 1,560 | 64.290 | 100,292.40 | |
| | 51JOB INC-ADR | 507 | 60.820 | 30,835.74 | |
| | DIDI GLOBAL INC | 4,435 | 1.800 | 7,983.00 | |
| | ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR | 8,212 | 23.750 | 195,035.00 | |
| | LI AUTO INC - ADR | 10,440 | 22.310 | 232,916.40 | |
| | NIO INC - ADR | 24,428 | 17.310 | 422,848.68 | |
| | XPENG INC - ADR | 7,360 | 24.210 | 178,185.60 | |
| | HUAZHU GROUP LTD-ADR | 3,165 | 30.020 | 95,013.30 | |
| | NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR | 2,577 | 10.400 | 26,800.80 | |
| | TAL EDUCATION GROUP- ADR | 7,046 | 2.810 | 19,799.26 | |
| | TRIP.COM GROUP LTD-ADR | 9,500 | 21.620 | 205,390.00 | |
| | YUM CHINA HOLDINGS INC | 7,985 | 40.970 | 327,145.45 | |
| | DADA NEXUS LTD-ADR | 799 | 7.690 | 6,144.31 | |
| | PINDUODUO INC-ADR | 8,046 | 35.600 | 286,437.60 | |
| | VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR | 7,497 | 6.980 | 52,329.06 | |
| | RLX TECHNOLOGY INC-ADR | 10,343 | 1.860 | 19,237.98 | |
| | BEIGENE LTD-ADR | 893 | 162.800 | 145,380.40 | |
| | HUTCHMED CHINA-ADR | 1,444 | 15.930 | 23,002.92 | |
| | I-MAB-SPONSORED ADR | 643 | 12.660 | 8,140.38 | |
| | LEGEND BIOTECH CORP-ADR | 724 | 39.080 | 28,293.92 | |
| | ZAI LAB LTD-ADR | 1,359 | 45.890 | 62,364.51 | |
| | CREDICORP LTD | 1,240 | 139.840 | 173,401.60 | |
| | 360 DIGITECH INC | 1,578 | 13.800 | 21,776.40 | |
| | LUFAX HOLDING LTD-ADR | 12,160 | 5.220 | 63,475.20 | |
| | NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS | 571 | 17.970 | 10,260.87 | |
| | KE HOLDINGS INC-ADR | 6,927 | 12.340 | 85,479.18 | |
| | SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B | 21,280 | 0.901 | 19,173.28 | |
| | CHINDATA GROUP HOLDINGS- ADR | 1,520 | 4.850 | 7,372.00 | |
| | GDS HOLDINGS LTD - ADR | 1,490 | 27.820 | 41,451.80 | |
| | KINGSOFT CLOUD HOLDINGS- ADR | 1,994 | 3.410 | 6,799.54 | |
| SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B | 7,100 | 3.597 | 25,538.70 | | |
| DAQO NEW ENERGY CORP-ADR | 982 | 40.770 | 40,036.14 | | |
| AUTOHOME INC-ADR | 1,276 | 25.920 | 33,073.92 | | |
| BAIDU INC - SPON ADR | 5,110 | 116.570 | 595,672.70 | | |

| | | | | | |
|---------------------------------|----------------------------------|---------|--------------|-------------------------------|--|
| | BILIBILI INC-SPONSORED ADR | 3,066 | 21.250 | 65,152.50 | |
| | HELLO GROUP INC -SPN ADR | 2,159 | 4.440 | 9,585.96 | |
| | IQIYI INC-ADR | 4,740 | 3.200 | 15,168.00 | |
| | JOYY INC-ADR | 933 | 37.690 | 35,164.77 | |
| | KANZHUN LTD - ADR | 1,553 | 19.810 | 30,764.93 | |
| | TENCENT MUSIC ENTERTAINM- ADR | 11,158 | 4.120 | 45,970.96 | |
| | WEIBO CORP-SPON ADR | 1,053 | 21.150 | 22,270.95 | |
| | アメリカ・ドル小計 | 210,921 | | 3,857,330.63 (492,195,387) | |
| 香港・ド ル | CHINA COAL ENERGY CO-H | 34,000 | 6.120 | 208,080.00 | |
| | CHINA OILFIELD SERVICES-H | 26,000 | 7.300 | 189,800.00 | |
| | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 444,000 | 3.860 | 1,713,840.00 | |
| | CHINA SHENHUA ENERGY CO-H | 64,500 | 23.850 | 1,538,325.00 | |
| | CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H | 29,000 | 4.230 | 122,670.00 | |
| | PETROCHINA CO LTD-H | 400,000 | 3.740 | 1,496,000.00 | |
| | YANKUANG ENERGY GROUP CO- H | 30,000 | 21.000 | 630,000.00 | |
| | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 72,000 | 3.630 | 261,360.00 | |
| | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H | 22,500 | 38.500 | 866,250.00 | |
| | CHINA HONGQIAO GROUP LTD | 47,000 | 10.100 | 474,700.00 | |
| | CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H | 66,000 | 3.930 | 259,380.00 | |
| | CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 74,000 | 9.420 | 697,080.00 | |
| | CHINA RESOURCES CEMENT | 38,000 | 6.140 | 233,320.00 | |
| | DONGYUE GROUP | 24,000 | 8.190 | 196,560.00 | |
| | GANFENG LITHIUM CO LTD-H | 4,400 | 79.100 | 348,040.00 | |
| | HUABAO INTERNATIONAL HOLDING | 18,000 | 4.080 | 73,440.00 | |
| | JIANGXI COPPER CO LTD-H | 20,000 | 12.180 | 243,600.00 | |
| | LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN | 13,000 | 3.630 | 47,190.00 | |
| | MMG LTD | 32,000 | 3.040 | 97,280.00 | |
| | NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS | 37,000 | 6.550 | 242,350.00 | |
| SHANDONG GOLD MINING CO LT-H | 14,250 | 14.440 | 205,770.00 | | |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H | 100,000 | 11.360 | 1,136,000.00 | | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|---------|--------------|--|
| AVICHINA INDUSTRY & TECH-H | 51,000 | 3.860 | 196,860.00 | |
| BOC AVIATION LTD | 3,500 | 58.600 | 205,100.00 | |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H | 54,000 | 3.300 | 178,200.00 | |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS | 29,000 | 20.900 | 606,100.00 | |
| CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L | 15,000 | 8.200 | 123,000.00 | |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H | 80,000 | 4.800 | 384,000.00 | |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT | 34,000 | 8.980 | 305,320.00 | |
| CITIC LTD | 113,000 | 8.110 | 916,430.00 | |
| CRRC CORP LTD - H | 85,000 | 2.790 | 237,150.00 | |
| FOSUN INTERNATIONAL LTD | 47,500 | 7.840 | 372,400.00 | |
| HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS | 13,000 | 18.260 | 237,380.00 | |
| SANY HEAVY EQUIPMENT INTL | 19,000 | 7.270 | 138,130.00 | |
| SINOTRUK HONG KONG LTD | 10,000 | 8.540 | 85,400.00 | |
| WEICHAI POWER CO LTD-H | 32,000 | 10.280 | 328,960.00 | |
| XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H | 10,418 | 10.940 | 113,972.92 | |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC | 9,100 | 24.000 | 218,400.00 | |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H | 13,000 | 4.650 | 60,450.00 | |
| CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT | 77,000 | 4.400 | 338,800.00 | |
| AIR CHINA LTD-H | 32,000 | 5.220 | 167,040.00 | |
| BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H | 44,000 | 4.190 | 184,360.00 | |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDING | 24,140 | 13.240 | 319,613.60 | |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H | 24,000 | 4.230 | 101,520.00 | |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H | 65,400 | 11.620 | 759,948.00 | |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD | 24,000 | 5.400 | 129,600.00 | |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H | 22,000 | 7.630 | 167,860.00 | |
| SHENZHEN INTL HOLDINGS | 27,000 | 8.200 | 221,400.00 | |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H | 32,000 | 6.610 | 211,520.00 | |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE | 30,000 | 4.430 | 132,900.00 | |
| BYD CO LTD-H | 15,500 | 219.400 | 3,400,700.00 | |

| | | | | |
|-------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 46,000 | 5.360 | 246,560.00 | |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H | 12,400 | 29.350 | 363,940.00 | |
| GEEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 110,000 | 10.800 | 1,188,000.00 | |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H | 60,000 | 10.180 | 610,800.00 | |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 55,200 | 6.190 | 341,688.00 | |
| MINTH GROUP LTD | 14,000 | 17.180 | 240,520.00 | |
| YADEA GROUP HOLDINGS LTD | 24,000 | 11.100 | 266,400.00 | |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 19,800 | 85.000 | 1,683,000.00 | |
| BOSIDENG INTL HLDGS LTD | 72,000 | 3.810 | 274,320.00 | |
| HAIER SMART HOME CO LTD-H | 43,400 | 25.350 | 1,100,190.00 | |
| LI NING CO LTD | 44,000 | 57.500 | 2,530,000.00 | |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 15,600 | 105.900 | 1,652,040.00 | |
| CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN | 12,000 | 5.900 | 70,800.00 | |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI | 21,000 | 12.920 | 271,320.00 | |
| JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD | 16,000 | 14.300 | 228,800.00 | |
| TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT | 15,200 | 13.000 | 197,600.00 | |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 279,000 | 81.850 | 22,836,150.00 | |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION T | 68,000 | 3.880 | 263,840.00 | |
| CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS | 12,000 | 24.550 | 294,600.00 | |
| CHINA RUYI HOLDINGS LTD | 36,000 | 1.850 | 66,600.00 | |
| GOME RETAIL HOLDINGS LTD | 198,000 | 0.385 | 76,230.00 | |
| JD HEALTH INTERNATIONAL INC | 6,600 | 43.450 | 286,770.00 | |
| JD.COM INC - CL A | 36,885 | 200.800 | 7,406,508.00 | |
| MEITUAN-CLASS B | 75,100 | 138.600 | 10,408,860.00 | |
| PING AN HEALTHCARE AND TECHN | 6,100 | 18.640 | 113,704.00 | |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD | 21,000 | 5.830 | 122,430.00 | |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS | 10,500 | 50.900 | 534,450.00 | |
| SUN ART RETAIL GROUP LTD | 24,500 | 2.280 | 55,860.00 | |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B | 2,000 | 100.390 | 200,780.00 | |

| | | | | |
|---------------------------------|---------|--------|--------------|--|
| CHINA FEIHE LTD | 60,000 | 6.990 | 419,400.00 | |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO | 58,000 | 41.950 | 2,433,100.00 | |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDING | 26,000 | 42.300 | 1,099,800.00 | |
| DALI FOODS GROUP CO LTD | 51,000 | 3.900 | 198,900.00 | |
| NONGFU SPRING CO LTD-H | 32,400 | 41.000 | 1,328,400.00 | |
| SMOORE INTERNATIONAL HOLDING | 35,000 | 15.920 | 557,200.00 | |
| TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO | 40,000 | 14.300 | 572,000.00 | |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-H | 10,000 | 58.400 | 584,000.00 | |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS | 28,000 | 6.580 | 184,240.00 | |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 88,000 | 6.700 | 589,600.00 | |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING | 9,000 | 22.050 | 198,450.00 | |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD | 11,000 | 37.350 | 410,850.00 | |
| VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS | 4,000 | 17.540 | 70,160.00 | |
| HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C | 5,600 | 33.450 | 187,320.00 | |
| JINXIN FERTILITY GROUP LTD | 20,000 | 5.220 | 104,400.00 | |
| MICROPORT SCIENTIFIC CORP | 9,000 | 14.120 | 127,080.00 | |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H | 50,400 | 7.860 | 396,144.00 | |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS- H | 16,600 | 12.320 | 204,512.00 | |
| SINOPHARM GROUP CO-H | 25,200 | 16.880 | 425,376.00 | |
| VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H | 3,000 | 12.240 | 36,720.00 | |
| 3SBIO INC | 17,000 | 5.290 | 89,930.00 | |
| AKESO INC | 4,000 | 12.780 | 51,120.00 | |
| CANSINO BIOLOGICS INC-H | 1,000 | 90.000 | 90,000.00 | |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING | 27,000 | 10.620 | 286,740.00 | |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE ME | 42,000 | 3.750 | 157,500.00 | |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT | 170,800 | 8.020 | 1,369,816.00 | |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP | 20,000 | 20.550 | 411,000.00 | |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H | 2,500 | 78.300 | 195,750.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|-----------|---------|--------------|--|
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP | 18,000 | 12.560 | 226,080.00 | |
| INNOVENT BIOLOGICS INC | 23,000 | 23.500 | 540,500.00 | |
| PHARMARON BEIJING CO LTD-H | 2,000 | 92.200 | 184,400.00 | |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H | 7,500 | 32.250 | 241,875.00 | |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 200,000 | 3.940 | 788,000.00 | |
| WUXI APTEC CO LTD-H | 6,911 | 102.800 | 710,450.80 | |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 66,500 | 53.650 | 3,567,725.00 | |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 479,000 | 2.930 | 1,403,470.00 | |
| BANK OF CHINA LTD-H | 1,457,000 | 3.090 | 4,502,130.00 | |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H | 161,000 | 5.470 | 880,670.00 | |
| CHINA BOHAI BANK CO LTD-H | 27,500 | 1.330 | 36,575.00 | |
| CHINA CITIC BANK CORP LTD-H | 149,000 | 3.940 | 587,060.00 | |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 1,764,000 | 5.550 | 9,790,200.00 | |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 77,000 | 2.850 | 219,450.00 | |
| CHINA MERCHANTS BANK-H | 71,500 | 46.700 | 3,339,050.00 | |
| CHINA MINSHENG BANKING COR-H | 106,600 | 2.920 | 311,272.00 | |
| IND & COMM BK OF CHINA-H | 1,047,000 | 4.670 | 4,889,490.00 | |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H | 142,000 | 6.240 | 886,080.00 | |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H | 188,000 | 1.300 | 244,400.00 | |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-H | 58,500 | 4.210 | 246,285.00 | |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H | 24,000 | 15.160 | 363,840.00 | |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H | 48,000 | 16.300 | 782,400.00 | |
| FAR EAST HORIZON LTD | 28,000 | 6.600 | 184,800.00 | |
| GF SECURITIES CO LTD-H | 17,000 | 9.540 | 162,180.00 | |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H | 42,800 | 5.480 | 234,544.00 | |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H | 24,600 | 10.620 | 261,252.00 | |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H | 136,000 | 11.440 | 1,555,840.00 | |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 48,400 | 17.600 | 851,840.00 | |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLD | 35,400 | 8.810 | 311,874.00 | |

| | | | | |
|---------------------------------|---------|--------|--------------|--|
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 17,100 | 19.500 | 333,450.00 | |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H | 127,000 | 2.450 | 311,150.00 | |
| PICC PROPERTY & CASUALTY- H | 126,000 | 7.840 | 987,840.00 | |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 117,000 | 50.600 | 5,920,200.00 | |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H | 6,700 | 22.800 | 152,760.00 | |
| AGILE GROUP HOLDINGS LTD | 12,000 | 3.580 | 42,960.00 | |
| A-LIVING SMART CITY SERVICES | 7,000 | 11.620 | 81,340.00 | |
| CHINA EVERGRANDE GROUP | 66,000 | 1.650 | 108,900.00 | |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP | 96,000 | 2.410 | 231,360.00 | |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 72,500 | 24.200 | 1,754,500.00 | |
| CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD | 30,000 | 8.820 | 264,600.00 | |
| CHINA RESOURCES LAND LTD | 60,000 | 34.700 | 2,082,000.00 | |
| CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY | 11,800 | 35.700 | 421,260.00 | |
| CHINA VANKE CO LTD-H | 28,600 | 18.200 | 520,520.00 | |
| CIFI EVER SUNSHINE SERVICES | 10,000 | 9.570 | 95,700.00 | |
| CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD | 58,000 | 3.610 | 209,380.00 | |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO | 139,000 | 5.200 | 722,800.00 | |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD | 38,000 | 30.000 | 1,140,000.00 | |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS | 12,500 | 12.960 | 162,000.00 | |
| GREENTOWN SERVICE GROUP CO L | 34,000 | 7.330 | 249,220.00 | |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H | 26,800 | 2.800 | 75,040.00 | |
| HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS | 11,000 | 14.340 | 157,740.00 | |
| KWG GROUP HOLDINGS LTD | 12,500 | 2.570 | 32,125.00 | |
| LOGAN GROUP CO LTD | 16,000 | 2.210 | 35,360.00 | |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | 34,500 | 38.900 | 1,342,050.00 | |
| POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN | 25,000 | 2.380 | 59,500.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|---------|--------------|--|
| SEAZEN GROUP LTD | 32,000 | 3.280 | 104,960.00 | |
| SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD | 18,500 | 4.420 | 81,770.00 | |
| SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD | 10,000 | 3.850 | 38,500.00 | |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD | 53,000 | 4.580 | 242,740.00 | |
| SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD | 18,000 | 3.790 | 68,220.00 | |
| WHARF HOLDINGS LTD | 23,000 | 22.050 | 507,150.00 | |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD | 17,600 | 8.260 | 145,376.00 | |
| CHINASOFT INTERNATIONAL LTD | 44,000 | 5.880 | 258,720.00 | |
| KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR | 50,000 | 13.760 | 688,000.00 | |
| MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN | 12,000 | 8.810 | 105,720.00 | |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H | 21,000 | 11.000 | 231,000.00 | |
| WEIMOB INC | 38,000 | 4.040 | 153,520.00 | |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN | 13,500 | 15.720 | 212,220.00 | |
| BYD ELECTRONIC INTL CO LTD | 13,000 | 13.640 | 177,320.00 | |
| KINGBOARD HOLDINGS LTD | 13,500 | 34.500 | 465,750.00 | |
| KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD | 21,000 | 11.780 | 247,380.00 | |
| LENOVO GROUP LTD | 132,000 | 7.450 | 983,400.00 | |
| SUNNY OPTICAL TECH | 13,100 | 103.100 | 1,350,610.00 | |
| XIAOMI CORP-CLASS B | 261,400 | 10.920 | 2,854,488.00 | |
| ZTE CORP-H | 16,600 | 15.480 | 256,968.00 | |
| FLAT GLASS GROUP CO LTD-H | 9,000 | 23.850 | 214,650.00 | |
| HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD | 9,000 | 27.200 | 244,800.00 | |
| XINYI SOLAR HOLDINGS LTD | 94,000 | 10.920 | 1,026,480.00 | |
| CHINA TOWER CORP LTD-H | 702,000 | 0.870 | 610,740.00 | |
| BEIJING ENTERPRISES HLDGS | 10,500 | 25.700 | 269,850.00 | |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GR | 100,000 | 2.480 | 248,000.00 | |
| CGN POWER CO LTD-H | 167,000 | 2.080 | 347,360.00 | |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD | 54,000 | 8.700 | 469,800.00 | |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 59,000 | 15.120 | 892,080.00 | |
| CHINA POWER INTERNATIONAL | 112,000 | 3.690 | 413,280.00 | |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LT | 16,000 | 29.300 | 468,800.00 | |

| | | | | | |
|-------|------------------------------|------------|-----------|-----------------------------------|--|
| | CHINA RESOURCES POWER HOLDIN | 34,000 | 14.000 | 476,000.00 | |
| | ENN ENERGY HOLDINGS LTD | 15,000 | 100.900 | 1,513,500.00 | |
| | GUANGDONG INVESTMENT LTD | 54,000 | 9.930 | 536,220.00 | |
| | HUANENG POWER INTL INC-H | 76,000 | 3.710 | 281,960.00 | |
| | KUNLUN ENERGY CO LTD | 78,000 | 6.260 | 488,280.00 | |
| | ALIBABA PICTURES GROUP LTD | 260,000 | 0.600 | 156,000.00 | |
| | CHINA LITERATURE LTD | 6,800 | 28.200 | 191,760.00 | |
| | KINGSOFT CORP LTD | 16,000 | 21.100 | 337,600.00 | |
| | KUAISHOU TECHNOLOGY | 9,400 | 55.300 | 519,820.00 | |
| | NETEASE INC | 38,000 | 133.400 | 5,069,200.00 | |
| | TENCENT HOLDINGS LTD | 105,800 | 327.400 | 34,638,920.00 | |
| | 香港・ドル小計 | 15,365,904 | | 203,222,217.32 (3,304,393,254) | |
| 台湾・ドル | FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | 19,000 | 90.100 | 1,711,900.00 | |
| | ASIA CEMENT CORP | 37,000 | 46.900 | 1,735,300.00 | |
| | CHINA STEEL CORP | 216,000 | 36.600 | 7,905,600.00 | |
| | FORMOSA CHEMICALS & FIBRE | 61,000 | 80.200 | 4,892,200.00 | |
| | FORMOSA PLASTICS CORP | 70,000 | 106.000 | 7,420,000.00 | |
| | NAN YA PLASTICS CORP | 97,000 | 85.900 | 8,332,300.00 | |
| | TAIWAN CEMENT | 91,077 | 46.100 | 4,198,649.70 | |
| | AIRTAC INTERNATIONAL GROUP | 3,000 | 805.000 | 2,415,000.00 | |
| | FAR EASTERN NEW CENTURY CORP | 49,000 | 30.000 | 1,470,000.00 | |
| | HIWIN TECHNOLOGIES CORP | 4,214 | 219.000 | 922,866.00 | |
| | VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY | 1,000 | 1,290.000 | 1,290,000.00 | |
| | EVERGREEN MARINE CORP LTD | 47,740 | 139.500 | 6,659,730.00 | |
| | TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP | 29,000 | 28.200 | 817,800.00 | |
| | WAN HAI LINES LTD | 12,700 | 148.000 | 1,879,600.00 | |
| | YANG MING MARINE TRANSPORT | 34,000 | 121.500 | 4,131,000.00 | |
| | CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD | 30,000 | 33.800 | 1,014,000.00 | |
| | ECLAT TEXTILE COMPANY LTD | 4,000 | 475.000 | 1,900,000.00 | |
| | FENG TAY ENTERPRISE CO LTD | 7,640 | 190.000 | 1,451,600.00 | |
| | GIANT MANUFACTURING | 5,000 | 248.500 | 1,242,500.00 | |
| | NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD | 3,000 | 312.500 | 937,500.00 | |
| | POU CHEN | 39,000 | 31.300 | 1,220,700.00 | |

| | | | | |
|---------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| HOTAI MOTOR COMPANY LTD | 6,000 | 573.000 | 3,438,000.00 | |
| MOMO.COM INC | 1,000 | 912.000 | 912,000.00 | |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 10,000 | 272.000 | 2,720,000.00 | |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 89,000 | 67.600 | 6,016,400.00 | |
| ONENESS BIOTECH CO LTD | 5,000 | 199.000 | 995,000.00 | |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK | 65,754 | 18.500 | 1,216,449.00 | |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT | 340,000 | 29.100 | 9,894,000.00 | |
| E.SUN FINANCIAL HOLDING CO | 227,201 | 32.450 | 7,372,672.45 | |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO | 197,792 | 27.600 | 5,459,059.20 | |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C | 165,855 | 23.150 | 3,839,543.25 | |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT | 200,000 | 41.550 | 8,310,000.00 | |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS | 197,760 | 18.250 | 3,609,120.00 | |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDING | 197,958 | 19.150 | 3,790,895.70 | |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL | 182,105 | 28.300 | 5,153,571.50 | |
| THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA | 60,299 | 48.550 | 2,927,516.45 | |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD | 24,463 | 236.500 | 5,785,499.50 | |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO | 186,160 | 26.250 | 4,886,700.00 | |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO | 145,000 | 63.800 | 9,251,000.00 | |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL | 292,196 | 18.150 | 5,303,357.40 | |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO | 141,000 | 74.800 | 10,546,800.00 | |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING | 199,432 | 10.000 | 1,994,320.00 | |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 19,180 | 67.800 | 1,300,404.00 | |
| ACCTON TECHNOLOGY CORP | 10,000 | 211.000 | 2,110,000.00 | |
| ACER INC | 48,000 | 27.100 | 1,300,800.00 | |
| ADVANTECH CO LTD | 7,299 | 374.000 | 2,729,826.00 | |
| ASUSTEK COMPUTER INC | 13,000 | 356.000 | 4,628,000.00 | |
| AU OPTRONICS CORP | 137,000 | 17.700 | 2,424,900.00 | |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 11,000 | 145.500 | 1,600,500.00 | |
| COMPAL ELECTRONICS | 70,000 | 22.200 | 1,554,000.00 | |

| | | | | |
|---------------------------------|---------|-----------|----------------|--|
| DELTA ELECTRONICS INC | 36,000 | 236.500 | 8,514,000.00 | |
| E INK HOLDINGS INC | 17,000 | 169.500 | 2,881,500.00 | |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD | 15,000 | 59.500 | 892,500.00 | |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY | 230,800 | 100.500 | 23,195,400.00 | |
| INNOLUX CORP | 158,000 | 14.650 | 2,314,700.00 | |
| INVENTEC CORP | 42,000 | 24.800 | 1,041,600.00 | |
| LARGAN PRECISION CO LTD | 2,080 | 1,685.000 | 3,504,800.00 | |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 35,000 | 68.000 | 2,380,000.00 | |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO | 11,000 | 119.000 | 1,309,000.00 | |
| NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD | 4,000 | 406.500 | 1,626,000.00 | |
| PEGATRON CORP | 33,000 | 70.500 | 2,326,500.00 | |
| QUANTA COMPUTER INC | 52,000 | 83.200 | 4,326,400.00 | |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP | 22,000 | 76.900 | 1,691,800.00 | |
| UNIMICRON TECHNOLOGY CORP | 23,000 | 202.000 | 4,646,000.00 | |
| WIWYNN CORP | 2,000 | 967.000 | 1,934,000.00 | |
| WPG HOLDINGS LTD | 24,520 | 54.700 | 1,341,244.00 | |
| YAGEO CORPORATION | 8,198 | 393.500 | 3,225,913.00 | |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING | 11,000 | 104.500 | 1,149,500.00 | |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT | 63,000 | 94.600 | 5,959,800.00 | |
| ASMEDIA TECHNOLOGY INC | 500 | 1,450.000 | 725,000.00 | |
| EMEMORY TECHNOLOGY INC | 1,000 | 1,125.000 | 1,125,000.00 | |
| GLOBALWAFERS CO LTD | 4,000 | 549.000 | 2,196,000.00 | |
| MEDIATEK INC | 28,000 | 837.000 | 23,436,000.00 | |
| NANYA TECHNOLOGY CORP | 21,000 | 64.300 | 1,350,300.00 | |
| NOVATEK MICROELECTRONICS COR | 10,000 | 374.500 | 3,745,000.00 | |
| PARADE TECHNOLOGIES LTD | 1,000 | 1,320.000 | 1,320,000.00 | |
| REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | 8,000 | 392.000 | 3,136,000.00 | |
| SILERGY CORP | 1,300 | 2,795.000 | 3,633,500.00 | |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 452,000 | 547.000 | 247,244,000.00 | |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP | 218,000 | 45.500 | 9,919,000.00 | |
| VANGUARD INTERNATIONAL SEMI | 15,000 | 103.000 | 1,545,000.00 | |
| WIN SEMICONDUCTORS CORP | 6,000 | 221.500 | 1,329,000.00 | |
| WINBOND ELECTRONICS CORP | 61,000 | 27.000 | 1,647,000.00 | |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 71,000 | 131.500 | 9,336,500.00 | |

| | | | | | |
|----------|-------------------------------|-----------|---------|-----------------------------------|--|
| | FAR EASTONE TELECOMM CO LTD | 27,000 | 78.300 | 2,114,100.00 | |
| | TAIWAN MOBILE CO LTD | 33,000 | 107.500 | 3,547,500.00 | |
| | 台湾・ドル小計 | 5,857,223 | | 576,228,137.15 (2,505,382,318) | |
| エジプト・ポンド | EASTERN CO SAE | 13,558 | 11.010 | 149,273.58 | |
| | COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN | 29,470 | 42.000 | 1,237,740.00 | |
| | FAWRY FOR BANKING & PAYMENT | 5,390 | 4.880 | 26,303.20 | |
| | FAWRY FOR BANKING & - RIGHTTS | 5,051 | 4.060 | 20,507.06 | |
| | エジプト・ポンド小計 | 53,469 | | 1,433,823.84 (9,854,241) | |
| トルコ・リラ | TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | 2,650 | 259.400 | 687,410.00 | |
| | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 25,680 | 34.500 | 885,960.00 | |
| | ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI | 8,452 | 27.000 | 228,204.00 | |
| | KOC HOLDING AS | 15,538 | 40.200 | 624,627.60 | |
| | TURK SISE VE CAM FABRIKALARI | 22,434 | 17.930 | 402,241.62 | |
| | FORD OTOMOTIV SANAYI AS | 947 | 304.900 | 288,740.30 | |
| | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | 8,767 | 86.800 | 760,975.60 | |
| | AKBANK T.A.S. | 70,766 | 9.360 | 662,369.76 | |
| | TURKIYE GARANTI BANKASI | 35,453 | 14.970 | 530,731.41 | |
| | TURKIYE IS BANKASI-C | 22,389 | 10.710 | 239,786.19 | |
| | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 27,080 | 23.020 | 623,381.60 | |
| | トルコ・リラ小計 | 240,156 | | 5,934,428.08 (51,255,654) | |
| メキシコ・ペソ | GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B | 58,500 | 97.870 | 5,725,395.00 | |
| | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 3,095 | 237.970 | 736,517.15 | |
| | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | 20,300 | 48.140 | 977,242.00 | |
| | ALFA S.A.B. -A | 49,200 | 14.220 | 699,624.00 | |
| | GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1 | 7,700 | 71.390 | 549,703.00 | |
| | GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B | 6,100 | 290.110 | 1,769,671.00 | |
| | GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B | 3,470 | 409.910 | 1,422,387.70 | |

| | | | | | |
|----------|------------------------------|---------|-----------|--------------------------------|--|
| | PROMOTORA Y OPERADORA DE INF | 5,105 | 152.680 | 779,431.40 | |
| | WALMART DE MEXICO SAB DE CV | 98,000 | 76.650 | 7,511,700.00 | |
| | ARCA CONTINENTAL SAB DE CV | 7,000 | 127.470 | 892,290.00 | |
| | BEACLE SAB DE CV | 12,700 | 47.750 | 606,425.00 | |
| | GRUMA S.A.B.-B | 3,575 | 243.040 | 868,868.00 | |
| | GRUPO BIMBO SAB- SERIES A | 26,200 | 56.140 | 1,470,868.00 | |
| | KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A | 25,400 | 29.110 | 739,394.00 | |
| | GRUPO FINANCIERO BANORTE-0 | 48,700 | 141.220 | 6,877,414.00 | |
| | GRUPO FINANCIERO INBURSA-0 | 45,000 | 36.700 | 1,651,500.00 | |
| | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L | 570,600 | 21.390 | 12,205,134.00 | |
| | メキシコ・ペソ小計 | 990,645 | | 45,483,564.25 (287,033,129) | |
| フィリピン・ペソ | ABOITIZ EQUITY VENTURES INC | 42,090 | 56.900 | 2,394,921.00 | |
| | AYALA CORPORATION | 4,660 | 779.000 | 3,630,140.00 | |
| | GT CAPITAL HOLDINGS INC | 1,310 | 514.000 | 673,340.00 | |
| | JG SUMMIT HOLDINGS INC | 56,042 | 58.000 | 3,250,436.00 | |
| | SM INVESTMENTS CORP | 4,025 | 885.000 | 3,562,125.00 | |
| | INTL CONTAINER TERM SVCS INC | 18,730 | 226.200 | 4,236,726.00 | |
| | JOLLIBEE FOODS CORP | 7,480 | 217.600 | 1,627,648.00 | |
| | MONDE NISSIN CORP | 75,000 | 12.740 | 955,500.00 | |
| | UNIVERSAL ROBINA CORP | 17,230 | 109.800 | 1,891,854.00 | |
| | BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN | 33,757 | 98.200 | 3,314,937.40 | |
| | BDO UNIBANK INC | 35,590 | 133.000 | 4,733,470.00 | |
| | METROPOLITAN BANK & TRUST | 38,980 | 55.500 | 2,163,390.00 | |
| | METRO PACIFIC INVESTMENTS CO | 110,900 | 3.830 | 424,747.00 | |
| | AYALA LAND INC | 158,000 | 34.750 | 5,490,500.00 | |
| | SM PRIME HOLDINGS INC | 177,300 | 36.150 | 6,409,395.00 | |
| | GLOBE TELECOM INC | 620 | 2,438.000 | 1,511,560.00 | |
| | PLDT INC | 1,255 | 1,910.000 | 2,397,050.00 | |
| | AC ENERGY CORP | 127,700 | 8.160 | 1,042,032.00 | |
| | MANILA ELECTRIC COMPANY | 5,120 | 342.400 | 1,753,088.00 | |
| | フィリピン・ペソ小計 | 915,789 | | 51,462,859.40 (125,265,746) | |
| | EMPRESAS COPEC SA | 8,012 | 6,281.000 | 50,323,372.00 | |

| | | | | | |
|--------------|---------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|--|
| チリ・ペ ソ | EMPRESAS CMPC SA | 22,543 | 1,325.000 | 29,869,475.00 | |
| | SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B | 2,369 | 62,606.000 | 148,313,614.00 | |
| | FALABELLA SA | 15,911 | 2,350.000 | 37,390,850.00 | |
| | CENCOSUD SA | 28,071 | 1,455.100 | 40,846,112.10 | |
| | CIA CERVECERIAS UNIDAS SA | 1,586 | 5,600.000 | 8,881,600.00 | |
| | BANCO DE CHILE | 824,852 | 88.210 | 72,760,194.92 | |
| | BANCO DE CREDITO E INVERSION | 1,001 | 26,562.000 | 26,588,562.00 | |
| | BANCO SANTANDER CHILE | 1,209,844 | 41.180 | 49,821,375.92 | |
| | ENEL AMERICAS SA | 408,318 | 90.990 | 37,152,854.82 | |
| | ENEL CHILE SA | 364,877 | 23.420 | 8,545,419.34 | |
| チリ・ペソ小計 | | 2,887,384 | | 510,493,430.10 (77,082,466) | |
| コロンビ ア・ペソ | ECOPETROL SA | 92,687 | 3,280.000 | 304,013,360.00 | |
| | BANCOLOMBIA SA | 3,656 | 41,000.000 | 149,896,000.00 | |
| | BANCOLOMBIA SA-PREF | 8,412 | 38,500.000 | 323,862,000.00 | |
| | GRUPO DE INV SURAMERICANA | 2,986 | 35,500.000 | 106,003,000.00 | |
| | INTERCONEXION ELECTRICA SA | 8,110 | 22,320.000 | 181,015,200.00 | |
| コロンビア・ペソ小計 | | 115,851 | | 1,064,789,560.00 (34,541,773) | |
| インド・ ルピー | BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 14,493 | 369.700 | 5,358,062.10 | |
| | COAL INDIA LTD | 25,735 | 188.450 | 4,849,760.75 | |
| | HINDUSTAN PETROLEUM CORP | 10,662 | 291.650 | 3,109,572.30 | |
| | INDIAN OIL CORP LTD | 29,088 | 127.750 | 3,715,992.00 | |
| | OIL & NATURAL GAS CORP LTD | 49,390 | 169.650 | 8,379,013.50 | |
| | PETRONET LNG LTD | 12,527 | 202.850 | 2,541,101.95 | |
| | RELIANCE INDUSTRIES LTD | 52,588 | 2,695.000 | 141,724,660.00 | |
| | ACC LTD | 1,628 | 2,262.050 | 3,682,617.40 | |
| | AMBUJA CEMENTS LTD | 11,609 | 376.350 | 4,369,047.15 | |
| | ASIAN PAINTS LTD | 7,202 | 3,130.600 | 22,546,581.20 | |
| | BERGER PAINTS INDIA LTD | 4,056 | 715.750 | 2,903,082.00 | |
| | GRASIM INDUSTRIES LTD | 5,159 | 1,693.700 | 8,737,798.30 | |
| | HINDALCO INDUSTRIES LTD | 29,822 | 495.500 | 14,776,801.00 | |
| | JSW STEEL LTD | 16,324 | 715.700 | 11,683,086.80 | |
| | PI INDUSTRIES LTD | 1,393 | 2,855.850 | 3,978,199.05 | |
| | PIDILITE INDUSTRIES LTD | 2,546 | 2,408.350 | 6,131,659.10 | |
| | SHREE CEMENT LTD | 181 | 25,649.600 | 4,642,577.60 | |
| | SRF LTD | 2,473 | 2,434.750 | 6,021,136.75 | |
| | TATA STEEL LTD | 13,699 | 1,220.350 | 16,717,574.65 | |
| | ULTRATECH CEMENT LTD | 1,932 | 6,595.050 | 12,741,636.60 | |
| UPL LTD | 8,296 | 803.050 | 6,662,102.80 | | |
| VEDANTA LTD | 21,814 | 402.100 | 8,771,409.40 | | |

| | | | | |
|---------------------------------|--------|------------|---------------|--|
| ADANI ENTERPRISES LTD | 5,362 | 2,284.200 | 12,247,880.40 | |
| BHARAT ELECTRONICS LTD | 24,926 | 245.800 | 6,126,810.80 | |
| HAVELLS INDIA LTD | 4,184 | 1,301.900 | 5,447,149.60 | |
| LARSEN & TOUBRO LTD | 12,918 | 1,657.350 | 21,409,647.30 | |
| SIEMENS LTD | 1,167 | 2,261.700 | 2,639,403.90 | |
| INDIAN RAILWAY CATERING & TO | 4,007 | 745.600 | 2,987,619.20 | |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECON | 8,526 | 859.550 | 7,328,523.30 | |
| CONTAINER CORP OF INDIA LTD | 3,801 | 644.700 | 2,450,504.70 | |
| INTERGLOBE AVIATION LTD | 2,035 | 1,864.900 | 3,795,071.50 | |
| BAJAJ AUTO LTD | 1,160 | 3,682.950 | 4,272,222.00 | |
| BALKRISHNA INDUSTRIES LTD | 1,453 | 2,030.200 | 2,949,880.60 | |
| BHARAT FORGE LTD | 3,465 | 701.550 | 2,430,870.75 | |
| EICHER MOTORS LTD | 2,283 | 2,594.150 | 5,922,444.45 | |
| HERO MOTOCORP LTD | 2,002 | 2,288.600 | 4,581,777.20 | |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD | 16,602 | 904.000 | 15,008,208.00 | |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD | 2,555 | 7,912.350 | 20,216,054.25 | |
| MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD | 21,100 | 133.000 | 2,806,300.00 | |
| MRF LTD | 32 | 69,115.900 | 2,211,708.80 | |
| TATA MOTORS LTD | 31,578 | 425.150 | 13,425,386.70 | |
| PAGE INDUSTRIES LTD | 115 | 44,866.350 | 5,159,630.25 | |
| TITAN CO LTD | 6,723 | 2,453.900 | 16,497,569.70 | |
| JUBILANT FOODWORKS LTD | 6,600 | 540.600 | 3,567,960.00 | |
| TRENT LTD | 3,028 | 1,237.450 | 3,746,998.60 | |
| ZOMATO LTD | 26,199 | 78.750 | 2,063,171.25 | |
| AVENUE SUPERMARTS LTD | 3,094 | 3,989.200 | 12,342,584.80 | |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD | 1,811 | 3,295.900 | 5,968,874.90 | |
| ITC LTD | 56,661 | 255.250 | 14,462,720.25 | |
| MARICO LTD | 8,623 | 515.550 | 4,445,587.65 | |
| NESTLE INDIA LTD | 648 | 18,174.700 | 11,777,205.60 | |
| TATA CONSUMER PRODUCTS LTD | 11,704 | 792.750 | 9,278,346.00 | |
| UNITED SPIRITS LTD | 4,855 | 844.300 | 4,099,076.50 | |
| COLGATE PALMOLIVE (INDIA) | 2,044 | 1,610.750 | 3,292,373.00 | |
| DABUR INDIA LTD | 10,335 | 551.300 | 5,697,685.50 | |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 5,978 | 761.150 | 4,550,154.70 | |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD | 15,323 | 2,100.750 | 32,189,792.25 | |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE | 1,958 | 4,676.050 | 9,155,705.90 | |
| AUROBINDO PHARMA LTD | 4,893 | 638.900 | 3,126,137.70 | |
| BIOCON LTD | 7,019 | 380.850 | 2,673,186.15 | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|------------|---------------|--|
| CIPLA LTD | 8,584 | 953.150 | 8,181,839.60 | |
| DIVI'S LABORATORIES LTD | 2,316 | 4,410.100 | 10,213,791.60 | |
| DR. REDDY'S LABORATORIES | 2,045 | 4,115.450 | 8,416,095.25 | |
| LUPIN LTD | 4,861 | 725.400 | 3,526,169.40 | |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS | 14,661 | 900.000 | 13,194,900.00 | |
| TORRENT PHARMACEUTICALS LTD | 848 | 2,732.300 | 2,316,990.40 | |
| AXIS BANK LTD | 42,316 | 780.700 | 33,036,101.20 | |
| BANDHAN BANK LTD | 10,002 | 332.750 | 3,328,165.50 | |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE | 31,758 | 2,210.500 | 70,201,059.00 | |
| ICICI BANK LTD | 94,918 | 752.200 | 71,397,319.60 | |
| KOTAK MAHINDRA BANK LTD | 10,464 | 1,728.850 | 18,090,686.40 | |
| STATE BANK OF INDIA | 33,811 | 494.750 | 16,727,992.25 | |
| YES BANK LTD | 188,310 | 13.750 | 2,589,262.50 | |
| BAJAJ FINANCE LTD | 5,048 | 7,005.500 | 35,363,764.00 | |
| BAJAJ FINSERV LTD | 732 | 15,265.150 | 11,174,089.80 | |
| CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND | 8,282 | 715.200 | 5,923,286.40 | |
| HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD | 718 | 2,005.000 | 1,439,590.00 | |
| MUTHOOT FINANCE LTD | 2,010 | 1,277.050 | 2,566,870.50 | |
| PIRAMAL ENTERPRISES LTD | 2,439 | 2,113.000 | 5,153,607.00 | |
| SBI CARDS & PAYMENT SERVICES | 3,930 | 804.600 | 3,162,078.00 | |
| SHRIRAM TRANSPORT FINANCE | 3,367 | 1,096.600 | 3,692,252.20 | |
| HDFC LIFE INSURANCE CO LTD | 17,668 | 540.000 | 9,540,720.00 | |
| ICICI LOMBARD GENERAL INSURA | 3,722 | 1,305.750 | 4,860,001.50 | |
| ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA | 6,000 | 516.950 | 3,101,700.00 | |
| SBI LIFE INSURANCE CO LTD | 8,746 | 1,091.250 | 9,544,072.50 | |
| DLF LTD | 10,337 | 364.000 | 3,762,668.00 | |
| GODREJ PROPERTIES LTD | 2,089 | 1,510.800 | 3,156,061.20 | |
| HCL TECHNOLOGIES LTD | 20,368 | 1,089.850 | 22,198,064.80 | |
| INFOSYS LTD | 62,021 | 1,561.100 | 96,820,983.10 | |
| LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD | 878 | 4,856.050 | 4,263,611.90 | |
| MINDTREE LTD | 1,101 | 3,722.550 | 4,098,527.55 | |
| MPHASIS LTD | 1,407 | 2,794.850 | 3,932,353.95 | |
| TATA CONSULTANCY SVCS LTD | 17,110 | 3,548.200 | 60,709,702.00 | |
| TECH MAHINDRA LTD | 11,940 | 1,270.400 | 15,168,576.00 | |
| WIPRO LTD | 25,986 | 529.350 | 13,755,689.10 | |
| BHARTI AIRTEL LTD | 46,084 | 739.350 | 34,072,205.40 | |

| | | | | | |
|------------|-------------------------------|-----------|------------|-------------------------------------|--|
| | INDUS TOWERS LTD | 9,651 | 211.100 | 2,037,326.10 | |
| | ADANI GREEN ENERGY LTD | 7,441 | 2,824.000 | 21,013,384.00 | |
| | ADANI TOTAL GAS LTD | 5,372 | 2,420.000 | 13,000,240.00 | |
| | ADANI TRANSMISSION LTD | 5,298 | 2,615.900 | 13,859,038.20 | |
| | GAIL INDIA LTD | 25,960 | 157.850 | 4,097,786.00 | |
| | INDRAPRASTHA GAS LTD | 4,121 | 372.150 | 1,533,630.15 | |
| | NTPC LTD | 84,726 | 156.100 | 13,225,728.60 | |
| | POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 54,806 | 222.850 | 12,213,517.10 | |
| | TATA POWER CO LTD | 24,009 | 247.350 | 5,938,626.15 | |
| | INFO EDGE INDIA LTD | 1,370 | 4,502.450 | 6,168,356.50 | |
| | インド・ルピー小計 | 1,579,015 | | 1,308,164,176.95 (2,184,634,176) | |
| インドネシア・ルピア | ADARO ENERGY INDONESIA TBK P | 263,900 | 3,210.000 | 847,119,000.00 | |
| | UNITED TRACTORS TBK PT | 28,000 | 27,625.000 | 773,500,000.00 | |
| | ANEKA TAMBANG TBK | 128,000 | 2,620.000 | 335,360,000.00 | |
| | BARITO PACIFIC TBK PT | 626,800 | 865.000 | 542,182,000.00 | |
| | INDAH KIAT PULP & PAPER TBK | 57,500 | 7,500.000 | 431,250,000.00 | |
| | INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA | 36,000 | 10,125.000 | 364,500,000.00 | |
| | MERDEKA COPPER GOLD TBK PT | 179,700 | 5,200.000 | 934,440,000.00 | |
| | MERDEKA COPPER GOLD T-RIGHTS | 9,461 | 2,330.000 | 22,044,130.00 | |
| | SEMEN INDONESIA PERSERO TBK | 43,500 | 5,975.000 | 259,912,500.00 | |
| | ASTRA INTERNATIONAL TBK PT | 353,700 | 7,075.000 | 2,502,427,500.00 | |
| | CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT | 112,900 | 4,920.000 | 555,468,000.00 | |
| | GUDANG GARAM TBK PT | 10,800 | 30,600.000 | 330,480,000.00 | |
| | INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T | 39,000 | 7,425.000 | 289,575,000.00 | |
| | INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P | 87,700 | 6,300.000 | 552,510,000.00 | |
| | UNILEVER INDONESIA TBK PT | 104,500 | 3,690.000 | 385,605,000.00 | |
| | KALBE FARMA TBK PT | 410,000 | 1,605.000 | 658,050,000.00 | |
| | BANK CENTRAL ASIA TBK PT | 1,029,900 | 8,000.000 | 8,239,200,000.00 | |
| | BANK JAGO TBK PT | 82,300 | 12,275.000 | 1,010,232,500.00 | |
| | BANK MANDIRI PERSERO TBK PT | 350,300 | 8,225.000 | 2,881,217,500.00 | |
| | BANK NEGARA INDONESIA PERSER | 124,600 | 9,500.000 | 1,183,700,000.00 | |

| | | | | | |
|------------------------|---------------------------------|-----------|--------------|------------------------------------|--|
| | BANK RAKYAT INDONESIA PERSER | 1,272,800 | 4,840.000 | 6,160,352,000.00 | |
| | SARANA MENARA NUSANTARA PT | 516,500 | 1,030.000 | 531,995,000.00 | |
| | TELKOM INDONESIA PERSERO TBK | 917,400 | 4,710.000 | 4,320,954,000.00 | |
| | TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE | 118,900 | 3,080.000 | 366,212,000.00 | |
| | インドネシア・ルピア小 計 | 6,904,161 | | 34,478,286,130.00 (306,856,747) | |
| ブラジ ル・レア ル | COSAN SA | 17,188 | 22.010 | 378,307.88 | |
| | PETRO RIO SA | 14,300 | 24.700 | 353,210.00 | |
| | PETROBRAS - PETROLEO BRAS | 69,200 | 33.140 | 2,293,288.00 | |
| | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 88,400 | 30.110 | 2,661,724.00 | |
| | ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | 10,600 | 14.100 | 149,460.00 | |
| | BRASKEM SA-PREF A | 2,600 | 41.280 | 107,328.00 | |
| | CIA SIDERURGICA NACIONAL SA | 11,600 | 21.430 | 248,588.00 | |
| | GERDAU SA-PREF | 22,400 | 27.700 | 620,480.00 | |
| | SUZANO SA | 14,415 | 51.750 | 745,976.25 | |
| | VALE SA | 75,688 | 79.080 | 5,985,407.04 | |
| | WEG SA | 31,960 | 31.210 | 997,471.60 | |
| | CCR SA | 23,400 | 13.450 | 314,730.00 | |
| | LOCALIZA RENT A CAR | 11,700 | 55.350 | 647,595.00 | |
| | RUMO SA | 21,700 | 18.130 | 393,421.00 | |
| | ALPARGATAS SA - PREF | 2,100 | 21.170 | 44,457.00 | |
| | AMERICANAS SA | 13,024 | 26.390 | 343,703.36 | |
| | LOJAS RENNEN S.A. | 16,558 | 25.000 | 413,950.00 | |
| | MAGAZINE LUIZA SA | 54,700 | 5.440 | 297,568.00 | |
| | VIBRA ENERGIA SA | 19,480 | 22.180 | 432,066.40 | |
| | ATACADA0 SA | 8,100 | 21.400 | 173,340.00 | |
| | RAIA DROGASIL SA | 17,900 | 22.920 | 410,268.00 | |
| | AMBEV SA | 88,200 | 15.120 | 1,333,584.00 | |
| | BRF SA | 15,000 | 13.980 | 209,700.00 | |
| | JBS SA | 14,100 | 38.080 | 536,928.00 | |
| | NATURA &CO HOLDING SA | 16,300 | 20.070 | 327,141.00 | |
| | HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE | 81,219 | 10.160 | 825,185.04 | |
| | REDE D'OR SAO LUIZ SA | 7,400 | 40.830 | 302,142.00 | |
| HYPERA SA | 6,000 | 37.550 | 225,300.00 | | |
| BANCO BRADESCO S.A. | 26,881 | 15.760 | 423,644.56 | | |
| BANCO BRADESCO SA-PREF | 99,336 | 19.100 | 1,897,317.60 | | |
| BANCO DO BRASIL S.A. | 16,800 | 34.700 | 582,960.00 | | |

| | | | | | |
|-------------|------------------------------|------------|---------------|--------------------------------|--|
| | ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | 90,300 | 25.570 | 2,308,971.00 | |
| | ITAUSA SA | 88,569 | 9.880 | 875,061.72 | |
| | B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO | 114,800 | 14.120 | 1,620,976.00 | |
| | BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 11,700 | 26.370 | 308,529.00 | |
| | TOTVS SA | 8,800 | 34.630 | 304,744.00 | |
| | TELEFONICA BRASIL S.A. | 8,500 | 53.650 | 456,025.00 | |
| | TIM SA | 18,200 | 13.750 | 250,250.00 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER | 6,500 | 40.240 | 261,560.00 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B | 5,700 | 39.840 | 227,088.00 | |
| | CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 17,846 | 15.050 | 268,582.30 | |
| | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP | 5,700 | 46.720 | 266,304.00 | |
| | ENGIE BRASIL ENERGIA SA | 2,550 | 44.450 | 113,347.50 | |
| | EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | 16,800 | 25.760 | 432,768.00 | |
| | ブラジル・リアル小計 | 1,314,214 | | 32,370,448.25 (846,707,341) | |
| チェコ・ コルナ | KOMERCNI BANKA AS | 1,270 | 845.000 | 1,073,150.00 | |
| | MONETA MONEY BANK AS | 4,790 | 93.700 | 448,823.00 | |
| | CEZ AS | 2,855 | 971.000 | 2,772,205.00 | |
| | チェコ・コルナ小計 | 8,915 | | 4,294,178.00 (24,113,957) | |
| 韓国・ ウォン | GS HOLDINGS | 628 | 43,850.000 | 27,537,800.00 | |
| | HD HYUNDAI | 932 | 58,400.000 | 54,428,800.00 | |
| | SK INNOVATION CO LTD | 974 | 212,500.000 | 206,975,000.00 | |
| | S-OIL CORP | 752 | 104,000.000 | 78,208,000.00 | |
| | HANWHA SOLUTIONS CORP | 2,077 | 31,900.000 | 66,256,300.00 | |
| | HYUNDAI STEEL CO | 1,449 | 42,400.000 | 61,437,600.00 | |
| | KOREA ZINC CO LTD | 142 | 621,000.000 | 88,182,000.00 | |
| | KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD | 305 | 147,500.000 | 44,987,500.00 | |
| | LG CHEM LTD | 857 | 486,000.000 | 416,502,000.00 | |
| | LG CHEM LTD-PREFERENCE | 128 | 247,000.000 | 31,616,000.00 | |
| | LOTTE CHEMICAL CORP | 286 | 192,000.000 | 54,912,000.00 | |
| | POSCO CHEMICAL CO LTD | 641 | 127,500.000 | 81,727,500.00 | |
| | POSCO HOLDINGS INC | 1,389 | 286,000.000 | 397,254,000.00 | |
| | SK CHEMICALS CO LTD/NEW | 144 | 125,000.000 | 18,000,000.00 | |
| | SK IE TECHNOLOGY CO LTD | 526 | 126,500.000 | 66,539,000.00 | |
| | SKC CO LTD | 348 | 149,000.000 | 51,852,000.00 | |
| CJ CORP | 168 | 86,500.000 | 14,532,000.00 | | |

| | | | | |
|---------------------------------|--------|-------------|----------------|--|
| DOOSAN BOBCAT INC | 664 | 40,450.000 | 26,858,800.00 | |
| DOOSAN ENERBILITY | 6,839 | 20,400.000 | 139,515,600.00 | |
| ECOPRO BM CO LTD | 183 | 455,200.000 | 83,301,600.00 | |
| GS ENGINEERING & CONSTRUCT | 1,373 | 40,400.000 | 55,469,200.00 | |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONST | 1,302 | 42,550.000 | 55,400,100.00 | |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES | 1,568 | 43,050.000 | 67,502,400.00 | |
| KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR | 650 | 95,000.000 | 61,750,000.00 | |
| LG CORP | 1,541 | 72,800.000 | 112,184,800.00 | |
| LG ENERGY SOLUTION | 407 | 433,000.000 | 176,231,000.00 | |
| SAMSUNG C&T CORP | 1,619 | 108,000.000 | 174,852,000.00 | |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD | 2,973 | 23,600.000 | 70,162,800.00 | |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES | 10,504 | 6,050.000 | 63,549,200.00 | |
| SK INC | 731 | 259,000.000 | 189,329,000.00 | |
| S-1 CORPORATION | 219 | 67,500.000 | 14,782,500.00 | |
| CJ LOGISTICS | 235 | 122,000.000 | 28,670,000.00 | |
| HMM CO LTD | 4,708 | 26,750.000 | 125,939,000.00 | |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD | 364 | 190,000.000 | 69,160,000.00 | |
| KOREAN AIR LINES CO LTD | 2,905 | 29,950.000 | 87,004,750.00 | |
| PAN OCEAN CO LTD | 4,527 | 6,440.000 | 29,153,880.00 | |
| HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO | 1,442 | 34,500.000 | 49,749,000.00 | |
| HANON SYSTEMS | 4,138 | 11,400.000 | 47,173,200.00 | |
| HYUNDAI MOBIS CO LTD | 1,252 | 203,500.000 | 254,782,000.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO | 2,596 | 182,000.000 | 472,472,000.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF | 609 | 92,000.000 | 56,028,000.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF | 313 | 91,200.000 | 28,545,600.00 | |
| KIA CORP | 4,948 | 79,600.000 | 393,860,800.00 | |
| COWAY CO LTD | 925 | 69,200.000 | 64,010,000.00 | |
| F&F CO LTD / NEW | 290 | 126,500.000 | 36,685,000.00 | |
| HLB INC | 2,030 | 29,200.000 | 59,276,000.00 | |
| LG ELECTRONICS INC | 2,019 | 119,000.000 | 240,261,000.00 | |
| KANGWON LAND INC | 2,078 | 26,400.000 | 54,859,200.00 | |
| HOTEL SHILLA CO LTD | 680 | 80,100.000 | 54,468,000.00 | |
| LOTTE SHOPPING CO | 172 | 93,100.000 | 16,013,200.00 | |
| BGF RETAIL CO LTD | 193 | 183,000.000 | 35,319,000.00 | |
| E-MART INC | 326 | 132,500.000 | 43,195,000.00 | |
| CJ CHEILJEDANG CORP | 125 | 418,000.000 | 52,250,000.00 | |
| KT&G CORP | 2,245 | 82,400.000 | 184,988,000.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|-------|-------------|----------------|--|
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA | 373 | 93,500.000 | 34,875,500.00 | |
| AMOREPACIFIC CORP | 583 | 158,500.000 | 92,405,500.00 | |
| AMOREPACIFIC GROUP | 473 | 45,950.000 | 21,734,350.00 | |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE | 181 | 883,000.000 | 159,823,000.00 | |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF | 35 | 489,000.000 | 17,115,000.00 | |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD | 1,452 | 57,700.000 | 83,780,400.00 | |
| SD BIOSENSOR INC | 604 | 46,100.000 | 27,844,400.00 | |
| ALTEOGEN INC | 312 | 53,600.000 | 16,723,200.00 | |
| CELLTRION INC | 1,861 | 155,500.000 | 289,385,500.00 | |
| CELLTRION PHARM INC | 347 | 83,100.000 | 28,835,700.00 | |
| GREEN CROSS CORP | 79 | 181,000.000 | 14,299,000.00 | |
| HANMI PHARM CO LTD | 88 | 303,500.000 | 26,708,000.00 | |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD | 314 | 793,000.000 | 249,002,000.00 | |
| SEEGENE INC | 713 | 40,700.000 | 29,019,100.00 | |
| SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD | 383 | 86,700.000 | 33,206,100.00 | |
| SK BIOSCIENCE CO LTD | 383 | 136,000.000 | 52,088,000.00 | |
| YUHAN CORP | 798 | 58,800.000 | 46,922,400.00 | |
| HANA FINANCIAL GROUP | 5,678 | 47,450.000 | 269,421,100.00 | |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA | 4,084 | 11,550.000 | 47,170,200.00 | |
| KAKAOBANK CORP | 1,587 | 42,450.000 | 67,368,150.00 | |
| KB FINANCIAL GROUP INC | 7,386 | 60,000.000 | 443,160,000.00 | |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD | 8,270 | 42,050.000 | 347,753,500.00 | |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC | 9,935 | 15,800.000 | 156,973,000.00 | |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO | 873 | 72,500.000 | 63,292,500.00 | |
| MERITZ FINANCIAL GROUP INC | 824 | 37,300.000 | 30,735,200.00 | |
| MERITZ SECURITIES CO LTD | 5,528 | 6,510.000 | 35,987,280.00 | |
| MIRAE ASSET SECURITIES CO LT | 4,496 | 8,100.000 | 36,417,600.00 | |
| NH INVESTMENT & SECURITIES C | 2,376 | 10,500.000 | 24,948,000.00 | |
| SAMSUNG SECURITIES CO LTD | 982 | 39,350.000 | 38,641,700.00 | |
| DB INSURANCE CO LTD | 912 | 69,800.000 | 63,657,600.00 | |
| MERITZ FIRE & MARINE INSURAN | 969 | 44,450.000 | 43,072,050.00 | |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INS | 514 | 210,000.000 | 107,940,000.00 | |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT | 1,423 | 64,900.000 | 92,352,700.00 | |

| | | | | | |
|---------------------|---------------------------------|---------|-------------|--------------------------------------|--|
| | SAMSUNG SDS CO LTD | 582 | 137,000.000 | 79,734,000.00 | |
| | ILJIN MATERIALS CO LTD | 385 | 83,200.000 | 32,032,000.00 | |
| | L&F CO LTD | 375 | 225,000.000 | 84,375,000.00 | |
| | LG DISPLAY CO LTD | 3,885 | 18,100.000 | 70,318,500.00 | |
| | LG INNOTEK CO LTD | 237 | 372,500.000 | 88,282,500.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO | 1,078 | 163,000.000 | 175,714,000.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 87,704 | 66,300.000 | 5,814,775,200.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF | 15,221 | 59,500.000 | 905,649,500.00 | |
| | SAMSUNG SDI CO LTD | 1,024 | 578,000.000 | 591,872,000.00 | |
| | SK HYNIX INC | 10,083 | 108,000.000 | 1,088,964,000.00 | |
| | SK SQUARE CO LTD | 1,963 | 54,500.000 | 106,983,500.00 | |
| | LG UPLUS CORP | 4,555 | 14,600.000 | 66,503,000.00 | |
| | SK TELECOM | 352 | 59,600.000 | 20,979,200.00 | |
| | KOREA ELECTRIC POWER CORP | 4,289 | 21,200.000 | 90,926,800.00 | |
| | CHEIL WORLDWIDE INC | 1,193 | 25,000.000 | 29,825,000.00 | |
| | CJ ENM CO LTD | 144 | 123,900.000 | 17,841,600.00 | |
| | HYBE CO LTD | 332 | 250,500.000 | 83,166,000.00 | |
| | KAKAO CORP | 5,811 | 89,700.000 | 521,246,700.00 | |
| | KAKAO GAMES CORP | 499 | 60,700.000 | 30,289,300.00 | |
| | KRAFTON INC | 383 | 242,500.000 | 92,877,500.00 | |
| | NAVER CORP | 2,286 | 288,500.000 | 659,511,000.00 | |
| | NCSOFT CORP | 321 | 412,500.000 | 132,412,500.00 | |
| | NETMARBLE CORP | 337 | 96,200.000 | 32,419,400.00 | |
| | PEARL ABYSS CORP | 498 | 91,600.000 | 45,616,800.00 | |
| | 韓国・ウォン小計 | 289,792 | | 19,490,671,860.00 (1,993,895,731) | |
| マレーシ ア・リン ギット | DIALOG GROUP BHD | 66,000 | 2.570 | 169,620.00 | |
| | PETRONAS DAGANGAN BHD | 5,000 | 21.080 | 105,400.00 | |
| | PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 43,400 | 10.120 | 439,208.00 | |
| | PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN | 59,200 | 6.170 | 365,264.00 | |
| | HAP SENG CONSOLIDATED | 8,100 | 7.610 | 61,641.00 | |
| | SIME DARBY BERHAD | 47,100 | 2.340 | 110,214.00 | |
| | MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD | 14,700 | 6.750 | 99,225.00 | |
| | MISC BHD | 28,500 | 7.760 | 221,160.00 | |
| | WESTPORTS HOLDINGS BHD | 10,000 | 3.920 | 39,200.00 | |
| | GENTING BHD | 41,600 | 4.520 | 188,032.00 | |
| | GENTING MALAYSIA BHD | 43,800 | 2.930 | 128,334.00 | |
| | FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD | 1,200 | 21.620 | 25,944.00 | |
| | IOI CORP BHD | 49,500 | 4.730 | 234,135.00 | |

| | | | | | |
|-------------------|---------------------------------|-----------|--------------|---------------|--|
| | KUALA LUMPUR KEPONG BHD | 8,600 | 29.000 | 249,400.00 | |
| | NESTLE (MALAYSIA) BERHAD | 1,500 | 132.500 | 198,750.00 | |
| | PPB GROUP BERHAD | 13,340 | 17.220 | 229,714.80 | |
| | QL RESOURCES BHD | 13,050 | 5.000 | 65,250.00 | |
| | SIME DARBY PLANTATION BHD | 37,800 | 5.340 | 201,852.00 | |
| | HARTALEGA HOLDINGS BHD | 37,700 | 4.510 | 170,027.00 | |
| | IHH HEALTHCARE BHD | 27,500 | 6.560 | 180,400.00 | |
| | TOP GLOVE CORP BHD | 97,900 | 1.710 | 167,409.00 | |
| | AMMB HOLDINGS BHD | 39,300 | 3.630 | 142,659.00 | |
| | CIMB GROUP HOLDINGS BHD | 127,000 | 5.160 | 655,320.00 | |
| | HONG LEONG BANK BERHAD | 13,400 | 20.820 | 278,988.00 | |
| | HONG LEONG FINANCIAL GROUP | 5,700 | 19.280 | 109,896.00 | |
| | MALAYAN BANKING BHD | 89,300 | 8.890 | 793,877.00 | |
| | PUBLIC BANK BERHAD | 267,000 | 4.710 | 1,257,570.00 | |
| | RHB BANK BHD | 28,900 | 5.970 | 172,533.00 | |
| | INARI AMERTRON BHD | 52,900 | 2.740 | 144,946.00 | |
| | AXIATA GROUP BERHAD | 52,900 | 3.440 | 181,976.00 | |
| | DIGI.COM BHD | 58,600 | 3.780 | 221,508.00 | |
| | MAXIS BHD | 39,200 | 3.810 | 149,352.00 | |
| | TELEKOM MALAYSIA BHD | 16,000 | 4.790 | 76,640.00 | |
| | PETRONAS GAS BHD | 14,900 | 16.920 | 252,108.00 | |
| | TENAGA NASIONAL BHD | 41,200 | 8.880 | 365,856.00 | |
| | マレーシア・リンギット 小計 | 1,501,790 | | 8,453,408.80 | |
| | | | | (247,897,057) | |
| 南アフリ カ・ラン ド | EXXARO RESOURCES LTD | 5,088 | 209.500 | 1,065,936.00 | |
| | AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD | 2,473 | 241.610 | 597,501.53 | |
| | ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD | 973 | 1,657.880 | 1,613,117.24 | |
| | ANGLOGOLD ASHANTI LTD | 7,292 | 318.150 | 2,319,949.80 | |
| | GOLD FIELDS LTD | 16,821 | 206.050 | 3,465,967.05 | |
| | HARMONY GOLD MINING CO LTD | 8,544 | 62.900 | 537,417.60 | |
| | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 15,377 | 191.580 | 2,945,925.66 | |
| | KUMBA IRON ORE LTD | 1,182 | 490.300 | 579,534.60 | |
| | NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT | 5,961 | 176.000 | 1,049,136.00 | |
| | SASOL LTD | 10,385 | 358.230 | 3,720,218.55 | |
| | SIBANYE STILLWATER LTD | 48,336 | 53.000 | 2,561,808.00 | |
| | BIDVEST GROUP LTD | 4,831 | 215.950 | 1,043,254.45 | |
| | MR PRICE GROUP LTD | 4,283 | 217.220 | 930,353.26 | |
| NASPERS LTD-N SHS | 4,051 | 1,502.880 | 6,088,166.88 | | |

| | | | | | |
|------------|----------------------------------|---------|-----------|--------------------------------|--|
| | PEPKOR HOLDINGS LTD | 21,607 | 21.420 | 462,821.94 | |
| | WOOLWORTHS HOLDINGS LTD | 16,661 | 59.210 | 986,497.81 | |
| | BID CORP LTD | 6,489 | 319.240 | 2,071,548.36 | |
| | CLICKS GROUP LTD | 4,102 | 312.640 | 1,282,449.28 | |
| | SHOPRITE HOLDINGS LTD | 9,683 | 232.800 | 2,254,202.40 | |
| | SPAR GROUP LIMITED/THE | 4,180 | 163.260 | 682,426.80 | |
| | TIGER BRANDS LTD | 3,772 | 152.550 | 575,418.60 | |
| | ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 6,974 | 171.090 | 1,193,181.66 | |
| | ABSA GROUP LTD | 13,218 | 165.600 | 2,188,900.80 | |
| | CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | 1,536 | 2,208.740 | 3,392,624.64 | |
| | NEDBANK GROUP LTD | 8,893 | 217.130 | 1,930,937.09 | |
| | STANDARD BANK GROUP LTD | 25,279 | 168.600 | 4,262,039.40 | |
| | FIRSTRAND LTD | 94,200 | 67.850 | 6,391,470.00 | |
| | REINET INVESTMENTS SCA | 2,291 | 303.080 | 694,356.28 | |
| | REMGRO LTD | 8,840 | 139.910 | 1,236,804.40 | |
| | DISCOVERY LTD | 8,625 | 158.120 | 1,363,785.00 | |
| | MOMENTUM METROPOLITAN HOLDIN | 3,349 | 16.700 | 55,928.30 | |
| | OLD MUTUAL LTD | 78,650 | 12.110 | 952,451.50 | |
| | RAND MERCHANT INVESTMENT HOL | 12,793 | 26.150 | 334,536.95 | |
| | SANLAM LTD | 33,606 | 67.600 | 2,271,765.60 | |
| | NEPI ROCKCASTLE PLC | 8,918 | 94.560 | 843,286.08 | |
| | MTN GROUP LTD | 31,150 | 165.330 | 5,150,029.50 | |
| | VODACOM GROUP LTD | 11,515 | 147.590 | 1,699,498.85 | |
| | MULTICHOICE GROUP LTD | 6,283 | 127.030 | 798,129.49 | |
| | 南アフリカ・ランド小計 | 558,211 | | 71,593,377.35 (582,054,158) | |
| タイ・ パーツ | PTT EXPLOR & PROD PCL- NVDR | 25,100 | 144.500 | 3,626,950.00 | |
| | PTT PCL-NVDR | 186,600 | 37.000 | 6,904,200.00 | |
| | THAI OIL PCL-NVDR | 24,800 | 53.750 | 1,333,000.00 | |
| | INDORAMA VENTURES PCL- NVDR | 35,700 | 45.500 | 1,624,350.00 | |
| | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL- NVDR | 44,800 | 49.000 | 2,195,200.00 | |
| | SCG PACKAGING PCL-NVDR | 27,300 | 56.500 | 1,542,450.00 | |
| | SIAM CEMENT PCL-NVDR | 14,900 | 358.000 | 5,334,200.00 | |
| | AIRPORTS OF THAILAND PC- NVDR | 75,200 | 67.750 | 5,094,800.00 | |
| | BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR | 126,600 | 8.300 | 1,050,780.00 | |
| | BTS GROUP HOLDINGS PCL- NVDR | 131,900 | 9.100 | 1,200,290.00 | |
| | ASSET WORLD CORP PCL-NVDR | 184,500 | 4.940 | 911,430.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|---------|--------------|--|
| MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | 52,100 | 34.500 | 1,797,450.00 | |
| CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR | 36,791 | 40.000 | 1,471,640.00 | |
| HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR | 114,300 | 15.200 | 1,737,360.00 | |
| PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR | 50,100 | 24.800 | 1,242,480.00 | |
| BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR | 19,000 | 34.500 | 655,500.00 | |
| CP ALL PCL-NVDR | 110,400 | 65.250 | 7,203,600.00 | |
| CARABAO GROUP PCL-NVDR | 5,400 | 108.500 | 585,900.00 | |
| CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR | 73,500 | 23.700 | 1,741,950.00 | |
| OSOTSPA PCL-NVDR | 16,200 | 34.500 | 558,900.00 | |
| THAI UNION GROUP PCL-NVDR | 58,800 | 16.900 | 993,720.00 | |
| BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR | 168,700 | 26.750 | 4,512,725.00 | |
| BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR | 8,000 | 165.000 | 1,320,000.00 | |
| SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR | 13,000 | 24.500 | 318,500.00 | |
| KRUNG THAI BANK - NVDR | 58,400 | 14.300 | 835,120.00 | |
| BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR | 43,300 | 20.100 | 870,330.00 | |
| KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR | 14,300 | 57.250 | 818,675.00 | |
| MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR | 16,200 | 48.500 | 785,700.00 | |
| SRISAWAD CORP PCL-NVDR | 11,800 | 54.000 | 637,200.00 | |
| CENTRAL PATTANA PCL-NVDR | 33,700 | 61.500 | 2,072,550.00 | |
| LAND & HOUSES PUB - NVDR | 176,900 | 9.350 | 1,654,015.00 | |
| DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR | 5,700 | 388.000 | 2,211,600.00 | |
| ADVANCED INFO SERVICE-NVDR | 20,900 | 216.000 | 4,514,400.00 | |
| INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR | 18,700 | 69.750 | 1,304,325.00 | |
| TRUE CORP PCL-NVDR | 259,200 | 4.800 | 1,244,160.00 | |
| B GRIMM POWER PCL-NVDR | 20,900 | 33.250 | 694,925.00 | |
| ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR | 3,800 | 169.000 | 642,200.00 | |
| ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR | 24,900 | 89.750 | 2,234,775.00 | |
| GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR | 9,600 | 68.750 | 660,000.00 | |
| GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR | 49,000 | 48.750 | 2,388,750.00 | |
| RATCH GROUP PCL-NVDR | 19,600 | 44.500 | 872,200.00 | |

| | | | | | |
|-------------------|------------------------------|------------|------------|------------------------------------|--|
| タイ・パーツ小計 | | 2,390,591 | | 79,398,300.00 (296,949,642) | |
| ポーランド・ズロチ | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN | 5,001 | 72.920 | 364,672.92 | |
| | POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I | 28,955 | 6.320 | 182,995.60 | |
| | KGHM POLSKA MIEDZ SA | 2,754 | 140.600 | 387,212.40 | |
| | LPP SA | 19 | 9,990.000 | 189,810.00 | |
| | ALLEGRO.EU SA | 6,626 | 27.055 | 179,266.43 | |
| | DINO POLSKA SA | 819 | 315.600 | 258,476.40 | |
| | BANK PEKAO SA | 3,299 | 102.250 | 337,322.75 | |
| | MBANK SA | 302 | 319.000 | 96,338.00 | |
| | PKO BANK POLSKI SA | 15,261 | 35.260 | 538,102.86 | |
| | SANTANDER BANK POLSKA SA | 565 | 271.400 | 153,341.00 | |
| | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | 10,870 | 31.800 | 345,666.00 | |
| | ORANGE POLSKA SA | 15,737 | 7.146 | 112,456.60 | |
| | PGE SA | 19,508 | 9.602 | 187,315.81 | |
| | CD PROJEKT SA | 1,469 | 130.720 | 192,027.68 | |
| CYFROWY POLSAT SA | 5,742 | 25.800 | 148,143.60 | | |
| ポーランド・ズロチ小計 | | 116,927 | | 3,673,148.05 (108,309,382) | |
| ハンガリー・フォリント | MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL | 8,186 | 3,010.000 | 24,639,860.00 | |
| | RICHTER GEDEON NYRT | 2,331 | 6,690.000 | 15,594,390.00 | |
| | OTP BANK PLC | 4,109 | 10,590.000 | 43,514,310.00 | |
| ハンガリー・フォリント小計 | | 14,626 | | 83,748,560.00 (30,793,341) | |
| ユーロ | FF GROUP | 123 | 4.800 | 590.40 | |
| | OPAP SA | 3,519 | 14.570 | 51,271.83 | |
| | JUMBO SA | 2,111 | 15.150 | 31,981.65 | |
| | ALPHA SERVICES AND HOLDINGS | 37,227 | 1.180 | 43,927.86 | |
| | EUROBANK ERGASIAS SERVICES A | 49,209 | 1.070 | 52,653.63 | |
| | HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA | 4,197 | 18.040 | 75,713.88 | |
| | PUBLIC POWER CORP | 4,579 | 8.180 | 37,456.22 | |
| ユーロ小計 | | 100,965 | | 293,595.47 (40,187,348) | |
| 合計 | | 41,416,549 | | 13,549,402,847 (13,549,402,847) | |

(注)金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 通貨 | 銘柄数 | | 組入株式時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|--------------|-----|-------|----------|------------|
| アメリカ・ドル | 株式 | 42銘柄 | 2.5% | 3.6% |
| 香港・ドル | 株式 | 205銘柄 | 16.5% | 24.4% |
| 台湾・ドル | 株式 | 86銘柄 | 12.5% | 18.5% |
| エジプト・ポンド | 株式 | 4銘柄 | 0.0% | 0.1% |
| トルコ・リラ | 株式 | 11銘柄 | 0.3% | 0.4% |
| メキシコ・ペソ | 株式 | 17銘柄 | 1.4% | 2.1% |
| フィリピン・ペソ | 株式 | 19銘柄 | 0.6% | 0.9% |
| チリ・ペソ | 株式 | 11銘柄 | 0.4% | 0.6% |
| コロンビア・ペソ | 株式 | 5銘柄 | 0.2% | 0.3% |
| インド・ルピー | 株式 | 106銘柄 | 10.9% | 16.1% |
| インドネシア・ルピア | 株式 | 24銘柄 | 1.5% | 2.3% |
| ブラジル・リアル | 株式 | 44銘柄 | 4.2% | 6.2% |
| チェコ・コルナ | 株式 | 3銘柄 | 0.1% | 0.2% |
| 韓国・ウォン | 株式 | 111銘柄 | 10.0% | 14.7% |
| マレーシア・リングギット | 株式 | 35銘柄 | 1.2% | 1.8% |
| 南アフリカ・ランド | 株式 | 38銘柄 | 2.9% | 4.3% |
| タイ・バーツ | 株式 | 41銘柄 | 1.5% | 2.2% |
| ポーランド・ズロチ | 株式 | 15銘柄 | 0.5% | 0.8% |
| ハンガリー・フォリント | 株式 | 3銘柄 | 0.2% | 0.2% |
| ユーロ | 株式 | 7銘柄 | 0.2% | 0.3% |

(b)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 | オフショア・人民元 | CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY | 1,000,000.00 | 38,760,000.00 | | |
| | | オフショア・人民元小計 | 1,000,000.00 | 38,760,000.00 (752,699,820) | | |
| 投資信託受益証券合計 | | | | 752,699,820 (752,699,820) | | |
| 投資証券 | アメリカ・ドル | ISHARES MSCI KUWAIT ETF | 25,744.00 | 1,038,770.40 | | |
| | | ISHARES MSCI QATAR ETF | 53,189.00 | 1,280,791.12 | | |
| | | ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF | 117,107.00 | 5,817,875.76 | | |
| | | ISHARES MSCI UAE ETF | 100,055.00 | 1,894,041.15 | | |
| | アメリカ・ドル小計 | | | 296,095.00 | 10,031,478.43 (1,280,016,649) | |
| | メキシコ・ペソ | CEMEX SAB-CPO | 263,900.00 | 2,348,710.00 | | |
| | | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | 8,775.00 | 992,540.25 | | |
| FOMENTO ECONOMICO MEXICANA-UBD | | 36,500.00 | 5,618,810.00 | | | |

| | | | | |
|-----------|-----------------------------|------------|----------------------------------|--|
| | GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO | 40,100.00 | 1,614,827.00 | |
| | MEGACABLE HOLDINGS-CPO | 4,184.00 | 250,119.52 | |
| | OPERADORA DE SITES MEX- A-1 | 30,400.00 | 784,928.00 | |
| | TRUST FIBRA UNO | 52,800.00 | 1,232,880.00 | |
| | メキシコ・ペソ小計 | 436,659.00 | 12,842,814.77 (81,047,151) | |
| ブラジル・リアル | BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT | 23,000.00 | 577,760.00 | |
| | BANCO INTER SA-UNITS | 5,700.00 | 97,527.00 | |
| | BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT | 6,300.00 | 211,869.00 | |
| | ENERGISA SA-UNITS | 3,100.00 | 149,110.00 | |
| | KLABIN SA - UNIT | 12,000.00 | 265,920.00 | |
| | ブラジル・リアル小計 | 50,100.00 | 1,302,186.00 (34,061,019) | |
| 南アフリカ・ランド | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | 57,305.00 | 794,820.35 | |
| | 南アフリカ・ランド小計 | 57,305.00 | 794,820.35 (6,461,889) | |
| 投資証券合計 | | | 1,401,586,708 (1,401,586,708) | |
| 合計 | | | 2,154,286,528 (2,154,286,528) | |

(注) 金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 通貨 | 銘柄数 | | 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 | 投資証券 | 4銘柄 | - | 6.4% | 59.4% |
| メキシコ・ペソ | 投資証券 | 7銘柄 | - | 0.4% | 3.8% |
| ブラジル・リアル | 投資証券 | 5銘柄 | - | 0.2% | 1.6% |
| オフショア・人民元 | 投資信託受益証券 | 1銘柄 | 3.8% | - | 34.9% |
| 南アフリカ・ランド | 投資証券 | 1銘柄 | - | 0.0% | 0.3% |

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)」に記載しております。

Jリート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(2021年4月26日現在)

(2022年4月26日現在)

資産の部

流動資産

金銭信託

29,114,056

960,122

| | | |
|-------------|---------------|---------------|
| コール・ローン | 66,809,626 | 48,427,834 |
| 投資証券 | 8,029,616,750 | 8,247,387,550 |
| 派生商品評価勘定 | 4,736,400 | 2,395,600 |
| 未収入金 | 2,631,744 | - |
| 未収配当金 | 58,652,103 | 69,756,673 |
| 差入委託証拠金 | 3,330,000 | 2,330,000 |
| 流動資産合計 | 8,194,890,679 | 8,371,257,779 |
| 資産合計 | 8,194,890,679 | 8,371,257,779 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 前受金 | 4,743,000 | 2,440,000 |
| 未払解約金 | 68,058,794 | 2,949,776 |
| 未払利息 | 193 | - |
| その他未払費用 | 2,229 | 169 |
| 流動負債合計 | 72,804,216 | 5,389,945 |
| 負債合計 | 72,804,216 | 5,389,945 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 3,071,522,148 | 3,142,280,407 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 5,050,564,315 | 5,223,587,427 |
| 元本等合計 | 8,122,086,463 | 8,365,867,834 |
| 純資産合計 | 8,122,086,463 | 8,365,867,834 |
| 負債純資産合計 | 8,194,890,679 | 8,371,257,779 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
|--------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |

| | |
|----------------------|---|
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に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によっております。 |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | 受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。 |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2021年4月26日現在) | (2022年4月26日現在) |
|-----------------------|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 3,071,522,148口 | 3,142,280,407口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 2.6443円 (1万口当たりの純資産額26,443円) | 1口当たり純資産額 2.6624円 (1万口当たりの純資産額26,624円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |

| | |
|----------------------------|--|
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| 4. 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。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2022年4月26日現在) |
|--------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | <p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区 分 | 種 類 | 契 約 額 等 | | 時 価 | 評 価 損 益 |
|------|-----------------|------------|--------------|------------|-----------|
| | | | う ち 1 年 超 | | |
| 市場取引 | リート指数先物取引 買建 | | | | |
| | TREIT 先物 | 56,628,600 | - | 61,365,000 | 4,736,400 |
| | 小計 | 56,628,600 | - | 61,365,000 | 4,736,400 |
| 合 計 | | 56,628,600 | - | 61,365,000 | 4,736,400 |

(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区 分 | 種 類 | 契 約 額 等 | | 時 価 | 評 価 損 益 |
|------|--------------------|------------|--------------|------------|-----------|
| | | | う ち 1 年 超 | | |
| 市場取引 | リート指数先物取引 買建 | | | | |
| | TREIT 先物 0406 月 | 37,204,400 | - | 39,600,000 | 2,395,600 |
| | 小計 | 37,204,400 | - | 39,600,000 | 2,395,600 |
| 合 計 | | 37,204,400 | - | 39,600,000 | 2,395,600 |

(注) 1. 時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に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。

2)リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| |
|--|
| 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| | |
|--------------------------------|----------------|
| (2021年4月26日現在) | |
| 開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額 | 2,079,734,759円 |

| | |
|--|----------------|
| 同期中における追加設定元本額 | 2,566,048,223円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,574,260,834円 |
| 2021年4月26日現在の元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 316,132,317円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 348,559,330円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 238,816,451円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 84,560,850円 |
| 三井住友・DC日本リートインデックスファンド | 1,588,375,824円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 9,834,653円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 35,461,155円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 25,278,674円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 80,153,697円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 41,281,247円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 33,683,493円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 15,113,869円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 1,448,736円 |
| 三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド | 20,024,548円 |
| SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定> | 50,433,479円 |
| SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 31,132,085円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 82,301,805円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 68,929,935円 |
| 合計 | 3,071,522,148円 |

(2022年4月26日現在)

| | |
|------------------------------------|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 3,071,522,148円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 2,198,779,564円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 2,128,021,305円 |
| 2022年4月26日現在の元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 74,332,453円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 144,802,192円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 113,294,756円 |
| 三井住友・DC日本リートインデックスファンド | 1,953,407,139円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 13,792,150円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 55,523,511円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 40,771,712円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 135,968,837円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 74,606,058円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 58,817,013円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 24,699,702円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 1,673,254円 |
| 三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド | 58,102,181円 |
| 日興FWS・Jリートインデックス | 181,297,356円 |
| 三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド | 1,894,768円 |
| SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定> | 3,536,609円 |

| | |
|--|----------------|
| SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 47,867,823円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 32,115,891円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 40,704,739円 |
| SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定> | 85,072,263円 |
| 合計 | 3,142,280,407円 |

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-----------------|-------------------------|------------|-------------|----|
| 投資証券 | エスコンジャパンリート投資法人 | 149 | 19,772,300 | |
| | サンケイリアルエステート投資法人 | 235 | 23,406,000 | |
| | SOSILA物流リート投資法人 | 347 | 54,305,500 | |
| | 東海道リート投資法人 | 55 | 6,314,000 | |
| | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 258 | 167,442,000 | |
| | 森ヒルズリート投資法人 | 882 | 130,095,000 | |
| | 産業ファンド投資法人 | 1,063 | 202,076,300 | |
| | アドバンス・レジデンス投資法人 | 749 | 268,142,000 | |
| | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 535 | 111,761,500 | |
| | アクティビア・プロパティーズ投資法人 | 400 | 166,200,000 | |
| | GLP投資法人 | 2,426 | 426,976,000 | |
| | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 349 | 112,552,500 | |
| | 日本プロロジスリート投資法人 | 1,226 | 449,329,000 | |
| | 星野リゾート・リート投資法人 | 126 | 85,428,000 | |
| | Oneリート投資法人 | 129 | 35,642,700 | |
| | イオンリート投資法人 | 882 | 130,712,400 | |
| | ヒューリックリート投資法人 | 698 | 111,889,400 | |
| | 日本リート投資法人 | 232 | 86,072,000 | |
| | 積水ハウス・リート投資法人 | 2,278 | 177,000,600 | |
| | トーセイ・リート投資法人 | 154 | 20,512,800 | |
| ケネディクス商業リート投資法人 | 298 | 81,324,200 | | |

| | | | |
|----------------------|-------|-------------|--|
| ヘルスケア&メディカル投資法人 | 182 | 28,628,600 | |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 | 186 | 24,273,000 | |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | 2,423 | 398,825,800 | |
| いちごホテルリート投資法人 | 120 | 10,908,000 | |
| ラサールロジポート投資法人 | 919 | 162,203,500 | |
| スターアジア不動産投資法人 | 777 | 45,765,300 | |
| マリモ地方創生リート投資法人 | 85 | 11,237,000 | |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 296 | 167,536,000 | |
| 大江戸温泉リート投資法人 | 116 | 7,957,600 | |
| 投資法人みらい | 908 | 46,217,200 | |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人 | 176 | 22,704,000 | |
| 三菱地所物流リート投資法人 | 218 | 102,024,000 | |
| CREロジスティクスファンド投資法人 | 288 | 57,456,000 | |
| ザイマックス・リート投資法人 | 119 | 14,672,700 | |
| タカラレーベン不動産投資法人 | 294 | 35,074,200 | |
| 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 | 291 | 46,792,800 | |
| 日本ビルファンド投資法人 | 873 | 594,513,000 | |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 749 | 474,117,000 | |
| 日本都市ファンド投資法人 | 3,781 | 390,955,400 | |
| オリックス不動産投資法人 | 1,492 | 260,204,800 | |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | 512 | 201,472,000 | |
| NTT都市開発リート投資法人 | 719 | 111,229,300 | |
| 東急リアル・エステート投資法人 | 504 | 91,929,600 | |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 523 | 59,255,900 | |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 1,687 | 242,928,000 | |
| 森トラスト総合リート投資法人 | 537 | 75,824,400 | |
| インヴィンシブル投資法人 | 3,305 | 142,941,250 | |
| フロンティア不動産投資法人 | 262 | 132,834,000 | |
| 平和不動産リート投資法人 | 486 | 72,219,600 | |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 506 | 162,426,000 | |
| 福岡リート投資法人 | 386 | 62,763,600 | |
| ケネディクス・オフィス投資法人 | 233 | 164,032,000 | |

| | | | |
|------------------|-------|---------------|--|
| いちごオフィスリート投資法人 | 613 | 52,227,600 | |
| 大和証券オフィス投資法人 | 156 | 114,504,000 | |
| 阪急阪神リート投資法人 | 337 | 50,314,100 | |
| スターツプロシード投資法人 | 116 | 26,958,400 | |
| 大和ハウスリート投資法人 | 1,125 | 355,500,000 | |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 2,300 | 154,100,000 | |
| 大和証券リビング投資法人 | 1,002 | 114,228,000 | |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 697 | 90,679,700 | |
| 投資証券 小計 | | 8,247,387,550 | |
| 合 計 | | 8,247,387,550 | |

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)」に記載しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

| | (2021年4月26日現在) | (2022年4月26日現在) |
|-------------|----------------|----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 44,482,747 | 257,992,966 |
| 金銭信託 | 28,588,674 | 2,592,223 |
| コール・ローン | 65,604,005 | 130,749,860 |
| 投資証券 | 11,519,480,828 | 23,371,768,716 |
| 派生商品評価勘定 | 17,814 | - |
| 未収入金 | 57,714,478 | 1,057,708 |
| 未収配当金 | 11,685,275 | 19,378,538 |
| 流動資産合計 | 11,727,573,821 | 23,783,540,011 |
| 資産合計 | 11,727,573,821 | 23,783,540,011 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 49,052 | 1,182,626 |
| 未払解約金 | 142,622,000 | 11,984,072 |
| 未払利息 | 189 | - |
| その他未払費用 | 547 | 220 |
| 流動負債合計 | 142,671,788 | 13,166,918 |
| 負債合計 | 142,671,788 | 13,166,918 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 4,897,225,610 | 7,379,512,147 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 6,687,676,423 | 16,390,860,946 |
| 元本等合計 | 11,584,902,033 | 23,770,373,093 |
| 純資産合計 | 11,584,902,033 | 23,770,373,093 |
| 負債純資産合計 | 11,727,573,821 | 23,783,540,011 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2021年4月26日現在) | (2022年4月26日現在) |
|-----------------------|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 4,897,225,610口 | 7,379,512,147口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 2.3656円 (1万口当たりの純資産額23,656円) | 1口当たり純資産額 3.2211円 (1万口当たりの純資産額32,211円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
|----|------------------------------|
| | |

| | |
|------------------------|---|
| 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、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p> |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っております。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |

| | |
|----------------------------|--|
| 4. 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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |
|----------------------------|--|

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2022年4月26日現在) |
|--------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|-----------|-------------|------------|-----------|------------|--------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 2,500,000 | - | 2,499,953 | 47 |
| | イギリス・ポンド | 500,000 | - | 499,947 | 53 |
| | オーストラリア・ドル | 800,000 | - | 799,894 | 106 |
| | ユーロ | 500,000 | - | 499,985 | 15 |
| | 小計 | 4,300,000 | - | 4,299,779 | 221 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 37,991,360 | - | 37,976,928 | 14,432 |
| | イギリス・ポンド | 2,839,151 | - | 2,846,004 | 6,853 |
| | オーストラリア・ドル | 3,410,872 | - | 3,431,290 | 20,418 |
| | カナダ・ドル | 949,850 | - | 952,152 | 2,302 |
| | シンガポール・ドル | 1,785,168 | - | 1,790,118 | 4,950 |
| | ニュージーランド・ドル | 1,245,808 | - | 1,243,028 | 2,780 |

| | | | | | |
|--|-------|------------|---|------------|--------|
| | ユーロ | 2,205,070 | - | 2,219,378 | 14,308 |
| | 香港・ドル | 1,196,002 | - | 1,195,400 | 602 |
| | 小計 | 51,623,281 | - | 51,654,298 | 31,017 |
| | 合計 | 55,923,281 | - | 55,954,077 | 31,238 |

(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|---------------|----------------|-------------|-----------|-------------|-----------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引以 外の取引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 78,000,000 | - | 77,319,579 | 680,421 |
| | カナダ・ドル | 1,800,000 | - | 1,782,470 | 17,530 |
| | オーストラリ ア・ドル | 9,300,000 | - | 9,098,200 | 201,800 |
| | 香港・ドル | 1,500,000 | - | 1,485,772 | 14,228 |
| | シンガポール・ ドル | 3,000,000 | - | 2,963,276 | 36,724 |
| | イギリス・ポン ド | 6,800,000 | - | 6,650,632 | 149,368 |
| | ユーロ | 4,800,000 | - | 4,717,445 | 82,555 |
| | 小計 | 105,200,000 | - | 104,017,374 | 1,182,626 |
| | 合計 | 105,200,000 | - | 104,017,374 | 1,182,626 |

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客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。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| |
|------------------------------|
| 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
|------------------------------|

市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

| (2021年4月26日現在) | |
|---|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 3,351,152,062円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 2,408,226,049円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 862,152,501円 |
| 2021年4月26日現在の元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 36,052,341円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 44,692,972円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 29,319,643円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 44,687,417円 |
| 三井住友・DC外国リートインデックスファンド | 4,353,843,871円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050 | 3,924,728円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 40,667,543円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 28,606,664円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 90,223,455円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 46,713,633円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 37,645,676円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 51,093,218円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060 | 583,824円 |
| 三井住友D S・外国リートインデックス年金ファンド | 17,098,546円 |
| S M A M・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定> | 46,391,095円 |
| S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 25,680,984円 |
| 合 計 | 4,897,225,610円 |

| (2022年4月26日現在) | |
|----------------------------|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 4,897,225,610円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 3,515,870,384円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,033,583,847円 |
| 2022年4月26日現在の元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 14,691,068円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 15,848,872円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 10,883,264円 |
| 三井住友・DC外国リートインデックスファンド | 6,414,868,609円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050 | 4,238,171円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 50,724,245円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 36,847,018円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 121,474,215円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 63,639,316円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 52,163,859円 |

| | |
|--|----------------|
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 63,412,875円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 551,319円 |
| 三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド | 132,295,590円 |
| 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり) | 65,236,916円 |
| 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし) | 168,671,758円 |
| 三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド | 3,412,797円 |
| SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定> | 37,893,158円 |
| SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 43,784,034円 |
| SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定> | 78,875,063円 |
| 合計 | 7,379,512,147円 |

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 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 | 8,247.00 | 173,516.88 | |
| | | AGREE REALTY CORP | 8,163.00 | 578,838.33 | |
| | | ALEXANDER & BALDWIN INC | 6,758.00 | 147,256.82 | |
| | | ALEXANDER'S INC | 300.00 | 78,987.00 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 16,644.00 | 3,212,292.00 | |
| | | ALPINE INCOME PROPERTY TRUST | 2,165.00 | 42,260.80 | |
| | | AMERICAN ASSETS TRUST INC | 5,414.00 | 197,881.70 | |
| | | AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 15,168.00 | 982,128.00 | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 34,264.00 | 1,412,019.44 | |
| | | AMERICOLD REALTY TRUST | 30,833.00 | 869,182.27 | |
| | | APARTMENT INCOME REIT CO | 18,454.00 | 994,116.98 | |
| | | APARTMENT INVT & MGMT CO - A | 15,893.00 | 107,277.75 | |
| | | APPLE HOSPITALITY REIT INC | 22,636.00 | 410,617.04 | |
| | | ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN | 8,429.00 | 121,293.31 | |
| | | ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 2,515.00 | 20,396.65 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 15,902.00 | 3,950,374.84 | |
| | | BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH | 3,745.00 | 99,841.70 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 16,013.00 | 2,014,755.66 | |
| | | BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 8,400.00 | 53,256.00 | |

| | | | |
|---------------------------------|-----------|--------------|--|
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 20,191.00 | 254,002.78 | |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 33,499.00 | 875,998.85 | |
| BROADSTONE NET LEASE INC | 19,744.00 | 432,985.92 | |
| BRT APARTMENTS CORP | 500.00 | 11,295.00 | |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 11,391.00 | 1,870,402.20 | |
| CARETRUST REIT INC | 9,346.00 | 157,853.94 | |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES | 3,648.00 | 105,500.16 | |
| CEDAR REALTY TRUST INC | 2,376.00 | 67,739.76 | |
| CENTERSPACE | 1,542.00 | 152,843.04 | |
| CHATHAM LODGING TRUST | 5,557.00 | 80,632.07 | |
| CITY OFFICE REIT INC | 4,603.00 | 72,727.40 | |
| CLIPPER REALTY INC | 800.00 | 7,208.00 | |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 3,216.00 | 126,292.32 | |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 11,896.00 | 334,872.40 | |
| COUSINS PROPERTIES INC | 17,057.00 | 664,711.29 | |
| CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T | 2,658.00 | 19,084.44 | |
| CTO REALTY GROWTH INC | 310.00 | 19,740.80 | |
| CUBESMART | 24,403.00 | 1,275,056.75 | |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 26,676.00 | 286,233.48 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 32,125.00 | 4,868,865.00 | |
| DIGITALBRIDGE GROUP INC | 54,264.00 | 388,530.24 | |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 23,884.00 | 58,993.48 | |
| DOUGLAS EMMETT INC | 20,496.00 | 647,058.72 | |
| DUKE REALTY CORP | 43,684.00 | 2,591,771.72 | |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST | 20,000.00 | 2,740.00 | |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 9,769.00 | 196,747.66 | |
| EASTGROUP PROPERTIES INC | 4,512.00 | 929,156.16 | |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST- A | 12,815.00 | 113,412.75 | |
| EPR PROPERTIES | 7,974.00 | 441,998.82 | |
| EQUINIX INC | 10,180.00 | 7,660,653.60 | |
| EQUITY COMMONWEALTH | 12,245.00 | 331,227.25 | |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 19,581.00 | 1,600,159.32 | |
| EQUITY RESIDENTIAL | 39,044.00 | 3,524,892.32 | |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY | 12,429.00 | 317,933.82 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 7,327.00 | 2,550,455.43 | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 14,995.00 | 3,127,057.30 | |

| | | | |
|------------------------------|------------|--------------|--|
| FARMLAND PARTNERS INC | 4,666.00 | 69,196.78 | |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 7,993.00 | 964,195.59 | |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 14,178.00 | 903,422.16 | |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 8,024.00 | 236,467.28 | |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 6,015.00 | 32,300.55 | |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 26,764.00 | 1,244,526.00 | |
| GETTY REALTY CORP | 5,036.00 | 141,964.84 | |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 3,102.00 | 68,337.06 | |
| GLADSTONE LAND CORP | 4,464.00 | 173,917.44 | |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 5,669.00 | 87,019.15 | |
| GLOBAL NET LEASE INC | 13,146.00 | 196,795.62 | |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 17,535.00 | 488,875.80 | |
| HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A | 25,145.00 | 789,050.10 | |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 60,975.00 | 2,090,223.00 | |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 2,876.00 | 28,156.04 | |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 12,194.00 | 536,170.18 | |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 82,608.00 | 1,728,985.44 | |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 17,289.00 | 443,117.07 | |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 24,950.00 | 695,606.00 | |
| INDUS REALTY TRUST INC | 823.00 | 60,087.23 | |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT | 6,274.00 | 122,782.18 | |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 3,230.00 | 506,464.00 | |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP | 8,406.00 | 255,458.34 | |
| INVITATION HOMES INC | 66,947.00 | 2,866,001.07 | |
| IRON MOUNTAIN INC | 32,272.00 | 1,798,195.84 | |
| JBG SMITH PROPERTIES | 12,389.00 | 343,423.08 | |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | 130,900.00 | 96,211.50 | |
| KILROY REALTY CORP | 12,366.00 | 934,003.98 | |
| KIMCO REALTY CORP | 70,199.00 | 1,798,498.38 | |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 24,850.00 | 557,137.00 | |
| LIFE STORAGE INC | 9,278.00 | 1,332,691.92 | |
| LTC PROPERTIES INC | 5,036.00 | 179,785.20 | |
| LXP INDUSTRIAL TRUST | 31,951.00 | 422,711.73 | |
| MACERICH CO/THE | 23,870.00 | 324,393.30 | |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV | 245,900.00 | 156,146.50 | |

| | | | |
|---------------------------------|-----------|---------------|--|
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 67,477.00 | 1,251,023.58 | |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 13,220.00 | 2,710,364.40 | |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 19,913.00 | 924,361.46 | |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 9,133.00 | 570,447.18 | |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 4,815.00 | 260,780.40 | |
| NECESSITY RETAIL REIT INC/TH | 17,023.00 | 133,630.55 | |
| NETSTREIT CORP | 4,793.00 | 111,533.11 | |
| NEXPOINT RESIDENTIAL | 2,355.00 | 210,913.80 | |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRU | 5,071.00 | 118,610.69 | |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 26,452.00 | 734,307.52 | |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 2,352.00 | 71,830.08 | |
| ORION OFFICE REIT INC | 5,199.00 | 70,862.37 | |
| PARAMOUNT GROUP INC | 20,155.00 | 202,759.30 | |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 25,733.00 | 515,431.99 | |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 15,094.00 | 380,821.62 | |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 5,400.00 | 3,180.60 | |
| PHILLIPS EDISON & COMPANY IN | 13,145.00 | 464,281.40 | |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 23,370.00 | 410,844.60 | |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 14,040.00 | 237,135.60 | |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 4,774.00 | 120,782.20 | |
| POSTAL REALTY TRUST INC- A | 1,424.00 | 24,763.36 | |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNIT | 6,243.00 | 155,575.56 | |
| PRIME US REIT | 54,200.00 | 40,379.00 | |
| PROLOGIS INC | 83,890.00 | 14,070,869.70 | |
| PS BUSINESS PARKS INC/MD | 2,274.00 | 426,375.00 | |
| PUBLIC STORAGE | 17,249.00 | 6,882,351.00 | |
| REALTY INCOME CORP | 64,430.00 | 4,687,282.50 | |
| REGENCY CENTERS CORP | 17,939.00 | 1,259,317.80 | |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 12,609.00 | 247,010.31 | |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 18,059.00 | 1,469,280.24 | |
| RLJ LODGING TRUST | 17,225.00 | 249,073.50 | |
| RPT REALTY | 8,262.00 | 114,841.80 | |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 6,226.00 | 603,174.88 | |

| | | | | |
|------------|---------------------------------|--------------|------------------------------------|--|
| | SABRA HEALTH CARE REIT INC | 28,223.00 | 348,554.05 | |
| | SAFEHOLD INC | 1,242.00 | 58,299.48 | |
| | SAUL CENTERS INC | 894.00 | 48,463.74 | |
| | SERITAGE GROWTH PROP- A REIT | 3,468.00 | 39,396.48 | |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 17,194.00 | 146,836.76 | |
| | SIMON PROPERTY GROUP INC | 37,439.00 | 4,728,171.31 | |
| | SITE CENTERS CORP | 18,028.00 | 303,411.24 | |
| | SL GREEN REALTY CORP | 7,052.00 | 529,605.20 | |
| | SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 14,917.00 | 681,557.73 | |
| | STAG INDUSTRIAL INC | 19,176.00 | 778,162.08 | |
| | STORE CAPITAL CORP | 26,534.00 | 788,855.82 | |
| | SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 14,098.00 | 137,596.48 | |
| | SUN COMMUNITIES INC | 13,110.00 | 2,477,790.00 | |
| | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 24,669.00 | 306,142.29 | |
| | TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 10,751.00 | 187,282.42 | |
| | TERRENO REALTY CORP | 8,564.00 | 659,513.64 | |
| | UDR INC | 33,731.00 | 1,949,651.80 | |
| | UMH PROPERTIES INC | 6,284.00 | 152,072.80 | |
| | UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 1,344.00 | 75,815.04 | |
| | URBAN EDGE PROPERTIES | 11,117.00 | 211,334.17 | |
| | URSTADT BIDDLE - CLASS A | 2,927.00 | 53,593.37 | |
| | VENTAS INC | 45,132.00 | 2,627,585.04 | |
| | VERIS RESIDENTIAL INC | 7,798.00 | 129,914.68 | |
| | VICI PROPERTIES INC | 72,348.00 | 2,172,610.44 | |
| | VORNADO REALTY TRUST | 17,599.00 | 728,774.59 | |
| | WASHINGTON REIT | 10,790.00 | 274,821.30 | |
| | WELLTOWER INC | 49,154.00 | 4,697,156.24 | |
| | WHITESTONE REIT | 4,511.00 | 57,785.91 | |
| | WP CAREY INC | 21,800.00 | 1,845,806.00 | |
| | XENIA HOTELS & RESORTS INC | 11,870.00 | 233,482.90 | |
| | アメリカ・ドル小計 | 2,963,308.00 | 141,469,684.81 (18,051,531,782) | |
| カナダ・ ドル | ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 7,021.00 | 306,887.91 | |
| | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 9,662.00 | 127,538.40 | |
| | AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E | 1,715.00 | 24,301.55 | |
| | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 3,190.00 | 179,660.80 | |

| | | | |
|---------------------------------|-----------|------------|--|
| BTB REAL ESTATE INVESTMENT T | 13,622.00 | 58,165.94 | |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 9,830.00 | 506,834.80 | |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 17,893.00 | 273,762.90 | |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 5,107.00 | 92,334.56 | |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 4,551.00 | 81,963.51 | |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 12,411.00 | 194,852.70 | |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 2,169.00 | 57,478.50 | |
| EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES | 11,377.00 | 54,609.60 | |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 10,775.00 | 187,592.75 | |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 3,563.00 | 348,568.29 | |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 16,425.00 | 211,389.75 | |
| INOVALIS REAL ESTATE INVESTM | 1,387.00 | 12,150.12 | |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 6,178.00 | 92,175.76 | |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 8,107.00 | 169,841.65 | |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE | 1,447.00 | 28,983.41 | |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 1,557.00 | 29,069.19 | |
| NEXUS INDUSTRIAL REIT | 4,345.00 | 57,527.80 | |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 12,305.00 | 167,348.00 | |
| PLAZA RETAIL REIT | 8,509.00 | 41,268.65 | |
| PRIMARIS REIT | 6,318.00 | 88,388.82 | |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 16,598.00 | 407,646.88 | |
| SLATE GROCERY REIT-CL U | 3,196.00 | 51,583.44 | |
| SLATE OFFICE REIT | 3,663.00 | 18,608.04 | |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 7,064.00 | 226,401.20 | |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI | 9,177.00 | 191,248.68 | |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | 4,770.00 | 33,342.30 | |

| | | | | |
|------------------------------|------------------------------|--------------|----------------------------------|--|
| | カナダ・ドル小計 | 223,932.00 | 4,321,525.90 (433,060,110) | |
| オーストラリア・ドル | ABACUS PROPERTY GROUP | 32,980.00 | 110,483.00 | |
| | ARENA REIT | 45,981.00 | 224,847.09 | |
| | BWP TRUST | 45,015.00 | 188,162.70 | |
| | CENTURIA CAPITAL GROUP | 64,710.00 | 178,599.60 | |
| | CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 53,468.00 | 211,198.60 | |
| | CENTURIA OFFICE REIT | 43,559.00 | 99,314.52 | |
| | CHARTER HALL GROUP | 56,632.00 | 895,918.24 | |
| | CHARTER HALL LONG WALE REIT | 73,852.00 | 398,800.80 | |
| | CHARTER HALL RETAIL REIT | 62,449.00 | 275,400.09 | |
| | CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR | 37,955.00 | 154,856.40 | |
| | CROMWELL PROPERTY GROUP | 158,718.00 | 138,084.66 | |
| | DEXUS INDUSTRIA REIT | 30,237.00 | 104,620.02 | |
| | DEXUS/AU | 122,668.00 | 1,337,081.20 | |
| | GDI PROPERTY GROUP | 43,204.00 | 48,388.48 | |
| | GOODMAN GROUP | 194,415.00 | 4,592,082.30 | |
| | GPT GROUP | 215,806.00 | 1,096,294.48 | |
| | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 30,439.00 | 135,149.16 | |
| | HEALTHCO REIT | 51,410.00 | 99,735.40 | |
| | HOME CONSORTIUM LTD | 16,399.00 | 117,252.85 | |
| | HOMEKO DAILY NEEDS REIT | 187,797.00 | 271,366.66 | |
| | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS | 15,921.00 | 63,843.21 | |
| | INGENIA COMMUNITIES GROUP | 39,965.00 | 192,231.65 | |
| | IRONGATE GROUP | 42,404.00 | 81,415.68 | |
| | MIRVAC GROUP | 438,177.00 | 1,051,624.80 | |
| | NATIONAL STORAGE REIT | 109,680.00 | 297,232.80 | |
| | RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE | 89,106.00 | 84,650.70 | |
| RURAL FUNDS GROUP | 52,739.00 | 160,326.56 | | |
| SCENTRE GROUP | 577,531.00 | 1,692,165.83 | | |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 116,511.00 | 361,184.10 | | |
| STOCKLAND | 270,858.00 | 1,124,060.70 | | |
| VICINITY CENTRES | 454,143.00 | 849,247.41 | | |
| WAYPOINT REIT | 76,045.00 | 207,602.85 | | |
| | オーストラリア・ドル小計 | 3,850,774.00 | 16,843,222.54 (1,545,702,532) | |
| 香港・ドル | CHAMPION REIT | 239,000.00 | 826,940.00 | |
| | FORTUNE REIT | 152,000.00 | 1,042,720.00 | |
| | LINK REIT | 237,100.00 | 16,122,800.00 | |
| | PROSPERITY REIT | 178,000.00 | 480,600.00 | |

| | | | | |
|----------------------|-------------------------------|--------------|--------------------------------|--|
| | SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST | 110,000.00 | 420,200.00 | |
| | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN | 230,000.00 | 715,300.00 | |
| | 香港・ドル小計 | 1,146,100.00 | 19,608,560.00 (318,835,186) | |
| シンガポール・ドル | AIMS APAC REIT | 38,300.00 | 54,769.00 | |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 365,800.00 | 1,046,188.00 | |
| | ASCOTT RESIDENCE TRUST | 205,555.00 | 232,277.15 | |
| | CAPITALAND CHINA TRUST | 113,900.00 | 134,402.00 | |
| | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | 575,408.00 | 1,334,946.56 | |
| | CDL HOSPITALITY TRUSTS | 94,950.00 | 124,384.50 | |
| | EC WORLD REIT | 52,800.00 | 34,056.00 | |
| | ESR-REIT | 606,713.00 | 254,819.46 | |
| | FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 99,600.00 | 66,234.00 | |
| | FIRST REAL ESTATE INV T TRUST | 176,400.00 | 54,684.00 | |
| | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 141,800.00 | 343,156.00 | |
| | FRASERS LOGISTICS & COMMERC I | 309,638.00 | 452,071.48 | |
| | IREIT GLOBAL | 57,600.00 | 36,576.00 | |
| | KEPPEL DC REIT | 143,600.00 | 301,560.00 | |
| | KEPPEL REIT | 202,900.00 | 245,509.00 | |
| | LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL | 175,700.00 | 136,167.50 | |
| | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 261,800.00 | 500,038.00 | |
| | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 217,000.00 | 577,220.00 | |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 380,350.00 | 684,630.00 | |
| | MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC | 235,000.00 | 289,050.00 | |
| | QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | 243,200.00 | 102,144.00 | |
| | PARKWAYLIFE REAL ESTATE | 39,600.00 | 196,416.00 | |
| | SASSEUR REAL ESTATE INVESTME | 66,700.00 | 55,694.50 | |
| SPH REIT | 115,700.00 | 111,650.50 | | |
| STARHILL GLOBAL REIT | 138,200.00 | 82,229.00 | | |
| SUNTEC REIT | 239,900.00 | 439,017.00 | | |
| | シンガポール・ドル小計 | 5,298,114.00 | 7,889,889.65 (733,444,142) | |
| ニュージーランド・ドル | ARGOSY PROPERTY LTD | 83,275.00 | 111,588.50 | |
| | GOODMAN PROPERTY TRUST | 123,606.00 | 284,293.80 | |
| | KIWI PROPERTY GROUP LTD | 182,643.00 | 198,167.65 | |

| | | | | |
|-----------------------------|------------------------------|------------|----------------------------|--|
| | PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | 151,115.00 | 232,717.10 | |
| | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | 46,161.00 | 144,022.32 | |
| | ニュージーランド・ドル小計 | 586,800.00 | 970,789.37 (82,089,949) | |
| イギリス・ポンド | AEW UK REIT PLC | 9,000.00 | 11,700.00 | |
| | ASSURA PLC | 320,833.00 | 211,428.94 | |
| | BIG YELLOW GROUP PLC | 20,546.00 | 306,751.78 | |
| | BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS | 89,651.00 | 103,098.65 | |
| | BRITISH LAND CO PLC | 107,908.00 | 546,877.74 | |
| | CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE | 95,185.00 | 149,821.19 | |
| | CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 52,238.00 | 45,081.39 | |
| | CUSTODIAN REIT PLC | 39,999.00 | 40,398.99 | |
| | DERWENT LONDON PLC | 12,339.00 | 383,742.90 | |
| | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 60,037.00 | 54,213.41 | |
| | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 30,485.00 | 211,413.47 | |
| | HAMMERSON PLC | 440,241.00 | 127,229.64 | |
| | HOME REIT PLC | 65,147.00 | 81,173.16 | |
| | IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 41,816.00 | 51,851.84 | |
| | INTU PROPERTIES PLC | 28,500.00 | 285.00 | |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 81,923.00 | 617,371.72 | |
| | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 118,804.00 | 324,810.13 | |
| | LXI REIT PLC | 112,143.00 | 167,765.92 | |
| | NEWRIVER REIT PLC | 46,021.00 | 42,155.23 | |
| | PICTON PROPERTY INCOME LTD | 57,141.00 | 56,112.46 | |
| | PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 146,583.00 | 215,183.84 | |
| | PRS REIT PLC/THE | 41,845.00 | 45,192.60 | |
| | REGIONAL REIT LTD | 45,664.00 | 39,590.68 | |
| | SAFESTORE HOLDINGS PLC | 25,924.00 | 337,530.48 | |
| | SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 70,698.00 | 41,075.53 | |
| | SEGRO PLC | 135,135.00 | 1,841,214.37 | |
| | SHAFTESBURY PLC | 36,339.00 | 217,307.22 | |
| | STANDARD LIFE INV PROP INC | 53,280.00 | 44,755.20 | |
| | SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 109,811.00 | 135,616.58 | |
| | TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING | 34,770.00 | 30,632.37 | |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 208,155.00 | 510,812.37 | | |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | 117,847.00 | 105,237.37 | | |

| | | | | |
|------------------------------|------------------------------|--------------|---------------------------------|--|
| | UNITE GROUP PLC/THE | 43,620.00 | 497,268.00 | |
| | WORKSPACE GROUP PLC | 13,356.00 | 87,281.46 | |
| | イギリス・ポンド小計 | 2,912,984.00 | 7,681,981.63 (1,249,397,492) | |
| イスラエル・シュケル | REIT 1 LTD | 20,136.00 | 437,152.56 | |
| | イスラエル・シュケル小計 | 20,136.00 | 437,152.56 (16,984,515) | |
| 韓国・ウォン | ESR KENDALL SQUARE REIT CO L | 14,308.00 | 103,733,000.00 | |
| | IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | 4,067.00 | 24,971,380.00 | |
| | JR REIT XXVII | 12,767.00 | 74,303,940.00 | |
| | KORAMCO ENERGY PLUS REIT | 6,226.00 | 45,449,800.00 | |
| | LOTTE REIT CO LTD | 12,522.00 | 75,132,000.00 | |
| | MIRAE ASIA PAC REAL EST-1 | 9,815.00 | 49,075,000.00 | |
| | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 5,302.00 | 42,734,120.00 | |
| | SK REITS CO LTD | 12,831.00 | 89,817,000.00 | |
| | 韓国・ウォン小計 | 77,838.00 | 505,216,240.00 (51,683,621) | |
| ユーロ | AEDIFICA | 4,152.00 | 474,573.60 | |
| | ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 1,480.00 | 20,586.80 | |
| | ALTAREA | 506.00 | 75,495.20 | |
| | BEFIMMO | 2,652.00 | 125,970.00 | |
| | CARE PROPERTY INVEST | 3,490.00 | 85,156.00 | |
| | CARMILA | 4,754.00 | 73,972.24 | |
| | COFINIMMO | 3,285.00 | 434,277.00 | |
| | COIMA RES SPA | 3,144.00 | 25,183.44 | |
| | COVIVIO | 5,703.00 | 392,366.40 | |
| | CROMWELL REIT EUR | 48,320.00 | 110,169.60 | |
| | EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 4,778.00 | 116,487.64 | |
| | GECINA SA | 6,030.00 | 662,094.00 | |
| | HAMBORNER REIT AG | 8,022.00 | 77,973.84 | |
| | HIBERNIA REIT PLC | 77,486.00 | 125,527.32 | |
| | ICADE | 3,844.00 | 227,949.20 | |
| | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 4,798.00 | 21,854.89 | |
| | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | 29,903.00 | 242,513.33 | |
| INTERVEST OFFICES & WAREHOUS | 2,388.00 | 67,938.60 | | |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 45,608.00 | 67,499.84 | | |

| | | | | |
|--------|---------------------------------|------------|------------------------------------|--|
| | KLEPIERRE | 20,731.00 | 475,569.14 | |
| | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 6,940.00 | 35,949.20 | |
| | MERCIALYS | 6,257.00 | 57,783.39 | |
| | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 36,919.00 | 399,463.58 | |
| | MONTEA NV | 989.00 | 113,339.40 | |
| | NSI NV | 2,336.00 | 86,548.80 | |
| | RETAIL ESTATES | 1,586.00 | 116,253.80 | |
| | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 13,143.00 | 922,244.31 | |
| | VASTNED RETAIL NV | 2,035.00 | 50,671.50 | |
| | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 16,051.00 | 617,963.50 | |
| | WERELDHAVE NV | 3,950.00 | 68,137.50 | |
| | XIOR STUDENT HOUSING NV | 2,441.00 | 123,514.60 | |
| | ユーロ小計 | 373,721.00 | 6,495,027.66 (889,039,386) | |
| 投資証券合計 | | | 23,371,768,716 (23,371,768,716) | |
| 合 計 | | | 23,371,768,716 (23,371,768,716) | |

(注) 金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 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 | 75.9% | 77.2% |
| カナダ・ドル | 投資証券 30銘柄 | 1.8% | 1.9% |
| オーストラリア・ドル | 投資証券 32銘柄 | 6.5% | 6.6% |
| 香港・ドル | 投資証券 6銘柄 | 1.3% | 1.4% |
| シンガポール・ドル | 投資証券 26銘柄 | 3.1% | 3.1% |
| ニュージーランド・ドル | 投資証券 5銘柄 | 0.3% | 0.4% |
| イギリス・ポンド | 投資証券 34銘柄 | 5.3% | 5.3% |
| イスラエル・シケル | 投資証券 1銘柄 | 0.1% | 0.1% |
| 韓国・ウォン | 投資証券 8銘柄 | 0.2% | 0.2% |
| ユーロ | 投資証券 31銘柄 | 3.7% | 3.8% |

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)」に記載しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

| | (2021年4月26日現在) | (2022年4月26日現在) |
|------|----------------|----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | 115,436,377 | 8,823,285 |

| | | |
|-------------|-----------------|-----------------|
| コール・ローン | 264,898,208 | 445,040,057 |
| 国債証券 | 105,830,132,390 | 108,663,423,560 |
| 地方債証券 | 8,548,198,020 | 9,869,641,000 |
| 特殊債券 | 11,590,909,198 | 9,355,166,234 |
| 社債券 | 4,049,851,000 | 5,077,580,900 |
| 未収入金 | 147,505,200 | - |
| 未収利息 | 272,216,894 | 244,695,528 |
| 前払費用 | 3,189,756 | 3,832,499 |
| 流動資産合計 | 130,822,337,043 | 133,668,203,063 |
| 資産合計 | 130,822,337,043 | 133,668,203,063 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 121,292,855 | 240,908 |
| 未払利息 | 766 | - |
| その他未払費用 | 12,631 | 1,265 |
| 流動負債合計 | 121,306,252 | 242,173 |
| 負債合計 | 121,306,252 | 242,173 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 102,129,036,469 | 106,516,151,054 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 28,571,994,322 | 27,151,809,836 |
| 元本等合計 | 130,701,030,791 | 133,667,960,890 |
| 純資産合計 | 130,701,030,791 | 133,667,960,890 |
| 負債純資産合計 | 130,822,337,043 | 133,668,203,063 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
|--------------------|---|
| 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、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2021年4月26日現在) | (2022年4月26日現在) |
|-----------------------|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 102,129,036,469口 | 106,516,151,054口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.2798円 (1万口当たりの純資産額12,798円) | 1口当たり純資産額 1.2549円 (1万口当たりの純資産額12,549円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク | (1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |

| | |
|----------------------------|--|
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| 4. 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。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2022年4月26日現在) |
|--------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | <p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| |
|--|
| 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| (2021年4月26日現在) | |
|---------------------------------|------------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 105,756,496,620円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 20,315,447,294円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 23,942,907,445円 |
| 2021年4月26日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 6,095,887,942円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 10,799,784,589円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 2,409,904,423円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 700,095,955円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 43,319,205円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 184,825,933円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ) | 433,396,306円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 578,861,248円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 261,394,053円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 405,524,676円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型) | 136,367,739円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 1,262,690,529円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 398,901,014円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 13,590,257円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 32,881,227円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 1,247,380,644円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 401,741,595円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 588,869,057円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 120,192,626円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 34,443,552円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 93,363,201円 |
| 三井住友DS・年金バランス30(債券重点型) | 77,139,001円 |
| 三井住友DS・年金バランス50(標準型) | 128,231,732円 |
| 三井住友DS・年金バランス70(株式重点型) | 35,509,835円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 4,679,578円 |
| SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定> | 1,590,676,701円 |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用> | 14,416,480,636円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 6,723,802,531円 |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 16,890,224,082円 |

| | |
|---|------------------|
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定> | 330,039,962円 |
| SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定> | 596,483,349円 |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 291,860,981円 |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定> | 124,997,220円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 1,898,851,071円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 2,221,232,701円 |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 2,559,318,640円 |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 9,293,268,718円 |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 948,903円 |
| 三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 1,258,717,162円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 469,800,479円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 595,459,501円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 182,525,240円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 43,116,807円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 1,623,185,800円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 2,259,171,883円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 791,362,877円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 219,084,514円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 19,227,758円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用> | 298,258,456円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 5,582,241,420円 |
| SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 344,315,421円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 907,783,289円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 758,516,436円 |
| SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定> | 3,349,108,014円 |
| 合計 | 102,129,036,469円 |

(2022年4月26日現在)

| | |
|---------------------------------|------------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 102,129,036,469円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 21,666,315,900円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 17,279,201,315円 |
| 2022年4月26日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 6,923,178,718円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 11,786,209,165円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 2,712,289,325円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 840,055,482円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 44,220,066円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 187,516,541円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ) | 486,968,806円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 776,225,280円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 393,791,215円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 525,712,133円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型) | 140,007,655円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 2,027,250,671円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 1,067,412,920円 |

| | |
|---|------------------|
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 428,125,024円 |
| 三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2050 | 46,655,634円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 2,013,005,035円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 679,976,897円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 1,079,337,052円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 252,769,138円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 93,799,630円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 160,655,525円 |
| 三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型) | 125,827,246円 |
| 三井住友D S ・年金バランス50(標準型) | 232,432,159円 |
| 三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型) | 73,539,762円 |
| 三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060 | 5,891,970円 |
| SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定> | 1,414,908,868円 |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用> | 12,052,710,188円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 6,250,509,723円 |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 15,736,258,422円 |
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定> | 320,961,241円 |
| SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定> | 557,125,171円 |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 265,176,086円 |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定> | 122,772,968円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 1,830,653,508円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 2,172,295,327円 |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 2,383,496,689円 |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 8,382,272,785円 |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 972,339円 |
| 三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 1,157,953,402円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 446,913,980円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 535,210,250円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 179,486,947円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 44,152,419円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 1,435,609,974円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 2,107,627,635円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 682,051,884円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 209,544,800円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 19,574,044円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用> | 272,432,388円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 5,119,360,113円 |
| SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 1,146,512,165円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 1,157,293,722円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 1,481,392,104円 |
| SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定> | 5,928,068,863円 |
| 合計 | 106,516,151,054円 |

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

| 種 類 | 銘 柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|--------------|--------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | 4 3 1 2年国債 | 50,000,000 | 50,063,500 | |
| | 4 3 2 2年国債 | 750,000,000 | 750,945,000 | |
| | 4 3 3 2年国債 | 330,000,000 | 330,405,900 | |
| | 4 3 4 2年国債 | 1,130,000,000 | 1,131,457,700 | |
| | 4 3 5 2年国債 | 3,480,000,000 | 3,484,350,000 | |
| | 1 3 8 5年国債 | 600,000,000 | 601,680,000 | |
| | 1 3 9 5年国債 | 260,000,000 | 260,787,800 | |
| | 1 4 0 5年国債 | 600,000,000 | 601,932,000 | |
| | 1 4 1 5年国債 | 795,000,000 | 797,766,600 | |
| | 1 4 2 5年国債 | 760,000,000 | 763,017,200 | |
| | 1 4 3 5年国債 | 770,000,000 | 773,234,000 | |
| | 1 4 4 5年国債 | 980,000,000 | 984,321,800 | |
| | 1 4 5 5年国債 | 1,080,000,000 | 1,084,957,200 | |
| | 1 4 6 5年国債 | 1,550,000,000 | 1,557,347,000 | |
| | 1 4 7 5年国債 | 1,540,000,000 | 1,541,786,400 | |
| | 1 4 8 5年国債 | 1,070,000,000 | 1,071,102,100 | |
| | 1 4 9 5年国債 | 1,240,000,000 | 1,240,818,400 | |
| | 1 5 0 5年国債 | 2,510,000,000 | 2,511,154,600 | |
| | 1 4 0年国債 | 40,000,000 | 53,671,200 | |
| | 2 4 0年国債 | 242,000,000 | 314,549,180 | |
| | 3 4 0年国債 | 185,000,000 | 241,861,600 | |
| | 4 4 0年国債 | 247,000,000 | 323,229,140 | |
| | 5 4 0年国債 | 235,000,000 | 296,593,500 | |
| | 6 4 0年国債 | 240,000,000 | 298,015,200 | |
| | 7 4 0年国債 | 285,000,000 | 339,816,900 | |
| | 8 4 0年国債 | 300,000,000 | 333,834,000 | |
| | 9 4 0年国債 | 513,000,000 | 424,333,080 | |
| | 1 0 4 0年国債 | 450,000,000 | 436,099,500 | |
| | 1 1 4 0年国債 | 380,000,000 | 356,158,800 | |
| | 1 2 4 0年国債 | 380,000,000 | 320,161,400 | |
| | 1 3 4 0年国債 | 475,000,000 | 398,235,250 | |
| | 1 4 4 0年国債 | 475,000,000 | 425,557,250 | |
| | 3 3 2 1 0年国債 | 793,000,000 | 801,770,580 | |
| | 3 3 3 1 0年国債 | 815,000,000 | 825,203,800 | |
| | 3 3 4 1 0年国債 | 315,000,000 | 319,400,550 | |
| | 3 3 5 1 0年国債 | 90,000,000 | 91,178,100 | |
| | 3 3 6 1 0年国債 | 340,000,000 | 344,960,600 | |
| | 3 3 7 1 0年国債 | 120,000,000 | 121,113,600 | |
| 3 3 8 1 0年国債 | 805,000,000 | 815,384,500 | | |

| | | | | |
|-----|-------|---------------|---------------|--|
| 339 | 10年国債 | 785,000,000 | 795,880,100 | |
| 340 | 10年国債 | 770,000,000 | 781,396,000 | |
| 341 | 10年国債 | 557,000,000 | 563,711,850 | |
| 342 | 10年国債 | 350,000,000 | 351,704,500 | |
| 343 | 10年国債 | 310,000,000 | 311,543,800 | |
| 344 | 10年国債 | 811,000,000 | 814,925,240 | |
| 345 | 10年国債 | 258,000,000 | 259,259,040 | |
| 346 | 10年国債 | 540,000,000 | 542,376,000 | |
| 347 | 10年国債 | 680,000,000 | 682,618,000 | |
| 348 | 10年国債 | 625,000,000 | 627,018,750 | |
| 349 | 10年国債 | 610,000,000 | 611,714,100 | |
| 350 | 10年国債 | 590,000,000 | 591,038,400 | |
| 351 | 10年国債 | 390,000,000 | 390,354,900 | |
| 352 | 10年国債 | 570,000,000 | 570,000,000 | |
| 353 | 10年国債 | 520,000,000 | 519,485,200 | |
| 354 | 10年国債 | 435,000,000 | 434,103,900 | |
| 355 | 10年国債 | 700,000,000 | 697,522,000 | |
| 356 | 10年国債 | 940,000,000 | 935,525,600 | |
| 357 | 10年国債 | 910,000,000 | 904,503,600 | |
| 358 | 10年国債 | 1,130,000,000 | 1,122,078,700 | |
| 359 | 10年国債 | 1,210,000,000 | 1,200,295,800 | |
| 360 | 10年国債 | 1,120,000,000 | 1,109,830,400 | |
| 361 | 10年国債 | 1,310,000,000 | 1,296,651,100 | |
| 362 | 10年国債 | 1,150,000,000 | 1,136,959,000 | |
| 363 | 10年国債 | 800,000,000 | 790,328,000 | |
| 364 | 10年国債 | 950,000,000 | 937,336,500 | |
| 365 | 10年国債 | 1,060,000,000 | 1,045,011,600 | |
| 366 | 10年国債 | 370,000,000 | 368,390,500 | |
| 2 | 30年国債 | 510,000,000 | 597,760,800 | |
| 4 | 30年国債 | 340,000,000 | 417,496,200 | |
| 5 | 30年国債 | 290,000,000 | 341,173,400 | |
| 7 | 30年国債 | 474,000,000 | 569,657,940 | |
| 9 | 30年国債 | 240,000,000 | 267,381,600 | |
| 10 | 30年国債 | 465,000,000 | 503,715,900 | |
| 11 | 30年国債 | 430,000,000 | 494,138,800 | |
| 12 | 30年国債 | 570,000,000 | 681,218,400 | |
| 14 | 30年国債 | 622,000,000 | 768,493,440 | |
| 16 | 30年国債 | 465,000,000 | 583,119,300 | |
| 18 | 30年国債 | 540,000,000 | 667,045,800 | |
| 19 | 30年国債 | 470,000,000 | 581,907,000 | |
| 21 | 30年国債 | 345,000,000 | 429,004,050 | |
| 22 | 30年国債 | 315,000,000 | 401,023,350 | |
| 23 | 30年国債 | 329,000,000 | 419,823,740 | |
| 24 | 30年国債 | 310,000,000 | 396,477,600 | |
| 25 | 30年国債 | 290,000,000 | 363,483,100 | |

| | | | | |
|----|-------|-------------|-------------|--|
| 26 | 30年国債 | 363,000,000 | 460,850,280 | |
| 27 | 30年国債 | 420,000,000 | 541,270,800 | |
| 28 | 30年国債 | 386,000,000 | 498,943,600 | |
| 29 | 30年国債 | 177,000,000 | 226,768,860 | |
| 30 | 30年国債 | 442,000,000 | 560,707,940 | |
| 31 | 30年国債 | 325,000,000 | 407,566,250 | |
| 32 | 30年国債 | 360,000,000 | 458,161,200 | |
| 33 | 30年国債 | 368,000,000 | 450,384,160 | |
| 34 | 30年国債 | 457,000,000 | 575,719,460 | |
| 35 | 30年国債 | 350,000,000 | 429,548,000 | |
| 36 | 30年国債 | 90,000,000 | 110,529,000 | |
| 37 | 30年国債 | 435,000,000 | 526,767,600 | |
| 38 | 30年国債 | 410,000,000 | 489,093,100 | |
| 39 | 30年国債 | 180,000,000 | 218,379,600 | |
| 40 | 30年国債 | 270,000,000 | 322,574,400 | |
| 41 | 30年国債 | 270,000,000 | 317,476,800 | |
| 42 | 30年国債 | 280,000,000 | 329,406,000 | |
| 43 | 30年国債 | 285,000,000 | 335,467,800 | |
| 44 | 30年国債 | 280,000,000 | 329,747,600 | |
| 45 | 30年国債 | 355,000,000 | 403,422,000 | |
| 46 | 30年国債 | 315,000,000 | 358,013,250 | |
| 47 | 30年国債 | 330,000,000 | 381,932,100 | |
| 48 | 30年国債 | 335,000,000 | 373,880,100 | |
| 49 | 30年国債 | 315,000,000 | 351,536,850 | |
| 50 | 30年国債 | 295,000,000 | 290,914,250 | |
| 51 | 30年国債 | 315,000,000 | 276,138,450 | |
| 52 | 30年国債 | 343,000,000 | 314,918,590 | |
| 53 | 30年国債 | 307,000,000 | 288,128,710 | |
| 54 | 30年国債 | 75,000,000 | 73,548,750 | |
| 55 | 30年国債 | 325,000,000 | 318,334,250 | |
| 56 | 30年国債 | 500,000,000 | 489,155,000 | |
| 57 | 30年国債 | 355,000,000 | 346,519,050 | |
| 58 | 30年国債 | 340,000,000 | 331,119,200 | |
| 59 | 30年国債 | 360,000,000 | 341,506,800 | |
| 60 | 30年国債 | 350,000,000 | 347,774,000 | |
| 61 | 30年国債 | 345,000,000 | 325,962,900 | |
| 62 | 30年国債 | 165,000,000 | 147,826,800 | |
| 63 | 30年国債 | 320,000,000 | 278,409,600 | |
| 64 | 30年国債 | 305,000,000 | 264,502,100 | |
| 65 | 30年国債 | 305,000,000 | 264,215,400 | |
| 66 | 30年国債 | 310,000,000 | 268,549,900 | |
| 67 | 30年国債 | 350,000,000 | 319,245,500 | |
| 68 | 30年国債 | 350,000,000 | 318,678,500 | |
| 69 | 30年国債 | 440,000,000 | 411,061,200 | |
| 70 | 30年国債 | 350,000,000 | 326,095,000 | |

| | | | | |
|-------|---------|---------------|---------------|--|
| 7 1 | 3 0 年国債 | 320,000,000 | 297,996,800 | |
| 7 2 | 3 0 年国債 | 380,000,000 | 353,293,600 | |
| 7 3 | 3 0 年国債 | 410,000,000 | 380,996,600 | |
| 7 4 | 3 0 年国債 | 10,000,000 | 10,034,600 | |
| 6 5 | 2 0 年国債 | 1,020,000,000 | 1,053,170,400 | |
| 6 9 | 2 0 年国債 | 1,020,000,000 | 1,061,809,800 | |
| 7 0 | 2 0 年国債 | 780,000,000 | 821,090,400 | |
| 7 2 | 2 0 年国債 | 753,000,000 | 791,802,090 | |
| 7 4 | 2 0 年国債 | 664,000,000 | 701,867,920 | |
| 7 5 | 2 0 年国債 | 490,000,000 | 520,473,100 | |
| 7 8 | 2 0 年国債 | 590,000,000 | 626,072,600 | |
| 8 2 | 2 0 年国債 | 620,000,000 | 665,055,400 | |
| 8 4 | 2 0 年国債 | 500,000,000 | 537,080,000 | |
| 8 5 | 2 0 年国債 | 645,000,000 | 698,444,700 | |
| 8 8 | 2 0 年国債 | 742,000,000 | 813,462,020 | |
| 8 9 | 2 0 年国債 | 20,000,000 | 21,843,200 | |
| 9 0 | 2 0 年国債 | 580,000,000 | 636,422,400 | |
| 9 2 | 2 0 年国債 | 424,000,000 | 465,505,360 | |
| 9 3 | 2 0 年国債 | 632,000,000 | 693,544,160 | |
| 9 5 | 2 0 年国債 | 305,000,000 | 340,672,800 | |
| 9 7 | 2 0 年国債 | 677,000,000 | 755,789,260 | |
| 9 9 | 2 0 年国債 | 153,000,000 | 170,715,870 | |
| 1 0 0 | 2 0 年国債 | 207,000,000 | 232,955,730 | |
| 1 0 1 | 2 0 年国債 | 355,000,000 | 403,684,700 | |
| 1 0 2 | 2 0 年国債 | 457,000,000 | 521,862,010 | |
| 1 0 5 | 2 0 年国債 | 390,000,000 | 439,740,600 | |
| 1 0 6 | 2 0 年国債 | 370,000,000 | 419,543,000 | |
| 1 0 7 | 2 0 年国債 | 378,000,000 | 427,654,080 | |
| 1 0 8 | 2 0 年国債 | 390,000,000 | 436,078,500 | |
| 1 0 9 | 2 0 年国債 | 140,000,000 | 156,989,000 | |
| 1 1 1 | 2 0 年国債 | 386,000,000 | 442,271,080 | |
| 1 1 3 | 2 0 年国債 | 227,000,000 | 259,299,830 | |
| 1 1 4 | 2 0 年国債 | 263,000,000 | 301,326,990 | |
| 1 1 6 | 2 0 年国債 | 100,000,000 | 115,771,000 | |
| 1 1 8 | 2 0 年国債 | 200,000,000 | 229,044,000 | |
| 1 1 9 | 2 0 年国債 | 295,000,000 | 333,108,100 | |
| 1 2 0 | 2 0 年国債 | 200,000,000 | 222,626,000 | |
| 1 2 1 | 2 0 年国債 | 55,000,000 | 62,750,050 | |
| 1 2 2 | 2 0 年国債 | 330,000,000 | 373,771,200 | |
| 1 2 3 | 2 0 年国債 | 80,000,000 | 92,883,200 | |
| 1 2 4 | 2 0 年国債 | 190,000,000 | 218,984,500 | |
| 1 2 5 | 2 0 年国債 | 205,000,000 | 240,518,300 | |
| 1 2 6 | 2 0 年国債 | 180,000,000 | 208,045,800 | |
| 1 2 7 | 2 0 年国債 | 145,000,000 | 166,326,600 | |
| 1 2 8 | 2 0 年国債 | 65,000,000 | 74,792,250 | |

| | | | | |
|-----|-------|-------------|-------------|--|
| 130 | 20年国債 | 155,000,000 | 177,389,750 | |
| 131 | 20年国債 | 380,000,000 | 431,395,000 | |
| 132 | 20年国債 | 450,000,000 | 512,199,000 | |
| 133 | 20年国債 | 190,000,000 | 218,055,400 | |
| 134 | 20年国債 | 200,000,000 | 230,158,000 | |
| 135 | 20年国債 | 155,000,000 | 176,873,600 | |
| 136 | 20年国債 | 120,000,000 | 135,775,200 | |
| 137 | 20年国債 | 185,000,000 | 211,338,450 | |
| 139 | 20年国債 | 60,000,000 | 67,948,800 | |
| 140 | 20年国債 | 340,000,000 | 388,983,800 | |
| 142 | 20年国債 | 190,000,000 | 219,636,200 | |
| 143 | 20年国債 | 120,000,000 | 136,387,200 | |
| 144 | 20年国債 | 170,000,000 | 191,421,700 | |
| 145 | 20年国債 | 110,000,000 | 126,407,600 | |
| 146 | 20年国債 | 95,000,000 | 109,298,450 | |
| 147 | 20年国債 | 210,000,000 | 239,515,500 | |
| 148 | 20年国債 | 219,000,000 | 247,618,920 | |
| 149 | 20年国債 | 575,000,000 | 650,911,500 | |
| 150 | 20年国債 | 391,000,000 | 438,224,980 | |
| 151 | 20年国債 | 580,000,000 | 636,248,400 | |
| 152 | 20年国債 | 585,000,000 | 641,996,550 | |
| 153 | 20年国債 | 437,000,000 | 485,214,210 | |
| 154 | 20年国債 | 380,000,000 | 417,069,000 | |
| 155 | 20年国債 | 410,000,000 | 439,278,100 | |
| 156 | 20年国債 | 480,000,000 | 475,612,800 | |
| 157 | 20年国債 | 335,000,000 | 322,146,050 | |
| 158 | 20年国債 | 410,000,000 | 410,549,400 | |
| 159 | 20年国債 | 388,000,000 | 393,292,320 | |
| 160 | 20年国債 | 355,000,000 | 364,336,500 | |
| 161 | 20年国債 | 380,000,000 | 383,997,600 | |
| 162 | 20年国債 | 370,000,000 | 373,156,100 | |
| 163 | 20年国債 | 430,000,000 | 432,782,100 | |
| 164 | 20年国債 | 385,000,000 | 380,791,950 | |
| 165 | 20年国債 | 390,000,000 | 384,824,700 | |
| 166 | 20年国債 | 335,000,000 | 340,252,800 | |
| 167 | 20年国債 | 400,000,000 | 393,052,000 | |
| 168 | 20年国債 | 480,000,000 | 462,787,200 | |
| 169 | 20年国債 | 400,000,000 | 378,108,000 | |
| 170 | 20年国債 | 385,000,000 | 362,800,900 | |
| 171 | 20年国債 | 365,000,000 | 342,870,050 | |
| 172 | 20年国債 | 480,000,000 | 457,459,200 | |
| 173 | 20年国債 | 505,000,000 | 480,214,600 | |
| 174 | 20年国債 | 510,000,000 | 483,480,000 | |
| 175 | 20年国債 | 515,000,000 | 495,960,450 | |
| 176 | 20年国債 | 610,000,000 | 585,728,100 | |

| | | | | |
|-------|-------------|-------------|-----------------|--|
| | 177 20年国債 | 540,000,000 | 507,929,400 | |
| | 178 20年国債 | 500,000,000 | 478,020,000 | |
| | 179 20年国債 | 580,000,000 | 553,267,800 | |
| | 国債証券 小計 | | 108,663,423,560 | |
| 地方債証券 | 727 東京都公債 | 500,000,000 | 505,446,000 | |
| | 792 東京都公債 | 300,000,000 | 295,790,100 | |
| | 1 東京都30年 | 100,000,000 | 119,537,800 | |
| | 8 東京都30年 | 400,000,000 | 498,271,200 | |
| | 13 東京都30年 | 500,000,000 | 604,446,000 | |
| | 1 東京都20年 | 100,000,000 | 101,722,800 | |
| | 6 東京都20年 | 100,000,000 | 105,550,000 | |
| | 24-14 北海道公債 | 100,000,000 | 100,648,700 | |
| | 26-15 北海道公債 | 100,000,000 | 100,979,900 | |
| | 30-18 北海道公債 | 200,000,000 | 198,184,200 | |
| | 1 神奈川県20年 | 100,000,000 | 105,294,000 | |
| | 3 神奈川県20年 | 100,000,000 | 106,356,400 | |
| | 7 神奈川県20年 | 100,000,000 | 110,258,800 | |
| | 13 神奈川県20年 | 100,000,000 | 114,398,600 | |
| | 373 大阪府公債 | 100,000,000 | 100,995,200 | |
| | 377 大阪府公債 | 100,000,000 | 101,018,400 | |
| | 388 大阪府公債 | 100,000,000 | 101,091,400 | |
| | 27-4 京都府公債 | 100,000,000 | 101,450,100 | |
| | 29-12 京都府5年 | 300,000,000 | 300,031,800 | |
| | 1-6 京都府5年 | 200,000,000 | 199,606,600 | |
| | 5 兵庫県公債15年 | 300,000,000 | 319,867,800 | |
| | 10 兵庫県公債20年 | 100,000,000 | 114,659,600 | |
| | 7 静岡県30年 | 100,000,000 | 122,100,600 | |
| | 1 静岡県20年 | 100,000,000 | 107,094,800 | |
| | 22-8 愛知県20年 | 200,000,000 | 225,911,000 | |
| | 27-16 愛知県公債 | 400,000,000 | 405,204,000 | |
| | 25-11 福岡県公債 | 100,000,000 | 101,140,000 | |
| | 26-3 福岡県公債 | 100,000,000 | 101,109,200 | |
| | 26-10 福岡県公債 | 100,000,000 | 101,049,700 | |
| | 1-1 福岡県公債 | 200,000,000 | 196,451,800 | |
| | 25-8 千葉県公債 | 100,000,000 | 100,969,700 | |
| | 118 共同発行地方 | 100,000,000 | 100,607,900 | |
| | 137 共同発行地方 | 200,000,000 | 202,235,000 | |
| | 138 共同発行地方 | 200,000,000 | 202,260,400 | |
| | 172 共同発行地方 | 500,000,000 | 502,127,500 | |
| | 183 共同発行地方 | 600,000,000 | 600,065,400 | |
| | 1-1 大阪市5年 | 300,000,000 | 299,553,900 | |
| | 1 名古屋市20年 | 200,000,000 | 206,370,600 | |
| | 3 名古屋市20年 | 100,000,000 | 106,105,000 | |
| | 5 名古屋市20年 | 100,000,000 | 109,617,200 | |
| | 29-5 京都市5年 | 100,000,000 | 100,009,900 | |

| | | | | |
|------|-------------|-------------|---------------|--|
| | 1 京都市30年 | 100,000,000 | 128,853,400 | |
| | 7 京都市20年 | 100,000,000 | 113,701,000 | |
| | 26-17 神戸市公債 | 100,000,000 | 100,547,500 | |
| | 26-3 横浜市公債 | 200,000,000 | 202,256,000 | |
| | 4 横浜市20年 | 100,000,000 | 105,630,500 | |
| | 9 横浜市20年 | 100,000,000 | 109,294,300 | |
| | 14 横浜市20年 | 100,000,000 | 112,486,300 | |
| | 47 横浜市5年 | 100,000,000 | 100,010,500 | |
| | 26-4 札幌市公債 | 100,000,000 | 100,978,900 | |
| | 24-2 北九州市債 | 100,000,000 | 100,458,400 | |
| | 1-2 北九州市5年 | 100,000,000 | 99,803,400 | |
| | 29-11 福岡市5年 | 300,000,000 | 300,031,800 | |
| | 地方債証券 小計 | | 9,869,641,000 | |
| 特殊債券 | 3 政保政策投資CO | 200,000,000 | 206,966,600 | |
| | 36 日本政策投資B | 100,000,000 | 110,548,500 | |
| | 18 道路機構 | 100,000,000 | 141,245,900 | |
| | 22 道路機構 | 300,000,000 | 410,631,300 | |
| | 27 道路機構 | 100,000,000 | 111,755,900 | |
| | 37 道路機構 | 300,000,000 | 339,990,600 | |
| | 47 道路機構 | 200,000,000 | 228,975,400 | |
| | 104 道路機構 | 400,000,000 | 402,432,400 | |
| | 79 政保道路機構 | 200,000,000 | 226,602,600 | |
| | 81 政保道路機構 | 200,000,000 | 226,841,000 | |
| | 88 政保道路機構 | 100,000,000 | 126,411,200 | |
| | 90 政保道路機構 | 500,000,000 | 569,185,500 | |
| | 99 政保道路機構 | 100,000,000 | 115,088,000 | |
| | 176 政保道路機構 | 100,000,000 | 113,400,600 | |
| | 196 政保道路機構 | 100,000,000 | 115,213,800 | |
| | 210 政保道路機構 | 200,000,000 | 225,983,400 | |
| | 227 政保道路機構 | 200,000,000 | 202,641,000 | |
| | 231 政保道路機構 | 300,000,000 | 303,845,700 | |
| | 288 政保道路機構 | 189,000,000 | 188,745,039 | |
| | 9 道路債券 | 100,000,000 | 125,199,500 | |
| | 2 地方公営20年 | 100,000,000 | 113,797,000 | |
| | 45 地方公共団体 | 200,000,000 | 201,277,200 | |
| | 61 地方公共団体 | 100,000,000 | 101,319,400 | |
| | 62 地方公共団体 | 400,000,000 | 404,938,400 | |
| | 63 地方公共団体 | 100,000,000 | 101,169,300 | |
| | 67 政保地方公共団 | 100,000,000 | 101,219,700 | |
| | 101 地方公共団体 | 100,000,000 | 100,332,700 | |
| | 106 地方公共団体 | 200,000,000 | 200,074,800 | |
| | 3 公営企業20年 | 100,000,000 | 100,897,400 | |
| | 5 公営企業20年 | 100,000,000 | 102,894,800 | |
| | 17 公営企業20年 | 100,000,000 | 108,925,300 | |
| | 20 公営企業20年 | 100,000,000 | 110,357,300 | |

| | | | | |
|-------|-------------|-------------|-------------|--|
| 2 2 | 公営企業20年 | 100,000,000 | 111,097,700 | |
| 2 4 | 公営企業20年 | 200,000,000 | 224,716,800 | |
| 5 2 | 住宅支援機構 | 100,000,000 | 113,502,400 | |
| 1 3 0 | 住宅支援機構 | 200,000,000 | 228,153,800 | |
| 2 2 6 | 住宅支援機構 | 100,000,000 | 100,251,500 | |
| S 9 | 住宅金融R M B S | 20,640,000 | 20,817,504 | |
| S 1 0 | 住宅金融R M B S | 31,836,000 | 32,087,504 | |
| S 3 | 住宅機構R M B S | 11,144,000 | 11,317,846 | |
| S 5 | 住宅機構R M B S | 23,666,000 | 24,170,085 | |
| S 7 | 住宅機構R M B S | 12,205,000 | 12,461,305 | |
| S 9 | 住宅機構R M B S | 12,367,000 | 12,712,039 | |
| S 1 0 | 住宅機構R M B S | 12,197,000 | 12,473,871 | |
| S 1 1 | 住宅機構R M B S | 13,073,000 | 13,488,721 | |
| 2 9 | 住宅金融R M B S | 10,032,000 | 10,096,204 | |
| 3 2 | 住宅金融R M B S | 11,073,000 | 11,201,446 | |
| 3 5 | 住宅金融R M B S | 11,822,000 | 12,045,435 | |
| 3 9 | 住宅金融R M B S | 10,766,000 | 10,907,034 | |
| 4 1 | 住宅金融R M B S | 11,525,000 | 11,780,855 | |
| 4 3 | 住宅金融R M B S | 22,070,000 | 22,454,018 | |
| 5 1 | 住宅金融R M B S | 10,506,000 | 10,590,048 | |
| 5 3 | 住宅金融R M B S | 11,419,000 | 11,632,535 | |
| 1 | 住宅機構R M B S | 20,726,000 | 20,889,735 | |
| 2 | 住宅機構R M B S | 23,390,000 | 23,963,055 | |
| 4 | 住宅機構R M B S | 10,780,000 | 10,967,572 | |
| 6 | 住宅機構R M B S | 10,721,000 | 10,891,463 | |
| 1 9 | 住宅機構R M B S | 15,880,000 | 16,648,592 | |
| 2 4 | 住宅機構R M B S | 32,450,000 | 34,228,260 | |
| 2 6 | 住宅機構R M B S | 50,523,000 | 53,155,248 | |
| 2 7 | 住宅機構R M B S | 18,258,000 | 19,234,803 | |
| 2 8 | 住宅機構R M B S | 20,026,000 | 21,201,526 | |
| 2 9 | 住宅機構R M B S | 22,104,000 | 23,474,448 | |
| 3 0 | 住宅機構R M B S | 22,033,000 | 23,414,469 | |
| 3 2 | 住宅機構R M B S | 43,162,000 | 45,527,277 | |
| 3 5 | 住宅機構R M B S | 21,904,000 | 23,132,814 | |
| 3 6 | 住宅機構R M B S | 21,275,000 | 22,402,575 | |
| 4 3 | 住宅機構R M B S | 26,914,000 | 28,348,516 | |
| 4 6 | 住宅機構R M B S | 21,342,000 | 22,483,797 | |
| 4 8 | 住宅機構R M B S | 40,284,000 | 42,354,597 | |
| 4 9 | 住宅機構R M B S | 20,570,000 | 21,540,904 | |
| 5 1 | 住宅機構R M B S | 45,364,000 | 47,477,962 | |
| 5 5 | 住宅機構R M B S | 60,218,000 | 62,849,526 | |
| 5 7 | 住宅機構R M B S | 29,469,000 | 30,747,954 | |
| 5 8 | 住宅機構R M B S | 33,387,000 | 34,846,011 | |
| 5 9 | 住宅機構R M B S | 64,350,000 | 67,200,705 | |
| 6 0 | 住宅機構R M B S | 101,619,000 | 105,673,598 | |

| | | | | |
|-----|-------------------|-------------|---------------|--|
| | 6 1 住宅機構R M B S | 33,618,000 | 34,952,634 | |
| | 6 7 住宅機構R M B S | 39,831,000 | 41,081,693 | |
| | 6 9 住宅機構R M B S | 81,038,000 | 84,303,831 | |
| | 7 0 住宅機構R M B S | 70,776,000 | 73,451,332 | |
| | 7 3 住宅機構R M B S | 40,325,000 | 41,990,422 | |
| | 9 9 住宅機構R M B S | 60,688,000 | 61,901,760 | |
| | 1 2 3 住宅機構R M B S | 78,771,000 | 77,920,273 | |
| | 1 2 4 住宅機構R M B S | 78,620,000 | 77,542,906 | |
| | 1 2 5 住宅機構R M B S | 78,727,000 | 77,648,440 | |
| | 1 2 7 住宅機構R M B S | 80,432,000 | 79,145,088 | |
| | 1 2 8 住宅機構R M B S | 79,545,000 | 78,399,552 | |
| | 1 2 9 住宅機構R M B S | 81,229,000 | 80,246,129 | |
| | 1 3 7 住宅機構R M B S | 84,072,000 | 82,937,028 | |
| | 1 6 7 住宅機構R M B S | 96,274,000 | 94,569,950 | |
| | 8 5 中日本高速道 | 300,000,000 | 299,553,900 | |
| | 特殊債券 小計 | | 9,355,166,234 | |
| 社債券 | 2 BPCE S.A. | 200,000,000 | 200,534,400 | |
| | 2 0 西日本高速道 | 100,000,000 | 100,998,000 | |
| | 2 3 西日本高速道 | 100,000,000 | 101,099,000 | |
| | 1 3 大和ハウス | 100,000,000 | 100,232,200 | |
| | 3 0 東レ | 100,000,000 | 100,444,900 | |
| | 5 6 住友化学 | 200,000,000 | 200,600,000 | |
| | 2 4 三菱ケミカルホールデイ | 100,000,000 | 100,211,800 | |
| | 1 6 日立製作所 | 100,000,000 | 101,208,500 | |
| | 2 2 パナソニック | 100,000,000 | 99,711,100 | |
| | 9 T D K | 100,000,000 | 98,303,300 | |
| | 6 3 三井物産 | 100,000,000 | 110,518,600 | |
| | 8 みずほコーポレート | 100,000,000 | 111,260,500 | |
| | 1 三井住友F G劣後 | 100,000,000 | 101,110,100 | |
| | 8 住友信託 劣後 | 100,000,000 | 109,932,800 | |
| | 1 みずほF G劣後 | 100,000,000 | 100,991,900 | |
| | 9 みずほ銀行劣後 | 100,000,000 | 109,458,200 | |
| | 1 7 N T Tファイナンス | 200,000,000 | 199,622,200 | |
| | 7 3 ホンダファイナンス | 200,000,000 | 198,949,000 | |
| | 2 三菱H Cキャピタル | 200,000,000 | 198,550,600 | |
| | 1 野村ホールディングス | 100,000,000 | 99,969,500 | |
| | 5 8 三菱地所 | 100,000,000 | 123,429,600 | |
| | 1 3 5 三菱地所 | 200,000,000 | 195,868,200 | |
| | 1 0 東急 | 100,000,000 | 97,844,800 | |
| | 3 8 京王電鉄 | 100,000,000 | 100,215,100 | |
| | 1 1 0 東日本旅客鉄 | 100,000,000 | 115,115,800 | |
| | 1 6 9 東日本旅客鉄 | 200,000,000 | 195,052,800 | |
| | 4 1 東海旅客鉄道 | 100,000,000 | 112,174,500 | |
| | 4 2 東海旅客鉄道 | 100,000,000 | 113,488,300 | |
| | 4 5 東京地下鉄 | 100,000,000 | 98,353,100 | |

| | | | | |
|-------|-------------|-------------|-----------------|--|
| 6 4 | 阪急阪神H L D G | 100,000,000 | 99,502,600 | |
| 5 4 6 | 中部電力 | 200,000,000 | 194,541,800 | |
| 5 5 3 | 中部電力 | 200,000,000 | 199,639,400 | |
| 5 0 8 | 東北電力 | 200,000,000 | 199,810,400 | |
| 4 9 6 | 九州電力 | 300,000,000 | 291,747,900 | |
| 3 8 | 東京電力パワー | 100,000,000 | 100,366,300 | |
| 4 1 | 大阪瓦斯 | 200,000,000 | 196,146,600 | |
| 7 | ファーストリテイリング | 100,000,000 | 100,577,100 | |
| | 社債券 小計 | | 5,077,580,900 | |
| | 合 計 | | 132,965,811,694 | |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位 : 円)

| | (2021年4月26日現在) | (2022年4月26日現在) |
|--------------|------------------|------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 101,589,326 | 211,176,152 |
| 金銭信託 | 105,268,890 | 5,445,859 |
| コール・ローン | 241,566,316 | 274,685,132 |
| 国債証券 | 161,434,643,407 | 154,868,895,807 |
| 派生商品評価勘定 | 1,325,008 | 141,836 |
| 未収入金 | 653,000,000 | - |
| 未収利息 | 1,174,280,811 | 1,049,674,843 |
| 前払費用 | 20,257,638 | 52,885,106 |
| 流動資産合計 | 163,731,931,396 | 156,462,904,735 |
| 資産合計 | 163,731,931,396 | 156,462,904,735 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 489,197 | - |
| 未払金 | 647,205,081 | - |
| 未払解約金 | 265,826,302 | 165,954,422 |
| 未払利息 | 699 | - |
| その他未払費用 | 9,108 | 859 |
| 流動負債合計 | 913,530,387 | 165,955,281 |
| 負債合計 | 913,530,387 | 165,955,281 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 84,390,597,281 | 78,572,267,228 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金 () | 78,427,803,728 | 77,724,682,226 |
| 元本等合計 | 162,818,401,009 | 156,296,949,454 |
| 純資産合計 | 162,818,401,009 | 156,296,949,454 |

負債純資産合計

163,731,931,396

156,462,904,735

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2021年4月26日現在) | (2022年4月26日現在) |
|-----------------------|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 84,390,597,281口 | 78,572,267,228口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.9293円 (1万口当たりの純資産額19,293円) | 1口当たり純資産額 1.9892円 (1万口当たりの純資産額19,892円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
|----|------------------------------|
| | |

| | |
|------------------------|---|
| 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、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p> |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っております。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |

| | |
|----------------------------|--|
| 4. 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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |
|----------------------------|--|

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2022年4月26日現在) |
|--------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|-----------|--------------|-------------|-----------|-------------|-----------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 309,432,427 | - | 309,153,111 | 279,316 |
| | イギリス・ポンド | 49,432,655 | - | 49,222,779 | 209,876 |
| | スウェーデン・クローナ | 26,903,934 | - | 26,965,931 | 61,997 |
| | ユーロ | 264,273,378 | - | 265,536,384 | 1,263,006 |
| | 小計 | 650,042,394 | - | 650,878,205 | 835,811 |
| 合計 | | 650,042,394 | - | 650,878,205 | 835,811 |

(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|----|----|------|-----------|----|------|
| | | | うち 1年超 | | |

| | | | | | |
|-----------|--------------|-------------|---|-------------|---------|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 235,598,096 | - | 235,544,702 | 53,394 |
| | イギリス・ポンド | 32,575,418 | - | 32,566,006 | 9,412 |
| | メキシコ・ペソ | 30,682,438 | - | 30,670,282 | 12,156 |
| | ユーロ | 194,426,170 | - | 194,359,296 | 66,874 |
| | 小計 | 493,282,122 | - | 493,140,286 | 141,836 |
| 合 計 | | 493,282,122 | - | 493,140,286 | 141,836 |

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| |
|--|
| 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| | |
|---------------------------------|-----------------|
| (2021年4月26日現在) | |
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 84,222,011,513円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 11,191,601,392円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 11,023,015,624円 |
| 2021年4月26日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・DC外国債券インデックスファンドS | 23,534,936,984円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 729,649,813円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 2,025,052,215円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 1,054,240,718円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 147,217,912円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 6,940,706円 |

| | |
|--|-----------------|
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 28,769,951円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ) | 94,042,578円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 178,438,989円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 114,062,243円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 213,016,075円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型) | 24,082,222円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 139,530,302円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 165,360,909円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 88,010,634円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 82,884,377円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050 | 13,098,149円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 70,276,236円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 46,159,136円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 110,380,542円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 33,794,045円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 22,772,725円 |
| 三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド | 82,278,579円 |
| 三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド | 123,896,191円 |
| 三井住友D S・年金バランス30(債券重点型) | 9,281,514円 |
| 三井住友D S・年金バランス50(標準型) | 24,027,031円 |
| 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型) | 15,516,979円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060 | 1,832,778円 |
| S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 2,338,391,074円 |
| S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定> | 53,057,364円 |
| S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用> | 8,328,869,926円 |
| S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用> | 4,860,208,256円 |
| S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用> | 11,174,840,543円 |
| S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定> | 35,901,694円 |
| S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定> | 97,373,210円 |
| S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用> | 740,287,615円 |
| S M A M・バランスファンドV L国際分散型<適格機関投資家限定> | 121,217,577円 |
| S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用> | 1,100,173,191円 |
| S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用> | 1,455,394,432円 |
| S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用> | 1,680,280,937円 |
| S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用> | 5,267,062,313円 |
| S M A M・バランスV A株4 0 T<適格機関投資家限定> | 619,895円 |
| S M A M・外国債券パッシブファンドV A<適格機関投資家限定> | 8,780,087,672円 |
| 三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用) | 345,222,445円 |
| S M A M・グローバルバランス4 0 V A<適格機関投資家限定> | 154,703,653円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A<適格機関投資家専用> | 90,561,097円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A<適格機関投資家専用> | 35,408,120円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用> | 11,874,819円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L<適格機関投資家専用> | 108,523,473円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L<適格機関投資家専用> | 453,166,105円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2<適格機関投資家専用> | 119,259,614円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2<適格機関投資家専用> | 42,530,817円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2<適格機関投資家専用> | 5,288,637円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2<適格機関投資家専用> | 1,117,376,981円 |

| | |
|---|-----------------|
| SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定> | 715,810,156円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定> | 1,078,469,323円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 3,029,032,100円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定> | 474,627,289円 |
| SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定> | 47,517,572円 |
| SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 64,301,287円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 177,723,755円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 149,075,586円 |
| SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定> | 956,808,220円 |
| 合計 | 84,390,597,281円 |

(2022年4月26日現在)

開示対象ファンドの

| | |
|-------------------|-----------------|
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 84,390,597,281円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 10,759,091,011円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 16,577,421,064円 |

2022年4月26日現在の元本の内訳

| | |
|---------------------------------|-----------------|
| 三井住友・DC外国債券インデックスファンドS | 24,404,431,209円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 797,136,312円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 2,119,967,555円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 1,147,542,270円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 117,929,040円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 6,893,764円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 28,777,610円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ) | 93,657,355円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 225,146,317円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 156,890,144円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 262,638,809円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型) | 23,180,349円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 53,018,449円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 75,940,895円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 53,017,014円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 17,667,980円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 72,121,077円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 51,857,305円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 133,397,804円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 38,493,469円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 18,531,301円 |
| 三井住友・DCつみたてNIS A・世界分散ファンド | 136,355,816円 |
| 三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド | 301,813,312円 |
| 三井住友DS・年金バランス30(債券重点型) | 14,359,695円 |
| 三井住友DS・年金バランス50(標準型) | 42,018,400円 |
| 三井住友DS・年金バランス70(株式重点型) | 30,944,093円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 2,203,842円 |
| 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし) | 226,959,316円 |

| | |
|--|-----------------|
| 三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド | 4,226,574円 |
| S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 3,835,643,626円 |
| S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定> | 40,032,740円 |
| S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用> | 6,760,871,438円 |
| S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用> | 4,399,167,424円 |
| S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用> | 10,143,367,252円 |
| S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定> | 34,375,893円 |
| S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定> | 87,983,369円 |
| S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用> | 690,283,030円 |
| S M A M・バランスファンドV L国際分散型<適格機関投資家限定> | 117,223,907円 |
| S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用> | 1,014,133,750円 |
| S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用> | 1,376,833,275円 |
| S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用> | 1,520,894,654円 |
| S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用> | 4,660,449,956円 |
| S M A M・バランスV A株4 0 T<適格機関投資家限定> | 627,347円 |
| S M A M・外国債券パッシブファンドV A<適格機関投資家限定> | 7,806,718,281円 |
| 三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用) | 319,831,085円 |
| S M A M・グローバルバランス4 0 V A<適格機関投資家限定> | 140,778,313円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A<適格機関投資家専用> | 78,444,198円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A<適格機関投資家専用> | 33,971,193円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用> | 11,926,289円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L<適格機関投資家専用> | 95,205,741円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L<適格機関投資家専用> | 404,375,583円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2<適格機関投資家専用> | 98,336,933円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2<適格機関投資家専用> | 39,422,989円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2<適格機関投資家専用> | 5,252,180円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2<適格機関投資家専用> | 991,937,006円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(標準型) V A<適格機関投資家限定> | 577,077,596円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(債券重視型) V A<適格機関投資家限定> | 847,744,078円 |
| S M A M・世界バランスファンドV A<適格機関投資家限定> | 754,418,443円 |
| S M A M・世界バランスファンドV A 2<適格機関投資家限定> | 341,578,053円 |
| S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 190,502,250円 |
| S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4<適格機関投資家限定> | 124,850,498円 |
| S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 159,858,275円 |
| S M A M・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定> | 211,033,507円 |
| 合 計 | 78,572,267,228円 |

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)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 | | T 0.125 02/15/24 | 7,700,000.00 | 7,363,664.00 | |

| | | | | |
|-----------------|------------------|--------------|--------------|--|
| アメリカ・ドル | T 0.125 07/15/23 | 4,300,000.00 | 4,190,479.00 | |
| | T 0.125 08/15/23 | 8,000,000.00 | 7,774,960.00 | |
| | T 0.125 10/15/23 | 5,700,000.00 | 5,512,926.00 | |
| | T 0.25 04/15/23 | 5,000,000.00 | 4,914,450.00 | |
| | T 0.25 06/15/23 | 7,700,000.00 | 7,539,917.00 | |
| | T 0.25 06/30/25 | 2,400,000.00 | 2,212,104.00 | |
| | T 0.25 07/31/25 | 3,300,000.00 | 3,033,921.00 | |
| | T 0.25 09/30/25 | 2,000,000.00 | 1,830,620.00 | |
| | T 0.25 11/15/23 | 3,000,000.00 | 2,901,090.00 | |
| | T 0.375 04/30/25 | 200,000.00 | 185,976.00 | |
| | T 0.375 07/31/27 | 4,700,000.00 | 4,130,830.00 | |
| | T 0.375 09/15/24 | 3,000,000.00 | 2,835,690.00 | |
| | T 0.375 09/30/27 | 4,800,000.00 | 4,201,104.00 | |
| | T 0.375 11/30/25 | 2,000,000.00 | 1,830,000.00 | |
| | T 0.375 12/31/25 | 3,000,000.00 | 2,739,360.00 | |
| | T 0.5 03/31/25 | 600,000.00 | 561,114.00 | |
| | T 0.5 04/30/27 | 200,000.00 | 178,014.00 | |
| | T 0.5 05/31/27 | 3,000,000.00 | 2,662,830.00 | |
| | T 0.5 06/30/27 | 4,400,000.00 | 3,898,620.00 | |
| | T 0.625 03/31/27 | 600,000.00 | 538,146.00 | |
| | T 0.625 05/15/30 | 7,500,000.00 | 6,319,275.00 | |
| | T 0.625 07/31/26 | 3,600,000.00 | 3,275,280.00 | |
| | T 0.625 08/15/30 | 8,800,000.00 | 7,374,048.00 | |
| | T 0.625 10/15/24 | 4,400,000.00 | 4,176,216.00 | |
| | T 0.625 11/30/27 | 2,100,000.00 | 1,855,707.00 | |
| | T 0.625 12/31/27 | 7,200,000.00 | 6,350,616.00 | |
| | T 0.75 01/31/28 | 6,700,000.00 | 5,937,339.00 | |
| | T 0.75 11/15/24 | 5,200,000.00 | 4,940,988.00 | |
| | T 0.875 11/15/30 | 7,000,000.00 | 5,972,960.00 | |
| | T 1 07/31/28 | 5,900,000.00 | 5,263,390.00 | |
| | T 1 12/15/24 | 4,500,000.00 | 4,296,960.00 | |
| | T 1.125 02/15/31 | 8,500,000.00 | 7,387,010.00 | |
| | T 1.125 02/28/25 | 1,500,000.00 | 1,431,615.00 | |
| | T 1.125 02/28/27 | 2,000,000.00 | 1,843,280.00 | |
| | T 1.125 05/15/40 | 2,000,000.00 | 1,462,500.00 | |
| | T 1.125 08/15/40 | 700,000.00 | 509,250.00 | |
| | T 1.125 08/31/28 | 3,500,000.00 | 3,142,335.00 | |
| | T 1.25 05/15/50 | 5,100,000.00 | 3,459,228.00 | |
| | T 1.25 06/30/28 | 3,000,000.00 | 2,721,540.00 | |
| | T 1.25 07/31/23 | 3,000,000.00 | 2,962,710.00 | |
| T 1.25 08/15/31 | 5,500,000.00 | 4,795,285.00 | | |
| T 1.25 09/30/28 | 4,500,000.00 | 4,067,190.00 | | |
| T 1.25 11/30/26 | 4,200,000.00 | 3,907,470.00 | | |
| T 1.25 12/31/26 | 2,300,000.00 | 2,136,562.00 | | |

| | | | |
|------------------|---------------|---------------|--|
| T 1.375 01/31/25 | 1,900,000.00 | 1,828,294.00 | |
| T 1.375 06/30/23 | 500,000.00 | 495,000.00 | |
| T 1.375 08/15/50 | 4,500,000.00 | 3,150,315.00 | |
| T 1.375 08/31/23 | 2,500,000.00 | 2,468,750.00 | |
| T 1.375 08/31/26 | 7,100,000.00 | 6,666,190.00 | |
| T 1.375 09/30/23 | 3,000,000.00 | 2,959,200.00 | |
| T 1.375 10/31/28 | 6,000,000.00 | 5,463,240.00 | |
| T 1.375 11/15/31 | 4,900,000.00 | 4,308,521.00 | |
| T 1.375 11/15/40 | 2,000,000.00 | 1,517,960.00 | |
| T 1.375 12/31/28 | 2,500,000.00 | 2,273,625.00 | |
| T 1.5 01/31/27 | 2,400,000.00 | 2,254,008.00 | |
| T 1.5 02/15/30 | 4,500,000.00 | 4,086,900.00 | |
| T 1.5 03/31/23 | 1,500,000.00 | 1,493,250.00 | |
| T 1.5 10/31/24 | 5,500,000.00 | 5,329,390.00 | |
| T 1.5 11/30/24 | 800,000.00 | 774,432.00 | |
| T 1.5 11/30/28 | 2,300,000.00 | 2,109,698.00 | |
| T 1.625 02/15/26 | 2,900,000.00 | 2,770,631.00 | |
| T 1.625 04/30/23 | 3,000,000.00 | 2,986,170.00 | |
| T 1.625 05/15/26 | 14,950,000.00 | 14,236,287.00 | |
| T 1.625 05/15/31 | 4,300,000.00 | 3,891,156.00 | |
| T 1.625 05/31/23 | 3,000,000.00 | 2,984,040.00 | |
| T 1.625 08/15/29 | 2,450,000.00 | 2,256,278.50 | |
| T 1.625 09/30/26 | 3,900,000.00 | 3,699,501.00 | |
| T 1.625 10/31/23 | 3,000,000.00 | 2,966,250.00 | |
| T 1.625 11/15/50 | 3,200,000.00 | 2,391,232.00 | |
| T 1.625 11/30/26 | 200,000.00 | 189,358.00 | |
| T 1.75 01/31/29 | 4,300,000.00 | 4,004,676.00 | |
| T 1.75 03/15/25 | 1,500,000.00 | 1,456,230.00 | |
| T 1.75 05/15/23 | 2,700,000.00 | 2,690,280.00 | |
| T 1.75 06/30/24 | 6,200,000.00 | 6,076,434.00 | |
| T 1.75 07/31/24 | 850,000.00 | 832,201.00 | |
| T 1.75 08/15/41 | 3,500,000.00 | 2,811,725.00 | |
| T 1.75 11/15/29 | 4,000,000.00 | 3,712,480.00 | |
| T 1.75 12/31/26 | 3,500,000.00 | 3,329,375.00 | |
| T 1.875 02/15/32 | 4,200,000.00 | 3,861,018.00 | |
| T 1.875 02/15/51 | 5,800,000.00 | 4,618,250.00 | |
| T 1.875 02/28/27 | 1,200,000.00 | 1,146,600.00 | |
| T 1.875 02/28/29 | 2,800,000.00 | 2,628,920.00 | |
| T 1.875 08/31/24 | 3,800,000.00 | 3,725,482.00 | |
| T 1.875 11/15/51 | 1,300,000.00 | 1,035,528.00 | |
| T 2 02/15/25 | 3,500,000.00 | 3,423,980.00 | |
| T 2 02/15/50 | 2,800,000.00 | 2,296,644.00 | |
| T 2 04/30/24 | 2,000,000.00 | 1,975,000.00 | |
| T 2 05/31/24 | 3,300,000.00 | 3,255,384.00 | |

| | | | |
|------------------|---------------|---------------|--|
| T 2 06/30/24 | 4,100,000.00 | 4,040,099.00 | |
| T 2 08/15/25 | 4,300,000.00 | 4,187,770.00 | |
| T 2 08/15/51 | 4,700,000.00 | 3,854,000.00 | |
| T 2 11/15/26 | 5,000,000.00 | 4,809,750.00 | |
| T 2.125 02/29/24 | 2,000,000.00 | 1,982,500.00 | |
| T 2.125 03/31/24 | 6,500,000.00 | 6,436,495.00 | |
| T 2.125 05/15/25 | 1,900,000.00 | 1,861,107.00 | |
| T 2.125 07/31/24 | 3,500,000.00 | 3,455,410.00 | |
| T 2.125 09/30/24 | 4,000,000.00 | 3,941,240.00 | |
| T 2.125 11/30/23 | 3,100,000.00 | 3,085,461.00 | |
| T 2.125 11/30/24 | 2,600,000.00 | 2,556,918.00 | |
| T 2.25 01/31/24 | 2,200,000.00 | 2,185,898.00 | |
| T 2.25 02/15/27 | 4,400,000.00 | 4,275,876.00 | |
| T 2.25 02/15/52 | 700,000.00 | 610,582.00 | |
| T 2.25 03/31/26 | 13,300,000.00 | 12,994,499.00 | |
| T 2.25 04/30/24 | 3,800,000.00 | 3,771,196.00 | |
| T 2.25 05/15/41 | 3,000,000.00 | 2,634,600.00 | |
| T 2.25 08/15/27 | 4,200,000.00 | 4,073,328.00 | |
| T 2.25 08/15/46 | 2,450,000.00 | 2,106,608.00 | |
| T 2.25 08/15/49 | 3,500,000.00 | 3,043,355.00 | |
| T 2.25 10/31/24 | 800,000.00 | 789,808.00 | |
| T 2.25 11/15/24 | 5,100,000.00 | 5,033,445.00 | |
| T 2.25 11/15/25 | 4,000,000.00 | 3,920,920.00 | |
| T 2.25 11/15/27 | 4,400,000.00 | 4,259,024.00 | |
| T 2.25 12/31/23 | 3,000,000.00 | 2,985,450.00 | |
| T 2.25 12/31/24 | 3,900,000.00 | 3,845,127.00 | |
| T 2.375 02/15/42 | 3,600,000.00 | 3,223,656.00 | |
| T 2.375 02/29/24 | 3,700,000.00 | 3,684,090.00 | |
| T 2.375 05/15/27 | 1,000,000.00 | 977,140.00 | |
| T 2.375 05/15/29 | 400,000.00 | 387,812.00 | |
| T 2.375 05/15/51 | 1,400,000.00 | 1,251,572.00 | |
| T 2.375 08/15/24 | 5,600,000.00 | 5,553,576.00 | |
| T 2.375 11/15/49 | 1,900,000.00 | 1,699,303.00 | |
| T 2.5 01/31/25 | 3,400,000.00 | 3,373,548.00 | |
| T 2.5 02/15/45 | 3,600,000.00 | 3,241,656.00 | |
| T 2.5 02/15/46 | 2,900,000.00 | 2,617,250.00 | |
| T 2.5 02/28/26 | 8,500,000.00 | 8,380,405.00 | |
| T 2.5 05/15/24 | 5,700,000.00 | 5,683,470.00 | |
| T 2.5 05/15/46 | 3,600,000.00 | 3,249,828.00 | |
| T 2.5 08/15/23 | 5,000,000.00 | 5,013,650.00 | |
| T 2.625 01/31/26 | 2,700,000.00 | 2,676,375.00 | |
| T 2.625 02/15/29 | 1,800,000.00 | 1,773,414.00 | |
| T 2.625 03/31/25 | 1,000,000.00 | 994,680.00 | |
| T 2.625 12/31/23 | 1,900,000.00 | 1,902,660.00 | |

| | | | |
|------------------|--------------|--------------|--|
| T 2.625 12/31/25 | 4,400,000.00 | 4,363,040.00 | |
| T 2.75 02/15/24 | 5,100,000.00 | 5,111,934.00 | |
| T 2.75 02/15/28 | 4,800,000.00 | 4,766,976.00 | |
| T 2.75 02/28/25 | 2,000,000.00 | 1,996,700.00 | |
| T 2.75 04/30/23 | 2,900,000.00 | 2,920,155.00 | |
| T 2.75 05/31/23 | 1,000,000.00 | 1,006,560.00 | |
| T 2.75 06/30/25 | 4,600,000.00 | 4,587,948.00 | |
| T 2.75 07/31/23 | 2,000,000.00 | 2,012,020.00 | |
| T 2.75 08/15/42 | 2,000,000.00 | 1,891,160.00 | |
| T 2.75 08/15/47 | 3,600,000.00 | 3,427,020.00 | |
| T 2.75 08/31/23 | 3,800,000.00 | 3,820,178.00 | |
| T 2.75 08/31/25 | 2,100,000.00 | 2,093,595.00 | |
| T 2.75 11/15/23 | 4,200,000.00 | 4,218,690.00 | |
| T 2.75 11/15/42 | 300,000.00 | 283,263.00 | |
| T 2.75 11/15/47 | 1,500,000.00 | 1,427,460.00 | |
| T 2.875 04/30/25 | 2,200,000.00 | 2,203,256.00 | |
| T 2.875 05/15/28 | 9,000,000.00 | 9,000,630.00 | |
| T 2.875 05/15/43 | 2,400,000.00 | 2,308,872.00 | |
| T 2.875 05/15/49 | 1,400,000.00 | 1,380,750.00 | |
| T 2.875 05/31/25 | 1,100,000.00 | 1,101,452.00 | |
| T 2.875 08/15/28 | 4,500,000.00 | 4,501,035.00 | |
| T 2.875 08/15/45 | 3,300,000.00 | 3,177,768.00 | |
| T 2.875 10/31/23 | 1,000,000.00 | 1,007,100.00 | |
| T 2.875 11/15/46 | 300,000.00 | 290,904.00 | |
| T 2.875 11/30/23 | 2,000,000.00 | 2,011,860.00 | |
| T 2.875 11/30/25 | 2,500,000.00 | 2,502,325.00 | |
| T 3 02/15/47 | 2,500,000.00 | 2,480,075.00 | |
| T 3 02/15/48 | 2,400,000.00 | 2,403,168.00 | |
| T 3 02/15/49 | 3,300,000.00 | 3,330,657.00 | |
| T 3 05/15/42 | 800,000.00 | 789,184.00 | |
| T 3 05/15/45 | 3,000,000.00 | 2,949,600.00 | |
| T 3 05/15/47 | 1,800,000.00 | 1,787,904.00 | |
| T 3 08/15/48 | 900,000.00 | 901,404.00 | |
| T 3 09/30/25 | 4,000,000.00 | 4,024,040.00 | |
| T 3 10/31/25 | 3,100,000.00 | 3,118,135.00 | |
| T 3 11/15/44 | 3,500,000.00 | 3,437,630.00 | |
| T 3 11/15/45 | 2,700,000.00 | 2,660,553.00 | |
| T 3.125 02/15/42 | 1,000,000.00 | 1,006,250.00 | |
| T 3.125 02/15/43 | 2,300,000.00 | 2,303,220.00 | |
| T 3.125 05/15/48 | 2,400,000.00 | 2,464,488.00 | |
| T 3.125 08/15/44 | 3,300,000.00 | 3,303,861.00 | |
| T 3.125 11/15/28 | 2,900,000.00 | 2,943,500.00 | |
| T 3.375 05/15/44 | 3,000,000.00 | 3,124,200.00 | |
| T 3.375 11/15/48 | 3,100,000.00 | 3,337,088.00 | |

| | | | | | |
|-----------|------------|----------------|------------------------------------|--------------|--|
| T 3.5 | 02/15/39 | 200,000.00 | 214,906.00 | | |
| T 3.625 | 02/15/44 | 3,600,000.00 | 3,895,308.00 | | |
| T 3.625 | 08/15/43 | 2,400,000.00 | 2,594,520.00 | | |
| T 3.75 | 08/15/41 | 1,500,000.00 | 1,648,125.00 | | |
| T 3.75 | 11/15/43 | 700,000.00 | 770,819.00 | | |
| T 3.875 | 08/15/40 | 500,000.00 | 559,175.00 | | |
| T 4.25 | 05/15/39 | 100,000.00 | 117,648.00 | | |
| T 4.25 | 11/15/40 | 600,000.00 | 702,468.00 | | |
| T 4.375 | 05/15/40 | 900,000.00 | 1,073,952.00 | | |
| T 4.375 | 05/15/41 | 300,000.00 | 356,835.00 | | |
| T 4.375 | 11/15/39 | 700,000.00 | 834,036.00 | | |
| T 4.5 | 08/15/39 | 300,000.00 | 363,750.00 | | |
| T 4.625 | 02/15/40 | 1,100,000.00 | 1,353,935.00 | | |
| T 4.75 | 02/15/41 | 900,000.00 | 1,122,750.00 | | |
| T 5.25 | 11/15/28 | 500,000.00 | 570,935.00 | | |
| T 5.375 | 02/15/31 | 320,000.00 | 383,974.40 | | |
| T 6 | 02/15/26 | 1,000,000.00 | 1,114,060.00 | | |
| T 6.25 | 08/15/23 | 800,000.00 | 840,432.00 | | |
| T-BOND | 15/11/2027 | 1,000,000.00 | 1,166,320.00 | | |
| アメリカ・ドル小計 | | 629,920,000.00 | 596,940,559.90 (76,169,615,443) | | |
| カナダ・ドル | CAN 0.5 | 09/01/25 | 2,700,000.00 | 2,512,809.00 | |
| | CAN 1 | 06/01/27 | 600,000.00 | 552,672.00 | |
| | CAN 1.25 | 06/01/30 | 6,000,000.00 | 5,346,360.00 | |
| | CAN 1.5 | 06/01/23 | 1,200,000.00 | 1,188,828.00 | |
| | CAN 1.5 | 06/01/26 | 3,200,000.00 | 3,057,344.00 | |
| | CAN 1.5 | 09/01/24 | 2,000,000.00 | 1,951,900.00 | |
| | CAN 1.5 | 12/01/31 | 400,000.00 | 356,568.00 | |
| | CAN 1.75 | 12/01/53 | 500,000.00 | 392,245.00 | |
| | CAN 2 | 06/01/28 | 700,000.00 | 673,505.00 | |
| | CAN 2 | 09/01/23 | 1,200,000.00 | 1,193,448.00 | |
| | CAN 2.25 | 03/01/24 | 1,000,000.00 | 995,220.00 | |
| | CAN 2.25 | 06/01/25 | 1,000,000.00 | 988,850.00 | |
| | CAN 2.25 | 06/01/29 | 1,900,000.00 | 1,843,361.00 | |
| | CAN 2.5 | 06/01/24 | 2,100,000.00 | 2,097,564.00 | |
| | CAN 2.75 | 12/01/48 | 1,300,000.00 | 1,291,563.00 | |
| | CAN 3.5 | 12/01/45 | 1,200,000.00 | 1,340,580.00 | |
| | CAN 4 | 06/01/41 | 1,800,000.00 | 2,102,868.00 | |
| | CAN 5 | 06/01/37 | 1,450,000.00 | 1,827,058.00 | |
| | CAN 5.75 | 06/01/29 | 250,000.00 | 298,577.50 | |
| | CAN 5.75 | 06/01/33 | 400,000.00 | 509,772.00 | |
| CANADA | 2.75 | 12/01/64 | 700,000.00 | 686,917.00 | |
| カナダ・ドル小計 | | 31,600,000.00 | 31,208,009.50 (3,127,354,632) | | |

| | | | | |
|-------------------|---------------------|---------------|----------------------------------|--|
| オーストラリア・ドル | ACGB 0.25 11/21/25 | 800,000.00 | 730,808.00 | |
| | ACGB 1.5 06/21/31 | 2,800,000.00 | 2,444,232.00 | |
| | ACGB 1.75 06/21/51 | 500,000.00 | 340,285.00 | |
| | ACGB 2.25 05/21/28 | 2,400,000.00 | 2,300,280.00 | |
| | ACGB 2.5 05/21/30 | 2,250,000.00 | 2,158,897.50 | |
| | ACGB 2.75 04/21/24 | 2,500,000.00 | 2,517,775.00 | |
| | ACGB 2.75 06/21/35 | 800,000.00 | 757,744.00 | |
| | ACGB 2.75 11/21/27 | 900,000.00 | 889,902.00 | |
| | ACGB 2.75 11/21/28 | 200,000.00 | 196,750.00 | |
| | ACGB 2.75 11/21/29 | 2,500,000.00 | 2,448,900.00 | |
| | ACGB 3 03/21/47 | 1,200,000.00 | 1,098,348.00 | |
| | ACGB 3.25 04/21/25 | 1,300,000.00 | 1,320,605.00 | |
| | ACGB 3.25 04/21/29 | 800,000.00 | 810,768.00 | |
| | ACGB 3.25 06/21/39 | 2,550,000.00 | 2,499,025.50 | |
| | ACGB 3.75 04/21/37 | 1,200,000.00 | 1,260,456.00 | |
| | ACGB 4.25 04/21/26 | 2,650,000.00 | 2,790,423.50 | |
| | ACGB 4.5 04/21/33 | 1,100,000.00 | 1,238,413.00 | |
| ACGB 5.5 04/21/23 | 900,000.00 | 933,579.00 | | |
| オーストラリア・ドル小計 | | 27,350,000.00 | 26,737,191.50 (2,453,672,064) | |
| シンガポール・ドル | SIGB 1.25 11/01/26 | 100,000.00 | 95,510.00 | |
| | SIGB 1.625 07/01/31 | 200,000.00 | 185,562.00 | |
| | SIGB 2.25 08/01/36 | 1,200,000.00 | 1,135,020.00 | |
| | SIGB 2.625 05/01/28 | 800,000.00 | 809,600.00 | |
| | SIGB 2.75 03/01/46 | 700,000.00 | 698,950.00 | |
| | SIGB 2.75 04/01/42 | 400,000.00 | 399,384.00 | |
| | SIGB 2.75 07/01/23 | 1,200,000.00 | 1,214,520.00 | |
| | SIGB 2.875 09/01/30 | 200,000.00 | 205,400.00 | |
| | SIGB 3 09/01/24 | 100,000.00 | 102,180.00 | |
| | SIGB 3.375 09/01/33 | 750,000.00 | 802,500.00 | |
| | SIGB 3.5 03/01/27 | 1,500,000.00 | 1,575,060.00 | |
| シンガポール・ドル小計 | | 7,150,000.00 | 7,223,686.00 (671,513,851) | |
| イギリス・ポンド | UK TSY GILT | 400,000.00 | 348,720.00 | |
| | UKT 0.125 01/30/26 | 1,500,000.00 | 1,420,140.00 | |
| | UKT 0.25 01/31/25 | 300,000.00 | 288,555.00 | |
| | UKT 0.25 07/31/31 | 1,600,000.00 | 1,385,136.00 | |
| | UKT 0.375 10/22/30 | 1,800,000.00 | 1,605,366.00 | |
| | UKT 0.5 01/31/29 | 700,000.00 | 644,966.00 | |
| | UKT 0.5 10/22/61 | 100,000.00 | 64,036.00 | |
| | UKT 0.625 06/07/25 | 800,000.00 | 776,680.00 | |
| | UKT 0.625 07/31/35 | 600,000.00 | 503,142.00 | |
| | UKT 0.75 07/22/23 | 1,700,000.00 | 1,685,448.00 | |
| | UKT 0.875 10/22/29 | 500,000.00 | 470,275.00 | |

| | | | |
|--------------------|---------------------|---------------|----------------------------------|
| UKT 1 04/22/24 | 800,000.00 | 791,336.00 | |
| UKT 1.125 10/22/73 | 300,000.00 | 245,007.00 | |
| UKT 1.25 07/22/27 | 200,000.00 | 196,260.00 | |
| UKT 1.5 07/22/26 | 1,100,000.00 | 1,095,039.00 | |
| UKT 1.5 07/22/47 | 2,000,000.00 | 1,810,200.00 | |
| UKT 1.625 10/22/28 | 900,000.00 | 898,569.00 | |
| UKT 1.625 10/22/54 | 500,000.00 | 467,430.00 | |
| UKT 1.75 01/22/49 | 850,000.00 | 813,220.50 | |
| UKT 1.75 09/07/37 | 100,000.00 | 96,433.00 | |
| UKT 2 09/07/25 | 1,100,000.00 | 1,114,663.00 | |
| UKT 2.25 09/07/23 | 2,700,000.00 | 2,726,325.00 | |
| UKT 2.5 07/22/65 | 1,600,000.00 | 1,955,616.00 | |
| UKT 2.75 09/07/24 | 900,000.00 | 924,003.00 | |
| UKT 3.25 01/22/44 | 1,600,000.00 | 1,944,768.00 | |
| UKT 3.5 01/22/45 | 1,250,000.00 | 1,587,475.00 | |
| UKT 3.5 07/22/68 | 1,450,000.00 | 2,244,498.50 | |
| UKT 3.75 07/22/52 | 1,200,000.00 | 1,697,016.00 | |
| UKT 4 01/22/60 | 1,600,000.00 | 2,556,560.00 | |
| UKT 4.25 03/07/36 | 900,000.00 | 1,146,447.00 | |
| UKT 4.25 06/07/32 | 300,000.00 | 366,315.00 | |
| UKT 4.25 09/07/39 | 750,000.00 | 996,817.50 | |
| UKT 4.25 12/07/27 | 900,000.00 | 1,023,552.00 | |
| UKT 4.25 12/07/40 | 600,000.00 | 807,336.00 | |
| UKT 4.25 12/07/46 | 1,500,000.00 | 2,148,315.00 | |
| UKT 4.25 12/07/49 | 900,000.00 | 1,335,870.00 | |
| UKT 4.25 12/07/55 | 1,700,000.00 | 2,703,034.00 | |
| UKT 4.5 09/07/34 | 1,100,000.00 | 1,406,603.00 | |
| UKT 4.5 12/07/42 | 1,250,000.00 | 1,771,987.50 | |
| UKT 4.75 12/07/30 | 1,150,000.00 | 1,426,540.50 | |
| UKT 4.75 12/07/38 | 1,000,000.00 | 1,390,370.00 | |
| UKT 5 03/07/25 | 1,300,000.00 | 1,420,367.00 | |
| UKT 6 12/07/28 | 650,000.00 | 825,064.50 | |
| イギリス・ポンド小計 | | 44,150,000.00 | 51,125,502.00 (8,315,051,644) |
| イスラエル・シケル | ILGOV 0.15 07/31/23 | 5,800,000.00 | 5,724,484.00 |
| | ILGOV 1.5 11/30/23 | 2,200,000.00 | 2,205,698.00 |
| | ILGOV 2.25 09/28/28 | 1,500,000.00 | 1,504,995.00 |
| | ILGOV 3.75 03/31/47 | 4,000,000.00 | 4,459,200.00 |
| | ILGOV 6.25 10/30/26 | 2,900,000.00 | 3,434,180.00 |
| イスラエル・シケル小計 | | 16,400,000.00 | 17,328,557.00 (673,259,494) |
| デンマーク・クローネ | DGB 0.25 11/15/52 | 1,800,000.00 | 1,327,050.00 |
| | DGB 0.5 11/15/27 | 8,500,000.00 | 8,316,485.00 |
| | DGB 0.5 11/15/29 | 4,300,000.00 | 4,146,705.00 |

| | | | | |
|---------------------|---------------------|----------------|-----------------------------------|--|
| | DGB 1.5 11/15/23 | 3,000,000.00 | 3,069,330.00 | |
| | DGB 1.75 11/15/25 | 3,100,000.00 | 3,215,537.00 | |
| | DGB 4.5 11/15/39 | 9,500,000.00 | 14,354,500.00 | |
| | デンマーク・クローネ小計 | 30,200,000.00 | 34,429,607.00 (633,504,769) | |
| ノル ウェー・ クローネ | NGB 1.375 08/19/30 | 3,200,000.00 | 2,887,584.00 | |
| | NGB 1.5 02/19/26 | 3,500,000.00 | 3,368,225.00 | |
| | NGB 1.75 03/13/25 | 3,000,000.00 | 2,941,530.00 | |
| | NGB 1.75 09/06/29 | 4,200,000.00 | 3,939,348.00 | |
| | NGB 2 04/26/28 | 9,000,000.00 | 8,686,440.00 | |
| | NGB 2 05/24/23 | 3,300,000.00 | 3,311,847.00 | |
| | NGB 3 03/14/24 | 4,300,000.00 | 4,365,016.00 | |
| | ノルウェー・クローネ小計 | 30,500,000.00 | 29,499,990.00 (413,294,860) | |
| スウェー デン・ク ローナ | SGB 0.75 05/12/28 | 3,700,000.00 | 3,550,002.00 | |
| | SGB 0.75 11/12/29 | 6,400,000.00 | 6,058,112.00 | |
| | SGB 1 11/12/26 | 5,800,000.00 | 5,706,852.00 | |
| | SGB 1.5 11/13/23 | 6,900,000.00 | 6,965,343.00 | |
| | SGB 2.5 05/12/25 | 5,000,000.00 | 5,189,150.00 | |
| | SGB 3.5 03/30/39 | 4,600,000.00 | 5,824,106.00 | |
| | スウェーデン・クローナ小 計 | 32,400,000.00 | 33,293,565.00 (437,810,380) | |
| メキシ コ・ペソ | MBONO 10 12/05/24 | 32,000,000.00 | 32,706,560.00 | |
| | MBONO 5.75 03/05/26 | 19,000,000.00 | 17,001,390.00 | |
| | MBONO 7.5 06/03/27 | 25,000,000.00 | 23,574,250.00 | |
| | MBONO 7.75 05/29/31 | 5,000,000.00 | 4,649,000.00 | |
| | MBONO 7.75 11/23/34 | 18,000,000.00 | 16,427,520.00 | |
| | MBONO 8 11/07/47 | 5,000,000.00 | 4,508,850.00 | |
| | MBONO 8 12/07/23 | 21,000,000.00 | 20,733,510.00 | |
| | MBONO 8.5 05/31/29 | 23,000,000.00 | 22,545,290.00 | |
| | MBONO 8.5 11/18/38 | 40,000,000.00 | 38,590,800.00 | |
| | メキシコ・ペソ小計 | 188,000,000.00 | 180,737,170.00 (1,140,578,059) | |
| オフショ ア・人民 元 | CGB 2.26 02/24/25 | 5,000,000.00 | 4,983,000.00 | |
| | CGB 2.47 09/02/24 | 26,000,000.00 | 26,072,280.00 | |
| | CGB 2.56 10/21/23 | 11,000,000.00 | 11,064,570.00 | |
| | CGB 2.69 08/12/26 | 32,000,000.00 | 32,150,400.00 | |
| | CGB 2.8 03/24/29 | 3,000,000.00 | 2,993,850.00 | |
| | CGB 2.91 10/14/28 | 14,000,000.00 | 14,098,840.00 | |
| | CGB 3.02 05/27/31 | 17,000,000.00 | 17,195,670.00 | |
| | CGB 3.72 04/12/51 | 11,000,000.00 | 11,728,640.00 | |
| | オフショア・人民元小計 | 119,000,000.00 | 120,287,250.00 (2,335,918,250) | |
| | MALAYSIA GOVT | 700,000.00 | 701,519.00 | |
| | MALAYSIA GOVT | 700,000.00 | 701,435.00 | |

| | | | | |
|--------------------|---------------------|---------------|--------------------------------|--|
| マレーシア・リングット | MGS 3.502 05/31/27 | 7,900,000.00 | 7,762,856.00 | |
| | MGS 3.955 09/15/25 | 4,700,000.00 | 4,742,488.00 | |
| | MGS 4.498 04/15/30 | 6,000,000.00 | 6,046,620.00 | |
| | MGS 4.736 03/15/46 | 6,700,000.00 | 6,451,765.00 | |
| マレーシア・リングット小計 | | 26,700,000.00 | 26,406,683.00 (774,378,620) | |
| ポーランド・ズロチ | POLGB 0 04/25/23 | 300,000.00 | 284,160.00 | |
| | POLGB 0.25 10/25/26 | 7,000,000.00 | 5,313,000.00 | |
| | POLGB 0.75 04/25/25 | 1,800,000.00 | 1,523,520.00 | |
| | POLGB 1.25 10/25/30 | 6,500,000.00 | 4,468,750.00 | |
| | POLGB 2.25 10/25/24 | 12,500,000.00 | 11,288,750.00 | |
| ポーランド・ズロチ小計 | | 28,100,000.00 | 22,878,180.00 (674,604,318) | |
| ユーロ | BGB 0 10/22/31 | 1,300,000.00 | 1,152,112.00 | |
| | BGB 0.1 06/22/30 | 700,000.00 | 645,568.00 | |
| | BGB 0.4 06/22/40 | 300,000.00 | 237,834.00 | |
| | BGB 0.5 10/22/24 | 1,300,000.00 | 1,305,993.00 | |
| | BGB 0.65 06/22/71 | 400,000.00 | 237,760.00 | |
| | BGB 0.8 06/22/25 | 300,000.00 | 302,994.00 | |
| | BGB 0.8 06/22/27 | 1,000,000.00 | 1,000,290.00 | |
| | BGB 0.8 06/22/28 | 1,600,000.00 | 1,591,776.00 | |
| | BGB 0.9 06/22/29 | 900,000.00 | 893,565.00 | |
| | BGB 1 06/22/26 | 1,800,000.00 | 1,826,982.00 | |
| | BGB 1 06/22/31 | 1,300,000.00 | 1,277,848.00 | |
| | BGB 1.25 04/22/33 | 1,200,000.00 | 1,195,656.00 | |
| | BGB 1.45 06/22/37 | 400,000.00 | 389,880.00 | |
| | BGB 1.6 06/22/47 | 650,000.00 | 619,976.50 | |
| | BGB 1.7 06/22/50 | 500,000.00 | 484,105.00 | |
| | BGB 1.9 06/22/38 | 1,000,000.00 | 1,038,530.00 | |
| | BGB 2.15 06/22/66 | 500,000.00 | 536,845.00 | |
| | BGB 2.25 06/22/23 | 1,300,000.00 | 1,337,310.00 | |
| | BGB 2.25 06/22/57 | 500,000.00 | 547,915.00 | |
| | BGB 2.6 06/22/24 | 800,000.00 | 840,928.00 | |
| | BGB 3 06/22/34 | 200,000.00 | 234,372.00 | |
| | BGB 3.75 06/22/45 | 800,000.00 | 1,090,656.00 | |
| | BGB 4 03/28/32 | 500,000.00 | 626,880.00 | |
| | BGB 4.25 03/28/41 | 1,000,000.00 | 1,395,620.00 | |
| | BGB 4.5 03/28/26 | 700,000.00 | 807,506.00 | |
| | BGB 5 03/28/35 | 1,000,000.00 | 1,407,040.00 | |
| | BGB 5.5 03/28/28 | 1,100,000.00 | 1,400,201.00 | |
| BTPS 0 12/15/24 | 1,300,000.00 | 1,261,481.00 | | |
| BTPS 0.35 02/01/25 | 2,400,000.00 | 2,349,528.00 | | |
| BTPS 0.5 02/01/26 | 1,000,000.00 | 965,970.00 | | |
| BTPS 0.65 10/15/23 | 2,000,000.00 | 2,010,820.00 | | |

| | | | |
|--------------------|--------------|--------------|--|
| BTPS 0.85 01/15/27 | 1,700,000.00 | 1,637,678.00 | |
| BTPS 0.9 04/01/31 | 2,000,000.00 | 1,750,480.00 | |
| BTPS 0.95 08/01/30 | 1,800,000.00 | 1,611,000.00 | |
| BTPS 0.95 09/15/27 | 800,000.00 | 765,472.00 | |
| BTPS 0.95 12/01/31 | 1,100,000.00 | 953,150.00 | |
| BTPS 1.25 12/01/26 | 800,000.00 | 787,288.00 | |
| BTPS 1.45 03/01/36 | 1,100,000.00 | 942,480.00 | |
| BTPS 1.45 05/15/25 | 700,000.00 | 704,207.00 | |
| BTPS 1.45 11/15/24 | 1,800,000.00 | 1,815,102.00 | |
| BTPS 1.5 06/01/25 | 2,700,000.00 | 2,722,815.00 | |
| BTPS 1.6 06/01/26 | 1,200,000.00 | 1,204,320.00 | |
| BTPS 1.65 12/01/30 | 2,200,000.00 | 2,071,652.00 | |
| BTPS 1.7 09/01/51 | 1,500,000.00 | 1,124,565.00 | |
| BTPS 1.85 05/15/24 | 3,000,000.00 | 3,064,890.00 | |
| BTPS 1.85 07/01/25 | 1,000,000.00 | 1,015,940.00 | |
| BTPS 2 02/01/28 | 3,900,000.00 | 3,929,016.00 | |
| BTPS 2 12/01/25 | 1,300,000.00 | 1,327,937.00 | |
| BTPS 2.05 08/01/27 | 1,500,000.00 | 1,519,635.00 | |
| BTPS 2.1 07/15/26 | 1,000,000.00 | 1,022,850.00 | |
| BTPS 2.2 06/01/27 | 900,000.00 | 920,718.00 | |
| BTPS 2.25 09/01/36 | 500,000.00 | 472,865.00 | |
| BTPS 2.45 09/01/33 | 1,100,000.00 | 1,086,250.00 | |
| BTPS 2.45 09/01/50 | 900,000.00 | 800,100.00 | |
| BTPS 2.5 11/15/25 | 2,100,000.00 | 2,182,089.00 | |
| BTPS 2.5 12/01/24 | 1,300,000.00 | 1,349,205.00 | |
| BTPS 2.7 03/01/47 | 1,550,000.00 | 1,484,667.50 | |
| BTPS 2.8 03/01/67 | 600,000.00 | 544,614.00 | |
| BTPS 2.8 12/01/28 | 1,000,000.00 | 1,048,530.00 | |
| BTPS 2.95 09/01/38 | 800,000.00 | 816,072.00 | |
| BTPS 3 08/01/29 | 2,700,000.00 | 2,852,010.00 | |
| BTPS 3.1 03/01/40 | 500,000.00 | 516,545.00 | |
| BTPS 3.25 09/01/46 | 1,500,000.00 | 1,580,340.00 | |
| BTPS 3.35 03/01/35 | 850,000.00 | 911,472.00 | |
| BTPS 3.45 03/01/48 | 1,000,000.00 | 1,084,880.00 | |
| BTPS 3.5 03/01/30 | 4,400,000.00 | 4,816,724.00 | |
| BTPS 3.75 09/01/24 | 2,300,000.00 | 2,452,191.00 | |
| BTPS 3.85 09/01/49 | 1,100,000.00 | 1,269,521.00 | |
| BTPS 4 02/01/37 | 2,600,000.00 | 3,003,000.00 | |
| BTPS 4.5 03/01/24 | 1,000,000.00 | 1,072,020.00 | |
| BTPS 4.5 03/01/26 | 1,800,000.00 | 2,010,222.00 | |
| BTPS 4.5 05/01/23 | 2,300,000.00 | 2,406,421.00 | |
| BTPS 4.75 08/01/23 | 2,500,000.00 | 2,647,400.00 | |
| BTPS 4.75 09/01/28 | 2,000,000.00 | 2,329,320.00 | |
| BTPS 4.75 09/01/44 | 1,400,000.00 | 1,820,420.00 | |

| | | | |
|--------------------|--------------|--------------|--|
| BTPS 5 03/01/25 | 1,000,000.00 | 1,109,040.00 | |
| BTPS 5 08/01/34 | 2,070,000.00 | 2,597,746.50 | |
| BTPS 5 08/01/39 | 1,800,000.00 | 2,333,700.00 | |
| BTPS 5 09/01/40 | 1,700,000.00 | 2,220,676.00 | |
| BTPS 5.75 02/01/33 | 1,700,000.00 | 2,220,710.00 | |
| BTPS 6 05/01/31 | 2,200,000.00 | 2,855,314.00 | |
| BTPS 6.5 11/01/27 | 1,700,000.00 | 2,124,558.00 | |
| BTPS 7.25 11/01/26 | 400,000.00 | 499,828.00 | |
| BTPS 9 11/01/23 | 300,000.00 | 339,129.00 | |
| DBR 0 02/15/30 | 1,300,000.00 | 1,228,981.00 | |
| DBR 0 02/15/32 | 400,000.00 | 368,356.00 | |
| DBR 0 05/15/35 | 4,100,000.00 | 3,623,293.00 | |
| DBR 0 08/15/29 | 2,600,000.00 | 2,471,300.00 | |
| DBR 0 08/15/30 | 5,800,000.00 | 5,453,566.00 | |
| DBR 0 08/15/31 | 1,500,000.00 | 1,394,775.00 | |
| DBR 0 08/15/50 | 2,800,000.00 | 2,131,052.00 | |
| DBR 0.25 02/15/27 | 2,300,000.00 | 2,268,306.00 | |
| DBR 0.25 02/15/29 | 1,800,000.00 | 1,748,664.00 | |
| DBR 0.25 08/15/28 | 1,500,000.00 | 1,461,330.00 | |
| DBR 0.5 02/15/25 | 2,500,000.00 | 2,512,750.00 | |
| DBR 0.5 02/15/26 | 3,100,000.00 | 3,103,844.00 | |
| DBR 0.5 02/15/28 | 2,100,000.00 | 2,082,423.00 | |
| DBR 0.5 08/15/27 | 3,400,000.00 | 3,381,334.00 | |
| DBR 1 08/15/24 | 1,300,000.00 | 1,323,062.00 | |
| DBR 1 08/15/25 | 2,050,000.00 | 2,090,077.50 | |
| DBR 1.25 08/15/48 | 1,450,000.00 | 1,551,761.00 | |
| DBR 1.5 05/15/23 | 1,300,000.00 | 1,324,505.00 | |
| DBR 1.5 05/15/24 | 3,600,000.00 | 3,697,848.00 | |
| DBR 1.75 02/15/24 | 2,200,000.00 | 2,266,088.00 | |
| DBR 2 08/15/23 | 2,000,000.00 | 2,058,460.00 | |
| DBR 2.5 07/04/44 | 2,200,000.00 | 2,897,114.00 | |
| DBR 2.5 08/15/46 | 2,500,000.00 | 3,364,250.00 | |
| DBR 3.25 07/04/42 | 700,000.00 | 998,403.00 | |
| DBR 4 01/04/37 | 1,800,000.00 | 2,563,668.00 | |
| DBR 4.25 07/04/39 | 700,000.00 | 1,066,688.00 | |
| DBR 4.75 07/04/28 | 1,600,000.00 | 1,999,792.00 | |
| DBR 4.75 07/04/34 | 600,000.00 | 871,482.00 | |
| DBR 4.75 07/04/40 | 1,450,000.00 | 2,369,633.50 | |
| DBR 5.5 01/04/31 | 900,000.00 | 1,260,522.00 | |
| DBR 5.625 01/04/28 | 1,000,000.00 | 1,280,420.00 | |
| DBR 6.25 01/04/24 | 1,200,000.00 | 1,326,888.00 | |
| DBR 6.25 01/04/30 | 500,000.00 | 708,495.00 | |
| DBR 6.5 07/04/27 | 1,000,000.00 | 1,301,540.00 | |
| FRTR 0 02/25/24 | 1,900,000.00 | 1,894,053.00 | |

| | | | |
|--------------------|--------------|--------------|--|
| FRTR 0 02/25/26 | 4,300,000.00 | 4,190,221.00 | |
| FRTR 0 03/25/24 | 4,800,000.00 | 4,778,592.00 | |
| FRTR 0 03/25/25 | 1,900,000.00 | 1,871,728.00 | |
| FRTR 0 11/25/29 | 4,500,000.00 | 4,153,230.00 | |
| FRTR 0 11/25/30 | 3,900,000.00 | 3,529,617.00 | |
| FRTR 0 11/25/31 | 3,400,000.00 | 3,012,638.00 | |
| FRTR 0.25 11/25/26 | 3,200,000.00 | 3,126,336.00 | |
| FRTR 0.5 05/25/25 | 1,300,000.00 | 1,298,258.00 | |
| FRTR 0.5 05/25/26 | 3,500,000.00 | 3,471,090.00 | |
| FRTR 0.5 05/25/29 | 200,000.00 | 193,056.00 | |
| FRTR 0.5 05/25/72 | 100,000.00 | 56,040.00 | |
| FRTR 0.75 05/25/28 | 3,300,000.00 | 3,269,409.00 | |
| FRTR 0.75 05/25/52 | 3,000,000.00 | 2,289,810.00 | |
| FRTR 0.75 11/25/28 | 3,500,000.00 | 3,454,885.00 | |
| FRTR 1 05/25/27 | 1,800,000.00 | 1,815,660.00 | |
| FRTR 1 11/25/25 | 2,050,000.00 | 2,076,998.50 | |
| FRTR 1.25 05/25/34 | 4,100,000.00 | 4,011,727.00 | |
| FRTR 1.25 05/25/36 | 3,700,000.00 | 3,570,463.00 | |
| FRTR 1.5 05/25/31 | 2,550,000.00 | 2,621,502.00 | |
| FRTR 1.5 05/25/50 | 2,400,000.00 | 2,273,688.00 | |
| FRTR 1.75 05/25/23 | 4,200,000.00 | 4,288,242.00 | |
| FRTR 1.75 05/25/66 | 800,000.00 | 784,728.00 | |
| FRTR 1.75 06/25/39 | 2,500,000.00 | 2,583,525.00 | |
| FRTR 1.75 11/25/24 | 2,600,000.00 | 2,687,490.00 | |
| FRTR 2 05/25/48 | 2,000,000.00 | 2,118,420.00 | |
| FRTR 2.25 05/25/24 | 1,700,000.00 | 1,768,935.00 | |
| FRTR 2.5 05/25/30 | 3,500,000.00 | 3,889,445.00 | |
| FRTR 2.75 10/25/27 | 3,850,000.00 | 4,245,279.50 | |
| FRTR 3.25 05/25/45 | 1,400,000.00 | 1,817,214.00 | |
| FRTR 3.5 04/25/26 | 2,500,000.00 | 2,778,825.00 | |
| FRTR 4 04/25/55 | 1,370,000.00 | 2,126,870.20 | |
| FRTR 4 04/25/60 | 1,400,000.00 | 2,245,376.00 | |
| FRTR 4 10/25/38 | 2,000,000.00 | 2,717,560.00 | |
| FRTR 4.25 10/25/23 | 1,000,000.00 | 1,063,130.00 | |
| FRTR 4.5 04/25/41 | 2,000,000.00 | 2,929,720.00 | |
| FRTR 4.75 04/25/35 | 2,200,000.00 | 3,067,614.00 | |
| FRTR 5.5 04/25/29 | 2,350,000.00 | 3,073,236.00 | |
| FRTR 5.75 10/25/32 | 400,000.00 | 574,968.00 | |
| FRTR 6 10/25/25 | 3,000,000.00 | 3,562,170.00 | |
| FRTR 8.5 04/25/23 | 600,000.00 | 652,536.00 | |
| IRISH 0.9 05/15/28 | 700,000.00 | 696,927.00 | |
| IRISH 1 05/15/26 | 600,000.00 | 607,830.00 | |
| IRISH 1.1 05/15/29 | 1,600,000.00 | 1,602,256.00 | |
| IRISH 1.3 05/15/33 | 1,000,000.00 | 980,680.00 | |

| | | | |
|----------------------|--------------|--------------|--|
| IRISH 1.35 03/18/31 | 500,000.00 | 505,745.00 | |
| IRISH 1.5 05/15/50 | 500,000.00 | 468,690.00 | |
| IRISH 1.7 05/15/37 | 300,000.00 | 303,987.00 | |
| IRISH 2 02/18/45 | 900,000.00 | 949,851.00 | |
| IRISH 2.4 05/15/30 | 600,000.00 | 658,428.00 | |
| IRISH 3.4 03/18/24 | 500,000.00 | 529,845.00 | |
| IRISH 5.4 03/13/25 | 800,000.00 | 911,248.00 | |
| NETHER 0 01/15/24 | 1,000,000.00 | 999,030.00 | |
| NETHER 0 01/15/27 | 800,000.00 | 774,616.00 | |
| NETHER 0 07/15/30 | 2,600,000.00 | 2,404,376.00 | |
| NETHER 0.25 07/15/25 | 1,700,000.00 | 1,688,423.00 | |
| NETHER 0.25 07/15/29 | 500,000.00 | 477,505.00 | |
| NETHER 0.5 01/15/40 | 1,700,000.00 | 1,512,677.00 | |
| NETHER 0.5 07/15/26 | 1,700,000.00 | 1,692,452.00 | |
| NETHER 0.75 07/15/27 | 400,000.00 | 400,404.00 | |
| NETHER 0.75 07/15/28 | 1,500,000.00 | 1,494,150.00 | |
| NETHER 1.75 07/15/23 | 800,000.00 | 819,960.00 | |
| NETHER 2 07/15/24 | 1,000,000.00 | 1,039,050.00 | |
| NETHER 2.5 01/15/33 | 600,000.00 | 684,354.00 | |
| NETHER 2.75 01/15/47 | 1,500,000.00 | 2,026,200.00 | |
| NETHER 3.75 01/15/42 | 1,300,000.00 | 1,881,685.00 | |
| NETHER 4 01/15/37 | 1,400,000.00 | 1,927,856.00 | |
| NETHER 5.5 01/15/28 | 700,000.00 | 885,409.00 | |
| OBL 0 04/05/24 | 1,300,000.00 | 1,296,581.00 | |
| OBL 0 04/11/25 | 2,800,000.00 | 2,770,264.00 | |
| OBL 0 04/14/23 | 200,000.00 | 200,586.00 | |
| OBL 0 10/09/26 | 1,100,000.00 | 1,073,424.00 | |
| OBL 0 10/10/25 | 1,800,000.00 | 1,773,828.00 | |
| OBL 0 10/13/23 | 1,600,000.00 | 1,603,200.00 | |
| OBL 0 10/18/24 | 600,000.00 | 595,848.00 | |
| RAGB 0 02/20/30 | 900,000.00 | 825,174.00 | |
| RAGB 0 02/20/31 | 800,000.00 | 720,160.00 | |
| RAGB 0 07/15/23 | 600,000.00 | 601,212.00 | |
| RAGB 0.5 02/20/29 | 550,000.00 | 532,020.50 | |
| RAGB 0.5 04/20/27 | 500,000.00 | 494,190.00 | |
| RAGB 0.75 02/20/28 | 700,000.00 | 696,122.00 | |
| RAGB 0.75 03/20/51 | 900,000.00 | 742,626.00 | |
| RAGB 0.75 10/20/26 | 900,000.00 | 903,123.00 | |
| RAGB 0.85 06/30/20 | 150,000.00 | 87,298.50 | |
| RAGB 1.2 10/20/25 | 1,000,000.00 | 1,023,450.00 | |
| RAGB 1.5 02/20/47 | 700,000.00 | 709,128.00 | |
| RAGB 1.5 11/02/86 | 200,000.00 | 181,060.00 | |
| RAGB 1.65 10/21/24 | 1,200,000.00 | 1,241,316.00 | |
| RAGB 1.75 10/20/23 | 1,000,000.00 | 1,026,890.00 | |

| | | | |
|---------------------|--------------|--------------|--|
| RAGB 2.4 05/23/34 | 600,000.00 | 671,838.00 | |
| RAGB 3.15 06/20/44 | 500,000.00 | 668,505.00 | |
| RAGB 3.8 01/26/62 | 700,000.00 | 1,154,867.00 | |
| RAGB 4.15 03/15/37 | 600,000.00 | 824,298.00 | |
| RAGB 4.85 03/15/26 | 500,000.00 | 583,965.00 | |
| RAGB 6.25 07/15/27 | 1,000,000.00 | 1,284,160.00 | |
| RFGB 0.25 09/15/40 | 300,000.00 | 241,710.00 | |
| RFGB 0.5 04/15/26 | 800,000.00 | 794,160.00 | |
| RFGB 0.5 09/15/28 | 400,000.00 | 388,724.00 | |
| RFGB 0.5 09/15/29 | 800,000.00 | 769,152.00 | |
| RFGB 0.75 04/15/31 | 500,000.00 | 482,310.00 | |
| RFGB 1.375 04/15/47 | 300,000.00 | 300,498.00 | |
| RFGB 1.5 04/15/23 | 200,000.00 | 203,328.00 | |
| RFGB 2 04/15/24 | 1,000,000.00 | 1,036,020.00 | |
| RFGB 2.625 07/04/42 | 1,000,000.00 | 1,207,560.00 | |
| RFGB 2.75 07/04/28 | 400,000.00 | 444,816.00 | |
| RFGB 4 07/04/25 | 600,000.00 | 667,134.00 | |
| SPGB 0 01/31/25 | 500,000.00 | 490,655.00 | |
| SPGB 0.25 07/30/24 | 1,400,000.00 | 1,392,552.00 | |
| SPGB 0.5 04/30/30 | 1,000,000.00 | 924,520.00 | |
| SPGB 0.5 10/31/31 | 1,400,000.00 | 1,247,148.00 | |
| SPGB 0.8 07/30/27 | 400,000.00 | 391,308.00 | |
| SPGB 1 10/31/50 | 300,000.00 | 217,959.00 | |
| SPGB 1.2 10/31/40 | 700,000.00 | 594,734.00 | |
| SPGB 1.25 10/31/30 | 3,000,000.00 | 2,921,100.00 | |
| SPGB 1.3 10/31/26 | 3,100,000.00 | 3,134,100.00 | |
| SPGB 1.4 04/30/28 | 2,200,000.00 | 2,213,860.00 | |
| SPGB 1.4 07/30/28 | 1,600,000.00 | 1,607,984.00 | |
| SPGB 1.45 04/30/29 | 2,000,000.00 | 2,007,860.00 | |
| SPGB 1.45 10/31/27 | 2,600,000.00 | 2,627,820.00 | |
| SPGB 1.45 10/31/71 | 400,000.00 | 264,032.00 | |
| SPGB 1.5 04/30/27 | 700,000.00 | 710,794.00 | |
| SPGB 1.6 04/30/25 | 1,400,000.00 | 1,435,896.00 | |
| SPGB 1.85 07/30/35 | 2,700,000.00 | 2,658,366.00 | |
| SPGB 1.95 04/30/26 | 2,000,000.00 | 2,071,800.00 | |
| SPGB 1.95 07/30/30 | 1,700,000.00 | 1,752,649.00 | |
| SPGB 2.15 10/31/25 | 2,400,000.00 | 2,503,992.00 | |
| SPGB 2.35 07/30/33 | 1,500,000.00 | 1,576,080.00 | |
| SPGB 2.7 10/31/48 | 1,050,000.00 | 1,138,851.00 | |
| SPGB 2.75 10/31/24 | 2,100,000.00 | 2,214,807.00 | |
| SPGB 2.9 10/31/46 | 1,700,000.00 | 1,908,930.00 | |
| SPGB 3.45 07/30/66 | 1,300,000.00 | 1,551,043.00 | |
| SPGB 3.8 04/30/24 | 1,400,000.00 | 1,495,046.00 | |
| SPGB 4.2 01/31/37 | 1,250,000.00 | 1,602,362.50 | |

| | | | | |
|--------|--------------------|----------------|--------------------------------------|--|
| | SPGB 4.4 10/31/23 | 2,000,000.00 | 2,128,200.00 | |
| | SPGB 4.65 07/30/25 | 1,800,000.00 | 2,017,764.00 | |
| | SPGB 4.7 07/30/41 | 1,500,000.00 | 2,112,180.00 | |
| | SPGB 4.8 01/31/24 | 3,000,000.00 | 3,236,940.00 | |
| | SPGB 4.9 07/30/40 | 1,200,000.00 | 1,716,816.00 | |
| | SPGB 5.15 10/31/28 | 1,500,000.00 | 1,853,190.00 | |
| | SPGB 5.15 10/31/44 | 1,000,000.00 | 1,529,380.00 | |
| | SPGB 5.75 07/30/32 | 1,500,000.00 | 2,064,030.00 | |
| | SPGB 5.9 07/30/26 | 500,000.00 | 601,445.00 | |
| | SPGB 6 01/31/29 | 2,200,000.00 | 2,868,250.00 | |
| | ユーロ小計 | 393,340,000.00 | 416,776,296.20 (57,048,339,424) | |
| 国債証券合計 | | | 154,868,895,807 (154,868,895,807) | |
| 合 計 | | | 154,868,895,807 (154,868,895,807) | |

(注)金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 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 | 196銘柄 | 48.7% | 49.2% |
| カナダ・ドル | 国債証券 | 21銘柄 | 2.0% | 2.0% |
| オーストラリア・ドル | 国債証券 | 18銘柄 | 1.6% | 1.6% |
| シンガポール・ドル | 国債証券 | 11銘柄 | 0.4% | 0.4% |
| イギリス・ポンド | 国債証券 | 43銘柄 | 5.3% | 5.4% |
| イスラエル・シケル | 国債証券 | 5銘柄 | 0.4% | 0.4% |
| デンマーク・クローネ | 国債証券 | 6銘柄 | 0.4% | 0.4% |
| ノルウェー・クローネ | 国債証券 | 7銘柄 | 0.3% | 0.3% |
| スウェーデン・クローナ | 国債証券 | 6銘柄 | 0.3% | 0.3% |
| メキシコ・ペソ | 国債証券 | 9銘柄 | 0.7% | 0.7% |
| オフショア・人民元 | 国債証券 | 8銘柄 | 1.5% | 1.5% |
| マレーシア・リングgit | 国債証券 | 6銘柄 | 0.5% | 0.5% |
| ポーランド・ズロチ | 国債証券 | 5銘柄 | 0.4% | 0.4% |
| ユーロ | 国債証券 | 261銘柄 | 36.5% | 36.8% |

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)」に記載しております。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

| | (2021年4月26日現在) | (2022年4月26日現在) |
|------|----------------|----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 68,082,064 | 27,275,290 |
| 金銭信託 | 80,177,155 | 3,473,575 |

| | | |
|-------------|----------------|----------------|
| コール・ローン | 183,986,932 | 175,204,587 |
| 国債証券 | 18,913,583,233 | 26,250,030,345 |
| 派生商品評価勘定 | 232,914,277 | 3,271,309 |
| 未収入金 | 214,000,000 | 2,276,442 |
| 未収利息 | 119,105,342 | 134,293,222 |
| 前払費用 | 15,533,861 | 33,807,273 |
| 流動資産合計 | 19,827,382,864 | 26,629,632,043 |
| 資産合計 | 19,827,382,864 | 26,629,632,043 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 52,791,964 | 707,126,924 |
| 未払金 | 316,453,295 | 12,354,515 |
| 未払解約金 | 23,100,000 | 1,000,000 |
| 未払利息 | 532 | - |
| その他未払費用 | 6,007 | 616 |
| 流動負債合計 | 392,351,798 | 720,482,055 |
| 負債合計 | 392,351,798 | 720,482,055 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 13,008,296,854 | 18,855,361,405 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 6,426,734,212 | 7,053,788,583 |
| 元本等合計 | 19,435,031,066 | 25,909,149,988 |
| 純資産合計 | 19,435,031,066 | 25,909,149,988 |
| 負債純資産合計 | 19,827,382,864 | 26,629,632,043 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
|--------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |

| | |
|----------------------------|--|
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。 |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2021年4月26日現在) | (2022年4月26日現在) |
|-----------------------|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 13,008,296,854口 | 18,855,361,405口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.4940円 (1万口当たりの純資産額14,940円) | 1口当たり純資産額 1.3741円 (1万口当たりの純資産額13,741円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2022年4月26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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク | (1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |

| | |
|-----------------------------------|--|
| <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| <p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</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。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2022年4月26日現在) |
|---------------------------|---|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> | <p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> |
| <p>2. 時価の算定方法</p> | <p>(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区 分 | 種 類 | 契 約 額 等 | | 時 価 | 評 価 損 益 |
|-------------------|-----------------|---------------|--------------|---------------|-------------|
| | | | う ち 1 年 超 | | |
| 市場取引 以外の取 引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 139,702,883 | - | 139,576,890 | 125,993 |
| | イギリス・ポ ンド | 20,781,467 | - | 20,693,234 | 88,233 |
| | イスラエル・ シュケル | 2,242,494 | - | 2,251,402 | 8,908 |
| | オーストラリ ア・ドル | 7,091,000 | - | 7,098,552 | 7,552 |
| | カナダ・ドル | 6,426,246 | - | 6,440,953 | 14,707 |
| | シンガポール・ ドル | 1,735,015 | - | 1,735,732 | 717 |
| | スウェーデン・ クローナ | 1,310,073 | - | 1,313,093 | 3,020 |
| | デンマーク・ク ローネ | 2,221,625 | - | 2,232,963 | 11,338 |
| | メキシコ・ペソ | 2,393,749 | - | 2,400,916 | 7,167 |
| | ユーロ | 133,044,305 | - | 133,680,122 | 635,817 |
| | 小計 | 316,948,857 | - | 317,423,857 | 475,000 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 8,523,839,369 | - | 8,320,321,620 | 203,517,749 |
| | イギリス・ポ ンド | 1,241,773,238 | - | 1,220,745,305 | 21,027,933 |
| | イスラエル・ シュケル | 87,079,739 | - | 87,314,367 | 234,628 |
| | オーストラリ ア・ドル | 415,566,659 | - | 415,102,400 | 464,259 |
| | カナダ・ドル | 383,679,312 | - | 378,220,441 | 5,458,871 |
| | シンガポール・ ドル | 174,180,624 | - | 172,470,480 | 1,710,144 |
| | スウェーデン・ クローナ | 68,046,060 | - | 69,111,900 | 1,065,840 |
| | デンマーク・ク ローネ | 98,247,095 | - | 98,862,800 | 615,705 |
| | ノルウェー・ク ローネ | 47,194,021 | - | 47,523,000 | 328,979 |
| | ポーランド・ズ ロチ | 124,661,162 | - | 127,601,080 | 2,939,918 |
| | メキシコ・ペソ | 152,850,854 | - | 154,069,344 | 1,218,490 |

| | | | | | |
|--|-----|----------------|---|----------------|-------------|
| | ユーロ | 7,849,844,966 | - | 7,895,973,049 | 46,128,083 |
| | 小計 | 19,166,963,099 | - | 18,987,315,786 | 179,647,313 |
| | 合計 | 19,483,911,956 | - | 19,304,739,643 | 180,122,313 |

(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|-------------------|-----------------|----------------|-----------|----------------|-------------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 以外の取 引 | 為替予約取引 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 12,764,125,201 | - | 13,303,120,810 | 538,995,609 |
| | カナダ・ドル | 537,103,222 | - | 549,889,380 | 12,786,158 |
| | オーストラリ ア・ドル | 431,601,589 | - | 432,161,340 | 559,751 |
| | シンガポール・ ドル | 240,762,153 | - | 248,075,040 | 7,312,887 |
| | イギリス・ポン ド | 1,432,825,579 | - | 1,450,035,200 | 17,209,621 |
| | イスラエル・ シュケル | 113,572,262 | - | 115,075,920 | 1,503,658 |
| | デンマーク・ク ローネ | 109,176,944 | - | 110,431,800 | 1,254,856 |
| | ノルウェー・ク ローネ | 69,538,844 | - | 70,023,500 | 484,656 |
| | スウェーデン・ クローナ | 75,018,208 | - | 75,612,500 | 594,292 |
| | メキシコ・ペソ | 196,132,224 | - | 201,962,754 | 5,830,530 |
| | オフショア・人 民元 | 392,885,374 | - | 396,512,754 | 3,627,380 |
| | ポーランド・ズ ロチ | 119,218,611 | - | 120,603,550 | 1,384,939 |
| | ユーロ | 9,924,318,899 | - | 10,036,630,177 | 112,311,278 |
| | 小計 | 26,406,279,110 | - | 27,110,134,725 | 703,855,615 |
| | 合計 | 26,406,279,110 | - | 27,110,134,725 | 703,855,615 |

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客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。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| |
|--|
| 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日 |
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| | |
|--|-----------------|
| (2021年4月26日現在) | |
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 17,571,381,562円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 8,582,179,054円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 13,145,263,762円 |
| 2021年4月26日現在の元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 2,096,603,813円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 634,468,070円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 11,763,790円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 536,817,606円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 1,158,343,666円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 418,497,151円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 681,787,045円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 146,325,380円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 29,424,709円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 26,193,219円 |
| SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定> | 1,362,970,381円 |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 810,193円 |
| SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定> | 5,187,705,209円 |
| SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 129,547,354円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 319,879,049円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 267,160,219円 |
| 合 計 | 13,008,296,854円 |

| | |
|-----------------------|-----------------|
| (2022年4月26日現在) | |
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 13,008,296,854円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 12,051,443,547円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 6,204,378,996円 |
| 2022年4月26日現在の元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 3,296,843,012円 |

| | |
|--|-----------------|
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 1,961,569,030円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 794,172,937円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 990,054,894円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 1,966,334,846円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 743,710,240円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 1,325,826,094円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 322,764,675円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 84,406,317円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 47,175,053円 |
| 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり) | 426,749,820円 |
| SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定> | 1,263,462,001円 |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 826,366円 |
| SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定> | 4,377,678,068円 |
| SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 379,170,766円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 384,686,299円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 489,930,987円 |
| 合計 | 18,855,361,405円 |

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 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 | 600,000.00 | 574,968.00 | |
| | | T 0.125 02/15/24 | 1,050,000.00 | 1,004,136.00 | |
| | | T 0.125 04/30/23 | 630,000.00 | 617,715.00 | |
| | | T 0.125 05/15/23 | 650,000.00 | 636,694.50 | |
| | | T 0.125 06/30/23 | 320,000.00 | 312,262.40 | |
| | | T 0.125 07/15/23 | 1,170,000.00 | 1,140,200.10 | |
| | | T 0.125 07/31/23 | 400,000.00 | 389,468.00 | |
| | | T 0.125 08/15/23 | 750,000.00 | 728,902.50 | |
| | | T 0.125 09/15/23 | 570,000.00 | 552,672.00 | |
| | | T 0.125 10/15/23 | 1,840,000.00 | 1,779,611.20 | |
| | | T 0.25 03/15/24 | 770,000.00 | 736,612.80 | |
| | | T 0.25 05/15/24 | 530,000.00 | 504,613.00 | |
| | | T 0.25 05/31/25 | 370,000.00 | 341,813.40 | |
| | | T 0.25 06/15/24 | 620,000.00 | 588,752.00 | |
| | | T 0.25 06/30/25 | 650,000.00 | 599,111.50 | |
| | | T 0.25 08/31/25 | 1,200,000.00 | 1,100,712.00 | |
| | | T 0.25 09/30/25 | 290,000.00 | 265,439.90 | |
| | | T 0.25 10/31/25 | 720,000.00 | 657,561.60 | |
| | | T 0.25 11/15/23 | 500,000.00 | 483,515.00 | |
| | | T 0.375 01/31/26 | 1,030,000.00 | 938,103.40 | |

| | | | |
|------------------|--------------|--------------|--|
| T 0.375 04/30/25 | 320,000.00 | 297,561.60 | |
| T 0.375 07/31/27 | 720,000.00 | 632,808.00 | |
| T 0.375 08/15/24 | 410,000.00 | 388,520.10 | |
| T 0.375 09/15/24 | 700,000.00 | 661,661.00 | |
| T 0.375 11/30/25 | 350,000.00 | 320,250.00 | |
| T 0.375 12/31/25 | 620,000.00 | 566,134.40 | |
| T 0.5 02/28/26 | 1,080,000.00 | 987,055.20 | |
| T 0.5 03/31/25 | 420,000.00 | 392,779.80 | |
| T 0.5 04/30/27 | 480,000.00 | 427,233.60 | |
| T 0.5 05/31/27 | 370,000.00 | 328,415.70 | |
| T 0.5 06/30/27 | 1,110,000.00 | 983,515.50 | |
| T 0.5 08/31/27 | 640,000.00 | 564,800.00 | |
| T 0.5 10/31/27 | 780,000.00 | 685,542.00 | |
| T 0.5 11/30/23 | 200,000.00 | 193,828.00 | |
| T 0.625 03/31/27 | 520,000.00 | 466,393.20 | |
| T 0.625 05/15/30 | 870,000.00 | 733,035.90 | |
| T 0.625 07/31/26 | 720,000.00 | 655,056.00 | |
| T 0.625 08/15/30 | 1,040,000.00 | 871,478.40 | |
| T 0.625 10/15/24 | 230,000.00 | 218,302.20 | |
| T 0.625 11/30/27 | 580,000.00 | 512,528.60 | |
| T 0.625 12/31/27 | 1,170,000.00 | 1,031,975.10 | |
| T 0.75 01/31/28 | 710,000.00 | 629,180.70 | |
| T 0.75 03/31/26 | 720,000.00 | 663,300.00 | |
| T 0.75 08/31/26 | 710,000.00 | 648,400.40 | |
| T 0.75 11/15/24 | 660,000.00 | 627,125.40 | |
| T 0.75 12/31/23 | 980,000.00 | 951,129.20 | |
| T 0.875 01/31/24 | 900,000.00 | 873,000.00 | |
| T 0.875 06/30/26 | 500,000.00 | 460,760.00 | |
| T 0.875 09/30/26 | 340,000.00 | 311,644.00 | |
| T 0.875 11/15/30 | 1,100,000.00 | 938,608.00 | |
| T 1 07/31/28 | 500,000.00 | 446,050.00 | |
| T 1 12/15/24 | 600,000.00 | 572,928.00 | |
| T 1.125 01/15/25 | 660,000.00 | 631,144.80 | |
| T 1.125 02/15/31 | 910,000.00 | 790,844.60 | |
| T 1.125 02/28/27 | 280,000.00 | 258,059.20 | |
| T 1.125 02/29/28 | 270,000.00 | 244,474.20 | |
| T 1.125 05/15/40 | 420,000.00 | 307,125.00 | |
| T 1.125 08/15/40 | 380,000.00 | 276,450.00 | |
| T 1.125 08/31/28 | 490,000.00 | 439,926.90 | |
| T 1.125 10/31/26 | 240,000.00 | 222,204.00 | |
| T 1.25 03/31/28 | 660,000.00 | 601,161.00 | |
| T 1.25 04/30/28 | 890,000.00 | 809,686.40 | |
| T 1.25 05/15/50 | 530,000.00 | 359,488.40 | |
| T 1.25 05/31/28 | 580,000.00 | 526,576.20 | |

| | | | |
|------------------|--------------|--------------|--|
| T 1.25 06/30/28 | 480,000.00 | 435,446.40 | |
| T 1.25 08/15/31 | 990,000.00 | 863,151.30 | |
| T 1.25 08/31/24 | 450,000.00 | 434,776.50 | |
| T 1.25 09/30/28 | 680,000.00 | 614,597.60 | |
| T 1.25 11/30/26 | 400,000.00 | 372,140.00 | |
| T 1.25 12/31/26 | 730,000.00 | 678,126.20 | |
| T 1.375 01/31/25 | 430,000.00 | 413,771.80 | |
| T 1.375 06/30/23 | 950,000.00 | 940,500.00 | |
| T 1.375 08/15/50 | 680,000.00 | 476,047.60 | |
| T 1.375 08/31/23 | 300,000.00 | 296,250.00 | |
| T 1.375 08/31/26 | 470,000.00 | 441,283.00 | |
| T 1.375 10/31/28 | 180,000.00 | 163,897.20 | |
| T 1.375 11/15/31 | 1,420,000.00 | 1,248,591.80 | |
| T 1.375 11/15/40 | 800,000.00 | 607,184.00 | |
| T 1.375 12/31/28 | 720,000.00 | 654,804.00 | |
| T 1.5 01/31/27 | 950,000.00 | 892,211.50 | |
| T 1.5 02/15/30 | 550,000.00 | 499,510.00 | |
| T 1.5 08/15/26 | 550,000.00 | 519,123.00 | |
| T 1.5 11/30/24 | 510,000.00 | 493,700.40 | |
| T 1.5 11/30/28 | 680,000.00 | 623,736.80 | |
| T 1.625 02/15/26 | 600,000.00 | 573,234.00 | |
| T 1.625 05/15/26 | 570,000.00 | 542,788.20 | |
| T 1.625 05/15/31 | 1,300,000.00 | 1,176,396.00 | |
| T 1.625 05/31/23 | 520,000.00 | 517,233.60 | |
| T 1.625 08/15/29 | 510,000.00 | 469,674.30 | |
| T 1.625 09/30/26 | 480,000.00 | 455,323.20 | |
| T 1.625 10/31/23 | 750,000.00 | 741,562.50 | |
| T 1.625 11/15/50 | 870,000.00 | 650,116.20 | |
| T 1.625 11/30/26 | 650,000.00 | 615,413.50 | |
| T 1.75 01/31/29 | 400,000.00 | 372,528.00 | |
| T 1.75 05/15/23 | 700,000.00 | 697,480.00 | |
| T 1.75 08/15/41 | 640,000.00 | 514,144.00 | |
| T 1.75 11/15/29 | 550,000.00 | 510,466.00 | |
| T 1.75 12/31/24 | 390,000.00 | 379,470.00 | |
| T 1.75 12/31/26 | 300,000.00 | 285,375.00 | |
| T 1.875 02/15/32 | 700,000.00 | 643,503.00 | |
| T 1.875 02/15/41 | 630,000.00 | 521,325.00 | |
| T 1.875 02/15/51 | 730,000.00 | 581,262.50 | |
| T 1.875 02/28/27 | 200,000.00 | 191,100.00 | |
| T 1.875 02/28/29 | 850,000.00 | 798,065.00 | |
| T 1.875 06/30/26 | 750,000.00 | 720,847.50 | |
| T 1.875 08/31/24 | 300,000.00 | 294,117.00 | |
| T 1.875 11/15/51 | 670,000.00 | 533,695.20 | |
| T 2 02/15/25 | 660,000.00 | 645,664.80 | |

| | | | |
|------------------|--------------|------------|--|
| T 2 02/15/50 | 470,000.00 | 385,508.10 | |
| T 2 04/30/24 | 200,000.00 | 197,500.00 | |
| T 2 05/31/24 | 500,000.00 | 493,240.00 | |
| T 2 06/30/24 | 600,000.00 | 591,234.00 | |
| T 2 08/15/25 | 600,000.00 | 584,340.00 | |
| T 2 08/15/51 | 720,000.00 | 590,400.00 | |
| T 2 11/15/41 | 590,000.00 | 495,092.60 | |
| T 2.125 03/31/24 | 280,000.00 | 277,264.40 | |
| T 2.125 05/31/26 | 320,000.00 | 310,723.20 | |
| T 2.125 07/31/24 | 410,000.00 | 404,776.60 | |
| T 2.25 01/31/24 | 460,000.00 | 457,051.40 | |
| T 2.25 02/15/27 | 450,000.00 | 437,305.50 | |
| T 2.25 02/15/52 | 580,000.00 | 505,910.80 | |
| T 2.25 03/31/26 | 420,000.00 | 410,352.60 | |
| T 2.25 04/30/24 | 770,000.00 | 764,163.40 | |
| T 2.25 05/15/41 | 970,000.00 | 851,854.00 | |
| T 2.25 08/15/27 | 570,000.00 | 552,808.80 | |
| T 2.25 08/15/46 | 250,000.00 | 214,960.00 | |
| T 2.25 08/15/49 | 460,000.00 | 399,983.80 | |
| T 2.25 10/31/24 | 580,000.00 | 572,610.80 | |
| T 2.25 11/15/24 | 500,000.00 | 493,475.00 | |
| T 2.25 11/15/27 | 300,000.00 | 290,388.00 | |
| T 2.25 12/31/23 | 550,000.00 | 547,332.50 | |
| T 2.25 12/31/24 | 500,000.00 | 492,965.00 | |
| T 2.375 02/15/42 | 170,000.00 | 152,228.20 | |
| T 2.375 04/30/26 | 400,000.00 | 392,656.00 | |
| T 2.375 05/15/29 | 330,000.00 | 319,944.90 | |
| T 2.375 05/15/51 | 900,000.00 | 804,582.00 | |
| T 2.375 08/15/24 | 600,000.00 | 595,026.00 | |
| T 2.375 11/15/49 | 520,000.00 | 465,072.40 | |
| T 2.5 01/31/24 | 1,000,000.00 | 997,650.00 | |
| T 2.5 01/31/25 | 400,000.00 | 396,888.00 | |
| T 2.5 02/15/45 | 220,000.00 | 198,101.20 | |
| T 2.5 02/15/46 | 150,000.00 | 135,375.00 | |
| T 2.5 05/15/24 | 900,000.00 | 897,390.00 | |
| T 2.5 05/15/46 | 230,000.00 | 207,627.90 | |
| T 2.5 08/15/23 | 300,000.00 | 300,819.00 | |
| T 2.625 01/31/26 | 430,000.00 | 426,237.50 | |
| T 2.625 02/15/29 | 520,000.00 | 512,319.60 | |
| T 2.625 03/31/25 | 500,000.00 | 497,340.00 | |
| T 2.75 02/15/28 | 420,000.00 | 417,110.40 | |
| T 2.75 02/28/25 | 500,000.00 | 499,175.00 | |
| T 2.75 06/30/25 | 200,000.00 | 199,476.00 | |
| T 2.75 07/31/23 | 900,000.00 | 905,409.00 | |

| | | | |
|------------------|------------|------------|--|
| T 2.75 08/15/47 | 210,000.00 | 199,909.50 | |
| T 2.75 08/31/25 | 600,000.00 | 598,170.00 | |
| T 2.75 11/15/23 | 900,000.00 | 904,005.00 | |
| T 2.75 11/15/42 | 400,000.00 | 377,684.00 | |
| T 2.75 11/15/47 | 250,000.00 | 237,910.00 | |
| T 2.875 04/30/25 | 200,000.00 | 200,296.00 | |
| T 2.875 05/15/28 | 500,000.00 | 500,035.00 | |
| T 2.875 05/15/43 | 290,000.00 | 278,988.70 | |
| T 2.875 05/15/49 | 410,000.00 | 404,362.50 | |
| T 2.875 05/31/25 | 600,000.00 | 600,792.00 | |
| T 2.875 08/15/28 | 660,000.00 | 660,151.80 | |
| T 2.875 08/15/45 | 110,000.00 | 105,925.60 | |
| T 2.875 11/15/46 | 660,000.00 | 639,988.80 | |
| T 2.875 11/30/23 | 900,000.00 | 905,337.00 | |
| T 2.875 11/30/25 | 390,000.00 | 390,362.70 | |
| T 3 02/15/47 | 120,000.00 | 119,043.60 | |
| T 3 02/15/48 | 400,000.00 | 400,528.00 | |
| T 3 02/15/49 | 590,000.00 | 595,481.10 | |
| T 3 05/15/42 | 290,000.00 | 286,079.20 | |
| T 3 05/15/45 | 290,000.00 | 285,128.00 | |
| T 3 05/15/47 | 300,000.00 | 297,984.00 | |
| T 3 08/15/48 | 350,000.00 | 350,546.00 | |
| T 3 09/30/25 | 620,000.00 | 623,726.20 | |
| T 3 11/15/44 | 220,000.00 | 216,079.60 | |
| T 3 11/15/45 | 300,000.00 | 295,617.00 | |
| T 3.125 02/15/42 | 150,000.00 | 150,937.50 | |
| T 3.125 02/15/43 | 70,000.00 | 70,098.00 | |
| T 3.125 05/15/48 | 420,000.00 | 431,285.40 | |
| T 3.125 08/15/44 | 110,000.00 | 110,128.70 | |
| T 3.125 11/15/28 | 380,000.00 | 385,700.00 | |
| T 3.125 11/15/41 | 210,000.00 | 211,180.20 | |
| T 3.375 05/15/44 | 300,000.00 | 312,420.00 | |
| T 3.375 11/15/48 | 450,000.00 | 484,416.00 | |
| T 3.5 02/15/39 | 180,000.00 | 193,415.40 | |
| T 3.625 02/15/44 | 400,000.00 | 432,812.00 | |
| T 3.625 08/15/43 | 230,000.00 | 248,641.50 | |
| T 3.875 08/15/40 | 120,000.00 | 134,202.00 | |
| T 4.25 05/15/39 | 170,000.00 | 200,001.60 | |
| T 4.25 11/15/40 | 140,000.00 | 163,909.20 | |
| T 4.375 02/15/38 | 40,000.00 | 47,659.20 | |
| T 4.375 05/15/40 | 230,000.00 | 274,454.40 | |
| T 4.375 05/15/41 | 120,000.00 | 142,734.00 | |
| T 4.375 11/15/39 | 300,000.00 | 357,444.00 | |
| T 4.5 02/15/36 | 100,000.00 | 120,328.00 | |

| | | | | |
|----------------------|--------------------|----------------|------------------------------------|--|
| | T 4.5 08/15/39 | 120,000.00 | 145,500.00 | |
| | T 4.625 02/15/40 | 100,000.00 | 123,085.00 | |
| | T 5.25 11/15/28 | 200,000.00 | 228,374.00 | |
| | T 5.375 02/15/31 | 80,000.00 | 95,993.60 | |
| | US TREASURY N/B | 980,000.00 | 937,575.80 | |
| | US TREASURY N/B | 520,000.00 | 494,015.60 | |
| | アメリカ・ドル小計 | 107,980,000.00 | 101,172,749.60 (12,909,642,849) | |
| カナダ・ドル | CAN 0.25 03/01/26 | 270,000.00 | 246,169.80 | |
| | CAN 0.25 04/01/24 | 460,000.00 | 440,330.40 | |
| | CAN 0.25 08/01/23 | 300,000.00 | 292,050.00 | |
| | CAN 0.5 09/01/25 | 350,000.00 | 325,734.50 | |
| | CAN 0.5 12/01/30 | 320,000.00 | 264,361.60 | |
| | CAN 1 06/01/27 | 140,000.00 | 128,956.80 | |
| | CAN 1.25 03/01/25 | 250,000.00 | 240,615.00 | |
| | CAN 1.25 06/01/30 | 420,000.00 | 374,245.20 | |
| | CAN 1.5 06/01/23 | 130,000.00 | 128,789.70 | |
| | CAN 1.5 06/01/26 | 170,000.00 | 162,421.40 | |
| | CAN 1.5 06/01/31 | 360,000.00 | 322,948.80 | |
| | CAN 1.5 09/01/24 | 150,000.00 | 146,392.50 | |
| | CAN 1.5 12/01/31 | 210,000.00 | 187,198.20 | |
| | CAN 1.75 12/01/53 | 260,000.00 | 203,967.40 | |
| | CAN 2 06/01/28 | 130,000.00 | 125,079.50 | |
| | CAN 2 09/01/23 | 130,000.00 | 129,290.20 | |
| | CAN 2 12/01/51 | 370,000.00 | 312,431.70 | |
| | CAN 2.25 03/01/24 | 200,000.00 | 199,044.00 | |
| | CAN 2.25 06/01/25 | 130,000.00 | 128,550.50 | |
| | CAN 2.25 06/01/29 | 150,000.00 | 145,528.50 | |
| | CAN 2.5 06/01/24 | 160,000.00 | 159,814.40 | |
| | CAN 2.75 12/01/48 | 140,000.00 | 139,091.40 | |
| | CAN 3.5 12/01/45 | 90,000.00 | 100,543.50 | |
| | CAN 4 06/01/41 | 90,000.00 | 105,143.40 | |
| CAN 5 06/01/37 | 70,000.00 | 88,202.80 | | |
| CAN 5.75 06/01/29 | 90,000.00 | 107,487.90 | | |
| CAN 5.75 06/01/33 | 60,000.00 | 76,465.80 | | |
| CANADA 2.75 12/01/64 | 50,000.00 | 49,065.50 | | |
| | カナダ・ドル小計 | 5,650,000.00 | 5,329,920.40 (534,111,323) | |
| オーストラリア・ドル | ACGB 0.25 11/21/24 | 380,000.00 | 358,370.40 | |
| | ACGB 0.25 11/21/25 | 140,000.00 | 127,891.40 | |
| | ACGB 0.5 09/21/26 | 150,000.00 | 135,243.00 | |
| | ACGB 1 11/21/31 | 250,000.00 | 206,480.00 | |
| | ACGB 1 12/21/30 | 230,000.00 | 193,602.50 | |
| | ACGB 1.25 05/21/32 | 280,000.00 | 234,920.00 | |

| | | | | |
|---------------------|---------------------|--------------|-------------------------------|--|
| | ACGB 1.5 06/21/31 | 250,000.00 | 218,235.00 | |
| | ACGB 1.75 06/21/51 | 110,000.00 | 74,862.70 | |
| | ACGB 1.75 11/21/32 | 240,000.00 | 210,079.20 | |
| | ACGB 2.25 05/21/28 | 170,000.00 | 162,936.50 | |
| | ACGB 2.5 05/21/30 | 300,000.00 | 287,853.00 | |
| | ACGB 2.75 04/21/24 | 190,000.00 | 191,350.90 | |
| | ACGB 2.75 05/21/41 | 130,000.00 | 116,989.60 | |
| | ACGB 2.75 06/21/35 | 110,000.00 | 104,189.80 | |
| | ACGB 2.75 11/21/27 | 360,000.00 | 355,960.80 | |
| | ACGB 2.75 11/21/28 | 110,000.00 | 108,212.50 | |
| | ACGB 2.75 11/21/29 | 180,000.00 | 176,320.80 | |
| | ACGB 3 03/21/47 | 120,000.00 | 109,834.80 | |
| | ACGB 3.25 04/21/25 | 180,000.00 | 182,853.00 | |
| | ACGB 3.25 04/21/29 | 200,000.00 | 202,692.00 | |
| | ACGB 3.25 06/21/39 | 100,000.00 | 98,001.00 | |
| | ACGB 3.75 04/21/37 | 180,000.00 | 189,068.40 | |
| | ACGB 4.25 04/21/26 | 190,000.00 | 200,068.10 | |
| | ACGB 4.5 04/21/33 | 180,000.00 | 202,649.40 | |
| | ACGB 5.5 04/21/23 | 110,000.00 | 114,104.10 | |
| | オーストラリア・ドル小計 | 4,840,000.00 | 4,562,768.90 (418,725,302) | |
| シンガ ポール・ ドル | SIGB 1.875 03/01/50 | 120,000.00 | 100,320.00 | |
| | SIGB 2 02/01/24 | 120,000.00 | 120,081.60 | |
| | SIGB 2.125 06/01/26 | 510,000.00 | 507,705.00 | |
| | SIGB 2.25 08/01/36 | 220,000.00 | 208,087.00 | |
| | SIGB 2.375 07/01/39 | 100,000.00 | 94,900.00 | |
| | SIGB 2.625 05/01/28 | 230,000.00 | 232,760.00 | |
| | SIGB 2.75 03/01/46 | 160,000.00 | 159,760.00 | |
| | SIGB 2.75 04/01/42 | 100,000.00 | 99,846.00 | |
| | SIGB 2.75 07/01/23 | 200,000.00 | 202,420.00 | |
| | SIGB 2.875 07/01/29 | 250,000.00 | 256,675.00 | |
| | SIGB 2.875 09/01/30 | 220,000.00 | 225,940.00 | |
| | SIGB 3 09/01/24 | 170,000.00 | 173,706.00 | |
| SIGB 3.375 09/01/33 | 220,000.00 | 235,400.00 | | |
| | シンガポール・ドル小計 | 2,620,000.00 | 2,617,600.60 (243,332,152) | |
| イギリ ス・ポ ンド | UK TSY GILT | 260,000.00 | 226,668.00 | |
| | UKT 0.125 01/30/26 | 180,000.00 | 170,416.80 | |
| | UKT 0.125 01/31/24 | 360,000.00 | 350,784.00 | |
| | UKT 0.125 01/31/28 | 140,000.00 | 128,252.60 | |
| | UKT 0.25 01/31/25 | 190,000.00 | 182,751.50 | |
| | UKT 0.25 07/31/31 | 250,000.00 | 216,427.50 | |
| | UKT 0.375 10/22/26 | 100,000.00 | 94,384.00 | |
| | UKT 0.375 10/22/30 | 110,000.00 | 98,105.70 | |

| | | | |
|--------------------|------------|------------|--|
| UKT 0.5 01/31/29 | 110,000.00 | 101,351.80 | |
| UKT 0.5 10/22/61 | 140,000.00 | 89,650.40 | |
| UKT 0.625 06/07/25 | 130,000.00 | 126,210.50 | |
| UKT 0.625 07/31/35 | 210,000.00 | 176,099.70 | |
| UKT 0.625 10/22/50 | 140,000.00 | 100,354.80 | |
| UKT 0.875 01/31/46 | 180,000.00 | 141,784.20 | |
| UKT 0.875 07/31/33 | 90,000.00 | 80,590.50 | |
| UKT 0.875 10/22/29 | 130,000.00 | 122,271.50 | |
| UKT 1 01/31/32 | 90,000.00 | 83,014.20 | |
| UKT 1 04/22/24 | 90,000.00 | 89,025.30 | |
| UKT 1.25 07/22/27 | 100,000.00 | 98,130.00 | |
| UKT 1.25 07/31/51 | 190,000.00 | 160,622.20 | |
| UKT 1.25 10/22/41 | 230,000.00 | 201,337.40 | |
| UKT 1.5 07/22/26 | 180,000.00 | 179,188.20 | |
| UKT 1.5 07/22/47 | 150,000.00 | 135,765.00 | |
| UKT 1.5 07/31/53 | 90,000.00 | 81,612.90 | |
| UKT 1.625 10/22/28 | 160,000.00 | 159,745.60 | |
| UKT 1.625 10/22/54 | 100,000.00 | 93,486.00 | |
| UKT 1.625 10/22/71 | 170,000.00 | 165,675.20 | |
| UKT 1.75 01/22/49 | 110,000.00 | 105,240.30 | |
| UKT 1.75 07/22/57 | 190,000.00 | 185,392.50 | |
| UKT 1.75 09/07/37 | 140,000.00 | 135,006.20 | |
| UKT 2 09/07/25 | 130,000.00 | 131,732.90 | |
| UKT 2.25 09/07/23 | 250,000.00 | 252,437.50 | |
| UKT 2.5 07/22/65 | 140,000.00 | 171,116.40 | |
| UKT 2.75 09/07/24 | 310,000.00 | 318,267.70 | |
| UKT 3.25 01/22/44 | 180,000.00 | 218,786.40 | |
| UKT 3.5 01/22/45 | 150,000.00 | 190,497.00 | |
| UKT 3.5 07/22/68 | 150,000.00 | 232,189.50 | |
| UKT 3.75 07/22/52 | 140,000.00 | 197,985.20 | |
| UKT 4 01/22/60 | 110,000.00 | 175,763.50 | |
| UKT 4.25 03/07/36 | 180,000.00 | 229,289.40 | |
| UKT 4.25 06/07/32 | 140,000.00 | 170,947.00 | |
| UKT 4.25 09/07/39 | 140,000.00 | 186,072.60 | |
| UKT 4.25 12/07/27 | 130,000.00 | 147,846.40 | |
| UKT 4.25 12/07/40 | 140,000.00 | 188,378.40 | |
| UKT 4.25 12/07/46 | 160,000.00 | 229,153.60 | |
| UKT 4.25 12/07/49 | 90,000.00 | 133,587.00 | |
| UKT 4.25 12/07/55 | 120,000.00 | 190,802.40 | |
| UKT 4.5 09/07/34 | 150,000.00 | 191,809.50 | |
| UKT 4.5 12/07/42 | 230,000.00 | 326,045.70 | |
| UKT 4.75 12/07/30 | 160,000.00 | 198,475.20 | |
| UKT 4.75 12/07/38 | 70,000.00 | 97,325.90 | |
| UKT 5 03/07/25 | 80,000.00 | 87,407.20 | |

| | | | | |
|-------------|---------------------|--------------|---------------------------------|--|
| | UKT 6 12/07/28 | 100,000.00 | 126,933.00 | |
| | イギリス・ポンド小計 | 8,160,000.00 | 8,672,193.90 (1,410,445,616) | |
| イスラエル・シユケル | ILGOV 1 03/31/30 | 150,000.00 | 135,906.00 | |
| | ILGOV 1.5 05/31/37 | 360,000.00 | 304,786.80 | |
| | ILGOV 1.5 11/30/23 | 780,000.00 | 782,020.20 | |
| | ILGOV 1.75 08/31/25 | 330,000.00 | 329,241.00 | |
| | ILGOV 2.25 09/28/28 | 270,000.00 | 270,899.10 | |
| | ILGOV 3.75 03/31/24 | 120,000.00 | 124,983.60 | |
| | ILGOV 3.75 03/31/47 | 290,000.00 | 323,292.00 | |
| | ILGOV 5.5 01/31/42 | 70,000.00 | 97,387.50 | |
| | ILGOV 6.25 10/30/26 | 450,000.00 | 532,890.00 | |
| | イスラエル・シユケル小計 | 2,820,000.00 | 2,901,406.20 (112,727,175) | |
| デンマーク・クローネ | DGB 0 11/15/24 | 510,000.00 | 503,691.30 | |
| | DGB 0 11/15/31 | 790,000.00 | 709,080.30 | |
| | DGB 0.25 11/15/52 | 500,000.00 | 368,625.00 | |
| | DGB 0.5 11/15/27 | 760,000.00 | 743,591.60 | |
| | DGB 0.5 11/15/29 | 860,000.00 | 829,341.00 | |
| | DGB 1.5 11/15/23 | 440,000.00 | 450,168.40 | |
| | DGB 1.75 11/15/25 | 480,000.00 | 497,889.60 | |
| | DGB 4.5 11/15/39 | 1,120,000.00 | 1,692,320.00 | |
| | デンマーク・クローネ小計 | 5,460,000.00 | 5,794,707.20 (106,622,612) | |
| ノルウェー・クローネ | NGB 1.25 09/17/31 | 230,000.00 | 202,526.50 | |
| | NGB 1.375 08/19/30 | 430,000.00 | 388,019.10 | |
| | NGB 1.5 02/19/26 | 440,000.00 | 423,434.00 | |
| | NGB 1.75 02/17/27 | 510,000.00 | 490,497.60 | |
| | NGB 1.75 03/13/25 | 810,000.00 | 794,213.10 | |
| | NGB 1.75 09/06/29 | 740,000.00 | 694,075.60 | |
| | NGB 2 04/26/28 | 400,000.00 | 386,064.00 | |
| | NGB 2 05/24/23 | 700,000.00 | 702,513.00 | |
| | NGB 2.125 05/18/32 | 240,000.00 | 227,736.00 | |
| | NGB 3 03/14/24 | 620,000.00 | 629,374.40 | |
| | ノルウェー・クローネ小計 | 5,120,000.00 | 4,938,453.30 (69,187,731) | |
| スウェーデン・クローナ | SGB 0.125 05/12/31 | 500,000.00 | 440,960.00 | |
| | SGB 0.75 05/12/28 | 830,000.00 | 796,351.80 | |
| | SGB 0.75 11/12/29 | 630,000.00 | 596,345.40 | |
| | SGB 1 11/12/26 | 880,000.00 | 865,867.20 | |
| | SGB 1.5 11/13/23 | 990,000.00 | 999,375.30 | |
| | SGB 2.25 06/01/32 | 500,000.00 | 532,895.00 | |
| | SGB 2.5 05/12/25 | 800,000.00 | 830,264.00 | |
| | SGB 3.5 03/30/39 | 430,000.00 | 544,427.30 | |

| | | | | |
|-----------|---------------------|---------------|--------------------------------|--|
| | スウェーデン・クローナ小計 | 5,560,000.00 | 5,606,486.00 (73,725,291) | |
| メキシコ・ペソ | MBONO 10 11/20/36 | 320,000.00 | 348,598.40 | |
| | MBONO 10 12/05/24 | 2,700,000.00 | 2,759,616.00 | |
| | MBONO 5.75 03/05/26 | 4,140,000.00 | 3,704,513.40 | |
| | MBONO 7.5 06/03/27 | 4,350,000.00 | 4,101,919.50 | |
| | MBONO 7.75 05/29/31 | 2,520,000.00 | 2,343,096.00 | |
| | MBONO 7.75 11/13/42 | 2,000,000.00 | 1,766,900.00 | |
| | MBONO 7.75 11/23/34 | 1,830,000.00 | 1,670,131.20 | |
| | MBONO 8 09/05/24 | 2,980,000.00 | 2,917,360.40 | |
| | MBONO 8 11/07/47 | 1,860,000.00 | 1,677,292.20 | |
| | MBONO 8 12/07/23 | 2,760,000.00 | 2,724,975.60 | |
| | MBONO 8.5 05/31/29 | 3,570,000.00 | 3,499,421.10 | |
| | MBONO 8.5 11/18/38 | 3,100,000.00 | 2,990,787.00 | |
| | メキシコ・ペソ小計 | 32,130,000.00 | 30,504,610.80 (192,505,447) | |
| オフショア・人民元 | CGB 2.47 09/02/24 | 2,000,000.00 | 2,005,560.00 | |
| | CGB 2.56 10/21/23 | 4,000,000.00 | 4,023,480.00 | |
| | CGB 2.69 08/12/26 | 3,000,000.00 | 3,014,100.00 | |
| | CGB 2.91 10/14/28 | 5,000,000.00 | 5,035,300.00 | |
| | CGB 3.02 05/27/31 | 5,000,000.00 | 5,057,550.00 | |
| | CGB 3.72 04/12/51 | 1,000,000.00 | 1,066,240.00 | |
| | オフショア・人民元小計 | 20,000,000.00 | 20,202,230.00 (392,317,205) | |
| ポーランド・ズロチ | POLGB 0 04/25/23 | 180,000.00 | 170,496.00 | |
| | POLGB 0.25 10/25/26 | 450,000.00 | 341,550.00 | |
| | POLGB 1.25 10/25/30 | 230,000.00 | 158,125.00 | |
| | POLGB 1.75 04/25/32 | 50,000.00 | 33,540.00 | |
| | POLGB 2.25 10/25/24 | 1,230,000.00 | 1,110,813.00 | |
| | POLGB 2.5 07/25/26 | 510,000.00 | 432,862.50 | |
| | POLGB 2.5 07/25/27 | 180,000.00 | 148,692.60 | |
| | POLGB 2.75 10/25/29 | 590,000.00 | 470,672.50 | |
| | POLGB 3.25 07/25/25 | 470,000.00 | 424,128.00 | |
| | POLGB 3.75 05/25/27 | 680,000.00 | 596,645.60 | |
| | ポーランド・ズロチ小計 | 4,570,000.00 | 3,887,525.20 (114,630,678) | |
| ユーロ | BGB 0 10/22/27 | 105,000.00 | 100,332.75 | |
| | BGB 0 10/22/31 | 140,000.00 | 124,073.60 | |
| | BGB 0.1 06/22/30 | 120,000.00 | 110,668.80 | |
| | BGB 0.2 10/22/23 | 80,000.00 | 80,300.80 | |
| | BGB 0.35 06/22/32 | 80,000.00 | 72,307.20 | |
| | BGB 0.4 06/22/40 | 90,000.00 | 71,350.20 | |
| | BGB 0.5 10/22/24 | 90,000.00 | 90,414.90 | |
| | BGB 0.65 06/22/71 | 30,000.00 | 17,832.00 | |

| | | | |
|--------------------|------------|------------|--|
| BGB 0.8 06/22/25 | 170,000.00 | 171,696.60 | |
| BGB 0.8 06/22/27 | 140,000.00 | 140,040.60 | |
| BGB 0.8 06/22/28 | 130,000.00 | 129,331.80 | |
| BGB 0.9 06/22/29 | 170,000.00 | 168,784.50 | |
| BGB 1 06/22/26 | 200,000.00 | 202,998.00 | |
| BGB 1 06/22/31 | 160,000.00 | 157,273.60 | |
| BGB 1.25 04/22/33 | 100,000.00 | 99,638.00 | |
| BGB 1.4 06/22/53 | 60,000.00 | 53,003.40 | |
| BGB 1.45 06/22/37 | 60,000.00 | 58,482.00 | |
| BGB 1.6 06/22/47 | 140,000.00 | 133,533.40 | |
| BGB 1.7 06/22/50 | 100,000.00 | 96,821.00 | |
| BGB 1.9 06/22/38 | 90,000.00 | 93,467.70 | |
| BGB 2.15 06/22/66 | 130,000.00 | 139,579.70 | |
| BGB 2.25 06/22/23 | 100,000.00 | 102,870.00 | |
| BGB 2.6 06/22/24 | 240,000.00 | 252,278.40 | |
| BGB 3 06/22/34 | 120,000.00 | 140,623.20 | |
| BGB 3.75 06/22/45 | 110,000.00 | 149,965.20 | |
| BGB 4 03/28/32 | 130,000.00 | 162,988.80 | |
| BGB 4.25 03/28/41 | 170,000.00 | 237,255.40 | |
| BGB 4.5 03/28/26 | 140,000.00 | 161,501.20 | |
| BGB 5 03/28/35 | 210,000.00 | 295,478.40 | |
| BGB 5.5 03/28/28 | 210,000.00 | 267,311.10 | |
| BKO 0 09/15/23 | 210,000.00 | 210,380.10 | |
| BTPS | 220,000.00 | 215,311.80 | |
| BTPS 0 01/30/24 | 240,000.00 | 237,732.00 | |
| BTPS 0 04/15/24 | 250,000.00 | 246,472.50 | |
| BTPS 0 08/01/26 | 50,000.00 | 46,727.00 | |
| BTPS 0 11/29/23 | 190,000.00 | 188,614.90 | |
| BTPS 0 12/15/24 | 60,000.00 | 58,222.20 | |
| BTPS 0.25 03/15/28 | 100,000.00 | 90,683.00 | |
| BTPS 0.3 08/15/23 | 100,000.00 | 100,246.00 | |
| BTPS 0.35 02/01/25 | 170,000.00 | 166,424.90 | |
| BTPS 0.45 02/15/29 | 290,000.00 | 259,132.40 | |
| BTPS 0.5 02/01/26 | 50,000.00 | 48,298.50 | |
| BTPS 0.5 07/15/28 | 250,000.00 | 228,262.50 | |
| BTPS 0.6 08/01/31 | 370,000.00 | 312,206.00 | |
| BTPS 0.65 10/15/23 | 160,000.00 | 160,865.60 | |
| BTPS 0.85 01/15/27 | 240,000.00 | 231,201.60 | |
| BTPS 0.9 04/01/31 | 170,000.00 | 148,790.80 | |
| BTPS 0.95 03/01/37 | 190,000.00 | 148,692.10 | |
| BTPS 0.95 06/01/32 | 160,000.00 | 137,110.40 | |
| BTPS 0.95 08/01/30 | 180,000.00 | 161,100.00 | |
| BTPS 0.95 09/15/27 | 200,000.00 | 191,368.00 | |
| BTPS 0.95 12/01/31 | 200,000.00 | 173,300.00 | |

| | | | |
|--------------------|------------|------------|--|
| BTPS 1.25 12/01/26 | 360,000.00 | 354,279.60 | |
| BTPS 1.35 04/01/30 | 370,000.00 | 345,398.70 | |
| BTPS 1.45 03/01/36 | 190,000.00 | 162,792.00 | |
| BTPS 1.45 05/15/25 | 240,000.00 | 241,442.40 | |
| BTPS 1.45 11/15/24 | 250,000.00 | 252,097.50 | |
| BTPS 1.5 04/30/45 | 130,000.00 | 99,342.10 | |
| BTPS 1.5 06/01/25 | 410,000.00 | 413,464.50 | |
| BTPS 1.6 06/01/26 | 230,000.00 | 230,828.00 | |
| BTPS 1.65 03/01/32 | 240,000.00 | 222,796.80 | |
| BTPS 1.65 12/01/30 | 210,000.00 | 197,748.60 | |
| BTPS 1.7 09/01/51 | 140,000.00 | 104,959.40 | |
| BTPS 1.8 03/01/41 | 140,000.00 | 117,640.60 | |
| BTPS 1.85 05/15/24 | 330,000.00 | 337,137.90 | |
| BTPS 2 02/01/28 | 320,000.00 | 322,380.80 | |
| BTPS 2 12/01/25 | 220,000.00 | 224,727.80 | |
| BTPS 2.05 08/01/27 | 430,000.00 | 435,628.70 | |
| BTPS 2.1 07/15/26 | 250,000.00 | 255,712.50 | |
| BTPS 2.15 03/01/72 | 50,000.00 | 37,843.50 | |
| BTPS 2.15 09/01/52 | 70,000.00 | 57,334.90 | |
| BTPS 2.2 06/01/27 | 180,000.00 | 184,143.60 | |
| BTPS 2.25 09/01/36 | 120,000.00 | 113,487.60 | |
| BTPS 2.45 09/01/33 | 150,000.00 | 148,125.00 | |
| BTPS 2.45 09/01/50 | 150,000.00 | 133,350.00 | |
| BTPS 2.45 10/01/23 | 680,000.00 | 701,590.00 | |
| BTPS 2.5 11/15/25 | 360,000.00 | 374,072.40 | |
| BTPS 2.5 12/01/24 | 130,000.00 | 134,920.50 | |
| BTPS 2.7 03/01/47 | 170,000.00 | 162,834.50 | |
| BTPS 2.8 03/01/67 | 90,000.00 | 81,692.10 | |
| BTPS 2.8 12/01/28 | 120,000.00 | 125,823.60 | |
| BTPS 2.95 09/01/38 | 150,000.00 | 153,013.50 | |
| BTPS 3 08/01/29 | 350,000.00 | 369,705.00 | |
| BTPS 3.1 03/01/40 | 120,000.00 | 123,970.80 | |
| BTPS 3.25 09/01/46 | 180,000.00 | 189,640.80 | |
| BTPS 3.35 03/01/35 | 110,000.00 | 117,955.20 | |
| BTPS 3.45 03/01/48 | 250,000.00 | 271,220.00 | |
| BTPS 3.5 03/01/30 | 60,000.00 | 65,682.60 | |
| BTPS 3.75 09/01/24 | 150,000.00 | 159,925.50 | |
| BTPS 3.85 09/01/49 | 140,000.00 | 161,575.40 | |
| BTPS 4 02/01/37 | 250,000.00 | 288,750.00 | |
| BTPS 4.5 03/01/24 | 70,000.00 | 75,041.40 | |
| BTPS 4.5 03/01/26 | 250,000.00 | 279,197.50 | |
| BTPS 4.75 08/01/23 | 300,000.00 | 317,688.00 | |
| BTPS 4.75 09/01/28 | 140,000.00 | 163,052.40 | |
| BTPS 4.75 09/01/44 | 170,000.00 | 221,051.00 | |

| | | | |
|--------------------|------------|------------|--|
| BTPS 5 03/01/25 | 300,000.00 | 332,712.00 | |
| BTPS 5 08/01/34 | 380,000.00 | 476,881.00 | |
| BTPS 5 08/01/39 | 330,000.00 | 427,845.00 | |
| BTPS 5 09/01/40 | 180,000.00 | 235,130.40 | |
| BTPS 5.25 11/01/29 | 350,000.00 | 427,178.50 | |
| BTPS 5.75 02/01/33 | 200,000.00 | 261,260.00 | |
| BTPS 6 05/01/31 | 250,000.00 | 324,467.50 | |
| BTPS 6.5 11/01/27 | 190,000.00 | 237,450.60 | |
| BTPS 9 11/01/23 | 170,000.00 | 192,173.10 | |
| DBR 0 02/15/30 | 210,000.00 | 198,527.70 | |
| DBR 0 02/15/31 | 450,000.00 | 420,651.00 | |
| DBR 0 02/15/32 | 160,000.00 | 147,342.40 | |
| DBR 0 05/15/35 | 200,000.00 | 176,746.00 | |
| DBR 0 05/15/36 | 280,000.00 | 244,168.40 | |
| DBR 0 08/15/26 | 380,000.00 | 371,765.40 | |
| DBR 0 08/15/29 | 250,000.00 | 237,625.00 | |
| DBR 0 08/15/30 | 500,000.00 | 470,135.00 | |
| DBR 0 08/15/31 | 350,000.00 | 324,859.50 | |
| DBR 0 08/15/50 | 230,000.00 | 175,050.70 | |
| DBR 0 08/15/50 | 130,000.00 | 99,602.10 | |
| DBR 0 08/15/52 | 160,000.00 | 118,520.00 | |
| DBR 0 11/15/27 | 400,000.00 | 386,500.00 | |
| DBR 0 11/15/28 | 200,000.00 | 191,418.00 | |
| DBR 0.25 02/15/27 | 320,000.00 | 315,590.40 | |
| DBR 0.25 02/15/29 | 250,000.00 | 242,870.00 | |
| DBR 0.25 08/15/28 | 220,000.00 | 214,328.40 | |
| DBR 0.5 02/15/25 | 230,000.00 | 231,173.00 | |
| DBR 0.5 02/15/26 | 360,000.00 | 360,446.40 | |
| DBR 0.5 02/15/28 | 230,000.00 | 228,074.90 | |
| DBR 0.5 08/15/27 | 330,000.00 | 328,188.30 | |
| DBR 1 08/15/24 | 160,000.00 | 162,838.40 | |
| DBR 1 08/15/25 | 430,000.00 | 438,406.50 | |
| DBR 1.25 08/15/48 | 280,000.00 | 299,650.40 | |
| DBR 1.5 05/15/23 | 400,000.00 | 407,540.00 | |
| DBR 1.5 05/15/24 | 390,000.00 | 400,600.20 | |
| DBR 1.75 02/15/24 | 320,000.00 | 329,612.80 | |
| DBR 2 08/15/23 | 250,000.00 | 257,307.50 | |
| DBR 2.5 07/04/44 | 290,000.00 | 381,892.30 | |
| DBR 2.5 08/15/46 | 350,000.00 | 470,995.00 | |
| DBR 3.25 07/04/42 | 180,000.00 | 256,732.20 | |
| DBR 4 01/04/37 | 260,000.00 | 370,307.60 | |
| DBR 4.25 07/04/39 | 250,000.00 | 380,960.00 | |
| DBR 4.75 07/04/28 | 170,000.00 | 212,477.90 | |
| DBR 4.75 07/04/34 | 230,000.00 | 334,068.10 | |

| | | | |
|--------------------|------------|------------|--|
| DBR 4.75 07/04/40 | 200,000.00 | 326,846.00 | |
| DBR 5.5 01/04/31 | 80,000.00 | 112,046.40 | |
| DBR 5.625 01/04/28 | 160,000.00 | 204,867.20 | |
| DBR 6.25 01/04/30 | 130,000.00 | 184,208.70 | |
| DBR 6.5 07/04/27 | 160,000.00 | 208,246.40 | |
| FRANCE O.A.T. | 80,000.00 | 59,980.00 | |
| FRTR 0 02/25/24 | 500,000.00 | 498,435.00 | |
| FRTR 0 02/25/26 | 540,000.00 | 526,213.80 | |
| FRTR 0 02/25/27 | 350,000.00 | 336,584.50 | |
| FRTR 0 03/25/24 | 720,000.00 | 716,788.80 | |
| FRTR 0 03/25/25 | 450,000.00 | 443,304.00 | |
| FRTR 0 05/25/32 | 180,000.00 | 157,712.40 | |
| FRTR 0 11/25/29 | 400,000.00 | 369,176.00 | |
| FRTR 0 11/25/30 | 510,000.00 | 461,565.30 | |
| FRTR 0 11/25/31 | 450,000.00 | 398,731.50 | |
| FRTR 0.25 11/25/26 | 360,000.00 | 351,712.80 | |
| FRTR 0.5 05/25/25 | 430,000.00 | 429,423.80 | |
| FRTR 0.5 05/25/26 | 640,000.00 | 634,713.60 | |
| FRTR 0.5 05/25/29 | 530,000.00 | 511,598.40 | |
| FRTR 0.5 05/25/40 | 180,000.00 | 148,098.60 | |
| FRTR 0.5 05/25/72 | 80,000.00 | 44,832.00 | |
| FRTR 0.5 06/25/44 | 120,000.00 | 94,034.40 | |
| FRTR 0.75 05/25/28 | 680,000.00 | 673,696.40 | |
| FRTR 0.75 05/25/52 | 350,000.00 | 267,144.50 | |
| FRTR 0.75 11/25/28 | 460,000.00 | 454,070.60 | |
| FRTR 1 05/25/27 | 360,000.00 | 363,132.00 | |
| FRTR 1 11/25/25 | 450,000.00 | 455,926.50 | |
| FRTR 1.25 05/25/34 | 430,000.00 | 420,742.10 | |
| FRTR 1.25 05/25/36 | 390,000.00 | 376,346.10 | |
| FRTR 1.5 05/25/31 | 620,000.00 | 637,384.80 | |
| FRTR 1.5 05/25/50 | 330,000.00 | 312,632.10 | |
| FRTR 1.75 05/25/23 | 390,000.00 | 398,193.90 | |
| FRTR 1.75 05/25/66 | 120,000.00 | 117,709.20 | |
| FRTR 1.75 06/25/39 | 300,000.00 | 310,023.00 | |
| FRTR 1.75 11/25/24 | 450,000.00 | 465,142.50 | |
| FRTR 2 05/25/48 | 280,000.00 | 296,578.80 | |
| FRTR 2.25 05/25/24 | 350,000.00 | 364,192.50 | |
| FRTR 2.5 05/25/30 | 610,000.00 | 677,874.70 | |
| FRTR 2.75 10/25/27 | 530,000.00 | 584,415.10 | |
| FRTR 3.25 05/25/45 | 360,000.00 | 467,283.60 | |
| FRTR 3.5 04/25/26 | 410,000.00 | 455,727.30 | |
| FRTR 4 04/25/55 | 270,000.00 | 419,164.20 | |
| FRTR 4 04/25/60 | 170,000.00 | 272,652.80 | |
| FRTR 4 10/25/38 | 270,000.00 | 366,870.60 | |

| | | | |
|----------------------|------------|------------|--|
| FRTR 4.25 10/25/23 | 340,000.00 | 361,464.20 | |
| FRTR 4.5 04/25/41 | 460,000.00 | 673,835.60 | |
| FRTR 4.75 04/25/35 | 300,000.00 | 418,311.00 | |
| FRTR 5.5 04/25/29 | 390,000.00 | 510,026.40 | |
| FRTR 5.75 10/25/32 | 340,000.00 | 488,722.80 | |
| FRTR 6 10/25/25 | 180,000.00 | 213,730.20 | |
| IRISH 0 10/18/31 | 100,000.00 | 87,712.00 | |
| IRISH 0.2 05/15/27 | 120,000.00 | 116,492.40 | |
| IRISH 0.2 10/18/30 | 40,000.00 | 36,709.20 | |
| IRISH 0.9 05/15/28 | 120,000.00 | 119,473.20 | |
| IRISH 1 05/15/26 | 120,000.00 | 121,566.00 | |
| IRISH 1.1 05/15/29 | 100,000.00 | 100,141.00 | |
| IRISH 1.3 05/15/33 | 90,000.00 | 88,261.20 | |
| IRISH 1.35 03/18/31 | 60,000.00 | 60,689.40 | |
| IRISH 1.5 05/15/50 | 70,000.00 | 65,616.60 | |
| IRISH 1.7 05/15/37 | 100,000.00 | 101,329.00 | |
| IRISH 2 02/18/45 | 100,000.00 | 105,539.00 | |
| IRISH 2.4 05/15/30 | 100,000.00 | 109,738.00 | |
| IRISH 3.4 03/18/24 | 80,000.00 | 84,775.20 | |
| IRISH 5.4 03/13/25 | 100,000.00 | 113,906.00 | |
| IRISH GOVT | 50,000.00 | 40,725.50 | |
| NETHER 0 01/15/24 | 170,000.00 | 169,835.10 | |
| NETHER 0 01/15/26 | 60,000.00 | 58,661.40 | |
| NETHER 0 01/15/27 | 140,000.00 | 135,557.80 | |
| NETHER 0 01/15/29 | 110,000.00 | 103,602.40 | |
| NETHER 0 01/15/38 | 80,000.00 | 66,003.20 | |
| NETHER 0 01/15/52 | 130,000.00 | 92,639.30 | |
| NETHER 0 07/15/30 | 120,000.00 | 110,971.20 | |
| NETHER 0 07/15/31 | 180,000.00 | 164,138.40 | |
| NETHER 0.25 07/15/25 | 210,000.00 | 208,569.90 | |
| NETHER 0.25 07/15/29 | 130,000.00 | 124,151.30 | |
| NETHER 0.5 01/15/40 | 110,000.00 | 97,879.10 | |
| NETHER 0.5 07/15/26 | 230,000.00 | 228,978.80 | |
| NETHER 0.5 07/15/32 | 100,000.00 | 94,147.00 | |
| NETHER 0.75 07/15/27 | 170,000.00 | 170,171.70 | |
| NETHER 0.75 07/15/28 | 210,000.00 | 209,181.00 | |
| NETHER 1.75 07/15/23 | 160,000.00 | 163,992.00 | |
| NETHER 2 07/15/24 | 170,000.00 | 176,638.50 | |
| NETHER 2.5 01/15/33 | 140,000.00 | 159,682.60 | |
| NETHER 2.75 01/15/47 | 200,000.00 | 270,160.00 | |
| NETHER 3.75 01/15/42 | 190,000.00 | 275,015.50 | |
| NETHER 4 01/15/37 | 190,000.00 | 261,637.60 | |
| NETHER 5.5 01/15/28 | 90,000.00 | 113,838.30 | |
| OBL 0 04/05/24 | 410,000.00 | 408,921.70 | |

| | | | |
|---------------------|------------|------------|--|
| OBL 0 04/10/26 | 120,000.00 | 117,708.00 | |
| OBL 0 04/11/25 | 190,000.00 | 187,982.20 | |
| OBL 0 04/16/27 | 30,000.00 | 29,135.40 | |
| OBL 0 10/09/26 | 230,000.00 | 224,443.20 | |
| OBL 0 10/10/25 | 310,000.00 | 306,159.10 | |
| OBL 0 10/13/23 | 350,000.00 | 350,700.00 | |
| OBL 0 10/18/24 | 330,000.00 | 327,716.40 | |
| RAGB 0 02/20/30 | 120,000.00 | 110,023.20 | |
| RAGB 0 02/20/31 | 140,000.00 | 126,028.00 | |
| RAGB 0 04/20/25 | 60,000.00 | 59,141.40 | |
| RAGB 0 07/15/23 | 180,000.00 | 180,363.60 | |
| RAGB 0 07/15/24 | 160,000.00 | 159,224.00 | |
| RAGB 0 10/20/28 | 30,000.00 | 28,129.20 | |
| RAGB 0 10/20/40 | 50,000.00 | 37,907.50 | |
| RAGB 0.25 10/20/36 | 110,000.00 | 92,634.30 | |
| RAGB 0.5 02/20/29 | 110,000.00 | 106,404.10 | |
| RAGB 0.5 04/20/27 | 200,000.00 | 197,676.00 | |
| RAGB 0.7 04/20/71 | 50,000.00 | 34,059.50 | |
| RAGB 0.75 02/20/28 | 130,000.00 | 129,279.80 | |
| RAGB 0.75 03/20/51 | 80,000.00 | 66,011.20 | |
| RAGB 0.75 10/20/26 | 150,000.00 | 150,520.50 | |
| RAGB 0.9 02/20/32 | 50,000.00 | 48,167.50 | |
| RAGB 1.2 10/20/25 | 140,000.00 | 143,283.00 | |
| RAGB 1.5 02/20/47 | 70,000.00 | 70,912.80 | |
| RAGB 1.5 11/02/86 | 100,000.00 | 90,530.00 | |
| RAGB 1.65 10/21/24 | 80,000.00 | 82,754.40 | |
| RAGB 1.75 10/20/23 | 80,000.00 | 82,151.20 | |
| RAGB 2.4 05/23/34 | 100,000.00 | 111,973.00 | |
| RAGB 3.15 06/20/44 | 100,000.00 | 133,701.00 | |
| RAGB 3.8 01/26/62 | 50,000.00 | 82,490.50 | |
| RAGB 4.15 03/15/37 | 120,000.00 | 164,859.60 | |
| RAGB 4.85 03/15/26 | 100,000.00 | 116,793.00 | |
| RAGB 6.25 07/15/27 | 20,000.00 | 25,683.20 | |
| RFGB 0 09/15/23 | 60,000.00 | 60,057.00 | |
| RFGB 0 09/15/24 | 110,000.00 | 109,104.60 | |
| RFGB 0 09/15/26 | 40,000.00 | 38,651.60 | |
| RFGB 0 09/15/30 | 70,000.00 | 63,590.80 | |
| RFGB 0.125 04/15/36 | 40,000.00 | 33,501.20 | |
| RFGB 0.125 04/15/52 | 20,000.00 | 13,677.60 | |
| RFGB 0.125 09/15/31 | 70,000.00 | 63,135.80 | |
| RFGB 0.25 09/15/40 | 70,000.00 | 56,399.00 | |
| RFGB 0.5 04/15/26 | 100,000.00 | 99,270.00 | |
| RFGB 0.5 04/15/43 | 60,000.00 | 49,397.40 | |
| RFGB 0.5 09/15/27 | 40,000.00 | 39,332.40 | |

| | | | |
|---------------------|------------|------------|--|
| RFGB 0.5 09/15/29 | 50,000.00 | 48,072.00 | |
| RFGB 0.75 04/15/31 | 30,000.00 | 28,938.60 | |
| RFGB 0.875 09/15/25 | 100,000.00 | 100,975.00 | |
| RFGB 1.125 04/15/34 | 30,000.00 | 29,245.80 | |
| RFGB 1.375 04/15/47 | 50,000.00 | 50,083.00 | |
| RFGB 1.5 04/15/23 | 60,000.00 | 60,998.40 | |
| RFGB 2.625 07/04/42 | 40,000.00 | 48,302.40 | |
| RFGB 2.75 07/04/28 | 100,000.00 | 111,204.00 | |
| SPGB 0 01/31/25 | 340,000.00 | 333,645.40 | |
| SPGB 0 01/31/26 | 210,000.00 | 202,169.10 | |
| SPGB 0 01/31/27 | 210,000.00 | 198,473.10 | |
| SPGB 0 01/31/28 | 280,000.00 | 260,106.00 | |
| SPGB 0 04/30/23 | 180,000.00 | 180,352.80 | |
| SPGB 0 05/31/24 | 230,000.00 | 227,739.10 | |
| SPGB 0.1 04/30/31 | 190,000.00 | 165,157.50 | |
| SPGB 0.25 07/30/24 | 260,000.00 | 258,616.80 | |
| SPGB 0.35 07/30/23 | 190,000.00 | 190,699.20 | |
| SPGB 0.5 04/30/30 | 310,000.00 | 286,601.20 | |
| SPGB 0.5 10/31/31 | 280,000.00 | 249,429.60 | |
| SPGB 0.6 10/31/29 | 220,000.00 | 206,927.60 | |
| SPGB 0.7 04/30/32 | 340,000.00 | 305,156.80 | |
| SPGB 0.8 07/30/27 | 120,000.00 | 117,392.40 | |
| SPGB 0.85 07/30/37 | 120,000.00 | 100,059.60 | |
| SPGB 1 10/31/50 | 190,000.00 | 138,040.70 | |
| SPGB 1.2 10/31/40 | 240,000.00 | 203,908.80 | |
| SPGB 1.25 10/31/30 | 240,000.00 | 233,688.00 | |
| SPGB 1.3 10/31/26 | 150,000.00 | 151,650.00 | |
| SPGB 1.4 04/30/28 | 280,000.00 | 281,764.00 | |
| SPGB 1.4 07/30/28 | 180,000.00 | 180,898.20 | |
| SPGB 1.45 04/30/29 | 230,000.00 | 230,903.90 | |
| SPGB 1.45 10/31/27 | 180,000.00 | 181,926.00 | |
| SPGB 1.45 10/31/71 | 70,000.00 | 46,205.60 | |
| SPGB 1.5 04/30/27 | 290,000.00 | 294,471.80 | |
| SPGB 1.85 07/30/35 | 280,000.00 | 275,682.40 | |
| SPGB 1.9 10/31/52 | 50,000.00 | 44,074.00 | |
| SPGB 1.95 04/30/26 | 450,000.00 | 466,155.00 | |
| SPGB 1.95 07/30/30 | 210,000.00 | 216,503.70 | |
| SPGB 2.15 10/31/25 | 250,000.00 | 260,832.50 | |
| SPGB 2.35 07/30/33 | 190,000.00 | 199,636.80 | |
| SPGB 2.7 10/31/48 | 160,000.00 | 173,539.20 | |
| SPGB 2.75 10/31/24 | 230,000.00 | 242,574.10 | |
| SPGB 2.9 10/31/46 | 190,000.00 | 213,351.00 | |
| SPGB 3.45 07/30/66 | 170,000.00 | 202,828.70 | |
| SPGB 3.8 04/30/24 | 80,000.00 | 85,431.20 | |

| | | | | |
|--------|--------------------|---------------|------------------------------------|--|
| | SPGB 4.2 01/31/37 | 230,000.00 | 294,834.70 | |
| | SPGB 4.4 10/31/23 | 300,000.00 | 319,230.00 | |
| | SPGB 4.65 07/30/25 | 460,000.00 | 515,650.80 | |
| | SPGB 4.7 07/30/41 | 200,000.00 | 281,624.00 | |
| | SPGB 4.8 01/31/24 | 140,000.00 | 151,057.20 | |
| | SPGB 4.9 07/30/40 | 180,000.00 | 257,522.40 | |
| | SPGB 5.15 10/31/28 | 380,000.00 | 469,474.80 | |
| | SPGB 5.15 10/31/44 | 160,000.00 | 244,700.80 | |
| | SPGB 5.75 07/30/32 | 120,000.00 | 165,122.40 | |
| | SPGB 5.9 07/30/26 | 110,000.00 | 132,317.90 | |
| | SPGB 6 01/31/29 | 160,000.00 | 208,600.00 | |
| | ユーロ小計 | 67,835,000.00 | 70,660,848.65 (9,672,056,963) | |
| 国債証券合計 | | | 26,250,030,345 (26,250,030,345) | |
| 合 計 | | | 26,250,030,345 (26,250,030,345) | |

(注) 金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 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 | 202銘柄 | 49.8% | 49.2% |
| カナダ・ドル | 国債証券 | 28銘柄 | 2.1% | 2.0% |
| オーストラリア・ドル | 国債証券 | 25銘柄 | 1.6% | 1.6% |
| シンガポール・ドル | 国債証券 | 13銘柄 | 0.9% | 0.9% |
| イギリス・ポンド | 国債証券 | 53銘柄 | 5.4% | 5.4% |
| イスラエル・シケル | 国債証券 | 9銘柄 | 0.4% | 0.4% |
| デンマーク・クローネ | 国債証券 | 8銘柄 | 0.4% | 0.4% |
| ノルウェー・クローネ | 国債証券 | 10銘柄 | 0.3% | 0.3% |
| スウェーデン・クローナ | 国債証券 | 8銘柄 | 0.3% | 0.3% |
| メキシコ・ペソ | 国債証券 | 12銘柄 | 0.7% | 0.7% |
| オフショア・人民元 | 国債証券 | 6銘柄 | 1.5% | 1.5% |
| ポーランド・ズロチ | 国債証券 | 10銘柄 | 0.4% | 0.4% |
| ユーロ | 国債証券 | 327銘柄 | 37.3% | 36.8% |

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)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

2022年5月31日現在

| | |
|--------------------------------|----------------------|
| 資産総額 | 9,087,241,720円 |
| 負債総額 | 46,028,758円 |
| 純資産総額（ - ） | 9,041,212,962円 |
| 発行済口数 | 8,898,215,652口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額） | 1.0161円 (10,161円) |

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

2022年5月31日現在

| | |
|--------------------------------|----------------------|
| 資産総額 | 7,363,376,574円 |
| 負債総額 | 89,412,334円 |
| 純資産総額（ - ） | 7,273,964,240円 |
| 発行済口数 | 6,676,115,712口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額） | 1.0896円 (10,896円) |

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

2022年5月31日現在

| | |
|--------------------------------|----------------------|
| 資産総額 | 3,853,488,935円 |
| 負債総額 | 6,362,685円 |
| 純資産総額（ - ） | 3,847,126,250円 |
| 発行済口数 | 3,412,106,047口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額） | 1.1275円 (11,275円) |

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、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また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等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券は発行されません。

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

八 受益者に対する特典

ありません。

二 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

- a. 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または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b. 上記aの申請のある場合には、上記aの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少およ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または記録するものとします。ただし、上記a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または記録が行われるよう通知するものとします。
- c. 上記a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または記録されている振替口座簿にかか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また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。

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

ホ 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議の上、社振法に定めるところに従い、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。

ヘ 償還金

償還金は、原則として、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に支払います。

ト 質権口記載また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または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金およ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】

イ 資本金の額および株式数

| | |
|--------------|--------------|
| | 2022年5月31日現在 |
| 資本金の額 | 20億円 |
| 会社が発行する株式の総数 | 60,000,000株 |
| 発行済株式総数 | 33,870,060株 |

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

ハ 会社の機構

委託会社の取締役は8名以内とし、株主総会で選任されます。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、累積投票によらないものとします。

取締役の任期は、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の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定し、必要に応じて取締役会長1名を選定することができます。

ニ 投資信託の運用の流れ



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投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

2022年5月31日現在、委託会社が運用を行っている投資信託(親投資信託は除きます)は、以下の通りです。

| | 本数(本) | 純資産総額(百万円) |
|------------|-------|------------|
| 追加型株式投資信託 | 721 | 9,134,166 |
| 単体型株式投資信託 | 100 | 492,047 |
| 追加型公社債投資信託 | 1 | 25,757 |
| 単体型公社債投資信託 | 187 | 365,263 |
| 合計 | 1,009 | 10,017,235 |

3【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、「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条の規定により、「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)に基づいて作成しております。
- 2 当社は、当事業年度(2021年4月1日から2022年3月31日まで)の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任あずさ監査法人の監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

| | (単位:千円) | |
|----------|-----------------------|-----------------------|
| | 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 | 33,048,142 | 49,008,279 |
| 顧客分別金信託 | 300,036 | 300,041 |
| 前払費用 | 449,748 | 475,266 |
| 未収入金 | 132,419 | 103,809 |
| 未収委託者報酬 | 9,936,096 | 12,125,117 |
| 未収運用受託報酬 | 2,247,156 | 2,437,063 |
| 未収投資助言報酬 | 398,108 | 388,639 |
| 未収収益 | 39,975 | 36,700 |
| その他の流動資産 | 6,981 | 18,458 |
| 流動資産合計 | 46,558,665 | 64,893,375 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | 1 | |
| 建物 | 1,509,450 | 1,433,442 |
| 器具備品 | 870,855 | 653,985 |
| 土地 | 710 | 710 |
| リース資産 | 13,483 | 7,357 |

| | | |
|------------|-------------|-------------|
| 建設仮勘定 | - | 5,500 |
| 有形固定資産合計 | 2,394,500 | 2,100,996 |
| 無形固定資産 | | |
| ソフトウェア | 1,347,889 | 2,766,476 |
| ソフトウェア仮勘定 | 1,029,033 | 100,616 |
| のれん | 3,654,491 | 3,349,950 |
| 顧客関連資産 | 15,671,890 | 13,558,615 |
| 電話加入権 | 12,727 | 12,716 |
| 商標権 | 48 | 42 |
| 無形固定資産合計 | 21,716,080 | 19,788,417 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | 22,866,282 | 14,212,354 |
| 関係会社株式 | 11,246,398 | 11,246,398 |
| 長期差入保証金 | 1,409,091 | 1,414,646 |
| 長期前払費用 | 116,117 | 77,936 |
| 会員権 | 90,479 | 90,479 |
| 貸倒引当金 | 20,750 | 20,750 |
| 投資その他の資産合計 | 35,707,619 | 27,021,065 |
| 固定資産合計 | 59,818,200 | 48,910,479 |
| 資産合計 | 106,376,866 | 113,803,855 |

(単位：千円)

| | 前事業年度 (2021年3月31日) | 当事業年度 (2022年3月31日) |
|--------------|-----------------------|-----------------------|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| リース債務 | 5,153 | 3,567 |
| 顧客からの預り金 | 20,077 | 6,045 |
| その他の預り金 | 169,380 | 196,515 |
| 未払金 | | |
| 未払収益分配金 | 1,646 | 1,969 |
| 未払償還金 | 43,523 | 152 |
| 未払手数料 | 4,480,697 | 5,545,582 |
| その他未払金 | 270,290 | 48,893 |
| 未払費用 | 5,940,121 | 7,379,404 |
| 未払消費税等 | 235,647 | 1,133,332 |
| 未払法人税等 | 762,648 | 2,455,291 |
| 賞与引当金 | 1,516,622 | 2,100,323 |
| 資産除去債務 | - | 7,192 |
| その他の流動負債 | 9,710 | 40,396 |
| 流動負債合計 | 13,455,519 | 18,918,667 |
| 固定負債 | | |
| リース債務 | 9,678 | 4,525 |
| 繰延税金負債 | 2,566,958 | 1,279,409 |
| 退職給付引当金 | 5,258,448 | 5,084,506 |
| その他の固定負債 | 40,950 | 4,620 |
| 固定負債合計 | 7,876,035 | 6,373,062 |
| 負債合計 | 21,331,554 | 25,291,730 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 2,000,000 | 2,000,000 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | 8,628,984 | 8,628,984 |
| その他資本剰余金 | 81,927,000 | 73,466,962 |

| | | |
|--------------|-------------|-------------|
| 資本剰余金合計 | 90,555,984 | 82,095,946 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 284,245 | 284,245 |
| その他利益剰余金 | | |
| 配当準備積立金 | 60,000 | - |
| 別途積立金 | 1,476,959 | - |
| 繰越利益剰余金 | 10,281,242 | 3,834,794 |
| 利益剰余金合計 | 8,460,037 | 4,119,040 |
| 株主資本計 | 84,095,946 | 88,214,986 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 949,365 | 297,138 |
| 評価・換算差額等合計 | 949,365 | 297,138 |
| 純資産合計 | 85,045,311 | 88,512,124 |
| 負債・純資産合計 | 106,376,866 | 113,803,855 |

(2) 【損益計算書】

| | (単位：千円) | |
|-----------|--|--|
| | 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) |
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 50,610,457 | 66,139,024 |
| 運用受託報酬 | 9,450,169 | 9,652,634 |
| 投資助言報酬 | 1,270,584 | 1,256,334 |
| その他営業収益 | | |
| サービス支援手数料 | 200,807 | 199,046 |
| その他 | 32,820 | 32,936 |
| 営業収益計 | 61,564,839 | 77,279,976 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 22,784,919 | 30,522,133 |
| 広告宣伝費 | 365,317 | 330,161 |
| 調査費 | | |
| 調査費 | 3,061,987 | 3,196,921 |
| 委託調査費 | 7,810,157 | 12,192,048 |
| 営業雑経費 | | |
| 通信費 | 95,163 | 67,600 |
| 印刷費 | 554,920 | 494,834 |
| 協会費 | 40,044 | 34,433 |
| 諸会費 | 29,473 | 30,488 |
| 情報機器関連費 | 4,562,612 | 4,767,504 |
| 販売促進費 | 23,614 | 31,930 |
| その他 | 163,332 | 181,301 |
| 営業費用合計 | 39,491,542 | 51,849,358 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | | |
| 役員報酬 | 277,027 | 263,893 |
| 給料・手当 | 9,280,730 | 8,664,828 |
| 賞与 | 950,630 | 991,916 |
| 賞与引当金繰入額 | 1,501,855 | 2,100,323 |
| 交際費 | 11,815 | 12,301 |
| 寄付金 | 949 | 29,273 |
| 事務委託費 | 844,255 | 1,422,189 |
| 旅費交通費 | 21,023 | 16,863 |

| | | |
|-----------|------------|------------|
| 租税公課 | 389,819 | 476,729 |
| 不動産賃借料 | 1,639,529 | 1,289,256 |
| 退職給付費用 | 790,144 | 632,559 |
| 固定資産減価償却費 | 3,040,894 | 3,133,951 |
| のれん償却費 | 2,645,986 | 304,540 |
| 諸経費 | 608,206 | 256,994 |
| 一般管理費合計 | 22,002,869 | 19,595,622 |
| 営業利益 | 70,426 | 5,834,995 |

(単位：千円)

| | 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 | | |
| 受取配当金 | 13,164 | 7,666 |
| 受取利息 | 2,736 | 1,836 |
| 時効成立分配金・償還金 | 88,335 | 43,406 |
| 原稿・講演料 | 2,603 | 2,587 |
| 投資有価証券償還益 | 57,388 | 383,608 |
| 投資有価証券売却益 | 162,941 | 911,268 |
| 為替差益 | - | 4,673 |
| 雑収入 | 72,933 | 81,640 |
| 営業外収益合計 | 400,104 | 1,436,686 |
| 営業外費用 | | |
| 投資有価証券償還損 | 11,762 | 146,219 |
| 投資有価証券売却損 | 34,473 | 81,384 |
| 為替差損 | 766 | - |
| 雑損失 | 1,240 | 2,866 |
| 営業外費用合計 | 48,243 | 230,470 |
| 経常利益 | 422,288 | 7,041,212 |
| 特別損失 | | |
| 固定資産除却損 | 1 54,493 | 83,651 |
| 減損損失 | 2 28,097,346 | - |
| システム統合関連費用 | 3 - | 375,636 |
| 早期退職費用 | 4 216,200 | 260,075 |
| 本社移転費用 | 127,044 | - |
| その他特別損失 | 5,460 | 67,000 |
| 特別損失合計 | 28,500,544 | 786,362 |
| 税引前当期純利益又は 税引前当期純損失() | 28,078,256 | 6,254,849 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 1,549,173 | 3,101,482 |
| 法人税等調整額 | 693,192 | 965,673 |
| 法人税等合計 | 855,980 | 2,135,809 |
| 当期純利益又は 当期純損失() | 28,934,237 | 4,119,040 |

(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:千円)

| | 株主資本 | | | | | | | |
|---------------------|-----------|-----------|------------|------------|---------|----------|-----------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | | 利益準備金 | 利益剰余金 | | |
| | | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | | その他利益剰余金 | | |
| | | | | | 配当準備積立金 | 別途積立金 | 繰越利益剰余金 | |
| 当期首残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 81,927,000 | 90,555,984 | 284,245 | 60,000 | 1,476,959 | 19,364,265 |
| 当期変動額 | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | | 711,271 |
| 当期純損失() | | | | | | | | 28,934,237 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | - | - | - | - | - | - | - | 29,645,508 |
| 当期末残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 81,927,000 | 90,555,984 | 284,245 | 60,000 | 1,476,959 | 10,281,242 |

| | 株主資本 | | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|---------------------|------------|-------------|--------------|------------|-------------|
| | 利益剰余金 | 株主資本合計 | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 | |
| | 利益剰余金合計 | | | | |
| 当期首残高 | 21,185,470 | 113,741,454 | 377,855 | 377,855 | 114,119,309 |
| 当期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | 711,271 | 711,271 | | | 711,271 |
| 当期純損失() | 28,934,237 | 28,934,237 | | | 28,934,237 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | | | 571,510 | 571,510 | 571,510 |
| 当期変動額合計 | 29,645,508 | 29,645,508 | 571,510 | 571,510 | 29,073,997 |
| 当期末残高 | 8,460,037 | 84,095,946 | 949,365 | 949,365 | 85,045,311 |

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位:千円)

| | 株主資本 | | | | | | | |
|---------------------|-----------|-----------|------------|------------|---------|----------|-----------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | | 利益準備金 | 利益剰余金 | | |
| | | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | | その他利益剰余金 | | |
| | | | | | 配当準備積立金 | 別途積立金 | 繰越利益剰余金 | |
| 当期首残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 81,927,000 | 90,555,984 | 284,245 | 60,000 | 1,476,959 | 10,281,242 |
| 当期変動額 | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | | |
| 欠損填補 | | | 8,460,037 | 8,460,037 | | | | 8,460,037 |
| 当期純利益 | | | | | | | | 4,119,040 |
| 任意積立金の取崩 | | | | | | 60,000 | 1,476,959 | 1,536,959 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | - | - | 8,460,037 | 8,460,037 | - | 60,000 | 1,476,959 | 14,116,037 |
| 当期末残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 73,466,962 | 82,095,946 | 284,245 | - | - | 3,834,794 |

| | |
|------|----------|
| 株主資本 | 評価・換算差額等 |
|------|----------|

| | 利益剰余金 | 株主資本合計 | その他有価証券 評価差額金 | 評価・換算 差額等合計 | 純資産合計 |
|-----------------------------|-------------|------------|------------------|----------------|------------|
| | 利益剰余金 合計 | | | | |
| 当期首残高 | 8,460,037 | 84,095,946 | 949,365 | 949,365 | 85,045,311 |
| 当期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | |
| 欠損填補 | 8,460,037 | - | | | - |
| 当期純利益 | 4,119,040 | 4,119,040 | | | 4,119,040 |
| 任意積立金の 取崩 | - | - | | | - |
| 株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額) | | | 652,227 | 652,227 | 652,227 |
| 当期変動額合計 | 12,579,078 | 4,119,040 | 652,227 | 652,227 | 3,466,812 |
| 当期末残高 | 4,119,040 | 88,214,986 | 297,138 | 297,138 | 88,512,124 |

[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

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外

決算日の市場価格等に基づく時価法

(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)

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産(リース資産を除く)

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 4～15年

(2) 無形固定資産(リース資産を除く)

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん 14年

顧客関連資産 6～19年

ソフトウェア(自社利用分) 5年(社内における利用可能期間)

(3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち、当事業年度の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. 収益及び費用の計上基準

「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。以下、「収益認識会計基準」という。)等を適用しており、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該サービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び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) 委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2) 運用受託報酬

運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(3) 投資助言報酬

投資助言報酬は、対象顧客との投資助言契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の助言期間にわたり収益として認識しております。

(会計方針の変更)

「収益認識会計基準」等を当事業年度の期首から適用し、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該サービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。当該会計基準等の適用が当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識関係」注記については記載していません。

(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 | 102,329千円 | 210,548千円 |
| 器具備品 | 1,153,649千円 | 1,309,352千円 |
| リース資産 | 2,830千円 | 6,073千円 |

2 当座借越契約

当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

| | 前事業年度 (2021年3月31日) | 当事業年度 (2022年3月31日) |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| 当座借越極度額の総額 | 10,000,000千円 | 10,000,000千円 |
| 借入実行残高 | - 千円 | - 千円 |
| 差引額 | 10,000,000千円 | 10,000,000千円 |

3 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

| | 前事業年度 (2021年3月31日) | 当事業年度 (2022年3月31日) |
|--|-----------------------|-----------------------|
| | | |

| | | |
|--|----------|----------|
| Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc. | 93,374千円 | 57,356千円 |
|--|----------|----------|

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

| | 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) |
|-----------|--|--|
| 建物 | 18,278千円 | -千円 |
| 器具備品 | 28,604千円 | 0千円 |
| リース資産 | -千円 | -千円 |
| ソフトウェア | 7,610千円 | 83,651千円 |
| ソフトウェア仮勘定 | -千円 | -千円 |

2 減損損失

前事業年度において、次のとおり減損損失を計上しております。

(単位：千円)

| 場所 | 用途 | 種類 | 減損損失 |
|----|-----|-----|------------|
| - | その他 | のれん | 28,097,346 |

当社は、資産と対応して継続的に収支の把握ができる単位が全社のみであることから全社資産の単一グループとしております。

当社は、当社を存続会社とし、大和住銀投信投資顧問株式会社を消滅会社とする吸収合併に伴って発生したのれんを計上しております。当該のれんについて下期以降の業績は上向いているものの、通期では業績計画を下回る結果となったことを踏まえて将来キャッシュ・フローを見直した結果、のれんの帳簿価額の回収が見込まれなくなったため、帳簿価額を回収可能価額まで減損し、当該減少額を減損損失として計上しております。

なお、回収可能価額は使用価値としており、将来キャッシュ・フローを9.2%で割り引いて算出しております。当事業年度において計上した減損損失はありません。

3 システム統合関連費用

社内システム統合に伴うものであり、主にデータの移行費用などであります。

4 早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

(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.発行済株式数に関する事項

| | 当期首株式数 | 当期増加株式数 | 当期減少株式数 | 当期末株式数 |
|------|-------------|---------|---------|-------------|
| 普通株式 | 33,870,060株 | - | - | 33,870,060株 |

2.剰余金の配当に関する事項

配当金支払額等

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額 (千円) | 一株当たり 配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|-------|----------------|-----------------|----------------|----------------|
| 2020年6月29日 定時株主総会 | 普通株式 | 711,271 | 21.00 | 2020年 3月31日 | 2020年 6月30日 |

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

| | 当期首株式数 | 当期増加株式数 | 当期減少株式数 | 当期末株式数 |
|------|-------------|---------|---------|-------------|
| 普通株式 | 33,870,060株 | - | - | 33,870,060株 |

2.剰余金の配当に関する事項

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額 (千円) | 一株当たり 配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|-------|----------------|-----------------|----------------|----------------|
| 2022年6月28日 定時株主総会 | 普通株式 | 2,540,254 | 75.00 | 2022年 3月31日 | 2022年 6月29日 |

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

| | 前事業年度 (2021年3月31日) | 当事業年度 (2022年3月31日) |
|------|-----------------------|-----------------------|
| 1年以内 | 1,194,699 | 1,166,952 |
| 1年超 | 3,497,258 | 2,323,090 |
| 合計 | 4,691,958 | 3,490,042 |

(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、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っています。そのため、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っています。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っていません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収運用受託報酬及び未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。未収委託者報酬は、信託財産中から支弁されるものであり、信託財産については受託者である信託銀行において分別管理されているため、リスクは僅少となっています。

投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて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

信用リスクの管理

当社は、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、営業債権について、取引先毎の期日管理及び残高管理を行うとともに、その状況について取締役会に報告しています。

投資有価証券、子会社株式は発行体の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

市場リスクの管理

投資有価証券については、自己勘定資産の運用・管理に関する規程に従い、各所管部においては所管する有価証券について管理を、経営企画部においては総合的なリスク管理を行い、定期的に時価を把握しています。また、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、その状況について取締役会に報告しています。

なお、事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等については、純資産額に対する保有制限を設けており、また、自社設定投信等の取得・処分に関する規則に従い、定期的に取締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。

2.金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれていません(注2)参照)。

前事業年度(2021年3月31日)

(単位：千円)

| 区分 | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|-------------|------------|------------|----|
| (1)現金及び預金 | 33,048,142 | 33,048,142 | - |
| (2)顧客分別金信託 | 300,036 | 300,036 | - |
| (3)未収委託者報酬 | 9,936,096 | 9,936,096 | - |
| (4)未収運用受託報酬 | 2,247,156 | 2,247,156 | - |
| (5)未収投資助言報酬 | 398,108 | 398,108 | - |
| (6)投資有価証券 | | | |
| その他有価証券 | 22,826,472 | 22,826,472 | - |
| (7)長期差入保証金 | 1,409,091 | 1,409,091 | - |
| 資産計 | 70,165,105 | 70,165,105 | - |
| (1)顧客からの預り金 | 20,077 | 20,077 | - |
| (2)未払手数料 | 4,480,697 | 4,480,697 | - |

| | | | |
|-----|-----------|-----------|---|
| 負債計 | 4,500,774 | 4,500,774 | - |
|-----|-----------|-----------|---|

当事業年度(2022年3月31日)

(単位:千円)

| 区分 | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|----------------------|------------|------------|----|
| (1)現金及び預金 | 49,008,279 | 49,008,279 | - |
| (2)顧客分別金信託 | 300,041 | 300,041 | - |
| (3)未収委託者報酬 | 12,125,117 | 12,125,117 | - |
| (4)未収運用受託報酬 | 2,437,063 | 2,437,063 | - |
| (5)未収投資助言報酬 | 388,639 | 388,639 | - |
| (6)投資有価証券 その他有価証券 | 14,172,545 | 14,172,545 | - |
| 資産計 | 78,431,686 | 78,431,686 | - |
| (1)顧客からの預り金 | 6,045 | 6,045 | - |
| (2)未払手数料 | 5,545,582 | 5,545,582 | - |
| 負債計 | 5,551,627 | 5,551,627 | - |

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(2)顧客分別金信託、(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬及び(5)未収投資助言報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(6)投資有価証券

これらの時価について、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

負 債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(注2)市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

(単位:千円)

| 区分 | 前事業年度 (2021年3月31日) | 当事業年度 (2022年3月31日) |
|------------------|-----------------------|-----------------------|
| その他有価証券 非上場株式 | 39,809 | 39,809 |
| 合計 | 39,809 | 39,809 |
| 子会社株式 非上場株式 | 11,246,398 | 11,246,398 |
| 合計 | 11,246,398 | 11,246,398 |

その他有価証券については、市場価格がないため、「(6) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式については、市場価格がないため、時価開示の対象とはしておりません。

また時価をもって貸借対照表計上額としている「(6) その他有価証券」は、全て投資信託で構成されております。そのため、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」第26項の経過措置を適用し、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は記載しておりません。

(注3)金銭債権及び満期が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:千円)

| 区分 | 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 | 33,048,142 | - | - | - |
| 顧客分別金信託 | 300,036 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 9,936,096 | - | - | - |
| 未収運用受託報酬 | 2,247,156 | - | - | - |
| 未収投資助言報酬 | 398,108 | - | - | - |
| 長期差入保証金 | 42,007 | 1,367,084 | - | - |
| 合計 | 45,971,548 | 1,367,084 | - | - |

当事業年度(2022年3月31日)

(単位:千円)

| 区分 | 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 | 49,008,279 | - | - | - |
| 顧客分別金信託 | 300,041 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 12,125,117 | - | - | - |
| 未収運用受託報酬 | 2,437,063 | - | - | - |
| 未収投資助言報酬 | 388,639 | - | - | - |
| 合計 | 64,259,140 | - | - | - |

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度（2021年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円）は、市場価格がないことから、記載しておりませ
ん。

当事業年度（2022年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円）は、市場価格がないことから、記載しておりませ
ん。

2. その他有価証券

前事業年度（2021年3月31日）

(単位：千円)

| 区分 | 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|-----------------------------------|------------|------------|-----------|
| (1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等 | 16,097,433 | 14,397,606 | 1,699,827 |
| 小計 | 16,097,433 | 14,397,606 | 1,699,827 |
| (2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等 | 6,729,039 | 6,994,762 | 265,723 |
| 小計 | 6,729,039 | 6,994,762 | 265,723 |
| 合計 | 22,826,472 | 21,392,369 | 1,434,103 |

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 39,809千円）については、市場価格がないことから、記載しておりませ
ん。

当事業年度（2022年3月31日）

(単位：千円)

| 区分 | 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|-----------------------------------|------------|------------|---------|
| (1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等 | 9,299,062 | 8,672,725 | 626,337 |
| 小計 | 9,299,062 | 8,672,725 | 626,337 |
| (2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等 | 4,873,482 | 5,039,817 | 166,335 |
| 小計 | 4,873,482 | 5,039,817 | 166,335 |
| 合計 | 14,172,545 | 13,712,543 | 460,001 |

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 39,809千円）については、市場価格がないことから、記載しておりませ
ん。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：千円)

| 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|-----------|---------|---------|
| 1,978,622 | 162,941 | 34,473 |

(単位：千円)

| 償還額 | 償還益の合計額 | 償還損の合計額 |
|-----------|---------|---------|
| 1,630,219 | 57,388 | 11,762 |

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位：千円)

| 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|-----------|---------|---------|
| 4,082,976 | 911,268 | 81,384 |

(単位：千円)

| 償還額 | 償還益の合計額 | 償還損の合計額 |
|-----------|---------|---------|
| 7,183,410 | 383,608 | 146,219 |

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、投資有価証券について1,560千円（その他有価証券1,560千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

当事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

(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、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

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：千円)

| | 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 | 5,299,814 | 5,258,448 |
| 勤務費用 | 476,308 | 454,611 |
| 利息費用 | - | 1,013 |
| 数理計算上の差異の発生額 | 67,476 | 34,553 |
| 退職給付の支払額 | 585,151 | 595,013 |
| 過去勤務費用の発生額 | - | - |
| 合併による発生額 | - | - |
| 退職給付債務の期末残高 | 5,258,448 | 5,084,506 |

(2)退職給付債務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：千円)

| | 前事業年度 (2021年3月31日) | 当事業年度 (2022年3月31日) |
|---------------|-----------------------|-----------------------|
| 非積立型制度の退職給付債務 | 5,258,448 | 5,084,506 |
| 未認識数理計算上の差異 | - | - |
| 未認識過去勤務費用 | - | - |
| 退職給付引当金 | 5,258,448 | 5,084,506 |

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

| | 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 | 476,308 | 454,611 |
| 利息費用 | - | 1,013 |
| 数理計算上の差異の費用処理額 | 67,476 | 34,553 |
| その他 | 246,359 | 211,487 |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 790,144 | 632,559 |

(注) その他は、その他の関係会社等からの出向者の年金掛金負担分及び退職給付引当額相当額負担分、退職定年制度適用による割増退職金並びに確定拠出年金への拠出額であります。

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

| | 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) |
|-----|--|--|
| 割引率 | 0.020% | 0.130% |

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239,162千円、当事業年度237,296千円であります。

(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

(単位：千円)

前事業年度 当事業年度

| | (2021年3月31日) | (2022年3月31日) |
|---------------|--------------|--------------|
| 繰延税金資産 | | |
| 退職給付引当金 | 1,610,136 | 1,556,876 |
| 賞与引当金 | 464,389 | 643,119 |
| 調査費 | 247,208 | 279,809 |
| 未払金 | 206,090 | 284,070 |
| 未払事業税 | 66,891 | 139,522 |
| ソフトウェア償却 | 90,431 | 107,998 |
| 子会社株式評価損 | 114,876 | 114,876 |
| その他有価証券評価差額金 | 131,391 | 93,946 |
| その他 | 35,930 | 28,056 |
| 繰延税金資産小計 | 2,967,346 | 3,248,274 |
| 評価性引当額（注） | 218,966 | 189,102 |
| 繰延税金資産合計 | 2,748,380 | 3,059,171 |
| 繰延税金負債 | | |
| 無形固定資産 | 4,798,732 | 4,151,648 |
| 資産除去債務 | - | 825 |
| その他有価証券評価差額金 | 516,605 | 186,107 |
| 繰延税金負債合計 | 5,315,338 | 4,338,581 |
| 繰延税金資産（負債）の純額 | 2,566,958 | 1,279,409 |

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

| | 前事業年度 (2021年3月31日) | 当事業年度 (2022年3月31日) |
|--------------------|-----------------------------|-----------------------|
| 法定実効税率 | 税引前当期純損失のため 記載を省略しております。 | 30.6% |
| (調整) | | |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目 | | 1.6 |
| 住民税均等割等 | | 0.1 |
| のれん償却費 | | 1.4 |
| その他 | | 0.2 |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | | 34.1 |

(収益認識関係)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、「セグメント情報等」注記に記載のとおりであります。

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

| | 委託者報酬 | 運用受託報酬 | 投資助言報酬 | その他 | 合計 |
|----------------|------------|-----------|-----------|---------|------------|
| 外部顧客への 営業収益 | 50,610,457 | 9,450,169 | 1,270,584 | 233,628 | 61,564,839 |

(2)地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3)主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3.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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

4.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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

5.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。

当事業年度(自 2021年4月1日 至2022年3月31日)

1.セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

| | 委託者報酬 | 運用受託報酬 | 投資助言報酬 | その他 | 合計 |
|----------------|------------|-----------|-----------|---------|------------|
| 外部顧客への 営業収益 | 66,139,024 | 9,652,634 | 1,256,334 | 231,982 | 77,279,976 |

(2)地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3)主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3.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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

4.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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

5.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)

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1.関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位：千円)

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金、出資金又は基金 | 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 | 科目 | 期末残高 |
|-------------|-------------|---------|---------------|-----------|----------------|------------------|-------------|-----------|-----------|-----------|
| 親会社の 子会社 | (株)三井住友銀行 | 東京都千代田区 | 1,770,996,505 | 銀行業 | % - | 投信の販売委託 役員の兼任 | 委託販売 手数料 | 3,728,851 | 未払 手数料 | 863,159 |
| 親会社の 子会社 | SMBC日興証券(株) | 東京都千代田区 | 10,000,000 | 証券業 | % - | 投信の販売委託 役員の兼任 | 委託販売 手数料 | 5,578,226 | 未払 手数料 | 1,070,559 |

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ(東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場)

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金、出資金又は基金 | 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 | 科目 | 期末残高 |
|-------------|-------------|---------|---------------|-----------|----------------|------------------|-------------|-----------|-----------|-----------|
| 親会社の 子会社 | (株)三井住友銀行 | 東京都千代田区 | 1,770,996,505 | 銀行業 | % - | 投信の販売委託 役員の兼任 | 委託販売 手数料 | 4,727,024 | 未払 手数料 | 1,098,966 |
| 親会社の 子会社 | SMBC日興証券(株) | 東京都千代田区 | 10,000,000 | 証券業 | % - | 投信の販売委託 役員の兼任 | 委託販売 手数料 | 8,397,864 | 未払 手数料 | 1,661,614 |

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ(東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場)

(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 | 2,510.93円 | 2,613.28円 |
| 1株当たり当期純利益又は 1株当たり当期純損失() | 854.27円 | 121.61円 |

(注) 1. 前事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、1株当たり当期純損失であり、また、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

当事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、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又は1株当たり当期純損失の算定上の基礎は、次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) |
|--------------------------------|--|--|
| 1株当たり当期純利益又は当期純損失 | | |
| 当期純利益又は当期純損失()(千円) | 28,934,237 | 4,119,040 |
| 普通株主に帰属しない金額(千円) | - | - |
| 普通株式に係る当期純利益又は 当期純損失()(千円) | 28,934,237 | 4,119,040 |
| 期中平均株式数(株) | 33,870,060 | 33,870,060 |

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。

- イ 自己また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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 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。）または子法人等（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または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等また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。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等また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、また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】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
 - (イ) 定款の変更
該当ありません。
 - (ロ) その他の重要事項
該当ありません。
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実
該当ありません。

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】

- イ 受託会社
 - (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
 - (ロ) 資本金の額 342,037百万円（2021年3月末現在）
 - (ハ) 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。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 株式会社日本カストディ銀行
- ・ 資本金の額 51,000百万円（2021年3月末現在）
- ・ 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。

ロ 販売会社

| 名称 | 資本金の額（百万円） 2021年3月末現在 | 事業の内容 |
|------------------|--------------------------|-------------------------------|
| 株式会社栃木銀行 | 27,408 | 銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。 |
| 株式会社福岡中央銀行 | 4,000 | 銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。 |
| a u カブコム証券株式会社 | 7,196 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 株式会社S B I証券 | 48,323 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 楽天証券株式会社 | 7,495 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| S M B C 日興証券株式会社 | 10,000 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 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。 |
| 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。 |

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、一部解約の実行の請求の受付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）
該当ありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

| 提出年月日 | 提出書類 |
|-------------|---------|
| 2021年 7月20日 | 有価証券届出書 |
| 2021年 7月20日 | 有価証券報告書 |
| 2022年 1月20日 | 有価証券届出書 |
| 2022年 1月20日 | 半期報告書 |

独立監査人の監査報告書

2022年6月15日

三井住友DS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 羽 太 典 明指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅 野 雅 子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕**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DS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37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DS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並びに監査役及び監査役会の責任

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。

監査役及び監査役会の責任は、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、監査役及び監査役会に対して、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 . 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年7月12日

三井住友DS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

菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

松井 貴志

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」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定型）の2021年4月27日から2022年4月26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、アセットアロケーション・ファンド（安定型）の2022年4月26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DS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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三井住友DS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 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年7月12日

三井住友DS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

菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

松井 貴志

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」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の2021年4月27日から2022年4月26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、アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の2022年4月26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DS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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三井住友DS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 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年7月12日

三井住友DS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

菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

松井 貴志

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」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（成長型）の2021年4月27日から2022年4月26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、アセットアロケーション・ファンド（成長型）の2022年4月26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DS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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三井住友DS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 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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。