# 【表紙】

| | |
|---|---|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 2022年10月20日提出 |
| 【発行者名】 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 代表取締役社長 菱田　賀夫 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都港区芝公園一丁目１番１号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 投資業務推進部長　民野　誠 |
| 【電話番号】 | 03-6453-3610 |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 | 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】 | 10兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

# 第一部【証券情報】

## （1）【ファンドの名称】

世界経済インデックスファンド（株式シフト型）

## （2）【内国投資信託受益証券の形態等】

①追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。
②三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

## （3）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

## （4）【発行（売出）価格】

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

## （5）【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜　3.0%）（※）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。
申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（8）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。
※「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

## （6）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。
「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。

**（７）【申込期間】**

**2022年10月21日から2023年 4月20日までとします。**
**継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。**

**（８）【申込取扱場所】**

**下記の照会先にお問い合わせください。**
**（照会先）**
**三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社**
**ホームページ：https://www.smtam.jp/**
**フリーダイヤル：0120-668001**
**（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）**

**（９）【払込期日】**

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

**（１０）【払込取扱場所】**

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

**（１１）【振替機関に関する事項】**

**振替機関は、下記の通りです。**
**株式会社証券保管振替機構**

**（１２）【その他】**

**＜振替受益権について＞**
**当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。**
**当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。**
**＜受益権の取得申込みの方法＞**
**販売会社所定の方法でお申込みください。**
**取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。**

**＜申込みコース＞**

**「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。**

**販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。**

**＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞**

**収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。**

**＜受付不可日＞**

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

**ニューヨークの取引所の休業日**

**ロンドンの取引所の休業日**

**ニューヨークの銀行休業日**

**ロンドンの銀行休業日**

# 第二部【ファンド情報】

## 第１【ファンドの状況】

### １【ファンドの性格】

#### （１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

当ファンドは、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に分散投資することでリスクの低減をはかり、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。

DR(預託証券)とは

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

＜信託金限度額＞

上限　5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

| 単位型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産<br>（収益の源泉） | 独立区分 | 補足分類 |
|---|---|---|---|---|
| 単位型 | 国内 | 株式 | ＭＭＦ | インデックス型 |
| 追加型 | 海外 | 債券 | ＭＲＦ | 特殊型 |
| | 内外 | 不動産投信 | ＥＴＦ | |
| | | その他資産<br>（　　） | | |
| | | 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<br>地域 | 投資形態 | 為替<br>ヘッジ | 対象<br>インデックス | 特殊型 |
|---|---|---|---|---|---|---|

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 株式<br>一般<br>大型株<br>中小型株<br><br>債券<br>一般<br>公債<br>社債<br>その他債券<br>クレジット属性<br>（　　）<br><br>不動産投信<br><br>その他資産<br>（投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分固定型））<br><br>資産複合<br>（　　）<br>資産配分固定型<br>資産配分変更型 | 年1回<br><br>年2回<br><br>年4回<br><br>年6回（隔月）<br><br>年12回（毎月）<br><br>日々<br><br>その他（　）<br> | グローバル（日本を含む）<br><br>日本<br><br>北米<br><br>欧州<br><br>アジア<br><br>オセアニア<br><br>中南米<br><br>アフリカ<br><br>中近東（中東）<br><br>エマージング | ファミリーファンド<br><br>ファンド・オブ・ファンズ | あり（　）<br><br>なし | 日経225<br><br>ＴＯＰＩＸ<br><br>その他（　　） | ブル・ベア型<br><br>条件付運用型<br><br>ロング・ショート型/絶対収益追求型<br><br>その他（　　） |

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。
なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でもご覧いただけます。

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

**＜商品分類表定義＞**

**［単位型投信・追加型投信の区分］**

**(1)単位型投信…当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。**

**(2)追加型投信…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。**

**［投資対象地域による区分］**

**(1)国内…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。**

**(2)海外…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。**

**(3)内外…目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。**

**［投資対象資産(収益の源泉)による区分］**

**(1)株式…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。**

**(2)債券…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。**

**(3)不動産投信(リート)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。**

**(4)その他資産…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。**

**(5)資産複合…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。**

**［独立した区分］**

**(1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。**

**(2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。**

**(3)ETF…投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。**

**［補足分類］**

**(1)インデックス型…目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。**

**(2)特殊型…目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊**

型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

(1)株式

①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

③社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

②資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

［決算頻度による属性区分］

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

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

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

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

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

いう。

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

(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

［投資対象地域による属性区分(重複使用可能)］

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

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

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

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

(5)アジア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(6)オセアニア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

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

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

(10)エマージング…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

［投資形態による属性区分］

(1)ファミリーファンド…目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。

(2)ファンド・オブ・ファンズ…「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

［為替ヘッジによる属性区分］

(1)為替ヘッジあり…目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

(2)為替ヘッジなし…目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

［インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分］

(1)日経225

(2)TOPIX

**(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。**

**［特殊型］**

**(1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。**

**(2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。**

**(3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。**

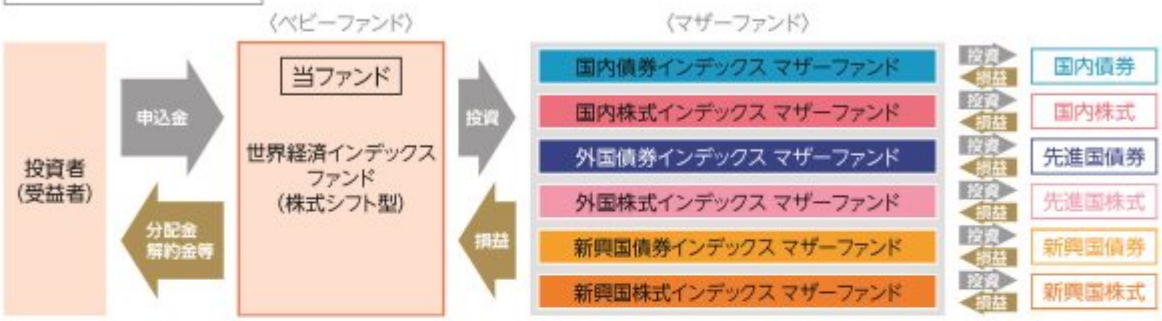
**(4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。**

**＜ファンドの特色＞**

## 1. 世界の債券及び株式に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

●世界の債券及び株式に分散投資を行うことで、リスクの低減に努めます。
●各マザーファンドは各投資対象市場の代表的な指数（インデックス）への連動を目指す運用を行います。
●原則として、為替ヘッジは行いません。

ファンドのしくみ

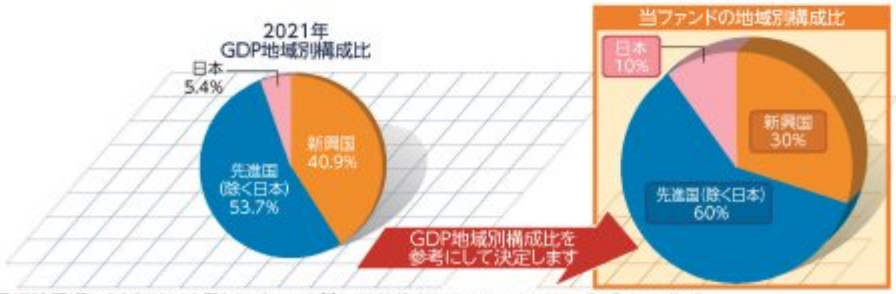



**？ ファミリーファンド方式とは**

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

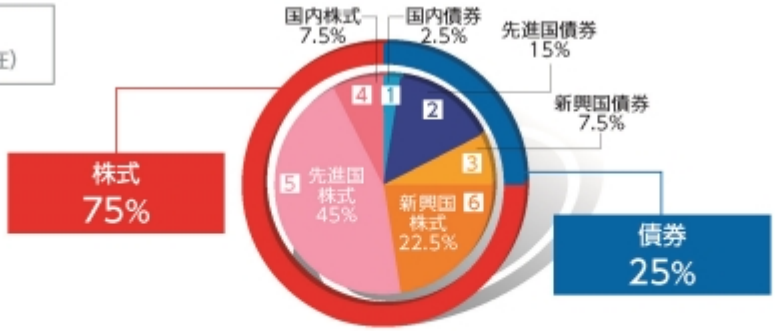
## 2. 世界経済全体の発展を享受します。

●基本組入比率は、地域別（日本、先進国、新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定します。
※世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回地域別構成比の見直しを行う場合があります。
※地域別の基本組入比率は市場動向等を勘案して調整を行うことがあります。




（出所）IMF「世界経済見通し2021年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。
※GDP地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。
※上記のファンドの地域別構成比は、2022年8月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。

基本組入比率
（2022年8月末現在）




●基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
●基本組入比率は原則として年1回見直しを行う場合があります。また、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で組入比率を調整する場合もあります。

| 資産 | インデックス |
|---|---|
| 1 国内債券 | NOMURA-BPI総合※1 |
| 2 先進国債券 | FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）※2 |

| | |
|---|---|
| 3 新興国債券 | JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）※3 |
| 4 国内株式 | TOPIX（東証株価指数）※4 |
| 5 先進国株式 | MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）※5 |
| 6 新興国株式 | MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）※6 |

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

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

※1「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

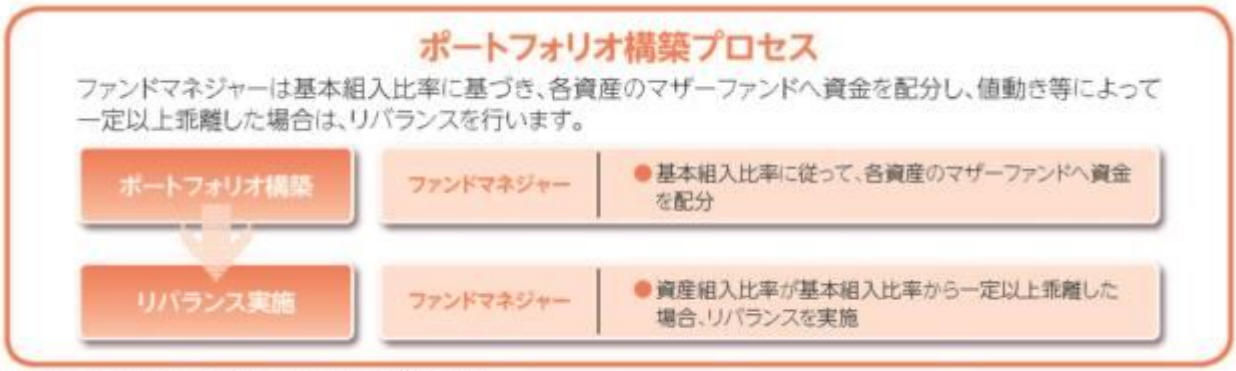
※2「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

※3「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド」とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

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

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

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




※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

分配方針

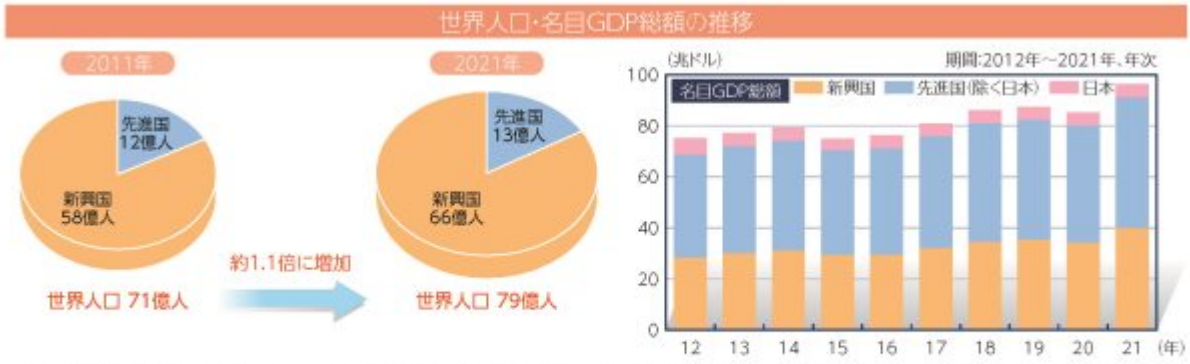
●年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。
ただし、分配を行わないことがあります。
●分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。
●外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

〈ご参考情報〉



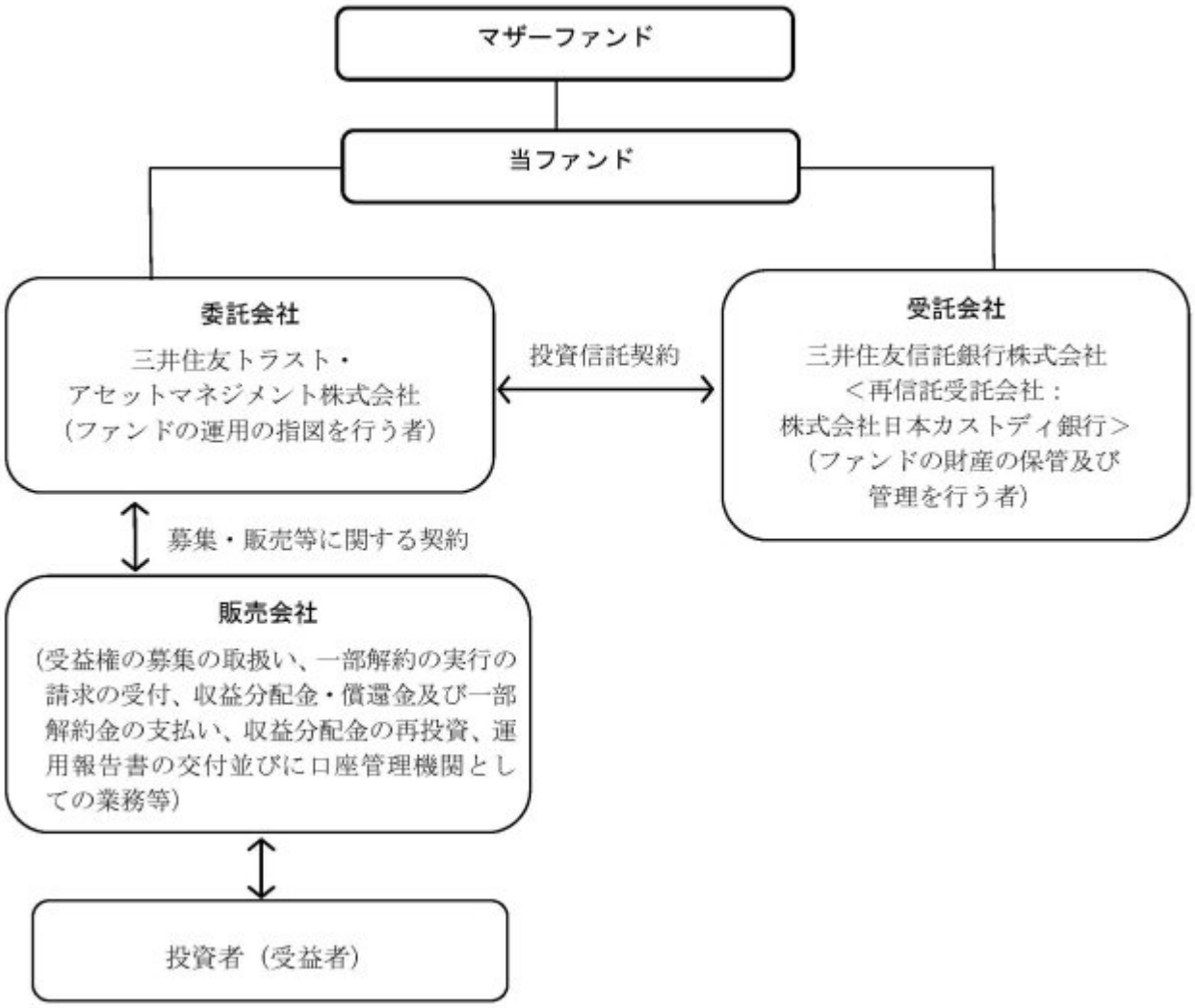

(出所)国連「World Population Prospects 2022」及びIMF「世界経済見通し2022年4月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。
※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。
※世界人口の数値は四捨五入しているため、合計値が一致しない場合があります。

**（2）【ファンドの沿革】**

**2013年11月8日　　当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始**

**（3）【ファンドの仕組み】**

**①当ファンドの仕組み及び関係法人**




**②委託会社の概況（2022年 8月31日現在）**

**イ．資本金の額：20億円**

**ロ．委託会社の沿革**

| | |
|---|---|
| 1986年11月1日： | 住信キャピタルマネジメント株式会社設立 |
| 1987年2月20日： | 投資顧問業の登録 |
| 1987年9月9日： | 投資一任契約に係る業務の認可 |
| 1990年10月1日： | 住信投資顧問株式会社に商号変更 |
| 1999年2月15日： | 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更 |
| 1999年3月25日： | 証券投資信託委託業の認可 |
| 2007年9月30日： | 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号） |
| 2012年4月1日： | 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更 |
| 2018年10月1日： | 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継 |

**ハ．大株主の状況**

| 株　主　名 | 住　　所 | 持株数 | 持株比率 |
|---|---|---|---|
| 三井住友トラスト・ホールディングス株式会社 | 東京都千代田区丸の内一丁目4番1号 | 3,000株 | 100% |

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

①基本方針

当ファンドは、主として、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」及び「新興国株式インデックス マザーファンド」（以下、総称して又は個々に「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下、総称して又は個々に「マザーファンド受益証券」ということがあります。）への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。

②投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

③投資態度

イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。

ロ．株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）と債券の基本資産配分比率は、原則として株式75%、債券25%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整する場合もあります。

ハ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のＧＤＰ（Gross Domestic Product（国内総生産））を参考に決定するものとします。また、各マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

ニ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年1回見直しを行う場合があります。

ホ．実質組入外貨建資産については、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。

ヘ．投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

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

### （2）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

**当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。**

**イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）**

**1.有価証券**

**2.デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第21条、第22条及び第23条に定めるものに限ります。）**

**3.金銭債権**

**4.約束手形**

**ロ．次に掲げる特定資産以外の資産**

**1.為替手形**

**②有価証券の指図範囲**

**委託会社は、信託金を主として次に掲げる1.から6.までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券並びに7.から28.までの有価証券（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.国内債券インデックス マザーファンド**

**2.国内株式インデックス マザーファンド**

**3.外国債券インデックス マザーファンド**

**4.外国株式インデックス マザーファンド**

**5.新興国債券インデックス マザーファンド**

**6.新興国株式インデックス マザーファンド**

**7.株券又は新株引受権証書**

**8.国債証券**

**9.地方債証券**

**10.特別の法律により法人の発行する債券**

**11.社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）**

**12.資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）**

**13.特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）**

**14.協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）**

**15.資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）**

**16.コマーシャル・ペーパー**

**17.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券**

**18.外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記7.から17.の証券又は証書の性質を有するもの**

**19.証券投資信託又は外国証券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。）**

**20.投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）**

**21.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）**

22.オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
23.預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
24.外国法人が発行する譲渡性預金証書
25.指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
26.抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
27.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
28.外国の者に対する権利で上記27.の有価証券の性質を有するもの

なお、上記7.の証券又は証書、上記18.並びに23.の証券又は証書のうち上記7.の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記8.から12.までの証券及び上記18.並びに23.の証券又は証書のうち上記8.から12.までの証券の性質を有するもの、及び上記20.に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、上記19.及び20.の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

③金融商品の指図範囲

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

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

ロ．上記②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ.に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（参考）マザーファンドの概要

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によって

は、上記の運用ができない場合があります。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

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

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資は、行いません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数

等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資は、行いません。

③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

⑤同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

④有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑥投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

①原則としてMSCIコクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

⑤有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑦投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑧投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑤同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。

②組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

③投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取

引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

**３．運用制限**

①株式への投資は行いません。

②同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

**「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要**

**１．基本方針**

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

**２．運用方法**

(1)投資対象

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

(2)投資態度

①主として、取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCIエマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。

②株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。

③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

**３．運用制限**

**①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。**

**②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。**

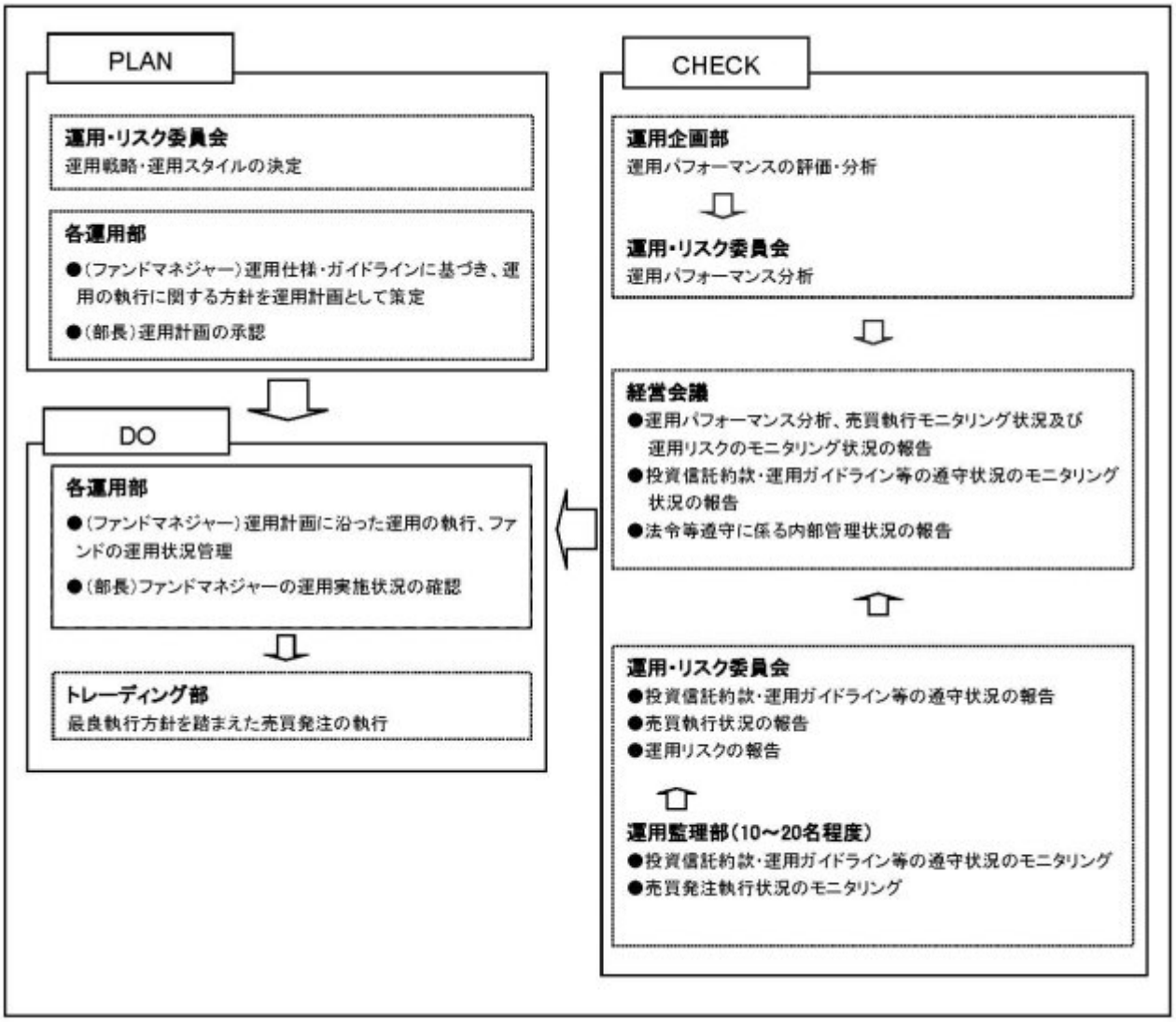
**③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。**

**④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。**

**⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。**

**（3）【運用体制】**

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



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

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

**（４）【分配方針】**

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

**※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。**

**（５）【投資制限】**

**＜約款に定める投資制限＞**

**イ．株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。**

**ロ．投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。**

**ハ．外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。**

**ニ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。**

**ホ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。**

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

投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（上記5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

ヘ．委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

ト．委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

チ．委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする外貨建資産（以下「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。

リ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

**2.公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。**

**ヌ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることを指図することができます。なお、当該売付の決済については、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことを指図することができるものとし、売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。**

**ル．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができ、この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。**

**ヲ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。**

**ワ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。**

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

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

**＜関連法令に基づく投資制限＞**

**イ．同一の法人の発行する株式への投資制限**

**（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）**

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

## 3【投資リスク】

### (1)ファンドのリスク

●当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。
●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①株価変動リスク
株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

②為替変動リスク
為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

③金利変動リスク
債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

④信用リスク
有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

⑤カントリーリスク
投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。また、新興国への投資は先進国に比べ、上記のリスクが高まる可能性があります。

⑥流動性リスク
時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

①同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。
②分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われ

**ると、その金額相当分、基準価額は下がります。**

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

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

**③ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。**

**④ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。**

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

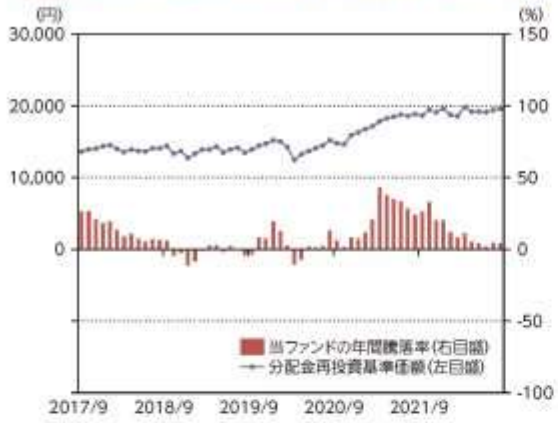
**(2)リスクの管理体制**

**委託会社におけるリスク管理体制**

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

〔参考情報〕

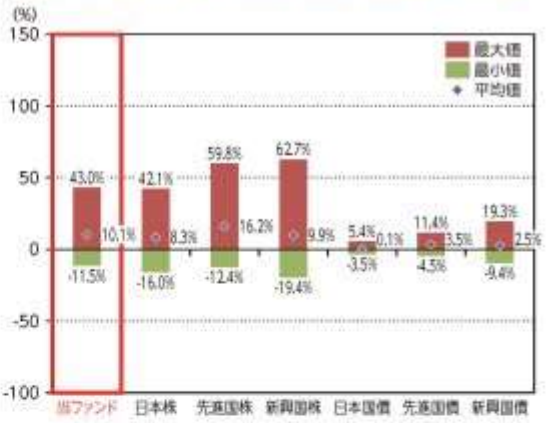
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移




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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較




＊2017年9月～2022年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

| | |
|---|---|
| 日本株<br>TOPIX(東証株価指数、配当込み) | TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出・公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。 |
| 先進国株<br>MSCIコクサイ・インデックス<br>(配当込み、円ベース) | MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。 |
| 新興国株<br>MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース) | MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。 |
| 日本国債<br>NOMURA-BPI国債 | NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。 |
| 先進国債<br>FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本、円ベース) | FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより算出されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 |
| 新興国債<br>JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース) | 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved. |

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

## 4【手数料等及び税金】

### （1）【申込手数料】

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

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

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

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

③上記①及び②の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞
ありません。
＜信託財産留保額＞
ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を信託財産留保額（※）として当該基準価額から控除します。また、当ファンドが保有する新興国債券インデックス マザーファンド及び新興国株式インデックス マザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法
①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.605%（税抜　0.55%）を乗じて得た額とします（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。
その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

| | | |
|---|---|---|
| 委託会社 | 年率　0.242%　（税抜　0.22%） | 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 |
| 販売会社 | 年率　0.308%　（税抜　0.28%） | 運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| 受託会社 | 年率　0.055%　（税抜　0.05%） | 運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価 |

②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。
③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

**（４）【その他の手数料等】**

**①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。**

**②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。**

**③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、先物取引・オプション取引に要する費用（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。**

**④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。**

**⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。**

**※上記における役務提供の内容は以下の通りです。**

**組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料**
**先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料**
**組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料**
**財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用**
**上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。**

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

**（５）【課税上の取扱い】**

**課税上は株式投資信託として取り扱われます。**

**①個人の受益者に対する課税**

**イ．収益分配金に対する課税**

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

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

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

**（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）**

**ロ．一部解約金及び償還金に対する課税**

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

**ハ．損益通算について**

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

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

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

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

**②法人の受益者に対する課税**

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

**なお、益金不算入制度の適用はありません。**

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

**（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）**

**③個別元本について**

**イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。**

**ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。**

**ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。**

**ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）**

**④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について**

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

**受益者が収益分配金を受け取る際、**

**イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、**

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

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

**※上記は、2022年 8月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。**

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

## 5【運用状況】

**以下は、2022年8月31日現在の状況について記載してあります。**

**【世界経済インデックスファンド（株式シフト型）】**

**（１）【投資状況】**

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---|---|---|---|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 5,462,872,672 | 99.04 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | ― | 53,191,920 | 0.96 |
| 合計(純資産総額) | | 5,516,064,592 | 100.00 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

**（２）【投資資産】**

**①【投資有価証券の主要銘柄】**

**イ.評価額上位銘柄明細**

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックス　マザーファンド | 581,871,101 | 4.1287 | 2,402,382,802 | 4.3380 | 2,524,156,836 | 45.76 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 新興国株式インデックス　マザーファンド | 340,147,207 | 3.6631 | 1,245,993,426 | 3.6312 | 1,235,142,538 | 22.39 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券インデックス　マザーファンド | 252,023,746 | 3.0555 | 770,060,416 | 3.1545 | 795,008,906 | 14.41 |
| 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 | 221,982,861 | 1.8890 | 419,326,149 | 1.9419 | 431,068,517 | 7.81 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 新興国債券インデックス　マザーファンド | 208,612,355 | 1.7486 | 364,780,550 | 1.8095 | 377,484,056 | 6.84 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内債券インデックス　マザーファンド | 72,704,143 | 1.3984 | 101,676,558 | 1.3756 | 100,011,819 | 1.81 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

**ロ.種類別投資比率**

| 種類 | 投資比率（％） |
|---|---|
| 親投資信託受益証券 | 99.04 |
| 合計 | 99.04 |

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

**②【投資不動産物件】**

該当事項はありません。

**③【その他投資資産の主要なもの】**

該当事項はありません。

## （３）【運用実績】

### ①【純資産の推移】

| | 純資産総額（円） | | 1万口当たりの純資産額（円） | |
|---|---|---|---|---|
| | （分配落） | （分配付） | （分配落） | （分配付） |
| 第1期計算期間末 (2014年 1月20日) | 283,066,086 | 283,066,086 | 10,633 | 10,633 |
| 第2期計算期間末 (2015年 1月20日) | 1,276,473,972 | 1,276,473,972 | 12,115 | 12,115 |
| 第3期計算期間末 (2016年 1月20日) | 2,569,972,114 | 2,569,972,114 | 10,633 | 10,633 |
| 第4期計算期間末 (2017年 1月20日) | 3,606,790,136 | 3,606,790,136 | 12,202 | 12,202 |
| 第5期計算期間末 (2018年 1月22日) | 4,732,719,412 | 4,732,719,412 | 14,734 | 14,734 |
| 第6期計算期間末 (2019年 1月21日) | 4,563,841,438 | 4,563,841,438 | 13,273 | 13,273 |
| 第7期計算期間末 (2020年 1月20日) | 4,713,634,378 | 4,713,634,378 | 15,543 | 15,543 |
| 第8期計算期間末 (2021年 1月20日) | 4,746,098,401 | 4,746,098,401 | 16,858 | 16,858 |
| 第9期計算期間末 (2022年 1月20日) | 5,362,732,621 | 5,362,732,621 | 19,104 | 19,104 |
| 2021年 8月末日 | 5,282,027,044 | — | 18,855 | — |
| 9月末日 | 5,243,258,318 | — | 18,639 | — |
| 10月末日 | 5,469,948,771 | — | 19,468 | — |
| 11月末日 | 5,366,783,007 | — | 19,120 | — |
| 12月末日 | 5,543,324,862 | — | 19,625 | — |
| 2022年 1月末日 | 5,272,375,698 | — | 18,766 | — |
| 2月末日 | 5,233,001,645 | — | 18,569 | — |
| 3月末日 | 5,613,242,037 | — | 19,818 | — |
| 4月末日 | 5,426,022,769 | — | 19,188 | — |
| 5月末日 | 5,432,864,466 | — | 19,218 | — |
| 6月末日 | 5,422,674,984 | — | 19,136 | — |
| 7月末日 | 5,513,105,263 | — | 19,417 | — |
| 8月末日 | 5,516,064,592 | — | 19,603 | — |

### ②【分配の推移】

| | 期　間 | 1万口当たりの分配金（円） |
|---|---|---|
| 第1期計算期間 | 2013年11月 8日～2014年 1月20日 | 0 |
| 第2期計算期間 | 2014年 1月21日～2015年 1月20日 | 0 |
| 第3期計算期間 | 2015年 1月21日～2016年 1月20日 | 0 |
| 第4期計算期間 | 2016年 1月21日～2017年 1月20日 | 0 |
| 第5期計算期間 | 2017年 1月21日～2018年 1月22日 | 0 |
| 第6期計算期間 | 2018年 1月23日～2019年 1月21日 | 0 |

| | | |
|---|---|---|
| 第7期計算期間 | 2019年 1月22日～2020年 1月20日 | 0 |
| 第8期計算期間 | 2020年 1月21日～2021年 1月20日 | 0 |
| 第9期計算期間 | 2021年 1月21日～2022年 1月20日 | 0 |

③【収益率の推移】

| | 期　間 | 収益率（%） |
|---|---|---|
| 第1期計算期間 | 2013年11月 8日～2014年 1月20日 | 6.3 |
| 第2期計算期間 | 2014年 1月21日～2015年 1月20日 | 13.9 |
| 第3期計算期間 | 2015年 1月21日～2016年 1月20日 | △12.2 |
| 第4期計算期間 | 2016年 1月21日～2017年 1月20日 | 14.8 |
| 第5期計算期間 | 2017年 1月21日～2018年 1月22日 | 20.8 |
| 第6期計算期間 | 2018年 1月23日～2019年 1月21日 | △9.9 |
| 第7期計算期間 | 2019年 1月22日～2020年 1月20日 | 17.1 |
| 第8期計算期間 | 2020年 1月21日～2021年 1月20日 | 8.5 |
| 第9期計算期間 | 2021年 1月21日～2022年 1月20日 | 13.3 |
| 第10期中間計算期間 | 2022年 1月21日～2022年 7月20日 | 1.7 |

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

| | 期　間 | 設定口数（口） | 解約口数（口） | 発行済み口数（口） |
|---|---|---|---|---|
| 第1期計算期間 | 2013年11月 8日～2014年 1月20日 | 280,722,826 | 14,505,786 | 266,217,040 |
| 第2期計算期間 | 2014年 1月21日～2015年 1月20日 | 1,026,539,215 | 239,100,858 | 1,053,655,397 |
| 第3期計算期間 | 2015年 1月21日～2016年 1月20日 | 2,010,163,370 | 646,934,428 | 2,416,884,339 |
| 第4期計算期間 | 2016年 1月21日～2017年 1月20日 | 1,194,172,622 | 655,117,548 | 2,955,939,413 |
| 第5期計算期間 | 2017年 1月21日～2018年 1月22日 | 1,109,479,703 | 853,384,626 | 3,212,034,490 |
| 第6期計算期間 | 2018年 1月23日～2019年 1月21日 | 726,202,777 | 499,703,761 | 3,438,533,506 |
| 第7期計算期間 | 2019年 1月22日～2020年 1月20日 | 409,735,354 | 815,721,688 | 3,032,547,172 |
| 第8期計算期間 | 2020年 1月21日～2021年 1月20日 | 439,486,500 | 656,664,572 | 2,815,369,100 |
| 第9期計算期間 | 2021年 1月21日～2022年 1月20日 | 363,887,048 | 372,185,023 | 2,807,071,125 |
| 第10期中間計算期間 | 2022年 1月21日～2022年 7月20日 | 150,966,166 | 116,088,896 | 2,841,948,395 |

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。
(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

（参考）

国内債券インデックス　マザーファンド

## 投資状況

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 国債証券 | 日本 | 527,932,778,300 | 83.98 |
| 地方債証券 | 日本 | 33,354,945,585 | 5.31 |
| 特殊債券 | 日本 | 36,791,977,469 | 5.85 |
| 社債券 | 日本 | 27,503,351,960 | 4.37 |
| | フランス | 895,636,000 | 0.14 |
| | スペイン | 398,484,000 | 0.06 |
| | 小計 | 28,797,471,960 | 4.58 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | — | 1,784,480,485 | 0.28 |
| 合計(純資産総額) | | 628,661,653,799 | 100.00 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ.評価額上位銘柄明細

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 利率(%) | 償還期限 | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 国債証券 | 第１５０回利付国債（５年） | 7,700,000,000 | 100.06 | 7,704,620,000 | 100.17 | 7,713,244,000 | 0.005 | 2026/12/20 | 1.23 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４１回利付国債（５年） | 7,650,000,000 | 100.36 | 7,677,612,900 | 100.40 | 7,680,600,000 | 0.100 | 2024/9/20 | 1.22 |
| 日本 | 国債証券 | 第３５０回利付国債（１０年） | 6,890,000,000 | 100.33 | 6,913,241,000 | 100.30 | 6,910,945,600 | 0.100 | 2028/3/20 | 1.10 |
| 日本 | 国債証券 | 第１３８回利付国債（５年） | 6,890,000,000 | 100.28 | 6,909,292,000 | 100.27 | 6,908,809,700 | 0.100 | 2023/12/20 | 1.10 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４８回利付国債（５年） | 6,770,000,000 | 100.12 | 6,778,124,000 | 100.28 | 6,789,294,500 | 0.005 | 2026/6/20 | 1.08 |
| 日本 | 国債証券 | 第３６５回利付国債（１０年） | 6,740,000,000 | 98.86 | 6,663,191,600 | 99.08 | 6,678,396,400 | 0.100 | 2031/12/20 | 1.06 |
| 日本 | 国債証券 | 第３６６回利付国債（１０年） | 5,970,000,000 | 99.71 | 5,953,275,400 | 100.37 | 5,992,447,200 | 0.200 | 2032/3/20 | 0.95 |
| 日本 | 国債証券 | 第３４４回利付国債（１０年） | 5,900,000,000 | 100.51 | 5,930,503,000 | 100.62 | 5,937,111,000 | 0.100 | 2026/9/20 | 0.94 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４４回利付国債（５年） | 5,830,000,000 | 100.45 | 5,856,235,000 | 100.54 | 5,861,890,100 | 0.100 | 2025/6/20 | 0.93 |
| 日本 | 国債証券 | 第３４６回利付国債（１０年） | 5,750,000,000 | 100.48 | 5,777,600,000 | 100.54 | 5,781,395,000 | 0.100 | 2027/3/20 | 0.92 |
| 日本 | 国債証券 | 第１３９回利付国債（５年） | 5,590,000,000 | 100.30 | 5,607,105,400 | 100.31 | 5,607,329,000 | 0.100 | 2024/3/20 | 0.89 |
| 日本 | 国債証券 | 第３５３回利付国債（１０年） | 5,415,000,000 | 100.12 | 5,421,629,500 | 100.09 | 5,420,090,100 | 0.100 | 2028/12/20 | 0.86 |
| 日本 | 国債証券 | 第３４１回利付国債（１０年） | 5,340,000,000 | 101.21 | 5,404,614,000 | 101.27 | 5,408,031,600 | 0.300 | 2025/12/20 | 0.86 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４５回利付国債（５年） | 5,370,000,000 | 100.48 | 5,395,776,000 | 100.58 | 5,401,199,700 | 0.100 | 2025/9/20 | 0.86 |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 国債証券 | 第３６４回利付国債（１０年） | 5,210,000,000 | 99.01 | 5,158,819,000 | 99.06 | 5,161,338,600 | 0.100 | 2031/9/20 | 0.82 |
| 日本 | 国債証券 | 第３６３回利付国債（１０年） | 5,070,000,000 | 99.11 | 5,024,877,000 | 99.00 | 5,019,604,200 | 0.100 | 2031/6/20 | 0.80 |
| 日本 | 国債証券 | 第３４９回利付国債（１０年） | 5,000,000,000 | 100.41 | 5,020,800,000 | 100.37 | 5,018,500,000 | 0.100 | 2027/12/20 | 0.80 |
| 日本 | 国債証券 | 第３５１回利付国債（１０年） | 4,940,000,000 | 100.27 | 4,953,387,400 | 100.23 | 4,951,411,400 | 0.100 | 2028/6/20 | 0.79 |
| 日本 | 国債証券 | 第３４０回利付国債（１０年） | 4,830,000,000 | 101.47 | 4,901,145,900 | 101.49 | 4,902,401,700 | 0.400 | 2025/9/20 | 0.78 |
| 日本 | 国債証券 | 第３６０回利付国債（１０年） | 4,890,000,000 | 99.46 | 4,863,936,300 | 99.24 | 4,853,129,400 | 0.100 | 2030/9/20 | 0.77 |
| 日本 | 国債証券 | 第３３２回利付国債（１０年） | 4,800,000,000 | 101.05 | 4,850,832,000 | 100.92 | 4,844,400,000 | 0.600 | 2023/12/20 | 0.77 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４９回利付国債（５年） | 4,820,000,000 | 100.10 | 4,824,820,000 | 100.24 | 4,831,712,600 | 0.005 | 2026/9/20 | 0.77 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４３回利付国債（５年） | 4,800,000,000 | 100.43 | 4,820,680,500 | 100.49 | 4,823,904,000 | 0.100 | 2025/3/20 | 0.77 |
| 日本 | 国債証券 | 第３５４回利付国債（１０年） | 4,790,000,000 | 100.06 | 4,793,209,300 | 100.03 | 4,791,532,800 | 0.100 | 2029/3/20 | 0.76 |
| 日本 | 国債証券 | 第３４２回利付国債（１０年） | 4,760,000,000 | 100.49 | 4,783,514,400 | 100.64 | 4,790,464,000 | 0.100 | 2026/3/20 | 0.76 |
| 日本 | 国債証券 | 第３３９回利付国債（１０年） | 4,670,000,000 | 101.37 | 4,733,979,000 | 101.38 | 4,734,866,300 | 0.400 | 2025/6/20 | 0.75 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４０回利付国債（５年） | 4,660,000,000 | 100.33 | 4,675,797,400 | 100.35 | 4,676,356,600 | 0.100 | 2024/6/20 | 0.74 |
| 日本 | 国債証券 | 第３３８回利付国債（１０年） | 4,560,000,000 | 101.27 | 4,618,231,200 | 101.26 | 4,617,638,400 | 0.400 | 2025/3/20 | 0.73 |
| 日本 | 国債証券 | 第３５２回利付国債（１０年） | 4,510,000,000 | 100.18 | 4,518,478,800 | 100.18 | 4,518,118,000 | 0.100 | 2028/9/20 | 0.72 |
| 日本 | 国債証券 | 第３４８回利付国債（１０年） | 4,460,000,000 | 100.42 | 4,478,738,000 | 100.42 | 4,479,133,400 | 0.100 | 2027/9/20 | 0.71 |

**(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。**

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

**ロ.種類別投資比率**

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 国債証券 | 83.98 |
| 地方債証券 | 5.31 |
| 特殊債券 | 5.85 |
| 社債券 | 4.58 |
| 合計 | 99.72 |

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

**投資不動産物件**

**該当事項はありません。**

**その他投資資産の主要なもの**

**該当事項はありません。**

## 国内株式インデックス　マザーファンド

### 投資状況

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 株式 | 日本 | 510,473,093,850 | 99.50 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | ― | 2,573,525,392 | 0.50 |
| 合計(純資産総額) | | 513,046,619,242 | 100.00 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | 買建 | 日本 | 2,629,080,000 | 0.51 |

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

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

### 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

### イ.評価額上位銘柄明細

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 株式 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 9,267,400 | 2,126.00 | 19,702,513,870 | 2,101.50 | 19,475,441,100 | 3.80 |
| 日本 | 株式 | ソニーグループ | 電気機器 | 1,273,500 | 11,968.01 | 15,241,262,650 | 11,135.00 | 14,180,422,500 | 2.76 |
| 日本 | 株式 | キーエンス | 電気機器 | 184,200 | 51,486.25 | 9,483,768,378 | 52,840.00 | 9,733,128,000 | 1.90 |
| 日本 | 株式 | 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 11,736,000 | 738.15 | 8,663,008,188 | 721.10 | 8,462,829,600 | 1.65 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 2,236,000 | 3,983.17 | 8,906,385,360 | 3,769.00 | 8,427,484,000 | 1.64 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 977,700 | 6,770.85 | 6,619,868,236 | 6,996.00 | 6,839,989,200 | 1.33 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 1,196,200 | 5,357.95 | 6,409,183,484 | 5,562.00 | 6,653,264,400 | 1.30 |
| 日本 | 株式 | 任天堂 | その他製品 | 114,800 | 58,338.63 | 6,697,275,465 | 56,990.00 | 6,542,452,000 | 1.28 |
| 日本 | 株式 | リクルートホールディングス | サービス業 | 1,391,600 | 4,685.31 | 6,520,086,719 | 4,483.00 | 6,238,542,800 | 1.22 |
| 日本 | 株式 | ＫＤＤＩ | 情報・通信業 | 1,454,300 | 4,540.47 | 6,603,208,070 | 4,277.00 | 6,220,041,100 | 1.21 |
| 日本 | 株式 | 第一三共 | 医薬品 | 1,474,600 | 3,464.69 | 5,109,036,540 | 4,197.00 | 6,188,896,200 | 1.21 |

| | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 1,597,800 | 3,746.72 | 5,986,510,444 | 3,850.00 | 6,151,530,000 | 1.20 |
| 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 1,312,800 | 4,487.76 | 5,891,533,022 | 4,564.00 | 5,991,619,200 | 1.17 |
| 日本 | 株式 | 東京エレクトロン | 電気機器 | 129,000 | 59,124.09 | 7,627,008,726 | 44,160.00 | 5,696,640,000 | 1.11 |
| 日本 | 株式 | ＨＯＹＡ | 精密機器 | 392,500 | 13,945.03 | 5,473,425,397 | 14,250.00 | 5,593,125,000 | 1.09 |
| 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 1,486,300 | 3,187.66 | 4,737,831,708 | 3,724.00 | 5,534,981,200 | 1.08 |
| 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 1,301,100 | 3,982.62 | 5,181,795,892 | 4,194.00 | 5,456,813,400 | 1.06 |
| 日本 | 株式 | ダイキン工業 | 機械 | 222,000 | 20,677.47 | 4,590,398,960 | 24,485.00 | 5,435,670,000 | 1.06 |
| 日本 | 株式 | 信越化学工業 | 化学 | 315,600 | 18,204.12 | 5,745,220,800 | 16,315.00 | 5,149,014,000 | 1.00 |
| 日本 | 株式 | 三井物産 | 卸売業 | 1,451,300 | 3,183.10 | 4,619,633,390 | 3,266.00 | 4,739,945,800 | 0.92 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンク | 情報・通信業 | 3,021,500 | 1,492.52 | 4,509,652,565 | 1,529.50 | 4,621,384,250 | 0.90 |
| 日本 | 株式 | 伊藤忠商事 | 卸売業 | 1,200,400 | 3,721.95 | 4,467,831,780 | 3,843.00 | 4,613,137,200 | 0.90 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 557,900 | 7,377.02 | 4,115,644,928 | 7,792.00 | 4,347,156,800 | 0.85 |
| 日本 | 株式 | オリエンタルランド | サービス業 | 206,600 | 19,686.87 | 4,067,308,644 | 20,850.00 | 4,307,610,000 | 0.84 |
| 日本 | 株式 | 日本電産 | 電気機器 | 451,700 | 8,643.06 | 3,904,074,468 | 9,324.00 | 4,211,650,800 | 0.82 |
| 日本 | 株式 | 村田製作所 | 電気機器 | 554,600 | 8,233.16 | 4,566,110,685 | 7,554.00 | 4,189,448,400 | 0.82 |
| 日本 | 株式 | ファナック | 電気機器 | 178,400 | 21,339.11 | 3,806,898,010 | 22,535.00 | 4,020,244,000 | 0.78 |
| 日本 | 株式 | ＳＭＣ | 機械 | 59,500 | 66,230.44 | 3,940,711,308 | 66,600.00 | 3,962,700,000 | 0.77 |
| 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 2,404,000 | 1,531.46 | 3,681,633,512 | 1,593.50 | 3,830,774,000 | 0.75 |
| 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス | 小売業 | 671,400 | 5,409.67 | 3,632,058,644 | 5,533.00 | 3,714,856,200 | 0.72 |

**(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。**

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

### ロ.種類別及び業種別の投資比率

| 種類 | 国内／外国 | 業種 | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 株式 | 国内 | 水産・農林業 | 0.10 |
| | | 鉱業 | 0.32 |
| | | 建設業 | 2.17 |
| | | 食料品 | 3.36 |
| | | 繊維製品 | 0.47 |
| | | パルプ・紙 | 0.18 |
| | | 化学 | 6.13 |
| | | 医薬品 | 5.30 |
| | | 石油・石炭製品 | 0.54 |
| | | ゴム製品 | 0.73 |
| | | ガラス・土石製品 | 0.72 |
| | | 鉄鋼 | 0.81 |
| | | 非鉄金属 | 0.74 |
| | | 金属製品 | 0.60 |
| | | 機械 | 5.34 |
| | | 電気機器 | 17.40 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | 輸送用機器 | 8.01 |
| | | 精密機器 | 2.83 |
| | | その他製品 | 2.40 |
| | | 電気・ガス業 | 1.27 |
| | | 陸運業 | 3.09 |
| | | 海運業 | 0.68 |
| | | 空運業 | 0.45 |
| | | 倉庫・運輸関連業 | 0.16 |
| | | 情報・通信業 | 9.01 |
| | | 卸売業 | 5.74 |
| | | 小売業 | 4.38 |
| | | 銀行業 | 5.19 |
| | | 証券、商品先物取引業 | 0.72 |
| | | 保険業 | 2.20 |
| | | その他金融業 | 1.15 |
| | | 不動産業 | 1.93 |
| | | サービス業 | 5.39 |
| | | 小計 | 99.50 |
| 合計 | | | 99.50 |

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

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 通貨 | 帳簿価額（円） | 評価金額（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | 大阪取引所 | ＴＯＰＩＸ先物 | 買建 | 134 | 円 | 2,622,445,550 | 2,629,080,000 | 0.51 |

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

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

## 外国債券インデックス　マザーファンド

### 投資状況

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 国債証券 | アメリカ | 161,501,455,974 | 50.53 |
| | フランス | 27,031,797,504 | 8.46 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | イタリア | 24,218,987,840 | 7.58 |
| | ドイツ | 20,251,557,958 | 6.34 |
| | スペイン | 15,788,098,509 | 4.94 |
| | イギリス | 14,711,741,903 | 4.60 |
| | 中国 | 8,028,466,233 | 2.51 |
| | カナダ | 6,699,441,453 | 2.10 |
| | ベルギー | 5,995,895,883 | 1.88 |
| | オランダ | 4,981,211,317 | 1.56 |
| | オーストラリア | 4,857,034,496 | 1.52 |
| | オーストリア | 3,775,436,906 | 1.18 |
| | メキシコ | 2,504,027,985 | 0.78 |
| | アイルランド | 2,029,407,229 | 0.63 |
| | マレーシア | 1,653,473,341 | 0.52 |
| | フィンランド | 1,636,060,009 | 0.51 |
| | ポーランド | 1,335,615,692 | 0.42 |
| | シンガポール | 1,327,217,657 | 0.42 |
| | イスラエル | 1,293,338,030 | 0.40 |
| | デンマーク | 1,136,457,232 | 0.36 |
| | スウェーデン | 795,997,813 | 0.25 |
| | ノルウェー | 645,102,503 | 0.20 |
| | 小計 | 312,197,823,467 | 97.68 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | — | 7,425,117,154 | 2.32 |
| 合計(純資産総額) | | 319,622,940,621 | 100.00 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 債券先物取引 | 買建 | アメリカ | 2,376,962,987 | 0.74 |
| | 買建 | ドイツ | 2,126,411,018 | 0.67 |

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

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

| 資産の種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | 買建 | — | 4,717,486,300 | 1.48 |

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ.評価額上位銘柄明細

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 利率(%) | 償還期限 | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 国債証券 | T 1.375% 11/15/31 | 21,030,000 | 12,193.11 | 2,564,212,267 | 11,938.42 | 2,510,650,939 | 1.375 | 2031/11/15 | 0.79 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.25% 08/15/31 | 19,380,000 | 12,156.33 | 2,355,898,588 | 11,862.61 | 2,298,974,299 | 1.250 | 2031/8/15 | 0.72 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2% 08/15/51 | 17,350,000 | 11,102.38 | 1,926,263,521 | 10,534.79 | 1,827,787,282 | 2.000 | 2051/8/15 | 0.57 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.25% 09/30/28 | 14,500,000 | 12,632.11 | 1,831,657,003 | 12,310.99 | 1,785,094,115 | 1.250 | 2028/9/30 | 0.56 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.125% 02/15/31 | 15,050,000 | 12,151.78 | 1,828,843,783 | 11,851.78 | 1,783,693,194 | 1.125 | 2031/2/15 | 0.56 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.625% 02/15/29 | 13,340,000 | 13,731.95 | 1,831,842,315 | 13,348.55 | 1,780,696,943 | 2.625 | 2029/2/15 | 0.56 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.25% 03/15/24 | 13,000,000 | 13,348.55 | 1,735,311,864 | 13,200.44 | 1,716,057,987 | 0.250 | 2024/3/15 | 0.54 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.25% 09/30/23 | 12,000,000 | 13,513.71 | 1,621,646,090 | 13,400.53 | 1,608,064,686 | 0.250 | 2023/9/30 | 0.50 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.375% 05/15/27 | 11,690,000 | 13,578.52 | 1,587,329,485 | 13,287.36 | 1,553,292,448 | 2.375 | 2027/5/15 | 0.49 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.75% 08/31/26 | 11,830,000 | 12,763.16 | 1,509,882,520 | 12,498.90 | 1,478,620,156 | 0.750 | 2026/8/31 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.25% 11/15/23 | 11,000,000 | 13,469.31 | 1,481,624,367 | 13,349.36 | 1,468,430,154 | 0.250 | 2023/11/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.5% 04/30/27 | 11,940,000 | 12,214.48 | 1,458,409,607 | 12,184.81 | 1,454,867,368 | 0.500 | 2027/4/30 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.75% 11/15/24 | 10,860,000 | 13,260.82 | 1,440,125,697 | 13,068.58 | 1,419,248,339 | 0.750 | 2024/11/15 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.75% 03/31/26 | 11,000,000 | 12,872.55 | 1,415,980,903 | 12,612.62 | 1,387,388,466 | 0.750 | 2026/3/31 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.625% 05/15/30 | 12,000,000 | 11,786.32 | 1,414,358,712 | 11,490.04 | 1,378,805,324 | 0.625 | 2030/5/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.625% 05/15/31 | 11,150,000 | 12,645.65 | 1,409,990,566 | 12,310.99 | 1,372,675,819 | 1.625 | 2031/5/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.25% 11/15/24 | 10,150,000 | 13,750.90 | 1,395,716,817 | 13,515.34 | 1,371,807,215 | 2.250 | 2024/11/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.625% 08/15/30 | 11,950,000 | 11,722.89 | 1,400,886,475 | 11,431.55 | 1,366,071,400 | 0.625 | 2030/8/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2% 11/15/26 | 10,220,000 | 13,425.44 | 1,372,080,894 | 13,114.61 | 1,340,313,619 | 2.000 | 2026/11/15 | 0.42 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.125% 01/15/24 | 10,000,000 | 13,380.23 | 1,338,023,183 | 13,248.37 | 1,324,837,086 | 0.125 | 2024/1/15 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.25% 05/15/24 | 10,000,000 | 13,284.92 | 1,328,492,371 | 13,132.21 | 1,313,221,417 | 0.250 | 2024/5/15 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.875% 11/15/30 | 11,150,000 | 11,936.25 | 1,330,892,953 | 11,649.25 | 1,298,891,618 | 0.875 | 2030/11/15 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.75% 08/15/41 | 12,330,000 | 10,989.20 | 1,354,968,372 | 10,397.25 | 1,281,980,925 | 1.750 | 2041/8/15 | 0.40 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.125% 08/31/28 | 10,210,000 | 12,548.72 | 1,281,224,575 | 12,238.97 | 1,249,598,956 | 1.125 | 2028/8/31 | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.625% 12/31/27 | 10,000,000 | 12,326.15 | 1,232,615,655 | 12,060.26 | 1,206,026,851 | 0.625 | 2027/12/31 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.25% 02/15/27 | 8,950,000 | 13,559.20 | 1,213,548,882 | 13,230.50 | 1,184,129,806 | 2.250 | 2027/2/15 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.375% 07/15/24 | 9,010,000 | 13,260.28 | 1,194,751,628 | 13,099.18 | 1,180,236,220 | 0.375 | 2024/7/15 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.25% 06/15/24 | 9,000,000 | 13,252.16 | 1,192,694,541 | 13,094.57 | 1,178,512,039 | 0.250 | 2024/6/15 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.25% 06/30/28 | 9,500,000 | 12,674.89 | 1,204,115,277 | 12,362.43 | 1,174,431,659 | 1.250 | 2028/6/30 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.5% 11/30/24 | 8,800,000 | 13,473.44 | 1,185,663,574 | 13,280.86 | 1,168,715,879 | 1.500 | 2024/11/30 | 0.37 |

**(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。**

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

#### ロ.種類別投資比率

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 国債証券 | 97.68 |
| 合計 | 97.68 |

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

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 地域 | 取引所 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 通貨 | 簿価金額（現地通貨） | 帳簿価額（円） | 評価金額（現地通貨） | 評価金額（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 債券先物取引 | アメリカ | シカゴ商品取引所 | US 5YR NOTE | 買建 | 58 | アメリカドル | 6,449,732.71 | 894,126,445 | 6,427,577.98 | 891,055,135 | 0.28 |
| | アメリカ | シカゴ商品取引所 | US 10YR NOTE | 買建 | 45 | アメリカドル | 5,294,844.76 | 734,024,329 | 5,268,515.85 | 730,374,352 | 0.23 |
| | アメリカ | シカゴ商品取引所 | US LONG BOND | 買建 | 40 | アメリカドル | 5,483,549.5 | 760,184,467 | 5,450,000 | 755,533,500 | 0.24 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO-SCHATZ | 買建 | 26 | ユーロ | 2,850,719.6 | 396,335,546 | 2,826,720 | 392,998,881 | 0.12 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO-BOBL FU | 買建 | 35 | ユーロ | 4,413,213.5 | 613,569,073 | 4,316,900 | 600,178,607 | 0.19 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO-BUND | 買建 | 55 | ユーロ | 8,471,425.5 | 1,177,782,287 | 8,151,000 | 1,133,233,530 | 0.35 |

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

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

| 種類 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 簿価（円） | 時価（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | アメリカドル | 買建 | 19,280,000.00 | 2,618,005,497 | 2,669,605,200 | 0.84 |
| | カナダドル | 買建 | 1,840,000.00 | 193,013,703 | 194,653,600 | 0.06 |
| | ユーロ | 買建 | 11,530,000.00 | 1,588,311,928 | 1,602,670,000 | 0.50 |
| | イギリスポンド | 買建 | 1,550,000.00 | 251,830,735 | 250,557,500 | 0.08 |

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

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

## 外国株式インデックス　マザーファンド

### 投資状況

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 株式 | アメリカ | 375,591,570,170 | 67.68 |
| | イギリス | 22,916,167,214 | 4.13 |
| | カナダ | 20,443,213,243 | 3.68 |
| | スイス | 17,437,768,835 | 3.14 |
| | フランス | 15,781,420,189 | 2.84 |
| | オーストラリア | 11,604,966,462 | 2.09 |
| | ドイツ | 11,306,957,460 | 2.04 |
| | アイルランド | 9,346,790,522 | 1.68 |
| | オランダ | 9,116,315,043 | 1.64 |
| | スウェーデン | 4,824,586,948 | 0.87 |
| | デンマーク | 4,183,635,463 | 0.75 |
| | スペイン | 3,681,126,652 | 0.66 |
| | 香港 | 3,385,244,937 | 0.61 |
| | イタリア | 2,460,915,920 | 0.44 |
| | フィンランド | 1,872,084,608 | 0.34 |
| | シンガポール | 1,836,803,130 | 0.33 |
| | ジャージー | 1,684,630,235 | 0.30 |
| | ノルウェー | 1,357,512,375 | 0.24 |
| | イスラエル | 1,295,868,050 | 0.23 |
| | ベルギー | 1,148,085,883 | 0.21 |
| | ケイマン | 1,110,638,882 | 0.20 |
| | バミューダ | 784,468,495 | 0.14 |
| | キュラソー | 603,387,862 | 0.11 |
| | ニュージーランド | 395,530,923 | 0.07 |
| | ルクセンブルク | 362,897,319 | 0.07 |
| | ポルトガル | 288,371,947 | 0.05 |
| | オーストリア | 275,317,418 | 0.05 |
| | パナマ | 114,259,812 | 0.02 |
| | マン島 | 102,705,414 | 0.02 |
| | リベリア | 97,020,840 | 0.02 |
| | 小計 | 525,410,262,251 | 94.68 |
| 投資信託受益証券 | オーストラリア | 179,315,036 | 0.03 |
| | 香港 | 84,583,894 | 0.02 |
| | アメリカ | 27,602,342 | 0.00 |
| | 小計 | 291,501,272 | 0.05 |
| 投資証券 | アメリカ | 11,257,264,281 | 2.03 |
| | オーストラリア | 697,983,941 | 0.13 |
| | イギリス | 250,210,047 | 0.05 |
| | シンガポール | 239,688,534 | 0.04 |
| | フランス | 202,487,650 | 0.04 |
| | 香港 | 184,877,242 | 0.03 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | カナダ | 56,997,801 | 0.01 |
| | ベルギー | 54,796,628 | 0.01 |
| | 小計 | 12,944,306,124 | 2.33 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | ― | 16,281,711,553 | 2.93 |
| 合計(純資産総額) | | 554,927,781,200 | 100.00 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 12,354,792,243 | 2.23 |
| | 買建 | カナダ | 897,845,731 | 0.16 |
| | 買建 | ドイツ | 2,757,939,066 | 0.50 |
| | 買建 | イギリス | 321,419,745 | 0.06 |
| | 買建 | オーストラリア | 526,542,816 | 0.09 |

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

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

| 資産の種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | 買建 | ― | 788,919,210 | 0.14 |

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

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

### 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

### イ.評価額上位銘柄明細

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 株式 | APPLE INC | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 1,323,029 | 20,791.28 | 27,507,473,896 | 22,029.69 | 29,145,923,097 | 5.25 |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 577,361 | 37,910.55 | 21,888,076,583 | 36,455.53 | 21,048,001,891 | 3.79 |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM | 小売 | 742,757 | 16,041.94 | 11,915,268,444 | 17,845.83 | 13,255,122,507 | 2.39 |

| | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 株式 | TESLA INC | 自動車・自動車部品 | 213,777 | 35,187.19 | 7,522,212,252 | 38,497.55 | 8,229,890,960 | 1.48 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A | メディア・娯楽 | 487,975 | 15,591.17 | 7,608,101,915 | 15,102.35 | 7,369,570,315 | 1.33 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C | メディア・娯楽 | 460,933 | 15,657.57 | 7,217,093,178 | 15,236.82 | 7,023,154,674 | 1.27 |
| アメリカ | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC | ヘルスケア機器・サービス | 76,357 | 70,344.81 | 5,371,318,865 | 72,481.30 | 5,534,455,327 | 1.00 |
| 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 | 213,402 | 25,063.24 | 5,348,546,607 | 22,517.67 | 4,805,316,005 | 0.87 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL | エネルギー | 343,717 | 13,512.60 | 4,644,511,579 | 13,351.45 | 4,589,122,161 | 0.83 |
| アメリカ | 株式 | NVIDIA CORP | 半導体・半導体製造装置 | 202,894 | 26,052.55 | 5,285,906,616 | 21,443.28 | 4,350,714,557 | 0.78 |
| アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 各種金融 | 105,127 | 44,164.84 | 4,642,918,118 | 39,567.77 | 4,159,641,440 | 0.75 |
| アメリカ | 株式 | META PLATFORMS INC-CLASS A | メディア・娯楽 | 187,450 | 27,003.15 | 5,061,741,835 | 21,787.09 | 4,083,990,170 | 0.74 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | 240,076 | 18,167.70 | 4,361,630,349 | 15,860.65 | 3,807,763,402 | 0.69 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO | 家庭用品・パーソナル用品 | 194,633 | 20,606.83 | 4,010,769,749 | 19,433.15 | 3,782,332,946 | 0.68 |
| アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES | ソフトウェア・サービス | 134,653 | 29,506.26 | 3,973,106,867 | 27,917.30 | 3,759,149,463 | 0.68 |
| スイス | 株式 | NESTLE SA - REGISTERED | 食品・飲料・タバコ | 229,173 | 16,598.19 | 3,803,858,445 | 16,398.78 | 3,758,158,526 | 0.68 |
| アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP | エネルギー | 158,183 | 24,649.65 | 3,899,157,077 | 22,266.75 | 3,522,221,410 | 0.63 |
| アメリカ | 株式 | HOME DEPOT | 小売 | 84,800 | 42,753.55 | 3,625,501,313 | 40,632.45 | 3,445,632,014 | 0.62 |
| アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC-CLASS A | ソフトウェア・サービス | 70,879 | 49,579.79 | 3,514,166,141 | 45,444.30 | 3,221,046,561 | 0.58 |
| アメリカ | 株式 | PFIZER | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 456,781 | 7,455.12 | 3,405,358,831 | 6,356.18 | 2,903,384,769 | 0.52 |
| アメリカ | 株式 | COCA-COLA CO | 食品・飲料・タバコ | 334,608 | 8,958.19 | 2,997,484,428 | 8,615.85 | 2,882,933,843 | 0.52 |
| アメリカ | 株式 | LILLY (ELI) & CO | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 65,773 | 44,757.22 | 2,943,817,119 | 42,564.95 | 2,799,624,798 | 0.50 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP | 銀行 | 591,261 | 5,128.19 | 3,032,103,302 | 4,725.89 | 2,794,238,409 | 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 | 143,718 | 20,764.38 | 2,984,215,948 | 18,791.29 | 2,700,647,550 | 0.49 |
| アメリカ | 株式 | PEPSICO INC | 食品・飲料・タバコ | 112,413 | 23,809.69 | 2,676,518,973 | 23,981.60 | 2,695,844,017 | 0.49 |
| アメリカ | 株式 | COSTCO WHOLESALE CORP | 食品・生活必需品小売り | 36,032 | 65,420.56 | 2,357,233,919 | 72,661.52 | 2,618,140,184 | 0.47 |
| スイス | 株式 | ROCHE HOLDING GENUSS | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 57,316 | 46,889.27 | 2,687,505,832 | 45,055.36 | 2,582,393,014 | 0.47 |
| アメリカ | 株式 | MERCK & CO | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 205,447 | 12,888.94 | 2,647,994,799 | 12,044.17 | 2,474,439,498 | 0.45 |

| | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 株式 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 31,791 | 79,392.38 | 2,523,963,218 | 76,841.22 | 2,442,859,311 | 0.44 |
| イギリス | 株式 | SHELL PLC-NEW | エネルギー | 620,239 | 3,845.20 | 2,384,943,625 | 3,785.31 | 2,347,797,508 | 0.42 |

**(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。**

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

**ロ.種類別及び業種別の投資比率**

| 種類 | 国内／外国 | 業種 | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|
| 株式 | 外国 | エネルギー | 5.38 |
| | | 素材 | 4.04 |
| | | 資本財 | 5.85 |
| | | 商業・専門サービス | 1.18 |
| | | 運輸 | 1.95 |
| | | 自動車・自動車部品 | 2.29 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 1.57 |
| | | 消費者サービス | 1.72 |
| | | メディア・娯楽 | 5.42 |
| | | 小売 | 4.89 |
| | | 食品・生活必需品小売り | 1.52 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 4.23 |
| | | 家庭用品・パーソナル用品 | 1.73 |
| | | ヘルスケア機器・サービス | 4.66 |
| | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 8.37 |
| | | 銀行 | 5.59 |
| | | 各種金融 | 4.55 |
| | | 保険 | 3.03 |
| | | 不動産 | 0.39 |
| | | ソフトウェア・サービス | 10.76 |
| | | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 6.68 |
| | | 電気通信サービス | 1.46 |
| | | 公益事業 | 3.23 |
| | | 半導体・半導体製造装置 | 4.19 |
| | | 小計 | 94.68 |
| 投資信託受益証券 | — | — | 0.05 |
| 投資証券 | — | — | 2.33 |
| 合計 | | | 97.07 |

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

**投資不動産物件**

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 地域 | 取引所 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 通貨 | 簿価金額(現地通貨) | 帳簿価額(円) | 評価金額(現地通貨) | 評価金額(円) | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | シカゴ商業取引所 | S&P 500 EMIN | 買建 | 447 | アメリカドル | 88,204,256.5 | 12,227,756,078 | 89,120,625 | 12,354,792,243 | 2.23 |
| | カナダ | モントリオール取引所 | S&P/TSE 60 | 買建 | 36 | カナダドル | 8,367,746 | 886,395,334 | 8,475,840 | 897,845,731 | 0.16 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | SWISS MKT IX | 買建 | 71 | スイスフラン | 7,803,027 | 1,111,151,045 | 7,736,870 | 1,101,730,288 | 0.20 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | DJ EURO STOX | 買建 | 335 | ユーロ | 11,913,427.5 | 1,656,323,825 | 11,912,600 | 1,656,208,778 | 0.30 |
| | オーストラリア | シドニー先物取引所 | SPI 200 FUTU | 買建 | 32 | オーストラリアドル | 5,364,099 | 510,340,379 | 5,534,400 | 526,542,816 | 0.09 |
| | イギリス | ロンドン国際金融先物オプション取引所 | FTSE 100 | 買建 | 27 | イギリスポンド | 1,954,406.25 | 316,222,931 | 1,986,525 | 321,419,745 | 0.06 |

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

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

| 種類 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 簿価(円) | 時価(円) | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | アメリカドル | 買建 | 4,785,000.00 | 663,243,750 | 663,240,215 | 0.12 |
| | カナダドル | 買建 | 550,000.00 | 58,253,250 | 58,251,215 | 0.01 |
| | ユーロ | 買建 | 485,000.00 | 67,391,910 | 67,427,780 | 0.01 |

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

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

## 新興国債券インデックス　マザーファンド

### 投資状況

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 国債証券 | ブラジル | 9,010,793,456 | 10.38 |
| | タイ | 8,747,366,279 | 10.07 |
| | インドネシア | 8,642,710,732 | 9.95 |
| | マレーシア | 8,619,755,054 | 9.93 |
| | メキシコ | 8,525,290,288 | 9.82 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 中国 | 8,466,025,026 | 9.75 |
| | 南アフリカ | 8,429,958,795 | 9.71 |
| | ポーランド | 5,754,768,393 | 6.63 |
| | チェコ | 4,266,465,692 | 4.91 |
| | コロンビア | 3,476,049,944 | 4.00 |
| | ルーマニア | 2,830,162,977 | 3.26 |
| | ハンガリー | 2,308,504,467 | 2.66 |
| | ペルー | 2,076,038,025 | 2.39 |
| | チリ | 1,851,368,079 | 2.13 |
| | ウルグアイ | 123,971,942 | 0.14 |
| | ドミニカ共和国 | 85,209,939 | 0.10 |
| | フィリピン | 71,927,264 | 0.08 |
| 小計 | | 83,286,366,352 | 95.92 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | — | 3,544,025,332 | 4.08 |
| 合計(純資産総額) | | 86,830,391,684 | 100.00 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

### イ.評価額上位銘柄明細

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 利率(%) | 償還期限 | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ブラジル | 国債証券 | BLTN 0% 01/01/24 | 138,400,000 | 2,162.95 | 2,993,525,494 | 2,297.32 | 3,179,504,628 | 0.000 | 2024/1/1 | 3.66 |
| コロンビア | 国債証券 | COLOM 9.85% 06/28/27 | 65,300,000,000 | 3.58 | 2,343,875,715 | 2.79 | 1,827,841,893 | 9.850 | 2027/6/28 | 2.11 |
| 南アフリカ | 国債証券 | SAGB 10.5% 12/21/26 | 182,400,000 | 898.65 | 1,639,144,322 | 863.83 | 1,575,641,624 | 10.500 | 2026/12/21 | 1.81 |
| ブラジル | 国債証券 | BLTN 0% 07/01/23 | 53,300,000 | 2,239.62 | 1,193,721,999 | 2,433.43 | 1,297,023,193 | 0.000 | 2023/7/1 | 1.49 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 5.75% 03/05/26 | 198,300,000 | 652.27 | 1,293,452,801 | 615.67 | 1,220,876,416 | 5.750 | 2026/3/5 | 1.41 |
| 南アフリカ | 国債証券 | SAGB 8% 01/31/30 | 155,100,000 | 751.31 | 1,165,290,885 | 719.98 | 1,116,703,590 | 8.000 | 2030/1/31 | 1.29 |
| ブラジル | 国債証券 | BNTNF 10% 01/01/27 | 41,200,000 | 2,555.21 | 1,052,749,402 | 2,529.64 | 1,042,214,558 | 10.000 | 2027/1/1 | 1.20 |
| 南アフリカ | 国債証券 | SAGB 8.75% 02/28/48 | 143,200,000 | 686.58 | 983,183,639 | 649.22 | 929,695,999 | 8.750 | 2048/2/28 | 1.07 |
| 南アフリカ | 国債証券 | SAGB 8.25% 03/31/32 | 129,000,000 | 726.20 | 936,807,610 | 695.05 | 896,620,408 | 8.250 | 2032/3/31 | 1.03 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 7.75% 05/29/31 | 140,600,000 | 701.69 | 986,582,748 | 633.07 | 890,098,548 | 7.750 | 2031/5/29 | 1.03 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 8% 09/05/24 | 128,400,000 | 705.57 | 905,958,582 | 668.00 | 857,715,325 | 8.000 | 2024/9/5 | 0.99 |
| ブラジル | 国債証券 | BNTNF 10% 01/01/25 | 31,800,000 | 2,586.27 | 822,435,909 | 2,589.17 | 823,359,065 | 10.000 | 2025/1/1 | 0.95 |
| コロンビア | 国債証券 | COLTES 7.25% 10/18/34 | 37,100,000,000 | 2.87 | 1,066,707,286 | 2.19 | 815,388,300 | 7.250 | 2034/10/18 | 0.94 |
| ブラジル | 国債証券 | BNTNF 10% 01/01/29 | 31,700,000 | 2,467.27 | 782,124,984 | 2,459.89 | 779,787,265 | 10.000 | 2029/1/1 | 0.90 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 8.5% 05/31/29 | 115,100,000 | 739.95 | 851,684,669 | 668.58 | 769,544,908 | 8.500 | 2029/5/31 | 0.89 |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 南アフリカ | 国債証券 | SAGB 8.875% 02/28/35 | 110,000,000 | 729.50 | 802,459,430 | 698.42 | 768,271,669 | 8.875 | 2035/2/28 | 0.88 |
| ブラジル | 国債証券 | BLTN 0% 07/01/25 | 38,900,000 | 1,899.17 | 738,778,005 | 1,962.38 | 763,368,930 | 0.000 | 2025/7/1 | 0.88 |
| タイ | 国債証券 | THAIGB 3.775% 06/25/32 | 180,000,000 | 423.67 | 762,607,201 | 420.06 | 756,116,370 | 3.775 | 2032/6/25 | 0.87 |
| 南アフリカ | 国債証券 | SAGB 8.75% 01/31/44 | 116,000,000 | 677.02 | 785,344,316 | 650.96 | 755,124,342 | 8.750 | 2044/1/31 | 0.87 |
| 南アフリカ | 国債証券 | SAGB 8.5% 01/31/37 | 113,700,000 | 695.81 | 791,138,045 | 660.10 | 750,537,475 | 8.500 | 2037/1/31 | 0.86 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 7.5% 06/03/27 | 114,000,000 | 699.44 | 797,370,874 | 645.27 | 735,616,644 | 7.500 | 2027/6/3 | 0.85 |
| タイ | 国債証券 | THAIGB 3.65% 06/20/31 | 175,500,000 | 437.89 | 768,507,182 | 416.00 | 730,089,758 | 3.650 | 2031/6/20 | 0.84 |
| マレーシア | 国債証券 | MGS 3.955% 09/15/25 | 23,000,000 | 3,210.58 | 738,434,453 | 3,146.55 | 723,707,069 | 3.955 | 2025/9/15 | 0.83 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 10% 12/05/24 | 104,250,000 | 744.29 | 775,931,614 | 693.98 | 723,480,024 | 10.000 | 2024/12/5 | 0.83 |
| タイ | 国債証券 | THAIGB 1.45% 12/17/24 | 184,000,000 | 385.72 | 709,726,738 | 377.63 | 694,849,504 | 1.450 | 2024/12/17 | 0.80 |
| 南アフリカ | 国債証券 | SAGB 9% 01/31/40 | 100,300,000 | 703.97 | 706,085,016 | 675.35 | 677,382,781 | 9.000 | 2040/1/31 | 0.78 |
| ブラジル | 国債証券 | BLTN 0% 07/01/24 | 30,850,000 | 2,038.46 | 628,864,923 | 2,179.94 | 672,513,150 | 0.000 | 2024/7/1 | 0.77 |
| マレーシア | 国債証券 | MGS 3.899% 11/16/27 | 20,800,000 | 3,180.72 | 661,590,354 | 3,124.97 | 649,993,979 | 3.899 | 2027/11/16 | 0.75 |
| マレーシア | 国債証券 | MGS 2.632% 04/15/31 | 23,100,000 | 2,843.51 | 656,853,093 | 2,794.25 | 645,472,222 | 2.632 | 2031/4/15 | 0.74 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 8.5% 11/18/38 | 98,300,000 | 739.05 | 726,492,892 | 654.30 | 643,185,207 | 8.500 | 2038/11/18 | 0.74 |

**(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。**
**(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。**

**ロ.種類別投資比率**

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 国債証券 | 95.92 |
| 合計 | 95.92 |

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

## 投資不動産物件

**該当事項はありません。**

## その他投資資産の主要なもの

**該当事項はありません。**

## 新興国株式インデックス　マザーファンド

## 投資状況

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

| | | | |
|---|---|---|---|
| 株式 | ケイマン | 19,716,165,184 | 17.12 |
| | インド | 16,061,501,422 | 13.95 |
| | 台湾 | 15,159,079,010 | 13.16 |
| | 中国 | 13,192,457,342 | 11.46 |
| | 韓国 | 12,235,504,259 | 10.62 |
| | ブラジル | 5,575,512,643 | 4.84 |
| | サウジアラビア | 5,163,833,383 | 4.48 |
| | 南アフリカ | 3,594,875,226 | 3.12 |
| | インドネシア | 2,137,709,911 | 1.86 |
| | メキシコ | 2,108,802,276 | 1.83 |
| | タイ | 2,093,580,745 | 1.82 |
| | マレーシア | 1,633,621,337 | 1.42 |
| | アラブ首長国連邦 | 1,480,720,668 | 1.29 |
| | 香港 | 1,270,658,366 | 1.10 |
| | カタール | 1,246,771,656 | 1.08 |
| | クウェート | 930,799,022 | 0.81 |
| | フィリピン | 867,443,063 | 0.75 |
| | チリ | 633,529,381 | 0.55 |
| | バミューダ | 617,061,128 | 0.54 |
| | ポーランド | 534,881,940 | 0.46 |
| | アメリカ | 418,245,888 | 0.36 |
| | トルコ | 380,765,553 | 0.33 |
| | ギリシャ | 271,272,915 | 0.24 |
| | ハンガリー | 200,962,547 | 0.17 |
| | コロンビア | 163,799,579 | 0.14 |
| | チェコ | 148,333,069 | 0.13 |
| | ルクセンブルク | 67,332,655 | 0.06 |
| | エジプト | 46,812,204 | 0.04 |
| | マン島 | 45,189,782 | 0.04 |
| | シンガポール | 26,668,543 | 0.02 |
| | ペルー | 12,861,592 | 0.01 |
| | ロシア | 175 | 0.00 |
| | 小計 | 108,036,752,464 | 93.81 |
| 投資信託受益証券 | ブラジル | 206,294,743 | 0.18 |
| | メキシコ | 50,176,703 | 0.04 |
| | 小計 | 256,471,446 | 0.22 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 投資証券 | メキシコ | 54,962,054 | 0.05 |
| | 南アフリカ | 50,181,319 | 0.04 |
| | 小計 | 105,143,373 | 0.09 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | ― | 6,767,052,807 | 5.88 |
| 合計(純資産総額) | | 115,165,420,090 | 100.00 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 6,874,857,861 | 5.97 |

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

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

| 資産の種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | 買建 | ― | 281,447,426 | 0.24 |
| | 売建 | ― | 1,934,068 | △0.00 |

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

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

### 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

### イ.評価額上位銘柄明細

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

| | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 台湾 | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 半導体・半導体製造装置 | 2,954,389 | 2,767.14 | 8,175,235,325 | 2,258.43 | 6,672,300,839 | 5.79 |
| ケイマン | 株式 | TENCENT HOLDINGS LTD | メディア・娯楽 | 748,300 | 7,743.75 | 5,794,648,389 | 5,714.77 | 4,276,366,881 | 3.71 |
| 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 | 573,964 | 7,229.30 | 4,149,363,531 | 6,044.64 | 3,469,405,753 | 3.01 |
| ケイマン | 株式 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 小売 | 1,830,888 | 2,677.12 | 4,901,512,593 | 1,681.23 | 3,078,147,494 | 2.67 |
| インド | 株式 | RELIANCE INDUSTRIES LTD | エネルギー | 375,247 | 4,423.61 | 1,659,948,654 | 4,616.41 | 1,732,294,941 | 1.50 |
| ケイマン | 株式 | MEITUAN-CLASS B | 小売 | 495,300 | 4,605.51 | 2,281,113,331 | 3,267.10 | 1,618,194,630 | 1.41 |
| インド | 株式 | INFOSYS LTD | ソフトウェア・サービス | 411,657 | 3,019.85 | 1,243,143,279 | 2,612.66 | 1,075,520,807 | 0.93 |
| ケイマン | 株式 | JD.COM INC - CL A | 小売 | 237,411 | 5,104.50 | 1,211,864,790 | 4,362.01 | 1,035,591,530 | 0.90 |
| インド | 株式 | ICICI BANK LTD | 銀行 | 637,362 | 1,370.45 | 873,476,957 | 1,552.77 | 989,679,780 | 0.86 |
| 中国 | 株式 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 銀行 | 11,210,620 | 93.01 | 1,042,768,543 | 85.65 | 960,200,814 | 0.83 |
| インド | 株式 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE | 各種金融 | 214,032 | 5,007.62 | 1,071,792,273 | 4,281.19 | 916,313,798 | 0.80 |
| ブラジル | 株式 | VALE SA | 素材 | 477,787 | 1,841.81 | 879,994,369 | 1,757.75 | 839,830,269 | 0.73 |
| サウジアラビア | 株式 | AL RAJHI BANK | 銀行 | 237,965 | 3,407.17 | 810,789,032 | 3,350.38 | 797,275,080 | 0.69 |
| 台湾 | 株式 | HON HAI PRECISION INDUSTRY | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 1,510,248 | 490.65 | 741,003,901 | 494.03 | 746,112,426 | 0.65 |
| サウジアラビア | 株式 | THE SAUDI NATIONAL BANK | 銀行 | 276,263 | 2,478.15 | 684,623,604 | 2,588.60 | 715,134,402 | 0.62 |
| ケイマン | 株式 | BAIDU INC-CLASS A | メディア・娯楽 | 267,900 | 2,579.67 | 691,094,940 | 2,583.65 | 692,161,978 | 0.60 |
| 中国 | 株式 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 保険 | 784,500 | 990.97 | 777,423,481 | 811.47 | 636,603,707 | 0.55 |
| 韓国 | 株式 | SK HYNIX INC | 半導体・半導体製造装置 | 65,667 | 11,256.68 | 739,193,021 | 9,580.95 | 629,152,900 | 0.55 |
| インド | 株式 | TATA CONSULTANCY SVCS LTD | ソフトウェア・サービス | 111,824 | 6,115.07 | 683,812,608 | 5,619.51 | 628,396,366 | 0.55 |
| ケイマン | 株式 | NETEASE INC | メディア・娯楽 | 246,830 | 2,779.34 | 686,025,466 | 2,461.80 | 607,647,081 | 0.53 |
| 南アフリカ | 株式 | NASPERS LTD-N SHS | 小売 | 27,673 | 19,977.41 | 552,835,137 | 19,714.29 | 545,553,594 | 0.47 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 96,421 | 6,785.78 | 654,292,471 | 5,623.15 | 542,190,710 | 0.47 |
| 台湾 | 株式 | MEDIATEK INC | 半導体・半導体製造装置 | 179,804 | 4,391.02 | 789,523,834 | 2,991.51 | 537,886,920 | 0.47 |
| ケイマン | 株式 | WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 423,000 | 1,759.22 | 744,153,716 | 1,234.43 | 522,165,582 | 0.45 |
| インドネシア | 株式 | BANK CENTRAL ASIA PT | 銀行 | 6,769,300 | 72.34 | 489,722,524 | 76.84 | 520,186,858 | 0.45 |
| ケイマン | 株式 | PINDUODUO INC-ADR | 小売 | 53,748 | 11,035.51 | 593,137,039 | 9,218.89 | 495,497,168 | 0.43 |
| インド | 株式 | HINDUSTAN UNILEVER LTD | 家庭用品・パーソナル用品 | 104,076 | 4,235.55 | 440,819,294 | 4,654.73 | 484,446,460 | 0.42 |
| ブラジル | 株式 | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | エネルギー | 544,440 | 720.73 | 392,399,616 | 877.38 | 477,684,668 | 0.41 |
| 中国 | 株式 | BANK OF CHINA LTD-H | 銀行 | 9,806,200 | 49.29 | 483,422,886 | 48.38 | 474,506,328 | 0.41 |
| 中国 | 株式 | BYD CO LTD-H | 自動車・自動車部品 | 102,000 | 5,351.93 | 545,897,579 | 4,644.58 | 473,747,160 | 0.41 |

**(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。**

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

**ロ.種類別及び業種別の投資比率**

| 種類 | 国内／外国 | 業種 | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 株式 | 外国 | エネルギー | 4.96 |
| | | 素材 | 7.99 |
| | | 資本財 | 3.53 |
| | | 商業・専門サービス | 0.08 |
| | | 運輸 | 2.04 |
| | | 自動車・自動車部品 | 3.52 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 1.63 |
| | | 消費者サービス | 1.05 |
| | | メディア・娯楽 | 6.47 |
| | | 小売 | 7.17 |
| | | 食品・生活必需品小売り | 1.22 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 3.65 |
| | | 家庭用品・パーソナル用品 | 0.87 |
| | | ヘルスケア機器・サービス | 0.96 |
| | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 2.73 |
| | | 銀行 | 14.77 |
| | | 各種金融 | 3.11 |
| | | 保険 | 2.29 |
| | | 不動産 | 1.75 |
| | | ソフトウェア・サービス | 2.44 |
| | | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 7.21 |
| | | 電気通信サービス | 3.00 |
| | | 公益事業 | 3.08 |
| | | 半導体・半導体製造装置 | 8.30 |
| | | 小計 | 93.81 |
| 投資信託受益証券 | — | — | 0.22 |
| 投資証券 | — | — | 0.09 |
| 合計 | | | 94.12 |

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

**投資不動産物件**

**該当事項はありません。**

**その他投資資産の主要なもの**

| 資産の種類 | 地域 | 取引所 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 通貨 | 簿価金額(現地通貨) | 帳簿価額(円) | 評価金額(現地通貨) | 評価金額(円) | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | インターコンチネンタル取引所 | MSCI EMERG M | 買建 | 1,013 | アメリカドル | 50,805,807 | 7,043,209,024 | 49,591,415 | 6,874,857,861 | 5.97 |

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

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

| 種類 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 簿価(円) | 時価(円) | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | アメリカドル | 買建 | 1,493,971.87 | 207,037,482 | 207,090,246 | 0.18 |
| | チェココルナ | 買建 | 9,500,000.00 | 53,855,500 | 53,770,950 | 0.05 |
| | ポーランドズロチ | 買建 | 700,000.00 | 20,612,200 | 20,586,230 | 0.02 |
| | ブラジルレアル | 売建 | 71,487.07 | 1,969,082 | 1,934,068 | △0.00 |

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

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

≪参考情報≫

## 交付目論見書に記載するファンドの運用実績

## 運用実績

当初設定日：2013年11月 8 日
作成基準日：2022年 8 月31日

### 基準価額・純資産の推移

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

| | |
|---|---|
| 基準価額 | 19,603円 |
| 純資産総額 | 55.16億円 |

### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

| 決算期 | 分配金 |
|---|---|
| 2018年 1 月 | 0円 |
| 2019年 1 月 | 0円 |
| 2020年 1 月 | 0円 |
| 2021年 1 月 | 0円 |
| 2022年 1 月 | 0円 |
| 設定来分配金合計額 | 0円 |

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

### 主要な資産の状況

| マザーファンド | 投資比率 | 上位組入銘柄 | 国/地域 | 種類 | 業種 | 利率 | 償還期限 | 実質投資比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 外国株式インデックスマザーファンド | 45.8% | APPLE INC | アメリカ | 株式 | テクノロジーハードウェアおよび機器 | - | - | 2.4% |
| | | MICROSOFT CORP | アメリカ | 株式 | ソフトウェア・サービス | - | - | 1.7% |
| 新興国株式インデックスマザーファンド | 22.4% | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 台湾 | 株式 | 半導体・半導体製造装置 | - | - | 1.3% |
| | | TENCENT HOLDINGS LTD | ケイマン諸島 | 株式 | メディア・娯楽 | - | - | 0.8% |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 14.4% | T 1.375% 11/15/31 | アメリカ | 国債 | - | 1.375% | 2031/11/15 | 0.1% |
| | | T 1.25% 08/15/31 | アメリカ | 国債 | - | 1.250% | 2031/08/15 | 0.1% |
| 国内株式インデックスマザーファンド | 7.8% | トヨタ自動車 | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | - | - | 0.3% |
| | | ソニーグループ | 日本 | 株式 | 電気機器 | - | - | 0.2% |
| 新興国債券インデックスマザーファンド | 6.8% | BLTN 0% 01/01/24 | ブラジル | 国債 | - | 0.000% | 2024/01/01 | 0.3% |
| | | COLOM 9.85% 06/28/27 | コロンビア | 国債 | - | 9.850% | 2027/06/28 | 0.1% |
| 国内債券インデックスマザーファンド | 1.8% | 第150回利付国債(5年) | 日本 | 国債 | - | 0.005% | 2026/12/20 | 0.0% |
| | | 第141回利付国債(5年) | 日本 | 国債 | - | 0.100% | 2024/09/20 | 0.0% |

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移(暦年ベース)

※2013年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2022年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第２【管理及び運営】

### １【申込（販売）手続等】

**＜申込手続＞**

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

**＜申込コース＞**

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

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

**＜申込みの受付＞**

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

**＜申込単位＞**

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

**＜申込価額＞**

**取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。**

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

**＜申込手数料＞**

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

**＜申込代金の支払い＞**

**販売会社が定める期日までにお支払いください。**

**＜受付不可日＞**

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

**ニューヨークの取引所の休業日**
**ロンドンの取引所の休業日**
**ニューヨークの銀行休業日**
**ロンドンの銀行休業日**

**＜申込受付の中止等＞**

**収益分配金を再投資する場合を除き、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。**

**＜その他＞**

**取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと**

**引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。**

**＜問い合わせ先＞**

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

**（照会先）**

**三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社**

**ホームページ：https://www.smtam.jp/**

**フリーダイヤル：0120-668001**

**（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）**

**2【換金（解約）手続等】**

**＜一部解約手続＞**

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

**＜一部解約の受付＞**

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

**＜一部解約単位＞**

**販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。**

**＜解約価額＞**

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

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

**＜一部解約代金の支払い＞**

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

**＜受付不可日＞**

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

**ニューヨークの取引所の休業日**
**ロンドンの取引所の休業日**
**ニューヨークの銀行休業日**
**ロンドンの銀行休業日**

**＜一部解約受付の中止等＞**

**委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。**
**一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記＜解約価額＞の規定に準じて計算された価額とします。**

**＜一部解約の制限＞**

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

**＜その他＞**

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

**＜問い合わせ先＞**

**上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。**
**（照会先）**
**三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社**
**ホームページ：https://www.smtam.jp/**
**フリーダイヤル：0120-668001**
**（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）**

## 3【資産管理等の概要】

### （1）【資産の評価】

**＜基準価額の算出方法＞**

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

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

イ．マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

ロ．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日のわが国の取引所の最終相場で評価します。

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

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

（ハ）公社債等

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

a.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c.価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

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

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2013年11月 8日設定）

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

**（４）【計算期間】**

**原則として、毎年1月21日から翌年1月20日までとします。**
**ただし、第1計算期間は2013年11月8日から2014年1月20日までとします。**
**なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。**

**（５）【その他】**

**＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞**

**(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）**

**①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。**

**・受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合**
**・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合**
**・やむを得ない事情が発生した場合**

**②委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。**

**③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。**

**④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。**

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

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

**①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。**

**②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。**

**③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。**

**④上記①から③までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。**

**＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞**

**(1)投資信託約款の変更等**

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

①信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

②上記①ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

## 4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

①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。

②収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③上記②の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

④上記②に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

⑤受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失

**い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。**

**(2)償還金に対する請求権**

**①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。**

**②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。**

**③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。**

**④受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。**

**(3)換金（解約）請求権**

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

**詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。**

**(4)帳簿閲覧・謄写請求権**

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

**第３【ファンドの経理状況】**

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

**(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2021年1月21日から2022年1月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。**

**１【財務諸表】**

## 【世界経済インデックスファンド（株式シフト型）】

### （１）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第8期<br>（2021年 1月20日現在） | 第9期<br>（2022年 1月20日現在） |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | 2,559 | - |
| コール・ローン | 49,985,864 | 75,933,591 |
| 親投資信託受益証券 | 4,698,812,954 | 5,293,469,090 |
| 未収入金 | 15,780,000 | 20,200,000 |
| 流動資産合計 | 4,764,581,377 | 5,389,602,681 |
| 資産合計 | 4,764,581,377 | 5,389,602,681 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 4,706,160 | 10,374,945 |
| 未払受託者報酬 | 1,241,164 | 1,486,043 |
| 未払委託者報酬 | 12,411,567 | 14,860,417 |
| 未払利息 | 33 | 113 |
| その他未払費用 | 124,052 | 148,542 |
| 流動負債合計 | 18,482,976 | 26,870,060 |
| 負債合計 | 18,482,976 | 26,870,060 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 2,815,369,100 | 2,807,071,125 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 1,930,729,301 | 2,555,661,496 |
| （分配準備積立金） | 1,113,566,462 | 1,546,996,315 |
| 元本等合計 | 4,746,098,401 | 5,362,732,621 |
| 純資産合計 | 4,746,098,401 | 5,362,732,621 |
| 負債純資産合計 | 4,764,581,377 | 5,389,602,681 |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第8期<br>自　2020年 1月21日<br>至　2021年 1月20日 | 第9期<br>自　2021年 1月21日<br>至　2022年 1月20日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 361 | 313 |
| 有価証券売買等損益 | 392,555,452 | 656,366,136 |
| 営業収益合計 | 392,555,813 | 656,366,449 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 24,933 | 24,503 |
| 受託者報酬 | 2,361,522 | 2,841,191 |
| 委託者報酬 | 23,615,131 | 28,411,829 |
| その他費用 | 236,118 | 283,996 |
| 営業費用合計 | 26,237,704 | 31,561,519 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 366,318,109 | 624,804,930 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 366,318,109 | 624,804,930 |
| 当期純利益又は当期純損失（△） | 366,318,109 | 624,804,930 |
| 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（△） | △50,787,453 | 52,613,261 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 1,681,087,206 | 1,930,729,301 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 187,642,951 | 310,122,538 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 187,642,951 | 310,122,538 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 355,106,418 | 257,382,012 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 355,106,418 | 257,382,012 |
| 分配金 | - | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 1,930,729,301 | 2,555,661,496 |

## （３）【注記表】

### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

### （貸借対照表に関する注記）

| | 第8期<br>(2021年 1月20日現在) | | 第9期<br>(2022年 1月20日現在) | |
|---|---|---|---|---|
| １．計算期間の末日における受益権の総数 | | 2,815,369,100口 | | 2,807,071,125口 |
| ２．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 | 1.6858円 | 1口当たり純資産額 | 1.9104円 |
| | (1万口当たり純資産額) | (16,858円) | (1万口当たり純資産額) | (19,104円) |

### （損益及び剰余金計算書に関する注記）

第8期
自 2020年 1月21日
至 2021年 1月20日

分配金の計算過程

| 項目 | | |
|---|---|---|
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 80,990,845円 |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 336,114,717円 |
| 収益調整金額 | C | 817,162,839円 |
| 分配準備積立金額 | D | 696,460,900円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 1,930,729,301円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 2,815,369,100口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 6,857円 |
| 1万口当たり分配金額 | H | －円 |
| 収益分配金金額 | I=F×H/10,000 | －円 |

第9期
自 2021年 1月21日
至 2022年 1月20日

分配金の計算過程

| 項目 | | |
|---|---|---|
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 95,109,322円 |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 477,082,347円 |
| 収益調整金額 | C | 1,008,665,181円 |
| 分配準備積立金額 | D | 974,804,646円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 2,555,661,496円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 2,807,071,125口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 9,104円 |
| 1万口当たり分配金額 | H | －円 |
| 収益分配金金額 | I=F×H/10,000 | －円 |

### （金融商品に関する注記）

#### １．金融商品の状況に関する事項

| | 第9期<br>自 2021年 1月21日<br>至 2022年 1月20日 |
|---|---|
| 1 .金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2 .金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 |
| 3 .金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。 |

## ２．金融商品の時価等に関する事項

| | 第9期<br>(2022年 1月20日現在) |
|---|---|
| 1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2 .時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

### （関連当事者との取引に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

### （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

| 区分 | 第8期<br>自 2020年 1月21日<br>至 2021年 1月20日 | 第9期<br>自 2021年 1月21日<br>至 2022年 1月20日 |
|---|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | | |
| 期首元本額 | 3,032,547,172円 | 2,815,369,100円 |
| 期中追加設定元本額 | 439,486,500円 | 363,887,048円 |
| 期中一部解約元本額 | 656,664,572円 | 372,185,023円 |

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

| 種類 | 第8期<br>(2021年 1月20日現在) | 第9期<br>(2022年 1月20日現在) |
|---|---|---|
| | 計算期間の損益に含まれた評価差額(円) | 計算期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 親投資信託受益証券 | 402,869,299 | 604,985,732 |
| 合計 | 402,869,299 | 604,985,732 |

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

| 種類 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額(円) | 備考 |
|---|---|---|---|---|
| 親投資信託受益証券 | 新興国株式インデックス　マザーファンド | 330,135,084 | 1,211,562,744 | |
| | 国内株式インデックス　マザーファンド | 216,766,384 | 409,861,878 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 外国株式インデックス　マザーファンド | 599,690,957 | 2,477,023,497 | |
| | 国内債券インデックス　マザーファンド | 62,889,699 | 88,271,981 | |
| | 外国債券インデックス　マザーファンド | 245,900,131 | 751,200,310 | |
| | 新興国債券インデックス　マザーファンド | 203,205,510 | 355,548,680 | |
| 合計 | | 1,658,587,765 | 5,293,469,090 | |

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。
なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 国内債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 515,724,210 |
| 国債証券 | 542,547,283,100 |
| 地方債証券 | 35,532,536,388 |
| 特殊債券 | 39,212,798,662 |
| 社債券 | 29,983,332,020 |
| 未収利息 | 1,034,521,342 |
| 前払費用 | 14,206,093 |
| 流動資産合計 | 648,840,401,815 |
| 資産合計 | 648,840,401,815 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 389,603,473 |
| 未払利息 | 773 |
| 流動負債合計 | 389,604,246 |
| 負債合計 | 389,604,246 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 462,000,831,762 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 186,449,965,807 |
| 元本等合計 | 648,450,797,569 |
| 純資産合計 | 648,450,797,569 |

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 負債純資産合計 | 648,840,401,815 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券<br>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | 先物取引<br>債券先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 |
| 3.収益及び費用の計上基準 | 派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| | | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|---|
| 1． | 計算期間の末日における受益権の総数 | 462,000,831,762口 |
| 2． | 担保資産 | 先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 |
| | | 有価証券　100,677,000円 |
| 3． | 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額　1.4036円 |
| | | (1万口当たり純資産額)　(14,036円) |

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

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 1 .金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2 .金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。<br>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。 |
| 3 .金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。 |

## ２．金融商品の時価等に関する事項

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2 .時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

## （関連当事者との取引に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

**（重要な後発事象に関する注記）**

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

**（その他の注記）**
**元本の移動**

| 区分 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2021年 1月21日 |
| 期首元本額 | 431,157,941,659円 |
| 期中追加設定元本額 | 66,787,655,439円 |
| 期中一部解約元本額 | 35,944,765,336円 |
| 期末元本額 | 462,000,831,762円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| エマージング株式オープン | 2,227,240円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 3,922,731,130円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 17,145,897円 |
| ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン | 20,053,396,007円 |
| 世界経済インデックスファンド | 3,326,552,717円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 25,206,785,211円 |
| ＤＣマイセレクション５０ | 28,693,332,315円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 8,417,033,589円 |
| ＤＣ日本債券インデックス・オープン | 443,229,994円 |
| ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ | 92,995,206,193円 |
| ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ | 68,158,829,575円 |
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 12,233,971,690円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 13,670,894,740円 |
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 2,937,613,546円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 884,907,016円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 2,079,681,432円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 762,802,847円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 3,188,517,405円 |
| 日本債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 8,508,675円 |
| 国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 2,561,112円 |
| マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 32,884,644円 |
| マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 9,687,330円 |
| 国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 1,065,314円 |
| バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 100,447,098円 |
| バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 143,873,019円 |

| 区分 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 34,399,011円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 33,251,587円 |
| バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 3,129,392,113円 |
| バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 780,768,188円 |
| バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 3,298,348,050円 |
| 世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用） | 128,476,574円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 80,708,395円 |
| バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,054,974,018円 |
| バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,165,136,913円 |
| バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,492,777,170円 |
| 国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 145,270,376円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ１ | 5,819,118,506円 |
| 日本債券ファンド・シリーズ１ | 14,983,744,748円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 25,923,818,430円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 32,971,011,995円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 147,276,557円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 1,308,708,904円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 62,889,699円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 35,787,715円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 58,185,006円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 32,116,270円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 61,315,746円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 101,463,607円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 8,214,116円 |
| グローバル経済コア | 227,435,681円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 27,173,499円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 14,846,995円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 10,638,408円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 4,740,525円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 1,601,884円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 1,034,565円 |
| ＦＯＦｓ用　国内債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用） | 81,142,630,576円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 76,106,868円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 9,657,995円 |
| ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用） | 333,925,336円 |

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

| 種類 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券 | △4,582,662,500 |

| | |
|---|---|
| 地方債証券 | △205,143,230 |
| 特殊債券 | △202,109,302 |
| 社債券 | △89,847,140 |
| 合計 | △5,079,762,172 |

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

### 第１　有価証券明細表

#### (1)株式

該当事項はありません。

#### (2)株式以外の有価証券

| 種類 | 銘　柄 | 券面総額(円) | 評価額(円) | 備考 |
|---|---|---|---|---|
| 国債証券 | 第４２１回利付国債（２年） | 590,000,000 | 591,185,900 | |
| | 第４２２回利付国債（２年） | 40,000,000 | 40,084,000 | |
| | 第４２３回利付国債（２年） | 1,310,000,000 | 1,311,480,300 | |
| | 第４２４回利付国債（２年） | 2,070,000,000 | 2,072,504,700 | |
| | 第４２５回利付国債（２年） | 2,870,000,000 | 2,873,702,300 | |
| | 第４２６回利付国債（２年） | 620,000,000 | 620,799,800 | |
| | 第４２７回利付国債（２年） | 3,870,000,000 | 3,875,301,900 | |
| | 第４２８回利付国債（２年） | 230,000,000 | 230,333,500 | |
| | 第４２９回利付国債（２年） | 950,000,000 | 951,444,000 | |
| | 第４３０回利付国債（２年） | 2,120,000,000 | 2,123,201,200 | |
| | 第１３５回利付国債（５年） | 4,080,000,000 | 4,088,976,000 | |
| | 第１３６回利付国債（５年） | 4,400,000,000 | 4,411,484,000 | |
| | 第１３７回利付国債（５年） | 6,760,000,000 | 6,780,820,800 | |
| | 第１３８回利付国債（５年） | 6,890,000,000 | 6,913,701,600 | |
| | 第１３９回利付国債（５年） | 5,690,000,000 | 5,712,134,100 | |
| | 第１４０回利付国債（５年） | 6,300,000,000 | 6,326,586,000 | |
| | 第１４１回利付国債（５年） | 7,250,000,000 | 7,283,785,000 | |
| | 第１４２回利付国債（５年） | 5,380,000,000 | 5,407,438,000 | |
| | 第１４３回利付国債（５年） | 4,800,000,000 | 4,826,592,000 | |
| | 第１４４回利付国債（５年） | 6,310,000,000 | 6,347,733,800 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第１４５回利付国債（５年） | 7,410,000,000 | 7,456,238,400 | |
| 第１４６回利付国債（５年） | 3,150,000,000 | 3,169,750,500 | |
| 第１４７回利付国債（５年） | 4,420,000,000 | 4,431,050,000 | |
| 第１４８回利付国債（５年） | 8,990,000,000 | 9,011,845,700 | |
| 第１４９回利付国債（５年） | 4,860,000,000 | 4,870,206,000 | |
| 第１回利付国債（４０年） | 400,000,000 | 567,928,000 | |
| 第２回利付国債（４０年） | 1,130,000,000 | 1,555,851,800 | |
| 第３回利付国債（４０年） | 550,000,000 | 761,981,000 | |
| 第４回利付国債（４０年） | 1,200,000,000 | 1,670,268,000 | |
| 第５回利付国債（４０年） | 1,070,000,000 | 1,441,504,000 | |
| 第６回利付国債（４０年） | 1,260,000,000 | 1,674,603,000 | |
| 第７回利付国債（４０年） | 1,440,000,000 | 1,842,163,200 | |
| 第８回利付国債（４０年） | 1,230,000,000 | 1,473,601,500 | |
| 第９回利付国債（４０年） | 2,050,000,000 | 1,847,357,500 | |
| 第１０回利付国債（４０年） | 2,200,000,000 | 2,317,590,000 | |
| 第１１回利付国債（４０年） | 1,790,000,000 | 1,828,449,200 | |
| 第１２回利付国債（４０年） | 1,450,000,000 | 1,340,757,000 | |
| 第１３回利付国債（４０年） | 2,140,000,000 | 1,972,480,800 | |
| 第１４回利付国債（４０年） | 1,340,000,000 | 1,315,732,600 | |
| 第３２８回利付国債（１０年） | 5,940,000,000 | 5,987,520,000 | |
| 第３２９回利付国債（１０年） | 4,410,000,000 | 4,464,816,300 | |
| 第３３０回利付国債（１０年） | 3,910,000,000 | 3,967,281,500 | |
| 第３３１回利付国債（１０年） | 900,000,000 | 910,188,000 | |
| 第３３２回利付国債（１０年） | 4,800,000,000 | 4,862,016,000 | |
| 第３３３回利付国債（１０年） | 3,030,000,000 | 3,074,207,700 | |
| 第３３４回利付国債（１０年） | 4,260,000,000 | 4,329,438,000 | |
| 第３３５回利付国債（１０年） | 2,410,000,000 | 2,446,969,400 | |
| 第３３６回利付国債（１０年） | 950,000,000 | 965,941,000 | |
| 第３３７回利付国債（１０年） | 2,800,000,000 | 2,830,632,000 | |
| 第３３８回利付国債（１０年） | 4,560,000,000 | 4,627,807,200 | |
| 第３３９回利付国債（１０年） | 4,750,000,000 | 4,826,285,000 | |
| 第３４０回利付国債（１０年） | 4,830,000,000 | 4,913,365,800 | |
| 第３４１回利付国債（１０年） | 5,340,000,000 | 5,416,415,400 | |
| 第３４２回利付国債（１０年） | 5,050,000,000 | 5,082,623,000 | |
| 第３４３回利付国債（１０年） | 2,670,000,000 | 2,687,702,100 | |
| 第３４４回利付国債（１０年） | 6,000,000,000 | 6,040,620,000 | |
| 第３４５回利付国債（１０年） | 3,740,000,000 | 3,764,833,600 | |
| 第３４６回利付国債（１０年） | 6,250,000,000 | 6,291,937,500 | |
| 第３４７回利付国債（１０年） | 3,880,000,000 | 3,906,267,600 | |
| 第３４８回利付国債（１０年） | 5,090,000,000 | 5,124,612,000 | |
| 第３４９回利付国債（１０年） | 5,070,000,000 | 5,104,476,000 | |
| 第３５０回利付国債（１０年） | 7,830,000,000 | 7,883,009,100 | 代用有価証券<br>100,000,000円 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第３５１回利付国債（１０年） | 5,110,000,000 | 5,144,390,300 | |
| 第３５２回利付国債（１０年） | 4,510,000,000 | 4,540,036,600 | |
| 第３５３回利付国債（１０年） | 4,300,000,000 | 4,328,208,000 | |
| 第３５４回利付国債（１０年） | 4,690,000,000 | 4,720,156,700 | |
| 第３５５回利付国債（１０年） | 4,750,000,000 | 4,778,072,500 | |
| 第３５６回利付国債（１０年） | 5,040,000,000 | 5,066,964,000 | |
| 第３５７回利付国債（１０年） | 2,500,000,000 | 2,511,825,000 | |
| 第３５８回利付国債（１０年） | 3,290,000,000 | 3,303,357,400 | |
| 第３５９回利付国債（１０年） | 3,430,000,000 | 3,441,456,200 | |
| 第３６０回利付国債（１０年） | 5,210,000,000 | 5,223,441,800 | |
| 第３６１回利付国債（１０年） | 4,640,000,000 | 4,648,166,400 | |
| 第３６２回利付国債（１０年） | 3,850,000,000 | 3,851,732,500 | |
| 第３６３回利付国債（１０年） | 7,360,000,000 | 7,349,696,000 | |
| 第３６４回利付国債（１０年） | 4,210,000,000 | 4,197,917,300 | |
| 第１回利付国債（３０年） | 110,000,000 | 133,244,100 | |
| 第２回利付国債（３０年） | 160,000,000 | 190,342,400 | |
| 第３回利付国債（３０年） | 120,000,000 | 142,327,200 | |
| 第４回利付国債（３０年） | 110,000,000 | 137,318,500 | |
| 第５回利付国債（３０年） | 50,000,000 | 59,701,500 | |
| 第６回利付国債（３０年） | 350,000,000 | 427,322,000 | |
| 第７回利付国債（３０年） | 180,000,000 | 219,463,200 | |
| 第８回利付国債（３０年） | 350,000,000 | 410,697,000 | |
| 第９回利付国債（３０年） | 240,000,000 | 271,480,800 | |
| 第１０回利付国債（３０年） | 160,000,000 | 175,908,800 | |
| 第１１回利付国債（３０年） | 260,000,000 | 303,677,400 | |
| 第１２回利付国債（３０年） | 190,000,000 | 231,142,600 | |
| 第１３回利付国債（３０年） | 400,000,000 | 483,208,000 | |
| 第１４回利付国債（３０年） | 800,000,000 | 1,007,120,000 | |
| 第１５回利付国債（３０年） | 340,000,000 | 433,387,800 | |
| 第１６回利付国債（３０年） | 200,000,000 | 255,704,000 | |
| 第１７回利付国債（３０年） | 1,150,000,000 | 1,461,098,000 | |
| 第１８回利付国債（３０年） | 345,000,000 | 435,100,200 | |
| 第１９回利付国債（３０年） | 530,000,000 | 670,110,800 | |
| 第２０回利付国債（３０年） | 480,000,000 | 621,451,200 | |
| 第２１回利付国債（３０年） | 500,000,000 | 635,670,000 | |
| 第２２回利付国債（３０年） | 420,000,000 | 546,982,800 | |
| 第２３回利付国債（３０年） | 430,000,000 | 561,451,000 | |
| 第２４回利付国債（３０年） | 380,000,000 | 497,416,200 | |
| 第２５回利付国債（３０年） | 350,000,000 | 449,274,000 | |
| 第２６回利付国債（３０年） | 1,140,000,000 | 1,482,809,400 | |
| 第２７回利付国債（３０年） | 1,920,000,000 | 2,538,604,800 | |
| 第２８回利付国債（３０年） | 2,140,000,000 | 2,843,653,400 | |
| | | | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第２９回利付国債（３０年） | 1,670,000,000 | 2,202,078,700 | |
| 第３０回利付国債（３０年） | 1,770,000,000 | 2,313,690,900 | |
| 第３１回利付国債（３０年） | 1,100,000,000 | 1,424,291,000 | |
| 第３２回利付国債（３０年） | 1,560,000,000 | 2,054,816,400 | |
| 第３３回利付国債（３０年） | 1,820,000,000 | 2,307,669,000 | |
| 第３４回利付国債（３０年） | 1,795,000,000 | 2,346,980,450 | |
| 第３５回利付国債（３０年） | 2,300,000,000 | 2,930,752,000 | |
| 第３６回利付国債（３０年） | 2,210,000,000 | 2,827,429,800 | |
| 第３７回利付国債（３０年） | 2,190,000,000 | 2,769,386,400 | |
| 第３８回利付国債（３０年） | 1,500,000,000 | 1,871,325,000 | |
| 第３９回利付国債（３０年） | 1,260,000,000 | 1,599,607,800 | |
| 第４０回利付国債（３０年） | 1,440,000,000 | 1,802,376,000 | |
| 第４１回利付国債（３０年） | 1,130,000,000 | 1,393,662,900 | |
| 第４２回利付国債（３０年） | 1,340,000,000 | 1,654,163,000 | |
| 第４３回利付国債（３０年） | 1,320,000,000 | 1,630,992,000 | |
| 第４４回利付国債（３０年） | 1,290,000,000 | 1,595,368,800 | |
| 第４５回利付国債（３０年） | 1,440,000,000 | 1,721,865,600 | |
| 第４６回利付国債（３０年） | 1,850,000,000 | 2,213,303,000 | |
| 第４７回利付国債（３０年） | 1,560,000,000 | 1,901,686,800 | |
| 第４８回利付国債（３０年） | 1,780,000,000 | 2,094,597,200 | |
| 第４９回利付国債（３０年） | 1,710,000,000 | 2,012,909,400 | |
| 第５０回利付国債（３０年） | 1,790,000,000 | 1,867,507,000 | |
| 第５１回利付国債（３０年） | 1,660,000,000 | 1,542,455,400 | |
| 第５２回利付国債（３０年） | 1,740,000,000 | 1,693,507,200 | |
| 第５３回利付国債（３０年） | 1,320,000,000 | 1,312,885,200 | |
| 第５４回利付国債（３０年） | 1,910,000,000 | 1,986,973,000 | |
| 第５５回利付国債（３０年） | 1,440,000,000 | 1,496,894,400 | |
| 第５６回利付国債（３０年） | 1,680,000,000 | 1,745,016,000 | |
| 第５７回利付国債（３０年） | 1,610,000,000 | 1,670,954,600 | |
| 第５８回利付国債（３０年） | 2,550,000,000 | 2,641,417,500 | |
| 第５９回利付国債（３０年） | 1,000,000,000 | 1,010,130,000 | |
| 第６０回利付国債（３０年） | 1,530,000,000 | 1,616,919,300 | |
| 第６１回利付国債（３０年） | 1,520,000,000 | 1,530,396,800 | |
| 第６２回利付国債（３０年） | 120,000,000 | 114,652,800 | |
| 第６３回利付国債（３０年） | 1,260,000,000 | 1,169,028,000 | |
| 第６４回利付国債（３０年） | 2,360,000,000 | 2,185,784,800 | |
| 第６５回利付国債（３０年） | 1,590,000,000 | 1,470,034,500 | |
| 第６６回利付国債（３０年） | 1,030,000,000 | 952,832,400 | |
| 第６７回利付国債（３０年） | 2,230,000,000 | 2,169,433,200 | |
| 第６８回利付国債（３０年） | 1,640,000,000 | 1,597,032,000 | |
| 第６９回利付国債（３０年） | 1,240,000,000 | 1,238,499,600 | |
| 第７０回利付国債（３０年） | 1,920,000,000 | 1,915,353,600 | |
| 第７１回利付国債（３０年） | 1,430,000,000 | 1,426,510,800 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第７２回利付国債（３０年） | 1,010,000,000 | 1,006,283,200 | |
| 第６１回利付国債（２０年） | 240,000,000 | 243,033,600 | |
| 第６２回利付国債（２０年） | 320,000,000 | 323,977,600 | |
| 第６３回利付国債（２０年） | 200,000,000 | 205,310,000 | |
| 第６４回利付国債（２０年） | 320,000,000 | 330,550,400 | |
| 第６５回利付国債（２０年） | 220,000,000 | 228,320,400 | |
| 第６６回利付国債（２０年） | 330,000,000 | 341,847,000 | |
| 第６７回利付国債（２０年） | 130,000,000 | 135,536,700 | |
| 第６８回利付国債（２０年） | 190,000,000 | 199,325,200 | |
| 第６９回利付国債（２０年） | 390,000,000 | 408,294,900 | |
| 第７０回利付国債（２０年） | 400,000,000 | 423,860,000 | |
| 第７１回利付国債（２０年） | 200,000,000 | 210,964,000 | |
| 第７２回利付国債（２０年） | 630,000,000 | 666,470,700 | |
| 第７３回利付国債（２０年） | 360,000,000 | 381,744,000 | |
| 第７４回利付国債（２０年） | 200,000,000 | 212,664,000 | |
| 第７５回利付国債（２０年） | 130,000,000 | 138,908,900 | |
| 第７６回利付国債（２０年） | 270,000,000 | 286,794,000 | |
| 第７７回利付国債（２０年） | 290,000,000 | 308,954,400 | |
| 第７８回利付国債（２０年） | 170,000,000 | 181,418,900 | |
| 第７９回利付国債（２０年） | 270,000,000 | 289,059,300 | |
| 第８０回利付国債（２０年） | 220,000,000 | 236,282,200 | |
| 第８１回利付国債（２０年） | 390,000,000 | 419,569,800 | |
| 第８２回利付国債（２０年） | 600,000,000 | 647,694,000 | |
| 第８３回利付国債（２０年） | 290,000,000 | 314,502,100 | |
| 第８４回利付国債（２０年） | 470,000,000 | 507,867,900 | |
| 第８５回利付国債（２０年） | 290,000,000 | 315,984,000 | |
| 第８６回利付国債（２０年） | 510,000,000 | 559,944,300 | |
| 第８７回利付国債（２０年） | 1,830,000,000 | 2,001,599,100 | |
| 第８８回利付国債（２０年） | 420,000,000 | 463,528,800 | |
| 第８９回利付国債（２０年） | 350,000,000 | 384,727,000 | |
| 第９０回利付国債（２０年） | 630,000,000 | 695,923,200 | |
| 第９１回利付国債（２０年） | 450,000,000 | 499,189,500 | |
| 第９２回利付国債（２０年） | 880,000,000 | 972,206,400 | |
| 第９３回利付国債（２０年） | 410,000,000 | 453,000,800 | |
| 第９４回利付国債（２０年） | 610,000,000 | 677,130,500 | |
| 第９５回利付国債（２０年） | 610,000,000 | 686,841,700 | |
| 第９６回利付国債（２０年） | 1,590,000,000 | 1,773,056,700 | |
| 第９７回利付国債（２０年） | 400,000,000 | 450,344,000 | |
| 第９８回利付国債（２０年） | 440,000,000 | 492,883,600 | |
| 第９９回利付国債（２０年） | 1,290,000,000 | 1,451,443,500 | |
| 第１００回利付国債（２０年） | 480,000,000 | 545,371,200 | |
| 第１０１回利付国債（２０年） | 715,000,000 | 821,191,800 | |
| | | | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第１０２回利付国債（２０年） | 1,260,000,000 | 1,454,329,800 | |
| 第１０３回利付国債（２０年） | 400,000,000 | 459,124,000 | |
| 第１０４回利付国債（２０年） | 160,000,000 | 181,598,400 | |
| 第１０５回利付国債（２０年） | 1,180,000,000 | 1,345,105,600 | |
| 第１０６回利付国債（２０年） | 380,000,000 | 435,700,400 | |
| 第１０７回利付国債（２０年） | 260,000,000 | 297,637,600 | |
| 第１０８回利付国債（２０年） | 660,000,000 | 746,420,400 | |
| 第１０９回利付国債（２０年） | 520,000,000 | 590,304,000 | |
| 第１１０回利付国債（２０年） | 1,100,000,000 | 1,264,461,000 | |
| 第１１１回利付国債（２０年） | 970,000,000 | 1,126,470,700 | |
| 第１１２回利付国債（２０年） | 790,000,000 | 911,588,900 | |
| 第１１３回利付国債（２０年） | 2,020,000,000 | 2,339,685,200 | |
| 第１１４回利付国債（２０年） | 2,330,000,000 | 2,708,555,100 | |
| 第１１５回利付国債（２０年） | 700,000,000 | 819,252,000 | |
| 第１１６回利付国債（２０年） | 1,490,000,000 | 1,751,018,200 | |
| 第１１７回利付国債（２０年） | 1,080,000,000 | 1,260,414,000 | |
| 第１１８回利付国債（２０年） | 660,000,000 | 767,467,800 | |
| 第１１９回利付国債（２０年） | 530,000,000 | 607,427,700 | |
| 第１２０回利付国債（２０年） | 1,570,000,000 | 1,773,079,500 | |
| 第１２１回利付国債（２０年） | 1,500,000,000 | 1,737,105,000 | |
| 第１２２回利付国債（２０年） | 940,000,000 | 1,080,492,400 | |
| 第１２３回利付国債（２０年） | 1,870,000,000 | 2,205,234,900 | |
| 第１２４回利付国債（２０年） | 610,000,000 | 713,956,200 | |
| 第１２５回利付国債（２０年） | 1,820,000,000 | 2,168,839,400 | |
| 第１２６回利付国債（２０年） | 730,000,000 | 856,655,000 | |
| 第１２７回利付国債（２０年） | 1,020,000,000 | 1,187,708,400 | |
| 第１２８回利付国債（２０年） | 970,000,000 | 1,132,251,900 | |
| 第１２９回利付国債（２０年） | 890,000,000 | 1,030,575,500 | |
| 第１３０回利付国債（２０年） | 1,285,000,000 | 1,491,203,950 | |
| 第１３１回利付国債（２０年） | 1,000,000,000 | 1,150,920,000 | |
| 第１３２回利付国債（２０年） | 1,160,000,000 | 1,338,222,400 | |
| 第１３３回利付国債（２０年） | 1,230,000,000 | 1,431,006,600 | |
| 第１３４回利付国債（２０年） | 1,130,000,000 | 1,317,218,400 | |
| 第１３５回利付国債（２０年） | 1,030,000,000 | 1,190,340,100 | |
| 第１３６回利付国債（２０年） | 1,450,000,000 | 1,661,207,000 | |
| 第１３７回利付国債（２０年） | 1,090,000,000 | 1,262,536,100 | |
| 第１３８回利付国債（２０年） | 620,000,000 | 705,436,000 | |
| 第１３９回利付国債（２０年） | 730,000,000 | 838,069,200 | |
| 第１４０回利付国債（２０年） | 2,520,000,000 | 2,925,316,800 | |
| 第１４１回利付国債（２０年） | 1,600,000,000 | 1,861,264,000 | |
| 第１４２回利付国債（２０年） | 1,020,000,000 | 1,197,480,000 | |
| 第１４３回利付国債（２０年） | 1,800,000,000 | 2,078,460,000 | |
| 第１４４回利付国債（２０年） | 1,150,000,000 | 1,315,335,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 第１４５回利付国債（２０年） | 3,155,000,000 | 3,685,008,450 | |
| | 第１４６回利付国債（２０年） | 2,870,000,000 | 3,358,732,300 | |
| | 第１４７回利付国債（２０年） | 2,510,000,000 | 2,913,758,600 | |
| | 第１４８回利付国債（２０年） | 1,990,000,000 | 2,290,271,100 | |
| | 第１４９回利付国債（２０年） | 2,880,000,000 | 3,319,315,200 | |
| | 第１５０回利付国債（２０年） | 2,760,000,000 | 3,151,506,000 | |
| | 第１５１回利付国債（２０年） | 2,395,000,000 | 2,677,921,350 | |
| | 第１５２回利付国債（２０年） | 3,290,000,000 | 3,681,115,200 | |
| | 第１５３回利付国債（２０年） | 2,440,000,000 | 2,763,470,800 | |
| | 第１５４回利付国債（２０年） | 2,800,000,000 | 3,136,924,000 | |
| | 第１５５回利付国債（２０年） | 2,950,000,000 | 3,227,919,500 | |
| | 第１５６回利付国債（２０年） | 2,310,000,000 | 2,336,611,200 | |
| | 第１５７回利付国債（２０年） | 3,030,000,000 | 2,975,793,300 | |
| | 第１５８回利付国債（２０年） | 2,530,000,000 | 2,588,341,800 | |
| | 第１５９回利付国債（２０年） | 2,730,000,000 | 2,830,737,000 | |
| | 第１６０回利付国債（２０年） | 2,300,000,000 | 2,415,874,000 | |
| | 第１６１回利付国債（２０年） | 2,190,000,000 | 2,266,737,600 | |
| | 第１６２回利付国債（２０年） | 1,050,000,000 | 1,085,752,500 | |
| | 第１６３回利付国債（２０年） | 2,060,000,000 | 2,128,000,600 | |
| | 第１６４回利付国債（２０年） | 1,660,000,000 | 1,686,460,400 | |
| | 第１６５回利付国債（２０年） | 2,180,000,000 | 2,211,849,800 | |
| | 第１６６回利付国債（２０年） | 1,330,000,000 | 1,390,155,900 | |
| | 第１６７回利付国債（２０年） | 2,340,000,000 | 2,367,682,200 | |
| | 第１６８回利付国債（２０年） | 1,450,000,000 | 1,440,734,500 | |
| | 第１６９回利付国債（２０年） | 1,990,000,000 | 1,940,230,100 | |
| | 第１７０回利付国債（２０年） | 2,610,000,000 | 2,539,686,600 | |
| | 第１７１回利付国債（２０年） | 1,540,000,000 | 1,495,509,400 | |
| | 第１７２回利付国債（２０年） | 2,520,000,000 | 2,486,307,600 | |
| | 第１７３回利付国債（２０年） | 3,080,000,000 | 3,033,184,000 | |
| | 第１７４回利付国債（２０年） | 2,480,000,000 | 2,437,641,600 | |
| | 第１７５回利付国債（２０年） | 1,960,000,000 | 1,958,294,800 | |
| | 第１７６回利付国債（２０年） | 3,350,000,000 | 3,341,223,000 | |
| | 第１７７回利付国債（２０年） | 2,550,000,000 | 2,491,630,500 | |
| | 第１７８回利付国債（２０年） | 1,690,000,000 | 1,680,958,500 | |
| 国債証券合計 | | 512,720,000,000 | 542,547,283,100 | |
| 地方債証券 | 第３回東京都公募公債（２０年） | 100,000,000 | 104,857,000 | |
| | 第５回東京都公募公債（東京グリーンボンド（３０年）） | 100,000,000 | 99,398,000 | |
| | 第６回東京都公募公債（２０年） | 100,000,000 | 106,284,000 | |
| | 第９回東京都公募公債（３０年） | 100,000,000 | 130,691,000 | |
| | 第１１回東京都公募公債（３０年） | 100,000,000 | 129,211,000 | |
| | 第１３回東京都公募公債（３０年） | 100,000,000 | 125,253,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第１５回東京都公募公債（３０年） | 100,000,000 | 124,616,000 | |
| 第１６回東京都公募公債（２０年） | 300,000,000 | 339,240,000 | |
| 第１７回東京都公募公債（２０年） | 100,000,000 | 113,629,000 | |
| 第１９回東京都公募公債（２０年） | 100,000,000 | 114,688,000 | |
| 第１９回東京都公募公債（３０年） | 100,000,000 | 98,920,000 | |
| 第２６回東京都公募公債（２０年） | 200,000,000 | 230,814,000 | |
| 第２７回東京都公募公債（２０年） | 200,000,000 | 230,382,000 | |
| 第３３回東京都公募公債（５年） | 200,000,000 | 199,998,000 | |
| 第７１７回東京都公募公債 | 100,000,000 | 100,719,000 | |
| 第７２０回東京都公募公債 | 100,000,000 | 101,217,000 | |
| 第７２６回東京都公募公債 | 200,000,000 | 202,758,000 | |
| 第７２８回東京都公募公債 | 100,000,000 | 101,225,000 | |
| 第７５１回東京都公募公債 | 100,000,000 | 101,408,000 | |
| 第７６５回東京都公募公債 | 100,000,000 | 100,792,000 | |
| 第７７０回東京都公募公債 | 100,000,000 | 100,619,000 | |
| 第７８１回東京都公募公債 | 300,000,000 | 301,242,000 | |
| 第８００回東京都公募公債 | 200,000,000 | 198,980,000 | |
| 平成２４年度第１４回北海道公募公債 | 100,000,000 | 100,867,000 | |
| 平成２７年度第１５回北海道公募公債 | 100,000,000 | 100,819,000 | |
| 平成２８年度第１回北海道公募公債 | 100,000,000 | 100,279,000 | |
| 平成２８年度第１４回北海道公募公債 | 100,000,000 | 100,910,000 | |
| 平成３０年度第１４回北海道公募公債 | 200,000,000 | 201,030,000 | |
| 第２９回１号宮城県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 101,180,000 | |
| 第４回神奈川県公募公債（３０年） | 200,000,000 | 266,800,000 | |
| 第１１回神奈川県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 114,435,000 | |
| 第１５回神奈川県公募公債（２０年） | 200,000,000 | 230,736,000 | |
| 第１７回神奈川県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 116,676,000 | |
| 第２０回神奈川県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 115,002,000 | |
| 第２７回神奈川県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 113,193,000 | |
| 第７８回神奈川県公募公債（５年） | 200,000,000 | 199,974,000 | |
| 第２０１回神奈川県公募公債 | 200,250,000 | 202,564,890 | |
| 第２１０回神奈川県公募公債 | 200,000,000 | 202,570,000 | |
| 第２１５回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 101,651,000 | |
| 第２１８回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 100,723,000 | |
| 第２２６回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 100,715,000 | |
| 第２２７回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 100,619,000 | |
| 第２４３回神奈川県公募公債 | 200,000,000 | 198,902,000 | |
| 第６回大阪府公募公債（２０年） | 200,000,000 | 230,852,000 | |
| 第７回大阪府公募公債（２０年） | 200,000,000 | 230,954,000 | |
| 第１０回大阪府公募公債（２０年） | 100,000,000 | 115,289,000 | |
| 第３７１回大阪府公募公債（１０年） | 100,000,000 | 100,713,000 | |
| 第３７５回大阪府公募公債（１０年） | 100,000,000 | 101,317,000 | |
| | | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 第３７７回大阪府公募公債（１０年） | 100,000,000 | 101,268,000 | |
| | 第３８９回大阪府公募公債（１０年） | 100,000,000 | 101,428,000 | |
| | 第３９５回大阪府公募公債（１０年） | 151,000,000 | 153,071,720 | |
| | 第３９９回大阪府公募公債（１０年） | 100,000,000 | 101,850,000 | |
| | 第４０２回大阪府公募公債（１０年） | 100,000,000 | 101,840,000 | |
| | 第４０７回大阪府公募公債（１０年） | 156,000,000 | 156,468,000 | |
| | 第４１０回大阪府公募公債（１０年） | 200,000,000 | 199,788,000 | |
| | 第４３９回大阪府公募公債（１０年） | 200,000,000 | 201,002,000 | |
| | 第４４０回大阪府公募公債（１０年） | 100,000,000 | 100,522,000 | |
| | 第４６５回大阪府公募公債（１０年） | 160,000,000 | 159,067,200 | |
| | 第４６８回大阪府公募公債（１０年） | 182,000,000 | 180,760,580 | |
| | 第４６９回大阪府公募公債（１０年） | 200,000,000 | 198,496,000 | |
| | 平成２１年度第３回京都府公募公債（２０年） | 100,000,000 | 115,550,000 | |
| | 平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年） | 100,000,000 | 115,156,000 | |
| | 平成２５年度第７回京都府公募公債 | 100,000,000 | 101,314,000 | |
| | 平成２７年度第４回京都府公募公債 | 100,000,000 | 101,852,000 | |
| | 平成２８年度第５回京都府公募公債（２０年） | 100,000,000 | 98,992,000 | |
| | 平成２９年度第５回京都府公募公債（２０年） | 100,000,000 | 102,931,000 | |
| | 令和２年度第１２回京都府公募公債 | 140,500,000 | 139,883,205 | |
| | 第２回兵庫県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 112,874,000 | |
| | 第３回兵庫県公募公債（１２年） | 100,000,000 | 101,779,000 | |
| | 第６回兵庫県公募公債（１５年） | 200,000,000 | 216,168,000 | |
| | 第７回兵庫県公募公債（１５年） | 100,000,000 | 106,982,000 | |
| | 第８回兵庫県公募公債（１５年） | 100,000,000 | 106,920,000 | |
| | 第９回兵庫県公募公債（２０年） | 400,000,000 | 465,380,000 | |
| | 平成２６年度第１７回兵庫県公募公債 | 100,000,000 | 101,395,000 | |
| | 第３５回兵庫県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 101,792,000 | |
| | 令和元年度第１７回兵庫県公募公債 | 300,000,000 | 300,237,000 | |
| | 第９回静岡県公募公債（３０年） | 100,000,000 | 118,913,000 | |
| | 第１２回静岡県公募公債（３０年） | 100,000,000 | 102,374,000 | |
| | 第１５回静岡県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 115,290,000 | |
| | 第１８回静岡県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 114,032,000 | |
| | 平成２４年度第１０回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 100,772,000 | |
| | 平成２６年度第３回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 101,571,000 | |
| | 平成２９年度第５回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 100,673,000 | |
| | 平成２９年度第８回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 100,781,000 | |
| | 平成２９年度第１１回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 100,737,000 | |
| | 平成２９年度第１４回静岡県公募公債（５年） | 100,000,000 | 100,033,000 | |
| | 令和２年度第１１回静岡県公募公債 | 310,000,000 | 310,923,800 | |
| | | 100,000,000 | 115,789,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年） | | | |
| 平成２５年度第２回愛知県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 100,715,000 | |
| 平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 101,489,000 | |
| 平成２６年度第５回愛知県公募公債（１０年） | 200,000,000 | 203,054,000 | |
| 平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 101,466,000 | |
| 平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 100,247,000 | |
| 平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年） | 200,000,000 | 201,486,000 | |
| 平成２９年度第１２回愛知県公募公債（２０年） | 300,000,000 | 307,608,000 | |
| 平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 100,569,000 | |
| 平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年） | 100,000,000 | 101,144,000 | |
| 令和元年度第１６回愛知県公募公債（１０年） | 200,000,000 | 199,120,000 | |
| 令和２年度第７回愛知県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 99,915,000 | |
| 令和３年度第６回愛知県公募公債（３０年） | 200,000,000 | 197,746,000 | |
| 平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 114,886,000 | |
| 平成２１年度第１回広島県公募公債（２０年） | 200,000,000 | 230,378,000 | |
| 平成２５年度第４回広島県公募公債 | 100,000,000 | 101,222,000 | |
| 平成２７年度第４回広島県公募公債 | 125,230,000 | 127,474,121 | |
| 平成２９年度第１回広島県公募公債 | 100,000,000 | 100,584,000 | |
| 令和２年度第７回広島県公募公債 | 390,000,000 | 391,368,900 | |
| 第３回埼玉県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 112,694,000 | |
| 第５回埼玉県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 113,862,000 | |
| 第６回埼玉県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 114,355,000 | |
| 第６回埼玉県公募公債（３０年） | 100,000,000 | 106,009,000 | |
| 第７回埼玉県公募公債（２０年） | 200,000,000 | 231,750,000 | |
| 第８回埼玉県公募公債（１５年） | 200,000,000 | 199,374,000 | |
| 第１０回埼玉県公募公債（２０年） | 200,000,000 | 230,736,000 | |
| 第１８回埼玉県公募公債（２０年） | 200,000,000 | 198,042,000 | |
| 平成２５年度第１１回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 101,404,000 | |
| 平成２７年度第７回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 101,803,000 | |
| 平成２８年度第６回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 100,302,000 | |
| 平成２８年度第９回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 100,982,000 | |
| 平成２９年度第４回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 100,675,000 | |
| 令和２年度第７回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 99,655,000 | |
| 令和２年度第８回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 99,517,000 | |
| 令和３年度第８回埼玉県公募公債 | 150,000,000 | 149,020,500 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 112,754,000 | |
| 平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 113,393,000 | |
| 平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年） | 100,000,000 | 106,365,000 | |
| 平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 116,707,000 | |
| 平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年） | 100,000,000 | 107,112,000 | |
| 平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年） | 100,000,000 | 129,498,000 | |
| 平成２６年度第４回福岡県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 111,606,000 | |
| 平成２７年度第７回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 101,783,000 | |
| 平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年） | 100,000,000 | 101,144,000 | |
| 平成３０年度第１回福岡県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 102,676,000 | |
| 令和２年度第１回福岡県公募公債 | 300,000,000 | 299,997,000 | |
| 令和３年度第２回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 99,649,000 | |
| 令和３年度第１回福岡県公募公債（１５年） | 100,000,000 | 98,615,000 | |
| 第５回千葉県公募公債（２０年） | 200,000,000 | 228,710,000 | |
| 第６回千葉県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 115,335,000 | |
| 第１３回千葉県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 115,290,000 | |
| 平成２５年度第５回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 101,324,000 | |
| 平成２５年度第８回千葉県公募公債 | 300,000,000 | 303,651,000 | |
| 平成２５年度第９回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 101,331,000 | |
| 平成２６年度第７回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 101,297,000 | |
| 平成２７年度第１回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 101,798,000 | |
| 平成２８年度第４回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 100,302,000 | |
| 平成２８年度第６回千葉県公募公債 | 120,000,000 | 120,867,600 | |
| 令和元年度第７回千葉県公募公債 | 300,000,000 | 298,317,000 | |
| 令和２年度第７回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 99,871,000 | |
| 令和３年度第１回長野県公募公債（１０年） | 300,000,000 | 300,237,000 | |
| 平成３０年度第３回茨城県公募公債 | 350,000,000 | 350,112,000 | |
| 第１回群馬県公募公債（２０年） | 200,000,000 | 228,892,000 | |
| 平成２９年度第１回岐阜県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 100,690,000 | |
| 第１１９回共同発行市場公募地方債 | 400,000,000 | 403,460,000 | |
| 第１２１回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 100,705,000 | |
| 第１２５回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 202,584,000 | |
| 第１２７回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 101,180,000 | |
| 第１２８回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 101,198,000 | |
| 第１３０回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 203,020,000 | |
| 第１３１回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 101,360,000 | |
| | | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 第１３２回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 304,239,000 | |
| | 第１３４回共同発行市場公募地方債 | 112,000,000 | 113,739,360 | |
| | 第１３５回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 101,575,000 | |
| | 第１３６回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 101,508,000 | |
| | 第１３７回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 101,439,000 | |
| | 第１４０回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 202,816,000 | |
| | 第１４５回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 202,580,000 | |
| | 第１４６回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 203,622,000 | |
| | 第１４８回共同発行市場公募地方債 | 125,400,000 | 127,788,870 | |
| | 第１５２回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 101,869,000 | |
| | 第１５６回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 100,354,000 | |
| | 第１５７回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 100,278,000 | |
| | 第１５９回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 200,494,000 | |
| | 第１６０回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 200,274,000 | |
| | 第１６１回共同発行市場公募地方債 | 400,000,000 | 400,736,000 | |
| | 第１６４回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 100,127,000 | |
| | 第１６６回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 100,723,000 | |
| | 第１６７回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 100,962,000 | |
| | 第１７１回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 201,298,000 | |
| | 第１７４回共同発行市場公募地方債 | 194,300,000 | 194,968,392 | |
| | 第１７５回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 100,746,000 | |
| | 第１８１回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 301,611,000 | |
| | 第２１９回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 99,498,000 | |
| | 平成２９年度第１回静岡市公募公債 | 100,000,000 | 100,782,000 | |
| | 第１３回大阪市公募公債（２０年） | 200,000,000 | 232,016,000 | |
| | 第１５回大阪市公募公債（３０年） | 100,000,000 | 98,537,000 | |
| | 第２２回大阪市公募公債（２０年） | 300,000,000 | 298,035,000 | |
| | 第２４回大阪市公募公債（２０年） | 100,000,000 | 103,446,000 | |
| | 平成２５年度第８回大阪市公募公債 | 100,000,000 | 101,536,000 | |
| | 令和３年度第２回大阪市公募公債 | 200,000,000 | 199,398,000 | |
| | 第１回名古屋市公募公債（３０年） | 100,000,000 | 127,918,000 | |
| | 第５回名古屋市公募公債（３０年） | 100,000,000 | 132,711,000 | |
| | 第９回名古屋市公募公債（２０年） | 100,000,000 | 113,531,000 | |
| | 第１１回名古屋市公募公債（３０年） | 100,000,000 | 123,676,000 | |
| | 第４９９回名古屋市公募公債（１０年） | 100,000,000 | 100,872,000 | |
| | 第５１２回名古屋市公募公債（１０年） | 300,000,000 | 299,874,000 | |
| | 平成２８年度第６回京都市公募公債 | 200,000,000 | 201,448,000 | |
| | 平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年） | 120,000,000 | 133,363,200 | |
| | 平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年） | 200,000,000 | 228,878,000 | |
| | 平成２１年度第１１回神戸市公募公債（２０年） | 100,000,000 | 116,611,000 | |
| | | 100,000,000 | 115,509,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 平成２４年度第１２回神戸市公募公債（２０年） | | | |
| | 令和２年度第９回神戸市公募公債（３０年） | 100,000,000 | 97,535,000 | |
| | 令和３年度第６回神戸市公募公債（３０年） | 100,000,000 | 98,753,000 | |
| | 第５回横浜市公募公債（２０年） | 100,000,000 | 107,373,000 | |
| | 第２０回横浜市公募公債（２０年） | 300,000,000 | 345,060,000 | |
| | 平成２８年度第４回横浜市公募公債 | 100,000,000 | 100,697,000 | |
| | 平成２９年度第２回横浜市公募公債 | 100,000,000 | 100,875,000 | |
| | 平成３０年度第１回横浜市公募公債 | 100,000,000 | 100,625,000 | |
| | 平成３０年度第４回横浜市公募公債 | 200,000,000 | 202,472,000 | |
| | 第３０回横浜市公募公債（２０年） | 200,000,000 | 225,872,000 | |
| | 令和２年度第１回横浜市公募公債 | 300,000,000 | 299,997,000 | |
| | 令和３年度第２回横浜市公募公債 | 100,000,000 | 99,698,000 | |
| | 平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年） | 100,000,000 | 107,258,000 | |
| | 平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年） | 100,000,000 | 101,224,000 | |
| | 第１１回川崎市公募公債（２０年） | 100,000,000 | 114,438,000 | |
| | 第８９回川崎市公募公債 | 100,000,000 | 100,662,000 | |
| | 第９３回川崎市公募公債 | 100,000,000 | 99,486,000 | |
| | 平成２６年度第２回北九州市公募公債 | 100,000,000 | 101,275,000 | |
| | 平成２７年度第２回北九州市公募公債 | 100,000,000 | 101,832,000 | |
| | 平成２８年度第１回北九州市公募公債 | 100,000,000 | 100,254,000 | |
| | 平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年） | 100,000,000 | 115,160,000 | |
| | 平成２５年度第６回福岡市公募公債（２０年） | 100,000,000 | 114,236,000 | |
| | 平成２６年度第５回福岡市公募公債 | 200,000,000 | 202,930,000 | |
| | 平成３０年度第５回福岡市公募公債（５年） | 200,000,000 | 200,064,000 | |
| | 平成３０年度第９回福岡市公募公債（１０年） | 100,000,000 | 101,241,000 | |
| | 平成３０年度第１０回福岡市公募公債（５年） | 100,000,000 | 100,019,000 | |
| | 平成２５年度第３回広島市公募公債 | 150,000,000 | 152,071,500 | |
| | 平成２６年度第２回広島市公募公債 | 100,000,000 | 101,306,000 | |
| | 平成２８年度第４回広島市公募公債 | 105,000,000 | 105,723,450 | |
| | 平成２９年度第６回広島市公募公債 | 170,000,000 | 171,433,100 | |
| | 令和元年度第６回広島市公募公債 | 550,000,000 | 548,674,500 | |
| | 令和２年度第３回広島市公募公債（５年） | 200,000,000 | 200,074,000 | |
| | 令和元年度第５回千葉市公募公債 | 200,000,000 | 198,958,000 | |
| | 平成２５年度第４回福井県公募公債 | 100,000,000 | 101,559,000 | |
| | 平成２４年度第１回徳島県公募公債 | 100,000,000 | 100,784,000 | |
| | 平成２４年度第２回岡山県公募公債（１０年） | 150,000,000 | 151,189,500 | |
| | 平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年） | 200,000,000 | 201,936,000 | |
| | | | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 第１１３回福岡北九州高速道路債券 | 100,000,000 | 112,554,000 | |
| 地方債証券合計 | | 34,011,680,000 | 35,532,536,388 | |
| 特殊債券 | 第２回政府保証新関西国際空港債券 | 102,000,000 | 103,311,720 | |
| | 第１９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 | 410,000,000 | 413,206,200 | |
| | 第２２回政府保証日本政策投資銀行債券 | 300,000,000 | 309,381,000 | |
| | 第３７回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 | 100,000,000 | 100,344,000 | |
| | 第１１９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債 | 300,000,000 | 299,946,000 | |
| | 第１２９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債 | 100,000,000 | 94,591,000 | |
| | 第２１回道路債券 | 100,000,000 | 127,044,000 | |
| | 第２７回道路債券 | 400,000,000 | 420,696,000 | |
| | 第２８回道路債券 | 200,000,000 | 257,750,000 | |
| | 第３３回道路債券 | 200,000,000 | 261,548,000 | |
| | 第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 113,863,000 | |
| | 第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 148,515,000 | |
| | 第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 114,677,000 | |
| | 第４２回道路債券 | 100,000,000 | 106,941,000 | |
| | 第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 116,328,000 | |
| | 第８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 140,809,000 | |
| | 第９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 230,608,000 | |
| | 第９４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 232,760,000 | |
| | 第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 115,453,000 | |
| | 第１０２回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 600,000,000 | 604,530,000 | |
| | 第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 900,000,000 | 907,308,000 | |
| | 第１０６回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 101,187,000 | |
| | 第１０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 129,032,000 | |
| | 第１１２回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 303,546,000 | |
| | 第１１５回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 101,205,000 | |
| | 第１１８回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 101,445,000 | |
| | 第１２５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 117,246,000 | |
| | 第１３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 112,962,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 101,313,000 | |
| 第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 130,465,000 | |
| 第１５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 221,748,000 | |
| 第１８１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 115,131,000 | |
| 第１８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 302,751,000 | |
| 第１８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 201,572,000 | |
| 第１８８回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 600,000,000 | 612,678,000 | |
| 第１８９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 302,000,000 | 304,129,100 | |
| 第１９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 628,000,000 | 633,294,040 | |
| 第１９３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 202,588,000 | |
| 第２００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 148,000,000 | 150,042,400 | |
| 第２０２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 101,270,000 | |
| 第２０４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 265,800,000 | 269,183,634 | |
| 第２０７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 202,742,000 | |
| 第２０８回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 108,618,000 | |
| 第２０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 422,000,000 | 428,435,500 | |
| 第２１３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 101,420,000 | |
| 第２１４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 228,024,000 | |
| 第２１５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 102,000,000 | 103,561,620 | |
| 第２２０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 101,580,000 | |
| 第２２２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 101,530,000 | |
| 第２２８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 226,664,000 | |
| 第２２９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 101,510,000 | |
| 第２３４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 101,381,000 | |
| 第２３６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 302,907,000 | |
| 第２３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 110,498,000 | |
| | 200,000,000 | 222,540,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第２４２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | | |
| 第２６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 202,496,000 | |
| 第２６９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 100,553,000 | |
| 第２７７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 93,540,000 | |
| 第２９４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 107,000,000 | 106,952,920 | |
| 第３００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 205,000,000 | 205,764,650 | |
| 第３０６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 100,513,000 | |
| 第３０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 200,992,000 | |
| 第３２１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 100,592,000 | |
| 第３３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 120,000,000 | 120,978,000 | |
| 第３４８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 200,996,000 | |
| 第３６１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 307,428,000 | |
| 第３６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 214,000,000 | 216,084,360 | |
| 第３８５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 99,334,000 | |
| 第３９３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 99,197,000 | |
| 第２回公営企業債券（３０年） | 300,000,000 | 371,676,000 | |
| 第３回公営企業債券（２０年） | 210,000,000 | 212,484,300 | |
| 第３回地方公共団体金融機構債券（１５年） | 100,000,000 | 107,236,000 | |
| 第５回公営企業債券（３０年） | 300,000,000 | 387,228,000 | |
| 第７回公営企業債券（２０年） | 100,000,000 | 104,734,000 | |
| 第７回公営企業債券（３０年） | 200,000,000 | 259,296,000 | |
| 第８回公営企業債券（２０年） | 40,000,000 | 41,937,200 | |
| 第８回公営企業債券（３０年） | 100,000,000 | 127,719,000 | |
| 第８回地方公共団体金融機構債券（２０年） | 200,000,000 | 231,062,000 | |
| 第１０回地方公共団体金融機構債券（２０年） | 200,000,000 | 226,734,000 | |
| 第１１回地方公共団体金融機構債券（３０年） | 200,000,000 | 191,962,000 | |
| 第１９回地方公共団体金融機構債券（２０年） | 200,000,000 | 231,158,000 | |
| 第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年） | 100,000,000 | 114,818,000 | |
| 第３４回地方公共団体金融機構債券（２０年） | 500,000,000 | 575,080,000 | |
| 第４５回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,892,000 | |
| 第４６回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 201,572,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第４７回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,694,000 | |
| 第４８回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,817,000 | |
| 第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 101,330,000 | |
| 第５４回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 105,000,000 | 106,310,400 | |
| 第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 202,756,000 | |
| 第５８回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 101,395,000 | |
| 第５８回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 101,580,000 | |
| 第６５回地方公共団体金融機構債券 | 300,000,000 | 304,317,000 | |
| 第６７回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 101,425,000 | |
| 第６９回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 101,437,000 | |
| 第７６回地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 203,606,000 | |
| Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 107,077,000 | |
| 第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 101,455,000 | |
| 第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,041,000 | |
| 第８８回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,232,000 | |
| 第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,344,000 | |
| 第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 251,000,000 | 252,234,920 | |
| Ｆ９５回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 104,023,000 | |
| 第９８回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,603,000 | |
| 第９９回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,585,000 | |
| 第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 110,000,000 | 110,891,000 | |
| Ｆ１０７回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 104,335,000 | |
| 第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 156,000,000 | 157,422,720 | |
| 第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,970,000 | |
| 第１１６回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,138,000 | |
| 第１２０回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 99,301,000 | |
| Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 103,785,000 | |
| Ｆ１４６回地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 208,432,000 | |
| Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 103,380,000 | |
| Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 104,537,000 | |
| 第７回阪神高速道路債券 | 100,000,000 | 106,746,000 | |
| 第２２回阪神高速道路株式会社社債 | 200,000,000 | 199,950,000 | |
| 第１９回水資源債券（サステナビリティボンド） | 200,000,000 | 199,858,000 | |
| 第４回株式会社日本政策金融公庫社債 | 100,000,000 | 115,494,000 | |
| 第１８回株式会社日本政策金融公庫社債 | 100,000,000 | 117,846,000 | |
| 第２５回政府保証日本政策金融公庫債券 | 200,000,000 | 201,816,000 | |
| 第４０回政府保証日本政策金融公庫債券 | 126,000,000 | 126,051,660 | |
| 第４６回政府保証日本政策金融公庫債券 | 100,000,000 | 100,604,000 | |
| 第４７回政府保証日本政策金融公庫債券 | 210,000,000 | 210,426,300 | |
| | | | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第５３回政府保証日本政策金融公庫債券 | 187,000,000 | 188,731,620 | |
| 第７７回株式会社日本政策金融公庫社債 | 400,000,000 | 399,948,000 | |
| 第８７回株式会社日本政策金融公庫社債 | 200,000,000 | 199,896,000 | |
| 第８８回株式会社日本政策金融公庫社債 | 200,000,000 | 199,950,000 | |
| 第１１７回都市再生債券 | 200,000,000 | 210,668,000 | |
| 第１５９回都市再生債券 | 200,000,000 | 170,212,000 | |
| 第１６１回都市再生債券 | 100,000,000 | 93,145,000 | |
| 第１７１回都市再生債券 | 200,000,000 | 198,598,000 | |
| 第５回本州四国連絡橋債券 | 100,000,000 | 106,377,000 | |
| 第３４４回東京交通債券 | 100,000,000 | 101,704,000 | |
| 第３４６回東京交通債券 | 20,000,000 | 20,292,400 | |
| 第６２回独立行政法人福祉医療機構債券 | 100,000,000 | 99,916,000 | |
| 第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 10,738,000 | 10,869,110 | |
| 第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券 | 11,071,000 | 11,246,143 | |
| 第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券 | 11,233,000 | 11,450,133 | |
| 第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券 | 145,263,000 | 144,898,389 | |
| 第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券 | 103,812,000 | 103,636,557 | |
| 第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 11,099,000 | 11,294,342 | |
| 第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券 | 12,082,000 | 12,367,135 | |
| 第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券 | 185,895,000 | 185,132,830 | |
| 第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券 | 19,936,000 | 20,013,750 | |
| 第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券 | 11,996,000 | 12,269,748 | |
| 第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券 | 207,495,000 | 206,401,501 | |
| 第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券 | 74,119,000 | 73,929,255 | |
| 第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券 | 10,459,000 | 10,580,010 | |
| 第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券 | 12,408,000 | 12,734,082 | |
| 第８回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券 | 244,845,000 | 244,115,361 | |
| 第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券 | 10,636,000 | 10,760,441 | |
| 第９回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券 | 169,216,000 | 168,825,111 | |
| 第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券 | 12,521,000 | 12,888,741 | |
| 第１２回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 112,841,000 | |
| 第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 16,442,000 | 17,323,620 | |
| 第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 16,796,000 | 17,749,508 | |
| 第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 18,590,000 | 19,769,535 | |
| 第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 20,421,000 | 21,611,340 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 22,641,000 | 24,103,835 | |
| 第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 22,995,000 | 24,438,856 | |
| 第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 48,684,000 | 51,629,868 | |
| 第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 10,890,000 | 11,013,710 | |
| 第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 21,993,000 | 23,166,326 | |
| 第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 11,099,000 | 11,264,264 | |
| 第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 10,696,000 | 10,839,647 | |
| 第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 22,547,000 | 23,744,020 | |
| 第４６回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 9,953,000 | 9,992,513 | |
| 第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 22,269,000 | 23,487,782 | |
| 第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 21,089,000 | 22,183,519 | |
| 第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 12,003,000 | 12,344,005 | |
| 第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 44,824,000 | 46,896,213 | |
| 第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 23,509,000 | 24,627,793 | |
| 第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 11,707,000 | 11,977,197 | |
| 第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 32,265,000 | 33,868,570 | |
| 第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 31,402,000 | 32,944,466 | |
| 第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 32,273,000 | 33,896,331 | |
| 第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 72,410,000 | 75,933,470 | |
| 第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 80,256,000 | 83,632,369 | |
| 第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 41,134,000 | 42,823,373 | |
| 第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 41,487,000 | 43,539,361 | |
| 第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 41,632,000 | 43,743,575 | |
| 第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 36,360,000 | 38,055,466 | |
| 第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 35,754,000 | 37,155,914 | |
| 第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 41,381,000 | 43,515,018 | |
| 第７５回一般担保住宅金融支援機構債券 | 150,000,000 | 175,596,000 | |
| 第７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 108,591,000 | 112,839,079 | |
| 第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 146,876,000 | 152,629,132 | |
| 第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 42,037,000 | 43,614,228 | |
| 第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 43,281,000 | 44,933,468 | |
| 第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 44,267,000 | 45,834,494 | |
| 第８８回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 115,566,000 | |
| 第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 139,617,000 | 144,518,952 | |
| 第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 47,974,000 | 49,465,031 | |
| 第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 100,564,000 | 103,023,795 | |
| 第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 55,970,000 | 57,523,167 | |
| 第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 59,806,000 | 61,295,169 | |
| 第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 59,401,000 | 61,175,307 | |
| 第９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 183,957,000 | 190,189,463 | |
| 第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 123,990,000 | 128,053,152 | |
| 第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 59,979,000 | 61,820,955 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 64,938,000 | 66,977,053 | |
| 第１０８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 71,333,000 | 71,372,946 | |
| 第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 76,760,000 | 76,978,766 | |
| 第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 76,513,000 | 76,567,324 | |
| 第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 76,800,000 | 77,197,824 | |
| 第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 77,146,000 | 77,881,201 | |
| 第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 77,852,000 | 78,474,816 | |
| 第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 79,535,000 | 80,137,875 | |
| 第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 80,034,000 | 80,731,896 | |
| 第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 79,868,000 | 80,348,805 | |
| 第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 80,117,000 | 80,596,099 | |
| 第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 80,712,000 | 81,235,820 | |
| 第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 163,500,000 | 164,207,955 | |
| 第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 80,708,000 | 81,177,720 | |
| 第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 164,848,000 | 166,198,105 | |
| 第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 82,107,000 | 82,590,610 | |
| 第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 164,496,000 | 165,203,332 | |
| 第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 83,114,000 | 83,607,697 | |
| 第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 167,178,000 | 167,843,368 | |
| 第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 168,188,000 | 168,838,887 | |
| 第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 127,787,000 | |
| 第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 85,302,000 | 86,091,043 | |
| 第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 84,909,000 | 85,873,566 | |
| 第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 85,175,000 | 85,450,115 | |
| 第１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 174,798,000 | 174,626,697 | |
| 第１４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 87,604,000 | 87,434,048 | |
| 第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 87,235,000 | 87,188,765 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 176,150,000 | 175,815,315 | |
| 第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 89,255,000 | 88,456,167 | |
| 第１４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 270,063,000 | 266,295,621 | |
| 第１４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 181,108,000 | 178,548,943 | |
| 第１５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 91,743,000 | 91,741,165 | |
| 第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 92,424,000 | 92,170,758 | |
| 第１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 189,440,000 | 189,860,556 | |
| 第１６２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 95,746,000 | 95,836,958 | |
| 第１６３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 191,918,000 | 192,065,776 | |
| 第１６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 192,816,000 | 192,621,255 | |
| 第１６５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 96,455,000 | 96,597,753 | |
| 第１６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 193,326,000 | 194,393,159 | |
| 第１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 194,486,000 | 195,357,297 | |
| 第１６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 97,897,000 | 98,241,597 | |
| 第１７１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 98,640,000 | 98,306,596 | |
| 第１７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 296,463,000 | 295,428,344 | |
| 第１７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 99,077,000 | 98,871,910 | |
| 第１９２回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 96,455,000 | |
| 第３２０回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 98,773,000 | |
| 第６２回日本学生支援債券 | 100,000,000 | 99,983,000 | |
| 第６４回日本学生支援債券 | 300,000,000 | 299,931,000 | |
| 第６５回日本学生支援債券 | 200,000,000 | 199,948,000 | |
| 第６回沖縄振興開発金融公庫債券 | 100,000,000 | 106,873,000 | |
| い第８２３号商工債 | 200,000,000 | 200,424,000 | |
| い第８２９号商工債 | 200,000,000 | 200,290,000 | |
| い第８３２号商工債 | 200,000,000 | 199,918,000 | |
| い第８３３号商工債 | 100,000,000 | 99,931,000 | |
| い第８４３号商工債 | 200,000,000 | 200,250,000 | |
| い第８４７号商工債 | 100,000,000 | 100,019,000 | |
| い第８５０号商工債 | 200,000,000 | 199,958,000 | |
| 第３３９回信金中金債（５年） | 200,000,000 | 200,152,000 | |
| 第３４２回信金中金債（５年） | 100,000,000 | 100,094,000 | |
| | | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 第３５０回信金中金債（５年） | 100,000,000 | 100,070,000 | |
| | 第３６０回信金中金債（５年） | 200,000,000 | 199,742,000 | |
| | 第３７６回信金中金債（５年） | 100,000,000 | 99,958,000 | |
| | 第２５４号商工債（３年） | 300,000,000 | 299,901,000 | |
| | 第２回信金中金債（１０年） | 100,000,000 | 101,690,000 | |
| | 第２１回国際協力機構債券 | 100,000,000 | 115,905,000 | |
| | 第６４回東日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 99,689,000 | |
| | 第６７回東日本高速道路株式会社社債 | 200,000,000 | 200,474,000 | |
| | 第７３回東日本高速道路株式会社社債 | 500,000,000 | 499,785,000 | |
| | 第８６回東日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 99,902,000 | |
| | 第８３回中日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 100,018,000 | |
| | 第６０回西日本高速道路株式会社社債 | 300,000,000 | 299,883,000 | |
| | 第６３回西日本高速道路株式会社社債 | 200,000,000 | 199,908,000 | |
| | 第６０回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 100,000,000 | 101,116,000 | |
| | 第９２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 100,000,000 | 100,161,000 | |
| | 第１２７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 200,000,000 | 198,264,000 | |
| 特殊債券合計 | | 37,795,213,000 | 39,212,798,662 | |
| 社債券 | 第２４回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債 | 100,000,000 | 100,096,000 | |
| | 第２９回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債 | 300,000,000 | 299,193,000 | |
| | 第２回Ｂ・Ｐ・Ｃ・Ｅ・Ｓ・Ａ円貨社債（ソーシャルボンド） | 100,000,000 | 100,057,000 | |
| | 第２回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債 | 400,000,000 | 401,624,000 | |
| | 第８回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債 | 100,000,000 | 100,131,000 | |
| | 第１４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債 | 100,000,000 | 99,868,000 | |
| | 第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債 | 100,000,000 | 100,092,000 | |
| | 第１３回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債 | 100,000,000 | 100,001,000 | |
| | 第１回バンコ・サンタンデール・エセ・アー円貨社債 | 400,000,000 | 400,696,000 | |
| | 第１２回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債 | 400,000,000 | 400,300,000 | |
| | 第８回ソシエテ　ジェネラル円貨社債 | 100,000,000 | 99,948,000 | |
| | 第３９回大成建設株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,894,000 | |
| | 第２４回清水建設株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,195,000 | |
| | 第１５回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債 | 200,000,000 | 199,510,000 | |
| | 第２４回大和ハウス工業株式会社無担保社債 | 300,000,000 | 299,220,000 | |
| | 第２５回大和ハウス工業株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,511,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第７回明治ホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,256,000 | |
| 第９回明治ホールディングス株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,624,000 | |
| 第１１回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,327,000 | |
| 第１３回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,754,000 | |
| 第１０回キリンホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,453,000 | |
| 第１９回キリンホールディングス株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,264,000 | |
| 第２４回株式会社ニチレイ無担保社債 | 100,000,000 | 100,199,000 | |
| 第６回ヒューリック株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,375,000 | |
| 第１０回Ｊ．フロント　リテイリング株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,867,000 | |
| 第１８回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,924,000 | |
| 第２５回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,090,000 | |
| 第１４回株式会社セブン＆アイ・ホールディングス無担保社債 | 200,000,000 | 200,274,000 | |
| 第１３回旭化成株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,864,000 | |
| 第３５回王子ホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,758,000 | |
| 第４回エア・ウォーター株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,279,000 | |
| 第２４回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債 | 100,000,000 | 100,501,000 | |
| 第３２回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債 | 200,000,000 | 199,646,000 | |
| 第３５回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債 | 200,000,000 | 200,210,000 | |
| 第４０回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債 | 100,000,000 | 99,610,000 | |
| 第４２回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債 | 100,000,000 | 98,601,000 | |
| 第４回株式会社野村総合研究所無担保社債 | 100,000,000 | 100,447,000 | |
| 第７回株式会社野村総合研究所無担保社債 | 200,000,000 | 199,658,000 | |
| 第４回株式会社電通グループ無担保社債 | 100,000,000 | 100,107,000 | |
| 第６回株式会社電通無担保社債 | 200,000,000 | 201,506,000 | |
| 第１６回武田薬品工業株式会社無担保社債 | 300,000,000 | 298,767,000 | |
| 第２回大塚ホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,225,000 | |
| 第４２回ＤＩＣ株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,022,000 | |
| 第１３回ヤフー株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,797,000 | |
| 第１５回楽天グループ株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,878,000 | |
| 第１９回楽天グループ株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,744,000 | |
| 第１４回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,896,000 | |
| 第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 102,062,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,551,000 | |
| 第１１回株式会社ブリヂストン無担保社債 | 100,000,000 | 100,180,000 | |
| 第１３回株式会社ブリヂストン無担保社債 | 100,000,000 | 100,126,000 | |
| 第１４回株式会社ブリヂストン無担保社債 | 100,000,000 | 100,481,000 | |
| 第２回日本製鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,044,000 | |
| 第３４回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債 | 300,000,000 | 300,423,000 | |
| 第８回株式会社タダノ無担保社債 | 100,000,000 | 99,796,000 | |
| 第１７回株式会社日立製作所無担保社債 | 100,000,000 | 107,382,000 | |
| 第２０回株式会社日立製作所無担保社債 | 100,000,000 | 99,959,000 | |
| 第１回株式会社安川電機無担保社債 | 100,000,000 | 99,850,000 | |
| 第２１回セイコーエプソン株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,107,000 | |
| 第２２回セイコーエプソン株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,015,000 | |
| 第１６回パナソニック株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,270,000 | |
| 第１７回パナソニック株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 202,260,000 | |
| 第２０回パナソニック株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,880,000 | |
| 第２１回パナソニック株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,001,000 | |
| 第２３回パナソニック株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,840,000 | |
| 第１８回株式会社デンソー無担保社債 | 100,000,000 | 100,205,000 | |
| 第１９回株式会社デンソー無担保社債 | 300,000,000 | 299,427,000 | |
| 第２９回三菱重工業株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,296,000 | |
| 第３５回三菱重工業株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,113,000 | |
| 第１１回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,094,000 | |
| 第３０回いすゞ自動車株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,880,000 | |
| 第２７回トヨタ自動車株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,890,000 | |
| 第１２回本田技研工業株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,874,000 | |
| 第１回明治安田生命２０１８基金特定目的会社特定社債 | 100,000,000 | 100,105,000 | |
| 第８回楽天カード株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,827,000 | |
| 第１回オリックス銀行株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,103,000 | |
| 第２１回株式会社ニコン無担保社債 | 100,000,000 | 101,326,000 | |
| 第６回大日本印刷株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 96,391,000 | |
| 第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,544,000 | |
| 第１０８回丸紅株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,563,000 | |
| 第７０回三井物産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 116,697,000 | |
| 第７３回三井物産株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,998,000 | |
| 第５３回住友商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,431,000 | |
| 第５６回住友商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,902,000 | |
| 第２２回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特 | 100,000,000 | 100,548,000 | |
| 第２３回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付） | 100,000,000 | 117,910,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債 | 100,000,000 | 111,109,000 | |
| 第１回三井住友ＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約） | 100,000,000 | 101,167,000 | |
| 第１１回株式会社セブン銀行無担保社債 | 100,000,000 | 101,258,000 | |
| 第１回みずほＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約） | 300,000,000 | 304,038,000 | |
| 第３回みずほリース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,159,000 | |
| 第４回みずほリース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,131,000 | |
| 第９回みずほリース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,053,000 | |
| 第１６回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 200,548,000 | |
| 第１８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 201,380,000 | |
| 第３４回東京センチュリー株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,195,000 | |
| 第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債 | 100,000,000 | 100,000,000 | |
| 第６４回株式会社ホンダファイナンス無担保社債 | 200,000,000 | 199,646,000 | |
| 第６５回株式会社ホンダファイナンス無担保社債 | 100,000,000 | 100,075,000 | |
| 第６７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債 | 100,000,000 | 99,981,000 | |
| 第９４回トヨタファイナンス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,056,000 | |
| 第４１回リコーリース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,664,000 | |
| 第7回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,950,000 | |
| 第１６回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,800,000 | |
| 第３０回株式会社ジャックス無担保社債 | 100,000,000 | 100,060,000 | |
| 第３２回株式会社ジャックス無担保社債 | 100,000,000 | 99,784,000 | |
| 第３５回株式会社ジャックス無担保社債 | 100,000,000 | 99,735,000 | |
| 第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 103,476,000 | |
| 第７７回日立キャピタル株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,205,000 | |
| 第８０回日立キャピタル株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,266,000 | |
| 第８７回日立キャピタル株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,810,000 | |
| 第２１回三井住友ファイナンス＆リース株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 200,304,000 | |
| 第４４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,101,000 | |
| 第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 201,236,000 | |
| 第５６回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,965,000 | |
| 第６４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,938,000 | |
| 第３１回株式会社大和証券グループ本社無担保社債 | 100,000,000 | 100,078,000 | |
| | | | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第１回野村ホールディングス株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 200,040,000 | |
| 第３回野村ホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,659,000 | |
| 第７回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,952,000 | |
| 第６６回三井不動産株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 200,782,000 | |
| 第１２０回三菱地所株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 200,316,000 | |
| 第１３１回三菱地所株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 97,933,000 | |
| 第１３５回三菱地所株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,280,000 | |
| 第９７回住友不動産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,648,000 | |
| 第１００回住友不動産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,669,000 | |
| 第１０９回住友不動産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,292,000 | |
| 第１３回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債 | 100,000,000 | 101,377,000 | |
| 第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 103,667,000 | |
| 第１２４回東武鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,720,000 | |
| 第８６回東京急行電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,104,000 | |
| 第４５回京浜急行電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,788,000 | |
| 第４６回京浜急行電鉄株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,624,000 | |
| 第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 102,944,000 | |
| 第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,762,000 | |
| 第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 95,597,000 | |
| 第４２回京王電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,357,000 | |
| 第５１回京成電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,902,000 | |
| 第４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 110,666,000 | |
| 第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 200,000,000 | 229,128,000 | |
| 第１１５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 99,576,000 | |
| 第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 107,277,000 | |
| 第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 107,036,000 | |
| 第１４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 100,080,000 | |
| 第１５９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 99,099,000 | |
| 第１６５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 99,216,000 | |
| 第１７２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 99,063,000 | |
| 第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 113,430,000 | |
| 第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,404,000 | |
| 第５０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,025,000 | |
| 第５９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債 | 500,000,000 | 499,995,000 | |
| 第７５回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,883,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 128,289,000 | |
| 第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 122,699,000 | |
| 第７２回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 110,680,000 | |
| 第３１回東京地下鉄株式会社社債 | 100,000,000 | 106,576,000 | |
| 第３７回東京地下鉄株式会社社債 | 100,000,000 | 92,635,000 | |
| 第４０回東京地下鉄株式会社社債 | 100,000,000 | 91,255,000 | |
| 第５４回東京地下鉄株式会社社債 | 100,000,000 | 100,553,000 | |
| 第５３回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 192,066,000 | |
| 第６回株式会社日立物流無担保社債 | 100,000,000 | 99,716,000 | |
| 第１６回三菱倉庫株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,934,000 | |
| 第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,339,000 | |
| 第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,725,000 | |
| 第１１回ソフトバンク株式会社無担保社債 | 400,000,000 | 399,140,000 | |
| 第３１回株式会社光通信無担保社債 | 200,000,000 | 201,992,000 | |
| 第３３回株式会社光通信無担保社債 | 100,000,000 | 100,139,000 | |
| 第３６回株式会社光通信無担保社債 | 100,000,000 | 99,600,000 | |
| 第５０３回中部電力株式会社社債 | 100,000,000 | 101,403,000 | |
| 第５０７回中部電力株式会社社債 | 100,000,000 | 101,752,000 | |
| 第５１１回中部電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,092,000 | |
| 第５１９回中部電力株式会社社債 | 100,000,000 | 103,516,000 | |
| 第５４０回中部電力株式会社社債 | 100,000,000 | 97,276,000 | |
| 第５０８回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 101,007,000 | |
| 第５１０回関西電力株式会社社債 | 200,000,000 | 202,444,000 | |
| 第５１１回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,729,000 | |
| 第５２４回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 101,020,000 | |
| 第５３６回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,214,000 | |
| 第５３８回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 99,912,000 | |
| 第３８５回中国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 101,964,000 | |
| 第３９８回中国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,897,000 | |
| 第４００回中国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,368,000 | |
| 第４０２回中国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,302,000 | |
| 第４１６回中国電力株式会社社債 | 200,000,000 | 200,284,000 | |
| 第４２５回中国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,040,000 | |
| 第３０７回北陸電力株式会社社債 | 100,000,000 | 103,779,000 | |
| 第３２２回北陸電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,642,000 | |
| 第３３０回北陸電力株式会社社債 | 200,000,000 | 199,998,000 | |
| 第４７１回東北電力株式会社社債 | 126,000,000 | 128,491,020 | |
| 第４８１回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,155,000 | |
| 第４９６回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,480,000 | |
| 第５０８回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,921,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 第５２１回東北電力株式会社社債 | 200,000,000 | 201,538,000 | |
| | 第５２７回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 99,515,000 | |
| | 第５３５回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 99,205,000 | |
| | 第３０９回四国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,282,000 | |
| | 第３１４回四国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 99,341,000 | |
| | 第４４９回九州電力株式会社社債 | 200,000,000 | 201,494,000 | |
| | 第４６５回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,224,000 | |
| | 第４６８回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,584,000 | |
| | 第４８４回九州電力株式会社社債 | 200,000,000 | 199,922,000 | |
| | 第４８９回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,403,000 | |
| | 第４９４回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 99,208,000 | |
| | 第３２６回北海道電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,256,000 | |
| | 第３４０回北海道電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,979,000 | |
| | 第３５０回北海道電力株式会社社債 | 100,000,000 | 101,222,000 | |
| | 第１３回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 106,351,000 | |
| | 第４４回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,178,000 | |
| | 第５０回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,700,000 | |
| | 第５７回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,085,000 | |
| | 第３１回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 200,000,000 | 207,098,000 | |
| | 第３８回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 300,000,000 | 303,324,000 | |
| | 第３９回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 100,000,000 | 104,102,000 | |
| | 第４１回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 300,000,000 | 304,461,000 | |
| | 第４２回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 100,000,000 | 104,242,000 | |
| | 第４４回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 100,000,000 | 100,441,000 | |
| | 第４５回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 100,000,000 | 101,452,000 | |
| | 第４８回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 300,000,000 | 300,342,000 | |
| | 第６４回東京瓦斯株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,149,000 | |
| | 第６５回東京瓦斯株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,406,000 | |
| | 第４１回大阪瓦斯株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,114,000 | |
| | 第４２回大阪瓦斯株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,733,000 | |
| | 第２７回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債 | 100,000,000 | 101,152,000 | |
| | 第７回株式会社ファーストリテイリング無担保社債 | 200,000,000 | 201,736,000 | |
| 社債券合計 | | 29,726,000,000 | 29,983,332,020 | |
| 合計 | | | 647,275,950,170 | |

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

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス　マザーファンド

### 貸借対照表

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 2,855,341,167 |
| 株式 | 478,384,690,050 |
| 派生商品評価勘定 | 1,307,050 |
| 未収入金 | 111,931,080 |
| 未収配当金 | 671,549,733 |
| 前払金 | 87,500,600 |
| 差入委託証拠金 | 147,495,000 |
| 流動資産合計 | 482,259,814,680 |
| 資産合計 | 482,259,814,680 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 88,826,350 |
| 未払解約金 | 188,443,078 |
| 未払利息 | 4,281 |
| 流動負債合計 | 277,273,709 |
| 負債合計 | 277,273,709 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 254,903,427,075 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 227,079,113,896 |
| 元本等合計 | 481,982,540,971 |
| 純資産合計 | 481,982,540,971 |
| 負債純資産合計 | 482,259,814,680 |

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| １.有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式 |

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| | 移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | 先物取引<br>株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。<br><br>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。 |
| 3.収益及び費用の計上基準 | (1)受取配当金<br>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。<br><br>(2)派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| | | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|---|
| 1． | 計算期間の末日における受益権の総数 | 254,903,427,075口 |
| 2． | 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額　1.8908円<br>(1万口当たり純資産額)　(18,908円) |

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 2.金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。<br>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。 |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。 |

## 2．金融商品の時価等に関する事項

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

| 区分 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2021年 1月21日 |
| 期首元本額 | 211,981,845,770円 |
| 期中追加設定元本額 | 72,330,508,234円 |
| 期中一部解約元本額 | 29,408,926,929円 |
| 期末元本額 | 254,903,427,075円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型） | 408,159,824円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 3,921,141,648円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 15,768,943円 |
| ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン | 11,200,895,614円 |
| 世界経済インデックスファンド | 3,488,644,943円 |
| 日本株式インデックス・オープン | 3,378,223,126円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 6,097,099,944円 |
| ＤＣマイセレクション５０ | 18,225,218,160円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 18,400,640,933円 |
| ＤＣ日本株式インデックス・オープン | 6,034,347,876円 |
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 3,007,744,182円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 8,765,668,257円 |
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 6,484,089,086円 |
| ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ | 7,985,893,097円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 223,390,964円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 699,382,339円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 503,044,042円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 3,448,735,396円 |
| 日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 1,605,027,279円 |
| 国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 5,883,786円 |
| マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 20,056,444円 |
| マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 20,644,035円 |
| 日本株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用） | 190,379,761円 |
| 国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 2,239,914円 |

| 区分 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 33,959,121円 |
| バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 127,312,851円 |
| バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 25,932,294円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 85,912,603円 |
| バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 974,441,481円 |
| バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 446,141,439円 |
| バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 2,912,344,874円 |
| 世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用） | 77,482,956円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 26,535,537円 |
| バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 510,661,983円 |
| バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 282,197,555円 |
| バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 366,966,879円 |
| 国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 37,133,693円 |
| ＦＯＦｓ用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用） | 594,125,943円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ１ | 3,528,653,872円 |
| 日本株式ファンド・シリーズ２ | 1,898,156,116円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 2,344,624,777円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 4,711,030,971円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 1,375,097,034円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 5,791,455,986円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 448,410,441円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 407,088,624円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 2,011,436,769円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 216,766,384円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 10,787,763円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 58,068,852円 |
| 国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用） | 26,688,154,154円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 559,164,334円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 41,637,953円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 150,556,024円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 28,364,728円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 7,265,088円 |
| グローバル経済コア | 215,653,204円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 25,462,864円 |
| ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード） | 90,031,575円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 20,547,117円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 1,270,588,596円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 169,958,346円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 6,568,493円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 4,525,364円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 2,362,872円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 2,528,273円 |
| ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用） | 42,869,552,502円 |

| 区分 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用） | 1,042,634,767円 |
| 世界株式ファンド（適格機関投資家専用） | 252,585,387円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 45,105,237円 |
| ＳＭＴＡＭ日本株式インデックスファンドＶＬ－Ｐ（適格機関投資家専用） | 47,734,272,173円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 10,401,234円 |
| ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用） | 230,460,399円 |

**（有価証券に関する注記）**

**売買目的有価証券**

| 種類 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式 | 3,781,582,047 |
| 合計 | 3,781,582,047 |

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

**（デリバティブ取引に関する注記）**

**株式関連**

（2022年 1月20日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 3,344,180,600 | － | 3,256,680,000 | △87,500,600 |
| 合計 | | 3,344,180,600 | － | 3,256,680,000 | △87,500,600 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

**附属明細表**

**第１　有価証券明細表**

**(1)株式**

| 銘　柄 | 株式数(株) | 評価額 | | 備考 |
|---|---|---|---|---|
| | | 単価(円) | 金額(円) | |
| 極洋 | 8,600 | 3,060.00 | 26,316,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日本水産 | 245,200 | 529.00 | 129,710,800 | |
| マルハニチロ | 38,400 | 2,365.00 | 90,816,000 | |
| 雪国まいたけ | 17,900 | 1,188.00 | 21,265,200 | |
| カネコ種苗 | 7,400 | 1,481.00 | 10,959,400 | |
| サカタのタネ | 29,200 | 3,270.00 | 95,484,000 | |
| ホクト | 20,600 | 1,907.00 | 39,284,200 | |
| ホクリヨウ | 3,300 | 689.00 | 2,273,700 | |
| 住石ホールディングス | 42,900 | 136.00 | 5,834,400 | |
| 日鉄鉱業 | 5,600 | 6,410.00 | 35,896,000 | |
| 三井松島ホールディングス | 10,300 | 1,607.00 | 16,552,100 | |
| ＩＮＰＥＸ | 983,600 | 1,118.00 | 1,099,664,800 | |
| 石油資源開発 | 28,800 | 2,742.00 | 78,969,600 | |
| Ｋ＆Ｏエナジーグループ | 11,800 | 1,447.00 | 17,074,600 | |
| ヒノキヤグループ | 5,300 | 2,022.00 | 10,716,600 | |
| ショーボンドホールディングス | 35,000 | 4,940.00 | 172,900,000 | |
| ミライト・ホールディングス | 78,900 | 1,821.00 | 143,676,900 | |
| タマホーム | 14,900 | 2,406.00 | 35,849,400 | |
| サンヨーホームズ | 2,800 | 735.00 | 2,058,000 | |
| 日本アクア | 9,700 | 644.00 | 6,246,800 | |
| ファーストコーポレーション | 7,500 | 684.00 | 5,130,000 | |
| ベステラ | 4,900 | 1,291.00 | 6,325,900 | |
| Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ | 40,900 | 226.00 | 9,243,400 | |
| キャンディル | 4,200 | 486.00 | 2,041,200 | |
| ダイセキ環境ソリューション | 4,700 | 1,223.00 | 5,748,100 | |
| 第一カッター興業 | 6,100 | 1,295.00 | 7,899,500 | |
| 安藤・間 | 121,800 | 874.00 | 106,453,200 | |
| 東急建設 | 71,800 | 689.00 | 49,470,200 | |
| コムシスホールディングス | 79,000 | 2,691.00 | 212,589,000 | |
| ビーアールホールディングス | 33,400 | 349.00 | 11,656,600 | |
| 高松コンストラクショングループ | 15,300 | 1,940.00 | 29,682,000 | |
| 東建コーポレーション | 7,600 | 9,180.00 | 69,768,000 | |
| ソネック | 2,500 | 1,022.00 | 2,555,000 | |
| ヤマウラ | 11,800 | 949.00 | 11,198,200 | |
| オリエンタル白石 | 82,400 | 238.00 | 19,611,200 | |
| 大成建設 | 163,600 | 3,705.00 | 606,138,000 | |
| 大林組 | 566,200 | 916.00 | 518,639,200 | |
| 清水建設 | 530,400 | 760.00 | 403,104,000 | |
| 飛島建設 | 15,200 | 1,025.00 | 15,580,000 | |
| 長谷工コーポレーション | 168,600 | 1,421.00 | 239,580,600 | |
| 松井建設 | 22,300 | 697.00 | 15,543,100 | |
| 錢高組 | 2,500 | 4,010.00 | 10,025,000 | |
| 鹿島建設 | 414,900 | 1,361.00 | 564,678,900 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 不動テトラ | 12,000 | 1,607.00 | 19,284,000 | |
| 大末建設 | 5,900 | 1,290.00 | 7,611,000 | |
| 鉄建建設 | 12,300 | 1,787.00 | 21,980,100 | |
| 西松建設 | 34,300 | 3,710.00 | 127,253,000 | |
| 三井住友建設 | 127,700 | 430.00 | 54,911,000 | |
| 大豊建設 | 8,300 | 3,705.00 | 30,751,500 | |
| 佐田建設 | 12,200 | 461.00 | 5,624,200 | |
| ナカノフドー建設 | 13,500 | 331.00 | 4,468,500 | |
| 奥村組 | 33,300 | 3,235.00 | 107,725,500 | |
| 東鉄工業 | 26,300 | 2,406.00 | 63,277,800 | |
| イチケン | 4,100 | 1,840.00 | 7,544,000 | |
| 富士ピー・エス | 7,300 | 483.00 | 3,525,900 | |
| 淺沼組 | 6,300 | 5,380.00 | 33,894,000 | |
| 戸田建設 | 235,100 | 724.00 | 170,212,400 | |
| 熊谷組 | 28,900 | 2,950.00 | 85,255,000 | |
| 北野建設 | 3,400 | 2,139.00 | 7,272,600 | |
| 植木組 | 5,000 | 1,405.00 | 7,025,000 | |
| 矢作建設工業 | 25,000 | 739.00 | 18,475,000 | |
| ピーエス三菱 | 18,600 | 593.00 | 11,029,800 | |
| 日本ハウスホールディングス | 38,600 | 440.00 | 16,984,000 | |
| 大東建託 | 57,900 | 13,340.00 | 772,386,000 | |
| 新日本建設 | 24,100 | 755.00 | 18,195,500 | |
| 東亜道路工業 | 2,900 | 4,840.00 | 14,036,000 | |
| 日本道路 | 5,500 | 8,250.00 | 45,375,000 | |
| 東亜建設工業 | 13,900 | 2,369.00 | 32,929,100 | |
| 日本国土開発 | 55,100 | 523.00 | 28,817,300 | |
| 若築建設 | 9,400 | 1,698.00 | 15,961,200 | |
| 東洋建設 | 63,500 | 552.00 | 35,052,000 | |
| 五洋建設 | 224,400 | 638.00 | 143,167,200 | |
| 世紀東急工業 | 27,200 | 790.00 | 21,488,000 | |
| 福田組 | 6,000 | 4,160.00 | 24,960,000 | |
| 住友林業 | 144,900 | 2,044.00 | 296,175,600 | |
| 日本基礎技術 | 15,600 | 578.00 | 9,016,800 | |
| 巴コーポレーション | 25,100 | 484.00 | 12,148,400 | |
| 大和ハウス工業 | 522,800 | 3,319.00 | 1,735,173,200 | |
| ライト工業 | 35,600 | 1,855.00 | 66,038,000 | |
| 積水ハウス | 614,100 | 2,332.00 | 1,432,081,200 | |
| 日特建設 | 11,700 | 641.00 | 7,499,700 | |
| 北陸電気工事 | 11,700 | 810.00 | 9,477,000 | |
| ユアテック | 32,400 | 640.00 | 20,736,000 | |
| 日本リーテック | 11,800 | 1,383.00 | 16,319,400 | |
| 四電工 | 6,200 | 1,660.00 | 10,292,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 中電工 | 26,100 | 2,095.00 | 54,679,500 | |
| 関電工 | 92,100 | 845.00 | 77,824,500 | |
| きんでん | 126,500 | 1,684.00 | 213,026,000 | |
| 東京エネシス | 18,800 | 946.00 | 17,784,800 | |
| トーエネック | 5,700 | 3,125.00 | 17,812,500 | |
| 住友電設 | 14,000 | 2,013.00 | 28,182,000 | |
| 日本電設工業 | 31,000 | 1,459.00 | 45,229,000 | |
| エクシオグループ | 85,400 | 2,363.00 | 201,800,200 | |
| 新日本空調 | 15,000 | 2,039.00 | 30,585,000 | |
| 九電工 | 43,700 | 3,420.00 | 149,454,000 | |
| 三機工業 | 36,800 | 1,415.00 | 52,072,000 | |
| 日揮ホールディングス | 174,400 | 1,072.00 | 186,956,800 | |
| 中外炉工業 | 5,700 | 1,590.00 | 9,063,000 | |
| ヤマト | 16,600 | 706.00 | 11,719,600 | |
| 太平電業 | 12,500 | 2,699.00 | 33,737,500 | |
| 高砂熱学工業 | 51,200 | 1,897.00 | 97,126,400 | |
| 三晃金属工業 | 2,200 | 2,362.00 | 5,196,400 | |
| 朝日工業社 | 3,800 | 2,824.00 | 10,731,200 | |
| 明星工業 | 36,600 | 694.00 | 25,400,400 | |
| 大氣社 | 27,500 | 2,962.00 | 81,455,000 | |
| ダイダン | 12,600 | 2,219.00 | 27,959,400 | |
| 日比谷総合設備 | 18,200 | 1,870.00 | 34,034,000 | |
| フィル・カンパニー | 3,200 | 1,116.00 | 3,571,200 | |
| テスホールディングス | 10,300 | 1,430.00 | 14,729,000 | |
| インフロニア・ホールディングス | 241,400 | 1,074.00 | 259,263,600 | |
| 東洋エンジニアリング | 23,800 | 674.00 | 16,041,200 | |
| レイズネクスト | 27,300 | 1,143.00 | 31,203,900 | |
| ニップン | 53,000 | 1,609.00 | 85,277,000 | |
| 日清製粉グループ本社 | 204,700 | 1,574.00 | 322,197,800 | |
| 日東富士製粉 | 2,600 | 3,760.00 | 9,776,000 | |
| 昭和産業 | 17,100 | 2,653.00 | 45,366,300 | |
| 鳥越製粉 | 16,100 | 625.00 | 10,062,500 | |
| 中部飼料 | 20,400 | 985.00 | 20,094,000 | |
| フィード・ワン | 24,300 | 687.00 | 16,694,100 | |
| 東洋精糖 | 3,100 | 1,033.00 | 3,202,300 | |
| 日本甜菜製糖 | 9,400 | 1,655.00 | 15,557,000 | |
| DM三井製糖ホールディングス | 16,500 | 1,941.00 | 32,026,500 | |
| 塩水港精糖 | 21,600 | 211.00 | 4,557,600 | |
| 日新製糖 | 8,600 | 1,706.00 | 14,671,600 | |
| 森永製菓 | 42,500 | 3,650.00 | 155,125,000 | |
| 中村屋 | 4,400 | 3,400.00 | 14,960,000 | |
| 江崎グリコ | 49,900 | 3,695.00 | 184,380,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 名糖産業 | 8,000 | 1,655.00 | 13,240,000 | |
| 井村屋グループ | 10,300 | 2,165.00 | 22,299,500 | |
| 不二家 | 10,100 | 2,192.00 | 22,139,200 | |
| 山崎製パン | 135,800 | 1,484.00 | 201,527,200 | |
| 第一屋製パン | 3,500 | 528.00 | 1,848,000 | |
| モロゾフ | 2,900 | 5,550.00 | 16,095,000 | |
| 亀田製菓 | 10,300 | 4,105.00 | 42,281,500 | |
| 寿スピリッツ | 17,400 | 4,870.00 | 84,738,000 | |
| カルビー | 82,600 | 2,644.00 | 218,394,400 | |
| 森永乳業 | 33,500 | 5,390.00 | 180,565,000 | |
| 六甲バター | 13,200 | 1,477.00 | 19,496,400 | |
| ヤクルト本社 | 134,200 | 5,810.00 | 779,702,000 | |
| 明治ホールディングス | 119,800 | 6,960.00 | 833,808,000 | |
| 雪印メグミルク | 43,600 | 2,002.00 | 87,287,200 | |
| プリマハム | 22,700 | 2,505.00 | 56,863,500 | |
| 日本ハム | 69,300 | 4,315.00 | 299,029,500 | |
| 林兼産業 | 5,500 | 506.00 | 2,783,000 | |
| 丸大食品 | 17,800 | 1,527.00 | 27,180,600 | |
| Ｓ　Ｆｏｏｄｓ | 16,300 | 3,290.00 | 53,627,000 | |
| 柿安本店 | 6,300 | 2,537.00 | 15,983,100 | |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 116,700 | 661.00 | 77,138,700 | |
| サッポロホールディングス | 61,800 | 2,192.00 | 135,465,600 | |
| アサヒグループホールディングス | 426,300 | 4,768.00 | 2,032,598,400 | |
| キリンホールディングス | 666,000 | 1,849.00 | 1,231,434,000 | |
| 宝ホールディングス | 123,100 | 1,136.00 | 139,841,600 | |
| オエノンホールディングス | 51,500 | 324.00 | 16,686,000 | |
| 養命酒製造 | 5,500 | 1,733.00 | 9,531,500 | |
| コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス | 127,200 | 1,332.00 | 169,430,400 | |
| サントリー食品インターナショナル | 121,200 | 4,305.00 | 521,766,000 | |
| ダイドーグループホールディングス | 9,300 | 4,600.00 | 42,780,000 | |
| 伊藤園 | 55,000 | 6,160.00 | 338,800,000 | |
| キーコーヒー | 17,800 | 2,000.00 | 35,600,000 | |
| ユニカフェ | 5,400 | 926.00 | 5,000,400 | |
| ジャパンフーズ | 2,600 | 1,205.00 | 3,133,000 | |
| 日清オイリオグループ | 22,700 | 2,944.00 | 66,828,800 | |
| 不二製油グループ本社 | 39,300 | 2,283.00 | 89,721,900 | |
| かどや製油 | 2,000 | 3,990.00 | 7,980,000 | |
| Ｊ－オイルミルズ | 16,900 | 1,688.00 | 28,527,200 | |
| キッコーマン | 130,400 | 8,450.00 | 1,101,880,000 | |
| 味の素 | 400,200 | 3,238.00 | 1,295,847,600 | |
| ブルドックソース | 7,600 | 2,016.00 | 15,321,600 | |
| キユーピー | 95,200 | 2,290.00 | 218,008,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ハウス食品グループ本社 | 67,800 | 2,870.00 | 194,586,000 | |
| カゴメ | 68,800 | 2,938.00 | 202,134,400 | |
| 焼津水産化学工業 | 8,800 | 907.00 | 7,981,600 | |
| アリアケジャパン | 16,600 | 6,050.00 | 100,430,000 | |
| ピエトロ | 2,400 | 1,790.00 | 4,296,000 | |
| エバラ食品工業 | 4,000 | 2,796.00 | 11,184,000 | |
| やまみ | 2,000 | 1,786.00 | 3,572,000 | |
| ニチレイ | 82,600 | 2,532.00 | 209,143,200 | |
| 東洋水産 | 87,000 | 4,690.00 | 408,030,000 | |
| イートアンドホールディングス | 6,800 | 2,292.00 | 15,585,600 | |
| 大冷 | 2,000 | 1,908.00 | 3,816,000 | |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | 9,300 | 506.00 | 4,705,800 | |
| 日清食品ホールディングス | 71,100 | 7,880.00 | 560,268,000 | |
| 永谷園ホールディングス | 8,000 | 1,895.00 | 15,160,000 | |
| 一正蒲鉾 | 7,000 | 750.00 | 5,250,000 | |
| フジッコ | 19,500 | 1,903.00 | 37,108,500 | |
| ロック・フィールド | 19,500 | 1,486.00 | 28,977,000 | |
| 日本たばこ産業 | 971,600 | 2,344.50 | 2,277,916,200 | |
| ケンコーマヨネーズ | 10,200 | 1,312.00 | 13,382,400 | |
| わらべや日洋ホールディングス | 11,900 | 1,870.00 | 22,253,000 | |
| なとり | 10,100 | 1,974.00 | 19,937,400 | |
| イフジ産業 | 3,200 | 914.00 | 2,924,800 | |
| ピックルスコーポレーション | 8,600 | 1,509.00 | 12,977,400 | |
| ファーマフーズ | 17,100 | 1,757.00 | 30,044,700 | |
| ユーグレナ | 92,300 | 683.00 | 63,040,900 | |
| 紀文食品 | 10,600 | 918.00 | 9,730,800 | |
| ミヨシ油脂 | 6,900 | 1,140.00 | 7,866,000 | |
| 理研ビタミン | 18,800 | 1,670.00 | 31,396,000 | |
| 片倉工業 | 19,800 | 2,273.00 | 45,005,400 | |
| グンゼ | 12,000 | 3,955.00 | 47,460,000 | |
| 東洋紡 | 70,300 | 1,269.00 | 89,210,700 | |
| ユニチカ | 50,100 | 308.00 | 15,430,800 | |
| 富士紡ホールディングス | 8,000 | 4,025.00 | 32,200,000 | |
| 倉敷紡績 | 15,400 | 1,849.00 | 28,474,600 | |
| シキボウ | 9,300 | 908.00 | 8,444,400 | |
| 日本毛織 | 53,800 | 901.00 | 48,473,800 | |
| トーア紡コーポレーション | 6,500 | 412.00 | 2,678,000 | |
| 帝国繊維 | 20,200 | 1,863.00 | 37,632,600 | |
| 帝人 | 166,800 | 1,451.00 | 242,026,800 | |
| 東レ | 1,281,000 | 734.70 | 941,150,700 | |
| 住江織物 | 3,900 | 1,759.00 | 6,860,100 | |
| 日本フエルト | 11,100 | 438.00 | 4,861,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| イチカワ | 2,600 | 1,352.00 | 3,515,200 | |
| 日東製網 | 1,900 | 1,431.00 | 2,718,900 | |
| アツギ | 13,900 | 539.00 | 7,492,100 | |
| ダイニック | 6,700 | 697.00 | 4,669,900 | |
| セーレン | 36,400 | 2,349.00 | 85,503,600 | |
| ソトー | 6,700 | 811.00 | 5,433,700 | |
| 東海染工 | 2,200 | 1,125.00 | 2,475,000 | |
| 小松マテーレ | 29,200 | 1,218.00 | 35,565,600 | |
| ワコールホールディングス | 44,200 | 2,073.00 | 91,626,600 | |
| ホギメディカル | 23,900 | 3,025.00 | 72,297,500 | |
| ＴＳＩホールディングス | 59,600 | 335.00 | 19,966,000 | |
| マツオカコーポレーション | 5,800 | 1,153.00 | 6,687,400 | |
| ワールド | 23,300 | 1,122.00 | 26,142,600 | |
| 三陽商会 | 8,500 | 860.00 | 7,310,000 | |
| ナイガイ | 6,600 | 287.00 | 1,894,200 | |
| オンワードホールディングス | 106,800 | 304.00 | 32,467,200 | |
| ルックホールディングス | 5,800 | 1,137.00 | 6,594,600 | |
| ゴールドウイン | 31,900 | 6,130.00 | 195,547,000 | |
| デサント | 34,500 | 3,740.00 | 129,030,000 | |
| キング | 8,800 | 518.00 | 4,558,400 | |
| ヤマトインターナショナル | 16,200 | 286.00 | 4,633,200 | |
| 特種東海製紙 | 10,900 | 4,010.00 | 43,709,000 | |
| 王子ホールディングス | 739,200 | 592.00 | 437,606,400 | |
| 日本製紙 | 84,700 | 1,144.00 | 96,896,800 | |
| 三菱製紙 | 25,100 | 311.00 | 7,806,100 | |
| 北越コーポレーション | 115,900 | 736.00 | 85,302,400 | |
| 中越パルプ工業 | 6,700 | 955.00 | 6,398,500 | |
| 巴川製紙所 | 5,300 | 743.00 | 3,937,900 | |
| 大王製紙 | 85,300 | 1,932.00 | 164,799,600 | |
| 阿波製紙 | 4,600 | 326.00 | 1,499,600 | |
| レンゴー | 167,100 | 869.00 | 145,209,900 | |
| トーモク | 10,800 | 1,712.00 | 18,489,600 | |
| ザ・パック | 13,400 | 2,591.00 | 34,719,400 | |
| 北の達人コーポレーション | 63,300 | 259.00 | 16,394,700 | |
| クラレ | 258,600 | 1,024.00 | 264,806,400 | |
| 旭化成 | 1,172,000 | 1,140.50 | 1,336,666,000 | |
| 共和レザー | 11,000 | 640.00 | 7,040,000 | |
| 昭和電工 | 153,300 | 2,458.00 | 376,811,400 | |
| 住友化学 | 1,299,100 | 585.00 | 759,973,500 | |
| 住友精化 | 7,800 | 3,115.00 | 24,297,000 | |
| 日産化学 | 96,200 | 6,200.00 | 596,440,000 | |
| ラサ工業 | 6,200 | 1,570.00 | 9,734,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| クレハ | 14,000 | 8,620.00 | 120,680,000 | |
| 多木化学 | 6,900 | 5,240.00 | 36,156,000 | |
| テイカ | 13,000 | 1,240.00 | 16,120,000 | |
| 石原産業 | 29,400 | 1,151.00 | 33,839,400 | |
| 片倉コープアグリ | 4,200 | 1,135.00 | 4,767,000 | |
| 日本曹達 | 22,600 | 3,195.00 | 72,207,000 | |
| 東ソー | 255,100 | 1,782.00 | 454,588,200 | |
| トクヤマ | 56,600 | 1,858.00 | 105,162,800 | |
| セントラル硝子 | 28,900 | 2,092.00 | 60,458,800 | |
| 東亞合成 | 100,700 | 1,114.00 | 112,179,800 | |
| 大阪ソーダ | 16,500 | 2,971.00 | 49,021,500 | |
| 関東電化工業 | 38,700 | 1,082.00 | 41,873,400 | |
| デンカ | 64,500 | 3,915.00 | 252,517,500 | |
| 信越化学工業 | 303,600 | 19,100.00 | 5,798,760,000 | |
| 日本カーバイド工業 | 6,300 | 1,292.00 | 8,139,600 | |
| 堺化学工業 | 12,400 | 2,149.00 | 26,647,600 | |
| 第一稀元素化学工業 | 16,400 | 1,125.00 | 18,450,000 | |
| エア・ウォーター | 167,400 | 1,769.00 | 296,130,600 | |
| 日本酸素ホールディングス | 169,900 | 2,383.00 | 404,871,700 | |
| 日本化学工業 | 5,500 | 2,665.00 | 14,657,500 | |
| 東邦アセチレン | 2,900 | 1,230.00 | 3,567,000 | |
| 日本パーカライジング | 89,200 | 1,040.00 | 92,768,000 | |
| 高圧ガス工業 | 28,000 | 724.00 | 20,272,000 | |
| チタン工業 | 2,000 | 1,711.00 | 3,422,000 | |
| 四国化成工業 | 23,100 | 1,386.00 | 32,016,600 | |
| 戸田工業 | 3,800 | 3,590.00 | 13,642,000 | |
| ステラ　ケミファ | 8,900 | 2,504.00 | 22,285,600 | |
| 保土谷化学工業 | 5,700 | 5,610.00 | 31,977,000 | |
| 日本触媒 | 29,700 | 5,320.00 | 158,004,000 | |
| 大日精化工業 | 14,600 | 2,208.00 | 32,236,800 | |
| カネカ | 45,700 | 3,710.00 | 169,547,000 | |
| 三菱瓦斯化学 | 164,500 | 2,152.00 | 354,004,000 | |
| 三井化学 | 160,600 | 3,190.00 | 512,314,000 | |
| ＪＳＲ | 164,800 | 3,995.00 | 658,376,000 | |
| 東京応化工業 | 30,300 | 6,610.00 | 200,283,000 | |
| 大阪有機化学工業 | 15,100 | 3,335.00 | 50,358,500 | |
| 三菱ケミカルホールディングス | 1,182,000 | 905.50 | 1,070,301,000 | |
| ＫＨネオケム | 29,200 | 2,985.00 | 87,162,000 | |
| ダイセル | 254,700 | 855.00 | 217,768,500 | |
| 住友ベークライト | 27,800 | 5,900.00 | 164,020,000 | |
| 積水化学工業 | 370,000 | 1,892.00 | 700,040,000 | |
| 日本ゼオン | 159,500 | 1,348.00 | 215,006,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| アイカ工業 | 49,300 | 3,220.00 | 158,746,000 | |
| 宇部興産 | 83,300 | 2,065.00 | 172,014,500 | |
| 積水樹脂 | 26,700 | 2,022.00 | 53,987,400 | |
| タキロンシーアイ | 38,300 | 542.00 | 20,758,600 | |
| 旭有機材 | 10,000 | 1,670.00 | 16,700,000 | |
| ニチバン | 10,500 | 1,719.00 | 18,049,500 | |
| リケンテクノス | 43,100 | 481.00 | 20,731,100 | |
| 大倉工業 | 9,000 | 1,977.00 | 17,793,000 | |
| 積水化成品工業 | 23,700 | 466.00 | 11,044,200 | |
| 群栄化学工業 | 4,000 | 3,465.00 | 13,860,000 | |
| タイガースポリマー | 9,300 | 441.00 | 4,101,300 | |
| ミライアル | 5,700 | 1,613.00 | 9,194,100 | |
| ダイキアクシス | 6,900 | 693.00 | 4,781,700 | |
| ダイキョーニシカワ | 37,300 | 596.00 | 22,230,800 | |
| 竹本容器 | 6,300 | 761.00 | 4,794,300 | |
| 森六ホールディングス | 9,500 | 1,909.00 | 18,135,500 | |
| 恵和 | 4,800 | 5,710.00 | 27,408,000 | |
| 日本化薬 | 139,300 | 1,116.00 | 155,458,800 | |
| カーリットホールディングス | 17,500 | 668.00 | 11,690,000 | |
| 日本精化 | 14,200 | 2,322.00 | 32,972,400 | |
| 扶桑化学工業 | 15,900 | 4,545.00 | 72,265,500 | |
| トリケミカル研究所 | 18,200 | 3,190.00 | 58,058,000 | |
| ＡＤＥＫＡ | 81,400 | 2,425.00 | 197,395,000 | |
| 日油 | 60,400 | 5,220.00 | 315,288,000 | |
| 新日本理化 | 29,300 | 250.00 | 7,325,000 | |
| ハリマ化成グループ | 13,200 | 804.00 | 10,612,800 | |
| 花王 | 399,400 | 5,748.00 | 2,295,751,200 | |
| 第一工業製薬 | 6,600 | 3,020.00 | 19,932,000 | |
| 石原ケミカル | 8,900 | 1,304.00 | 11,605,600 | |
| 日華化学 | 6,000 | 814.00 | 4,884,000 | |
| ニイタカ | 3,700 | 2,169.00 | 8,025,300 | |
| 三洋化成工業 | 10,600 | 5,120.00 | 54,272,000 | |
| 有機合成薬品工業 | 12,300 | 270.00 | 3,321,000 | |
| 大日本塗料 | 21,600 | 800.00 | 17,280,000 | |
| 日本ペイントホールディングス | 664,400 | 942.00 | 625,864,800 | |
| 関西ペイント | 183,400 | 2,391.00 | 438,509,400 | |
| 神東塗料 | 13,900 | 153.00 | 2,126,700 | |
| 中国塗料 | 41,700 | 914.00 | 38,113,800 | |
| 日本特殊塗料 | 13,200 | 872.00 | 11,510,400 | |
| 藤倉化成 | 22,000 | 476.00 | 10,472,000 | |
| 太陽ホールディングス | 26,000 | 3,315.00 | 86,190,000 | |
| ＤＩＣ | 74,700 | 2,948.00 | 220,215,600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| サカタインクス | 35,100 | 958.00 | 33,625,800 | |
| 東洋インキＳＣホールディングス | 37,400 | 1,885.00 | 70,499,000 | |
| Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ | 14,300 | 777.00 | 11,111,100 | |
| 富士フイルムホールディングス | 317,300 | 7,897.00 | 2,505,718,100 | |
| 資生堂 | 336,300 | 5,885.00 | 1,979,125,500 | |
| ライオン | 218,000 | 1,511.00 | 329,398,000 | |
| 高砂香料工業 | 12,400 | 2,749.00 | 34,087,600 | |
| マンダム | 37,900 | 1,366.00 | 51,771,400 | |
| ミルボン | 22,300 | 5,380.00 | 119,974,000 | |
| ファンケル | 73,100 | 2,934.00 | 214,475,400 | |
| コーセー | 34,000 | 10,980.00 | 373,320,000 | |
| コタ | 11,400 | 1,560.00 | 17,784,000 | |
| シーボン | 2,300 | 1,705.00 | 3,921,500 | |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 77,100 | 1,745.00 | 134,539,500 | |
| ノエビアホールディングス | 15,300 | 5,010.00 | 76,653,000 | |
| アジュバンホールディングス | 4,000 | 1,125.00 | 4,500,000 | |
| 新日本製薬 | 4,900 | 1,086.00 | 5,321,400 | |
| エステー | 11,600 | 1,481.00 | 17,179,600 | |
| アグロ　カネショウ | 6,000 | 1,176.00 | 7,056,000 | |
| コニシ | 29,700 | 1,623.00 | 48,203,100 | |
| 長谷川香料 | 31,100 | 2,460.00 | 76,506,000 | |
| 星光ＰＭＣ | 10,200 | 659.00 | 6,721,800 | |
| 小林製薬 | 50,600 | 8,530.00 | 431,618,000 | |
| 荒川化学工業 | 15,000 | 1,131.00 | 16,965,000 | |
| メック | 13,500 | 3,345.00 | 45,157,500 | |
| 日本高純度化学 | 5,000 | 2,492.00 | 12,460,000 | |
| タカラバイオ | 47,200 | 2,380.00 | 112,336,000 | |
| ＪＣＵ | 20,300 | 4,995.00 | 101,398,500 | |
| 新田ゼラチン | 11,300 | 635.00 | 7,175,500 | |
| ＯＡＴアグリオ | 3,700 | 1,903.00 | 7,041,100 | |
| デクセリアルズ | 46,900 | 3,245.00 | 152,190,500 | |
| アース製薬 | 14,800 | 5,840.00 | 86,432,000 | |
| 北興化学工業 | 16,800 | 852.00 | 14,313,600 | |
| 大成ラミック | 5,500 | 2,701.00 | 14,855,500 | |
| クミアイ化学工業 | 67,200 | 776.00 | 52,147,200 | |
| 日本農薬 | 32,200 | 504.00 | 16,228,800 | |
| アキレス | 11,600 | 1,224.00 | 14,198,400 | |
| 有沢製作所 | 26,400 | 1,029.00 | 27,165,600 | |
| 日東電工 | 109,100 | 8,910.00 | 972,081,000 | |
| レック | 23,500 | 842.00 | 19,787,000 | |
| 三光合成 | 18,900 | 344.00 | 6,501,600 | |
| きもと | 27,600 | 212.00 | 5,851,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 藤森工業 | 16,200 | 4,020.00 | 65,124,000 | |
| 前澤化成工業 | 11,500 | 1,246.00 | 14,329,000 | |
| 未来工業 | 6,500 | 1,534.00 | 9,971,000 | |
| ウェーブロックホールディングス | 6,900 | 723.00 | 4,988,700 | |
| ＪＳＰ | 10,600 | 1,594.00 | 16,896,400 | |
| エフピコ | 33,200 | 3,735.00 | 124,002,000 | |
| 天馬 | 14,700 | 2,474.00 | 36,367,800 | |
| 信越ポリマー | 32,400 | 1,044.00 | 33,825,600 | |
| 東リ | 45,000 | 211.00 | 9,495,000 | |
| ニフコ | 60,300 | 3,740.00 | 225,522,000 | |
| バルカー | 14,700 | 2,553.00 | 37,529,100 | |
| ユニ・チャーム | 348,000 | 4,728.00 | 1,645,344,000 | |
| ショーエイコーポレーション | 4,800 | 646.00 | 3,100,800 | |
| 協和キリン | 211,900 | 2,925.00 | 619,807,500 | |
| 武田薬品工業 | 1,419,000 | 3,325.00 | 4,718,175,000 | |
| アステラス製薬 | 1,565,400 | 1,903.00 | 2,978,956,200 | |
| 大日本住友製薬 | 111,500 | 1,346.00 | 150,079,000 | |
| 塩野義製薬 | 227,000 | 7,000.00 | 1,589,000,000 | |
| わかもと製薬 | 21,500 | 296.00 | 6,364,000 | |
| 日本新薬 | 47,300 | 7,420.00 | 350,966,000 | |
| 中外製薬 | 564,700 | 3,689.00 | 2,083,178,300 | |
| 科研製薬 | 28,300 | 4,210.00 | 119,143,000 | |
| エーザイ | 216,100 | 5,996.00 | 1,295,735,600 | |
| ロート製薬 | 92,700 | 3,110.00 | 288,297,000 | |
| 小野薬品工業 | 414,600 | 2,716.50 | 1,126,260,900 | |
| 久光製薬 | 47,700 | 3,445.00 | 164,326,500 | |
| 持田製薬 | 22,800 | 3,445.00 | 78,546,000 | |
| 参天製薬 | 336,700 | 1,305.00 | 439,393,500 | |
| 扶桑薬品工業 | 6,400 | 2,270.00 | 14,528,000 | |
| 日本ケミファ | 2,100 | 2,007.00 | 4,214,700 | |
| ツムラ | 55,900 | 3,295.00 | 184,190,500 | |
| 日医工 | 56,000 | 723.00 | 40,488,000 | |
| キッセイ薬品工業 | 31,900 | 2,289.00 | 73,019,100 | |
| 生化学工業 | 31,800 | 943.00 | 29,987,400 | |
| 栄研化学 | 31,700 | 1,803.00 | 57,155,100 | |
| 日水製薬 | 6,600 | 974.00 | 6,428,400 | |
| 鳥居薬品 | 9,700 | 2,731.00 | 26,490,700 | |
| ＪＣＲファーマ | 50,900 | 2,030.00 | 103,327,000 | |
| 東和薬品 | 26,000 | 2,695.00 | 70,070,000 | |
| 富士製薬工業 | 11,100 | 977.00 | 10,844,700 | |
| ゼリア新薬工業 | 32,800 | 1,966.00 | 64,484,800 | |
| 第一三共 | 1,418,800 | 2,608.50 | 3,700,939,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| キョーリン製薬ホールディングス | 36,200 | 1,799.00 | 65,123,800 | |
| 大幸薬品 | 27,200 | 692.00 | 18,822,400 | |
| ダイト | 11,600 | 2,715.00 | 31,494,000 | |
| 大塚ホールディングス | 375,200 | 4,130.00 | 1,549,576,000 | |
| 大正製薬ホールディングス | 43,000 | 5,360.00 | 230,480,000 | |
| ペプチドリーム | 94,700 | 2,271.00 | 215,063,700 | |
| あすか製薬ホールディングス | 20,600 | 971.00 | 20,002,600 | |
| サワイグループホールディングス | 39,500 | 4,315.00 | 170,442,500 | |
| 日本コークス工業 | 152,500 | 134.00 | 20,435,000 | |
| ニチレキ | 23,100 | 1,287.00 | 29,729,700 | |
| ユシロ化学工業 | 9,300 | 1,074.00 | 9,988,200 | |
| ビーピー・カストロール | 6,400 | 1,290.00 | 8,256,000 | |
| 富士石油 | 48,200 | 258.00 | 12,435,600 | |
| ＭＯＲＥＳＣＯ | 6,000 | 1,129.00 | 6,774,000 | |
| 出光興産 | 200,400 | 3,195.00 | 640,278,000 | |
| ＥＮＥＯＳホールディングス | 2,716,000 | 458.30 | 1,244,742,800 | |
| コスモエネルギーホールディングス | 52,300 | 2,346.00 | 122,695,800 | |
| 横浜ゴム | 104,500 | 1,752.00 | 183,084,000 | |
| ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ | 95,000 | 1,702.00 | 161,690,000 | |
| ブリヂストン | 520,100 | 5,030.00 | 2,616,103,000 | |
| 住友ゴム工業 | 162,200 | 1,188.00 | 192,693,600 | |
| 藤倉コンポジット | 14,500 | 863.00 | 12,513,500 | |
| オカモト | 10,700 | 4,085.00 | 43,709,500 | |
| フコク | 7,900 | 988.00 | 7,805,200 | |
| ニッタ | 18,700 | 2,766.00 | 51,724,200 | |
| 住友理工 | 35,000 | 596.00 | 20,860,000 | |
| 三ツ星ベルト | 21,900 | 2,079.00 | 45,530,100 | |
| バンドー化学 | 29,100 | 868.00 | 25,258,800 | |
| 日東紡績 | 26,900 | 2,834.00 | 76,234,600 | |
| ＡＧＣ | 165,700 | 5,110.00 | 846,727,000 | |
| 日本板硝子 | 86,700 | 528.00 | 45,777,600 | |
| 石塚硝子 | 3,100 | 2,078.00 | 6,441,800 | |
| 日本山村硝子 | 7,000 | 779.00 | 5,453,000 | |
| 日本電気硝子 | 72,600 | 2,842.00 | 206,329,200 | |
| オハラ | 7,200 | 1,103.00 | 7,941,600 | |
| 住友大阪セメント | 33,400 | 3,530.00 | 117,902,000 | |
| 太平洋セメント | 102,600 | 2,288.00 | 234,748,800 | |
| 日本ヒューム | 18,200 | 692.00 | 12,594,400 | |
| 日本コンクリート工業 | 36,000 | 281.00 | 10,116,000 | |
| 三谷セキサン | 8,400 | 6,340.00 | 53,256,000 | |
| アジアパイルホールディングス | 28,000 | 439.00 | 12,292,000 | |
| 東海カーボン | 151,400 | 1,242.00 | 188,038,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日本カーボン | 9,300 | 4,000.00 | 37,200,000 | |
| 東洋炭素 | 11,800 | 2,895.00 | 34,161,000 | |
| ノリタケカンパニーリミテド | 10,000 | 4,580.00 | 45,800,000 | |
| ＴＯＴＯ | 129,000 | 4,985.00 | 643,065,000 | |
| 日本碍子 | 195,600 | 1,942.00 | 379,855,200 | |
| 日本特殊陶業 | 137,400 | 2,011.00 | 276,311,400 | |
| ＭＡＲＵＷＡ | 6,200 | 15,810.00 | 98,022,000 | |
| 品川リフラクトリーズ | 4,300 | 3,845.00 | 16,533,500 | |
| 黒崎播磨 | 3,100 | 4,620.00 | 14,322,000 | |
| ヨータイ | 11,500 | 1,230.00 | 14,145,000 | |
| イソライト工業 | 8,000 | 1,198.00 | 9,584,000 | |
| 東京窯業 | 23,300 | 297.00 | 6,920,100 | |
| ニッカトー | 8,300 | 652.00 | 5,411,600 | |
| フジミインコーポレーテッド | 14,500 | 7,110.00 | 103,095,000 | |
| クニミネ工業 | 5,800 | 1,005.00 | 5,829,000 | |
| エーアンドエーマテリアル | 3,100 | 902.00 | 2,796,200 | |
| ニチアス | 41,800 | 2,641.00 | 110,393,800 | |
| ニチハ | 25,100 | 2,815.00 | 70,656,500 | |
| 日本製鉄 | 799,100 | 1,931.50 | 1,543,461,650 | |
| 神戸製鋼所 | 333,400 | 565.00 | 188,371,000 | |
| 中山製鋼所 | 28,400 | 425.00 | 12,070,000 | |
| 合同製鐵 | 9,700 | 1,404.00 | 13,618,800 | |
| ジェイ　エフ　イー　ホールディングス | 482,200 | 1,520.00 | 732,944,000 | |
| 東京製鐵 | 60,900 | 1,295.00 | 78,865,500 | |
| 共英製鋼 | 20,200 | 1,506.00 | 30,421,200 | |
| 大和工業 | 34,200 | 3,570.00 | 122,094,000 | |
| 東京鐵鋼 | 7,900 | 1,337.00 | 10,562,300 | |
| 大阪製鐵 | 9,500 | 1,174.00 | 11,153,000 | |
| 淀川製鋼所 | 23,500 | 2,458.00 | 57,763,000 | |
| 丸一鋼管 | 63,300 | 2,525.00 | 159,832,500 | |
| モリ工業 | 5,300 | 2,614.00 | 13,854,200 | |
| 大同特殊鋼 | 29,200 | 4,215.00 | 123,078,000 | |
| 日本高周波鋼業 | 6,800 | 352.00 | 2,393,600 | |
| 日本冶金工業 | 13,100 | 2,281.00 | 29,881,100 | |
| 山陽特殊製鋼 | 18,400 | 1,979.00 | 36,413,600 | |
| 愛知製鋼 | 10,100 | 2,509.00 | 25,340,900 | |
| 日立金属 | 192,400 | 2,085.00 | 401,154,000 | |
| 日本金属 | 4,500 | 1,005.00 | 4,522,500 | |
| 大平洋金属 | 11,000 | 2,253.00 | 24,783,000 | |
| 新日本電工 | 115,500 | 292.00 | 33,726,000 | |
| 栗本鐵工所 | 8,100 | 1,540.00 | 12,474,000 | |
| 虹技 | 2,500 | 985.00 | 2,462,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 三菱製鋼 | 11,500 | 1,055.00 | 12,132,500 | |
| 日亜鋼業 | 23,400 | 279.00 | 6,528,600 | |
| 日本精線 | 2,900 | 4,650.00 | 13,485,000 | |
| エンビプロ・ホールディングス | 7,600 | 1,645.00 | 12,502,000 | |
| シンニッタン | 21,900 | 223.00 | 4,883,700 | |
| 新家工業 | 4,400 | 1,637.00 | 7,202,800 | |
| 大紀アルミニウム工業所 | 27,000 | 1,667.00 | 45,009,000 | |
| 日本軽金属ホールディングス | 45,200 | 1,791.00 | 80,953,200 | |
| 三井金属鉱業 | 48,200 | 3,215.00 | 154,963,000 | |
| 東邦亜鉛 | 9,900 | 2,401.00 | 23,769,900 | |
| 三菱マテリアル | 118,000 | 2,049.00 | 241,782,000 | |
| 住友金属鉱山 | 228,200 | 5,052.00 | 1,152,866,400 | |
| ＤＯＷＡホールディングス | 48,700 | 5,020.00 | 244,474,000 | |
| 古河機械金属 | 29,500 | 1,253.00 | 36,963,500 | |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 20,700 | 840.00 | 17,388,000 | |
| 東邦チタニウム | 32,100 | 968.00 | 31,072,800 | |
| ＵＡＣＪ | 27,100 | 2,762.00 | 74,850,200 | |
| ＣＫサンエツ | 3,800 | 4,075.00 | 15,485,000 | |
| 古河電気工業 | 55,500 | 2,344.00 | 130,092,000 | |
| 住友電気工業 | 667,600 | 1,579.00 | 1,054,140,400 | |
| フジクラ | 199,200 | 610.00 | 121,512,000 | |
| 昭和電線ホールディングス | 15,600 | 1,809.00 | 28,220,400 | |
| 東京特殊電線 | 2,700 | 2,885.00 | 7,789,500 | |
| タツタ電線 | 31,700 | 476.00 | 15,089,200 | |
| カナレ電気 | 2,700 | 1,597.00 | 4,311,900 | |
| 平河ヒューテック | 10,000 | 1,114.00 | 11,140,000 | |
| リョービ | 22,000 | 1,125.00 | 24,750,000 | |
| アーレスティ | 19,200 | 392.00 | 7,526,400 | |
| アサヒホールディングス | 71,500 | 2,093.00 | 149,649,500 | |
| 稲葉製作所 | 10,000 | 1,313.00 | 13,130,000 | |
| 宮地エンジニアリンググループ | 5,400 | 3,145.00 | 16,983,000 | |
| トーカロ | 46,100 | 1,363.00 | 62,834,300 | |
| アルファＣｏ | 6,900 | 1,079.00 | 7,445,100 | |
| ＳＵＭＣＯ | 274,800 | 2,281.00 | 626,818,800 | |
| 川田テクノロジーズ | 3,600 | 3,925.00 | 14,130,000 | |
| ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ | 5,800 | 6,090.00 | 35,322,000 | |
| ジェイテックコーポレーション | 2,000 | 1,721.00 | 3,442,000 | |
| 信和 | 11,100 | 818.00 | 9,079,800 | |
| 東洋製罐グループホールディングス | 113,700 | 1,326.00 | 150,766,200 | |
| ホッカンホールディングス | 9,800 | 1,405.00 | 13,769,000 | |
| コロナ | 9,900 | 878.00 | 8,692,200 | |
| 横河ブリッジホールディングス | 30,600 | 2,178.00 | 66,646,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 駒井ハルテック | 3,300 | 2,277.00 | 7,514,100 | |
| 高田機工 | 1,600 | 2,836.00 | 4,537,600 | |
| 三和ホールディングス | 168,300 | 1,230.00 | 207,009,000 | |
| 文化シヤッター | 56,700 | 1,043.00 | 59,138,100 | |
| 三協立山 | 23,000 | 647.00 | 14,881,000 | |
| アルインコ | 13,000 | 942.00 | 12,246,000 | |
| 東洋シヤッター | 3,900 | 562.00 | 2,191,800 | |
| ＬＩＸＩＬ | 281,000 | 2,684.00 | 754,204,000 | |
| 日本フイルコン | 12,400 | 509.00 | 6,311,600 | |
| ノーリツ | 34,200 | 1,653.00 | 56,532,600 | |
| 長府製作所 | 18,200 | 1,980.00 | 36,036,000 | |
| リンナイ | 33,600 | 10,600.00 | 356,160,000 | |
| ダイニチ工業 | 8,500 | 701.00 | 5,958,500 | |
| 日東精工 | 22,400 | 576.00 | 12,902,400 | |
| 三洋工業 | 2,200 | 1,819.00 | 4,001,800 | |
| 岡部 | 36,200 | 726.00 | 26,281,200 | |
| ジーテクト | 22,200 | 1,397.00 | 31,013,400 | |
| 東プレ | 33,300 | 1,256.00 | 41,824,800 | |
| 高周波熱錬 | 31,900 | 597.00 | 19,044,300 | |
| 東京製綱 | 10,900 | 870.00 | 9,483,000 | |
| サンコール | 15,300 | 594.00 | 9,088,200 | |
| モリテック　スチール | 13,900 | 330.00 | 4,587,000 | |
| パイオラックス | 26,300 | 1,739.00 | 45,735,700 | |
| エイチワン | 17,500 | 665.00 | 11,637,500 | |
| 日本発條 | 164,200 | 941.00 | 154,512,200 | |
| 中央発條 | 8,600 | 782.00 | 6,725,200 | |
| アドバネクス | 2,400 | 1,341.00 | 3,218,400 | |
| 立川ブラインド工業 | 7,900 | 1,045.00 | 8,255,500 | |
| 三益半導体工業 | 13,900 | 2,494.00 | 34,666,600 | |
| 日本ドライケミカル | 4,500 | 1,817.00 | 8,176,500 | |
| 日本製鋼所 | 54,300 | 4,020.00 | 218,286,000 | |
| 三浦工業 | 77,300 | 3,490.00 | 269,777,000 | |
| タクマ | 60,700 | 1,424.00 | 86,436,800 | |
| ツガミ | 42,400 | 1,506.00 | 63,854,400 | |
| オークマ | 20,900 | 5,070.00 | 105,963,000 | |
| 芝浦機械 | 20,200 | 3,745.00 | 75,649,000 | |
| アマダ | 282,100 | 1,147.00 | 323,568,700 | |
| アイダエンジニアリング | 47,000 | 1,075.00 | 50,525,000 | |
| 滝澤鉄工所 | 5,200 | 1,165.00 | 6,058,000 | |
| ＦＵＪＩ | 82,300 | 2,518.00 | 207,231,400 | |
| 牧野フライス製作所 | 19,600 | 3,955.00 | 77,518,000 | |
| オーエスジー | 82,700 | 2,015.00 | 166,640,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ダイジェット工業 | 2,300 | 962.00 | 2,212,600 | |
| 旭ダイヤモンド工業 | 47,300 | 588.00 | 27,812,400 | |
| DMG森精機 | 106,000 | 1,896.00 | 200,976,000 | |
| ソディック | 39,700 | 810.00 | 32,157,000 | |
| ディスコ | 26,300 | 33,250.00 | 874,475,000 | |
| 日東工器 | 9,800 | 1,679.00 | 16,454,200 | |
| 日進工具 | 14,100 | 1,410.00 | 19,881,000 | |
| パンチ工業 | 15,100 | 491.00 | 7,414,100 | |
| 冨士ダイス | 9,100 | 616.00 | 5,605,600 | |
| 豊和工業 | 9,500 | 749.00 | 7,115,500 | |
| ＯＫＫ | 6,800 | 1,039.00 | 7,065,200 | |
| 東洋機械金属 | 11,800 | 497.00 | 5,864,600 | |
| 津田駒工業 | 3,400 | 590.00 | 2,006,000 | |
| エンシュウ | 4,400 | 600.00 | 2,640,000 | |
| 島精機製作所 | 26,200 | 1,889.00 | 49,491,800 | |
| オプトラン | 22,400 | 2,327.00 | 52,124,800 | |
| ＮＣホールディングス | 5,100 | 1,695.00 | 8,644,500 | |
| イワキポンプ | 11,400 | 980.00 | 11,172,000 | |
| フリュー | 15,900 | 1,207.00 | 19,191,300 | |
| ヤマシンフィルタ | 36,200 | 443.00 | 16,036,600 | |
| 日阪製作所 | 22,100 | 806.00 | 17,812,600 | |
| やまびこ | 34,700 | 1,077.00 | 37,371,900 | |
| 野村マイクロ・サイエンス | 4,700 | 4,660.00 | 21,902,000 | |
| 平田機工 | 8,500 | 6,180.00 | 52,530,000 | |
| ペガサスミシン製造 | 18,300 | 482.00 | 8,820,600 | |
| マルマエ | 7,300 | 2,683.00 | 19,585,900 | |
| タツモ | 8,400 | 1,397.00 | 11,734,800 | |
| ナブテスコ | 101,900 | 3,625.00 | 369,387,500 | |
| 三井海洋開発 | 19,000 | 1,462.00 | 27,778,000 | |
| レオン自動機 | 19,200 | 1,041.00 | 19,987,200 | |
| ＳＭＣ | 52,900 | 67,600.00 | 3,576,040,000 | |
| ホソカワミクロン | 12,600 | 2,993.00 | 37,711,800 | |
| ユニオンツール | 6,700 | 3,800.00 | 25,460,000 | |
| オイレス工業 | 25,100 | 1,588.00 | 39,858,800 | |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 6,100 | 3,210.00 | 19,581,000 | |
| サトーホールディングス | 23,500 | 2,065.00 | 48,527,500 | |
| 技研製作所 | 15,800 | 3,925.00 | 62,015,000 | |
| 日本エアーテック | 8,300 | 1,075.00 | 8,922,500 | |
| カワタ | 5,800 | 1,051.00 | 6,095,800 | |
| 日精樹脂工業 | 12,700 | 1,050.00 | 13,335,000 | |
| オカダアイヨン | 5,700 | 1,451.00 | 8,270,700 | |
| ワイエイシイホールディングス | 7,100 | 1,093.00 | 7,760,300 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 小松製作所 | 818,300 | 2,915.00 | 2,385,344,500 | |
| 住友重機械工業 | 103,400 | 2,935.00 | 303,479,000 | |
| 日立建機 | 72,400 | 2,981.00 | 215,824,400 | |
| 日工 | 25,100 | 612.00 | 15,361,200 | |
| 巴工業 | 7,100 | 2,157.00 | 15,314,700 | |
| 井関農機 | 16,900 | 1,349.00 | 22,798,100 | |
| ＴＯＷＡ | 15,500 | 2,660.00 | 41,230,000 | |
| 丸山製作所 | 3,800 | 1,458.00 | 5,540,400 | |
| 北川鉄工所 | 8,300 | 1,352.00 | 11,221,600 | |
| ローツェ | 8,900 | 11,540.00 | 102,706,000 | |
| タカキタ | 6,400 | 610.00 | 3,904,000 | |
| クボタ | 880,800 | 2,525.00 | 2,224,020,000 | |
| 荏原実業 | 8,400 | 2,213.00 | 18,589,200 | |
| 三菱化工機 | 5,900 | 2,080.00 | 12,272,000 | |
| 月島機械 | 33,500 | 1,051.00 | 35,208,500 | |
| 帝国電機製作所 | 12,700 | 1,375.00 | 17,462,500 | |
| 新東工業 | 40,200 | 689.00 | 27,697,800 | |
| 澁谷工業 | 15,900 | 2,571.00 | 40,878,900 | |
| アイチ　コーポレーション | 26,500 | 812.00 | 21,518,000 | |
| 小森コーポレーション | 46,100 | 684.00 | 31,532,400 | |
| 鶴見製作所 | 14,000 | 1,652.00 | 23,128,000 | |
| 住友精密工業 | 2,700 | 1,970.00 | 5,319,000 | |
| 日本ギア工業 | 6,800 | 265.00 | 1,802,000 | |
| 酒井重工業 | 3,300 | 2,685.00 | 8,860,500 | |
| 荏原製作所 | 75,000 | 5,960.00 | 447,000,000 | |
| 石井鐵工所 | 2,600 | 2,979.00 | 7,745,400 | |
| 酉島製作所 | 16,600 | 891.00 | 14,790,600 | |
| 北越工業 | 17,000 | 945.00 | 16,065,000 | |
| ダイキン工業 | 230,000 | 24,810.00 | 5,706,300,000 | |
| オルガノ | 5,200 | 8,700.00 | 45,240,000 | |
| トーヨーカネツ | 6,900 | 2,488.00 | 17,167,200 | |
| 栗田工業 | 97,800 | 5,020.00 | 490,956,000 | |
| 椿本チエイン | 23,700 | 3,180.00 | 75,366,000 | |
| 大同工業 | 8,200 | 961.00 | 7,880,200 | |
| 木村化工機 | 15,300 | 744.00 | 11,383,200 | |
| アネスト岩田 | 28,200 | 727.00 | 20,501,400 | |
| ダイフク | 99,400 | 8,360.00 | 830,984,000 | |
| サムコ | 4,500 | 2,334.00 | 10,503,000 | |
| 加藤製作所 | 8,900 | 818.00 | 7,280,200 | |
| 油研工業 | 3,200 | 1,723.00 | 5,513,600 | |
| タダノ | 94,600 | 1,160.00 | 109,736,000 | |
| フジテック | 67,000 | 2,700.00 | 180,900,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ＣＫＤ | 53,300 | 2,146.00 | 114,381,800 | |
| キトー | 15,400 | 1,750.00 | 26,950,000 | |
| 平和 | 50,400 | 1,862.00 | 93,844,800 | |
| 理想科学工業 | 15,200 | 2,065.00 | 31,388,000 | |
| ＳＡＮＫＹＯ | 39,000 | 3,000.00 | 117,000,000 | |
| 日本金銭機械 | 18,400 | 630.00 | 11,592,000 | |
| マースグループホールディングス | 11,500 | 1,604.00 | 18,446,000 | |
| フクシマガリレイ | 12,400 | 4,285.00 | 53,134,000 | |
| オーイズミ | 6,600 | 380.00 | 2,508,000 | |
| ダイコク電機 | 8,400 | 1,191.00 | 10,004,400 | |
| 竹内製作所 | 27,500 | 2,909.00 | 79,997,500 | |
| アマノ | 47,300 | 2,426.00 | 114,749,800 | |
| ＪＵＫＩ | 25,100 | 782.00 | 19,628,200 | |
| ジャノメ | 15,500 | 717.00 | 11,113,500 | |
| マックス | 24,000 | 1,790.00 | 42,960,000 | |
| グローリー | 46,400 | 2,139.00 | 99,249,600 | |
| 新晃工業 | 16,800 | 1,796.00 | 30,172,800 | |
| 大和冷機工業 | 26,200 | 1,126.00 | 29,501,200 | |
| セガサミーホールディングス | 179,100 | 1,889.00 | 338,319,900 | |
| 日本ピストンリング | 6,700 | 1,286.00 | 8,616,200 | |
| リケン | 7,800 | 2,580.00 | 20,124,000 | |
| ＴＰＲ | 24,400 | 1,465.00 | 35,746,000 | |
| ツバキ・ナカシマ | 39,700 | 1,436.00 | 57,009,200 | |
| ホシザキ | 52,800 | 8,440.00 | 445,632,000 | |
| 大豊工業 | 14,800 | 826.00 | 12,224,800 | |
| 日本精工 | 340,000 | 785.00 | 266,900,000 | |
| ＮＴＮ | 388,000 | 240.00 | 93,120,000 | |
| ジェイテクト | 173,300 | 1,007.00 | 174,513,100 | |
| 不二越 | 15,400 | 4,295.00 | 66,143,000 | |
| 日本トムソン | 49,600 | 628.00 | 31,148,800 | |
| ＴＨＫ | 104,500 | 2,803.00 | 292,913,500 | |
| ユーシン精機 | 14,100 | 713.00 | 10,053,300 | |
| 前澤給装工業 | 13,600 | 975.00 | 13,260,000 | |
| イーグル工業 | 22,400 | 1,095.00 | 24,528,000 | |
| 前澤工業 | 11,000 | 622.00 | 6,842,000 | |
| 日本ピラー工業 | 18,300 | 3,330.00 | 60,939,000 | |
| キッツ | 60,900 | 651.00 | 39,645,900 | |
| マキタ | 219,800 | 4,673.00 | 1,027,125,400 | |
| 三井Ｅ＆Ｓホールディングス | 65,200 | 398.00 | 25,949,600 | |
| 日立造船 | 153,000 | 776.00 | 118,728,000 | |
| 三菱重工業 | 283,800 | 3,061.00 | 868,711,800 | |
| ＩＨＩ | 112,800 | 2,346.00 | 264,628,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| スター精密 | 27,700 | 1,472.00 | 40,774,400 | |
| 日清紡ホールディングス | 110,400 | 935.00 | 103,224,000 | |
| イビデン | 94,900 | 6,370.00 | 604,513,000 | |
| コニカミノルタ | 396,100 | 527.00 | 208,744,700 | |
| ブラザー工業 | 220,900 | 2,227.00 | 491,944,300 | |
| ミネベアミツミ | 311,500 | 2,885.00 | 898,677,500 | |
| 日立製作所 | 868,400 | 6,377.00 | 5,537,786,800 | |
| 東芝 | 315,500 | 4,832.00 | 1,524,496,000 | |
| 三菱電機 | 1,805,300 | 1,472.00 | 2,657,401,600 | |
| 富士電機 | 108,800 | 5,740.00 | 624,512,000 | |
| 東洋電機製造 | 7,100 | 965.00 | 6,851,500 | |
| 安川電機 | 194,300 | 5,060.00 | 983,158,000 | |
| シンフォニアテクノロジー | 21,700 | 1,210.00 | 26,257,000 | |
| 明電舎 | 30,600 | 2,581.00 | 78,978,600 | |
| オリジン | 4,500 | 1,237.00 | 5,566,500 | |
| 山洋電気 | 8,100 | 5,350.00 | 43,335,000 | |
| デンヨー | 15,400 | 1,695.00 | 26,103,000 | |
| ＰＨＣホールディングス | 21,100 | 1,752.00 | 36,967,200 | |
| 東芝テック | 19,400 | 4,350.00 | 84,390,000 | |
| 芝浦メカトロニクス | 3,300 | 8,560.00 | 28,248,000 | |
| マブチモーター | 42,500 | 3,765.00 | 160,012,500 | |
| 日本電産 | 468,000 | 11,635.00 | 5,445,180,000 | |
| トレックス・セミコンダクター | 9,300 | 2,811.00 | 26,142,300 | |
| 東光高岳 | 10,800 | 1,394.00 | 15,055,200 | |
| ダイヘン | 19,700 | 4,335.00 | 85,399,500 | |
| ヤーマン | 30,300 | 878.00 | 26,603,400 | |
| ＪＶＣケンウッド | 152,100 | 181.00 | 27,530,100 | |
| ミマキエンジニアリング | 17,300 | 791.00 | 13,684,300 | |
| Ｉ－ＰＥＸ | 8,900 | 1,795.00 | 15,975,500 | |
| 日新電機 | 42,300 | 1,548.00 | 65,480,400 | |
| 大崎電気工業 | 33,100 | 465.00 | 15,391,500 | |
| オムロン | 150,300 | 9,610.00 | 1,444,383,000 | |
| 日東工業 | 24,100 | 1,529.00 | 36,848,900 | |
| ＩＤＥＣ | 22,300 | 2,489.00 | 55,504,700 | |
| 正興電機製作所 | 6,600 | 1,037.00 | 6,844,200 | |
| 不二電機工業 | 4,300 | 1,196.00 | 5,142,800 | |
| ジーエス・ユアサ　コーポレーション | 60,300 | 2,528.00 | 152,438,400 | |
| サクサホールディングス | 4,200 | 1,270.00 | 5,334,000 | |
| メルコホールディングス | 5,200 | 3,690.00 | 19,188,000 | |
| テクノメディカ | 4,700 | 1,610.00 | 7,567,000 | |
| 日本電気 | 229,400 | 5,180.00 | 1,188,292,000 | |
| 富士通 | 162,400 | 18,875.00 | 3,065,300,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 沖電気工業 | 73,300 | 903.00 | 66,189,900 | |
| 岩崎通信機 | 7,400 | 814.00 | 6,023,600 | |
| 電気興業 | 9,500 | 2,360.00 | 22,420,000 | |
| サンケン電気 | 16,900 | 5,140.00 | 86,866,000 | |
| ナカヨ | 3,300 | 1,172.00 | 3,867,600 | |
| アイホン | 10,200 | 2,075.00 | 21,165,000 | |
| ルネサスエレクトロニクス | 979,600 | 1,382.00 | 1,353,807,200 | |
| セイコーエプソン | 224,000 | 2,014.00 | 451,136,000 | |
| ワコム | 141,000 | 877.00 | 123,657,000 | |
| アルバック | 33,200 | 6,170.00 | 204,844,000 | |
| アクセル | 9,000 | 1,112.00 | 10,008,000 | |
| ＥＩＺＯ | 14,000 | 3,910.00 | 54,740,000 | |
| 日本信号 | 46,000 | 878.00 | 40,388,000 | |
| 京三製作所 | 38,700 | 416.00 | 16,099,200 | |
| 能美防災 | 24,300 | 2,080.00 | 50,544,000 | |
| ホーチキ | 13,900 | 1,201.00 | 16,693,900 | |
| 星和電機 | 10,400 | 623.00 | 6,479,200 | |
| エレコム | 41,900 | 1,436.00 | 60,168,400 | |
| パナソニック | 1,925,600 | 1,293.50 | 2,490,763,600 | |
| シャープ | 205,800 | 1,315.00 | 270,627,000 | |
| アンリツ | 116,300 | 1,692.00 | 196,779,600 | |
| 富士通ゼネラル | 49,000 | 2,558.00 | 125,342,000 | |
| ソニーグループ | 1,131,000 | 13,135.00 | 14,855,685,000 | |
| ＴＤＫ | 261,700 | 4,235.00 | 1,108,299,500 | |
| 帝国通信工業 | 8,800 | 1,317.00 | 11,589,600 | |
| タムラ製作所 | 69,600 | 652.00 | 45,379,200 | |
| アルプスアルパイン | 160,600 | 1,122.00 | 180,193,200 | |
| 池上通信機 | 5,300 | 637.00 | 3,376,100 | |
| 日本電波工業 | 16,800 | 1,416.00 | 23,788,800 | |
| 鈴木 | 9,300 | 857.00 | 7,970,100 | |
| メイコー | 14,800 | 4,200.00 | 62,160,000 | |
| 日本トリム | 3,700 | 3,010.00 | 11,137,000 | |
| ローランド　ディー．ジー． | 10,900 | 2,968.00 | 32,351,200 | |
| フォスター電機 | 18,200 | 738.00 | 13,431,600 | |
| ＳＭＫ | 4,200 | 2,173.00 | 9,126,600 | |
| ヨコオ | 13,700 | 2,615.00 | 35,825,500 | |
| ホシデン | 44,300 | 1,133.00 | 50,191,900 | |
| ヒロセ電機 | 27,800 | 17,450.00 | 485,110,000 | |
| 日本航空電子工業 | 41,400 | 1,929.00 | 79,860,600 | |
| ＴＯＡ | 19,400 | 762.00 | 14,782,800 | |
| マクセル | 36,500 | 1,352.00 | 49,348,000 | |
| 古野電気 | 22,200 | 1,010.00 | 22,422,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ユニデンホールディングス | 4,000 | 3,465.00 | 13,860,000 | |
| スミダコーポレーション | 17,700 | 1,041.00 | 18,425,700 | |
| アイコム | 6,700 | 2,337.00 | 15,657,900 | |
| リオン | 7,300 | 2,106.00 | 15,373,800 | |
| 本多通信工業 | 16,600 | 411.00 | 6,822,600 | |
| 横河電機 | 180,700 | 1,985.00 | 358,689,500 | |
| 新電元工業 | 7,000 | 3,430.00 | 24,010,000 | |
| アズビル | 105,800 | 4,720.00 | 499,376,000 | |
| 東亜ディーケーケー | 10,200 | 868.00 | 8,853,600 | |
| 日本光電工業 | 74,900 | 3,055.00 | 228,819,500 | |
| チノー | 5,700 | 1,568.00 | 8,937,600 | |
| 共和電業 | 17,300 | 373.00 | 6,452,900 | |
| 日本電子材料 | 9,100 | 2,472.00 | 22,495,200 | |
| 堀場製作所 | 33,400 | 6,150.00 | 205,410,000 | |
| アドバンテスト | 134,200 | 10,050.00 | 1,348,710,000 | |
| 小野測器 | 9,800 | 471.00 | 4,615,800 | |
| エスペック | 15,000 | 2,027.00 | 30,405,000 | |
| キーエンス | 163,600 | 61,940.00 | 10,133,384,000 | |
| 日置電機 | 8,700 | 7,790.00 | 67,773,000 | |
| シスメックス | 152,800 | 11,335.00 | 1,731,988,000 | |
| 日本マイクロニクス | 31,900 | 1,627.00 | 51,901,300 | |
| メガチップス | 17,000 | 4,600.00 | 78,200,000 | |
| ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ | 8,400 | 3,285.00 | 27,594,000 | |
| 澤藤電機 | 2,800 | 1,564.00 | 4,379,200 | |
| 原田工業 | 9,600 | 967.00 | 9,283,200 | |
| コーセル | 23,000 | 808.00 | 18,584,000 | |
| イリソ電子工業 | 15,400 | 4,455.00 | 68,607,000 | |
| オプテックスグループ | 30,100 | 1,481.00 | 44,578,100 | |
| 千代田インテグレ | 8,000 | 1,856.00 | 14,848,000 | |
| アイ・オー・データ機器 | 8,100 | 745.00 | 6,034,500 | |
| レーザーテック | 79,300 | 28,025.00 | 2,222,382,500 | |
| スタンレー電気 | 126,700 | 2,850.00 | 361,095,000 | |
| 岩崎電気 | 7,000 | 2,270.00 | 15,890,000 | |
| ウシオ電機 | 93,000 | 1,790.00 | 166,470,000 | |
| 岡谷電機産業 | 16,400 | 316.00 | 5,182,400 | |
| ヘリオス　テクノ　ホールディング | 19,400 | 293.00 | 5,684,200 | |
| エノモト | 5,600 | 1,754.00 | 9,822,400 | |
| 日本セラミック | 17,100 | 2,482.00 | 42,442,200 | |
| 遠藤照明 | 9,300 | 992.00 | 9,225,600 | |
| 古河電池 | 13,500 | 1,293.00 | 17,455,500 | |
| 双信電機 | 9,600 | 687.00 | 6,595,200 | |
| 山一電機 | 13,400 | 2,088.00 | 27,979,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 図研 | 12,000 | 2,979.00 | 35,748,000 | |
| 日本電子 | 37,600 | 6,570.00 | 247,032,000 | |
| カシオ計算機 | 130,700 | 1,472.00 | 192,390,400 | |
| ファナック | 158,400 | 22,715.00 | 3,598,056,000 | |
| 日本シイエムケイ | 37,200 | 594.00 | 22,096,800 | |
| エンプラス | 4,900 | 2,820.00 | 13,818,000 | |
| 大真空 | 24,900 | 1,305.00 | 32,494,500 | |
| ローム | 80,900 | 10,130.00 | 819,517,000 | |
| 浜松ホトニクス | 129,600 | 5,990.00 | 776,304,000 | |
| 三井ハイテック | 17,800 | 8,820.00 | 156,996,000 | |
| 新光電気工業 | 53,200 | 4,905.00 | 260,946,000 | |
| 京セラ | 254,100 | 6,835.00 | 1,736,773,500 | |
| 太陽誘電 | 87,700 | 5,860.00 | 513,922,000 | |
| 村田製作所 | 530,400 | 8,653.00 | 4,589,551,200 | |
| 双葉電子工業 | 32,200 | 675.00 | 21,735,000 | |
| 北陸電気工業 | 7,700 | 1,228.00 | 9,455,600 | |
| ニチコン | 57,500 | 1,219.00 | 70,092,500 | |
| 日本ケミコン | 17,100 | 1,733.00 | 29,634,300 | |
| ＫＯＡ | 27,800 | 1,503.00 | 41,783,400 | |
| 市光工業 | 23,600 | 518.00 | 12,224,800 | |
| 小糸製作所 | 99,300 | 6,260.00 | 621,618,000 | |
| ミツバ | 33,200 | 409.00 | 13,578,800 | |
| ＳＣＲＥＥＮホールディングス | 31,300 | 11,970.00 | 374,661,000 | |
| キヤノン電子 | 17,100 | 1,544.00 | 26,402,400 | |
| キヤノン | 897,100 | 2,770.00 | 2,484,967,000 | |
| リコー | 501,000 | 1,108.00 | 555,108,000 | |
| 象印マホービン | 49,400 | 1,334.00 | 65,899,600 | |
| ＭＵＴＯＨホールディングス | 3,000 | 2,195.00 | 6,585,000 | |
| 東京エレクトロン | 114,600 | 61,310.00 | 7,026,126,000 | |
| トヨタ紡織 | 73,600 | 2,200.00 | 161,920,000 | |
| 芦森工業 | 3,400 | 929.00 | 3,158,600 | |
| ユニプレス | 26,900 | 842.00 | 22,649,800 | |
| 豊田自動織機 | 146,100 | 9,390.00 | 1,371,879,000 | |
| モリタホールディングス | 28,900 | 1,273.00 | 36,789,700 | |
| 三櫻工業 | 25,000 | 874.00 | 21,850,000 | |
| デンソー | 397,500 | 9,191.00 | 3,653,422,500 | |
| 東海理化電機製作所 | 47,500 | 1,530.00 | 72,675,000 | |
| 川崎重工業 | 131,800 | 2,283.00 | 300,899,400 | |
| 名村造船所 | 54,200 | 197.00 | 10,677,400 | |
| 日本車輌製造 | 6,600 | 2,031.00 | 13,404,600 | |
| 三菱ロジスネクスト | 23,900 | 1,037.00 | 24,784,300 | |
| 近畿車輛 | 2,700 | 1,004.00 | 2,710,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日産自動車 | 2,129,200 | 618.10 | 1,316,058,520 | |
| いすゞ自動車 | 566,500 | 1,433.00 | 811,794,500 | |
| トヨタ自動車 | 9,144,900 | 2,342.50 | 21,421,928,250 | |
| 日野自動車 | 225,400 | 973.00 | 219,314,200 | |
| 三菱自動車工業 | 668,300 | 322.00 | 215,192,600 | |
| エフテック | 12,600 | 599.00 | 7,547,400 | |
| レシップホールディングス | 7,200 | 548.00 | 3,945,600 | |
| ＧＭＢ | 3,300 | 772.00 | 2,547,600 | |
| ファルテック | 3,200 | 700.00 | 2,240,000 | |
| 武蔵精密工業 | 40,300 | 1,935.00 | 77,980,500 | |
| 日産車体 | 26,400 | 688.00 | 18,163,200 | |
| 新明和工業 | 51,000 | 878.00 | 44,778,000 | |
| 極東開発工業 | 33,500 | 1,431.00 | 47,938,500 | |
| トピー工業 | 14,800 | 1,096.00 | 16,220,800 | |
| ティラド | 5,200 | 2,739.00 | 14,242,800 | |
| 曙ブレーキ工業 | 99,100 | 180.00 | 17,838,000 | |
| タチエス | 31,600 | 1,224.00 | 38,678,400 | |
| ＮＯＫ | 87,300 | 1,239.00 | 108,164,700 | |
| フタバ産業 | 45,200 | 434.00 | 19,616,800 | |
| ＫＹＢ | 18,800 | 3,110.00 | 58,468,000 | |
| 大同メタル工業 | 34,600 | 617.00 | 21,348,200 | |
| プレス工業 | 89,500 | 395.00 | 35,352,500 | |
| ミクニ | 22,900 | 460.00 | 10,534,000 | |
| 太平洋工業 | 37,800 | 1,146.00 | 43,318,800 | |
| 河西工業 | 22,100 | 305.00 | 6,740,500 | |
| アイシン | 132,100 | 4,410.00 | 582,561,000 | |
| マツダ | 566,600 | 943.00 | 534,303,800 | |
| 今仙電機製作所 | 12,100 | 584.00 | 7,066,400 | |
| 本田技研工業 | 1,421,500 | 3,420.00 | 4,861,530,000 | |
| スズキ | 412,900 | 4,651.00 | 1,920,397,900 | |
| ＳＵＢＡＲＵ | 517,400 | 2,123.00 | 1,098,440,200 | |
| 安永 | 8,700 | 859.00 | 7,473,300 | |
| ヤマハ発動機 | 235,600 | 2,784.00 | 655,910,400 | |
| ＴＢＫ | 20,000 | 395.00 | 7,900,000 | |
| エクセディ | 27,200 | 1,675.00 | 45,560,000 | |
| 豊田合成 | 58,300 | 2,477.00 | 144,409,100 | |
| 愛三工業 | 28,300 | 732.00 | 20,715,600 | |
| 盟和産業 | 2,600 | 1,000.00 | 2,600,000 | |
| 日本プラスト | 14,100 | 554.00 | 7,811,400 | |
| ヨロズ | 16,900 | 1,013.00 | 17,119,700 | |
| エフ・シー・シー | 29,500 | 1,507.00 | 44,456,500 | |
| シマノ | 72,500 | 26,860.00 | 1,947,350,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| テイ・エス　テック | 76,200 | 1,468.00 | 111,861,600 | |
| ジャムコ | 10,500 | 878.00 | 9,219,000 | |
| テルモ | 510,900 | 4,236.00 | 2,164,172,400 | |
| クリエートメディック | 5,400 | 970.00 | 5,238,000 | |
| 日機装 | 54,200 | 855.00 | 46,341,000 | |
| 日本エム・ディ・エム | 10,400 | 1,576.00 | 16,390,400 | |
| 島津製作所 | 232,300 | 4,075.00 | 946,622,500 | |
| ＪＭＳ | 15,300 | 609.00 | 9,317,700 | |
| 長野計器 | 13,100 | 1,365.00 | 17,881,500 | |
| ブイ・テクノロジー | 7,900 | 3,520.00 | 27,808,000 | |
| 東京計器 | 11,500 | 975.00 | 11,212,500 | |
| 愛知時計電機 | 2,600 | 5,460.00 | 14,196,000 | |
| インターアクション | 9,000 | 1,999.00 | 17,991,000 | |
| オーバル | 16,300 | 246.00 | 4,009,800 | |
| 東京精密 | 30,500 | 4,910.00 | 149,755,000 | |
| マニー | 71,900 | 1,659.00 | 119,282,100 | |
| ニコン | 275,700 | 1,217.00 | 335,526,900 | |
| トプコン | 84,900 | 1,485.00 | 126,076,500 | |
| オリンパス | 946,800 | 2,420.00 | 2,291,256,000 | |
| 理研計器 | 14,600 | 5,410.00 | 78,986,000 | |
| タムロン | 14,000 | 2,596.00 | 36,344,000 | |
| ＨＯＹＡ | 352,300 | 15,235.00 | 5,367,290,500 | |
| シード | 8,500 | 532.00 | 4,522,000 | |
| ノーリツ鋼機 | 16,200 | 2,306.00 | 37,357,200 | |
| エー・アンド・デイ | 16,500 | 1,037.00 | 17,110,500 | |
| 朝日インテック | 197,900 | 2,086.00 | 412,819,400 | |
| シチズン時計 | 211,500 | 499.00 | 105,538,500 | |
| リズム | 5,700 | 1,226.00 | 6,988,200 | |
| 大研医器 | 14,300 | 521.00 | 7,450,300 | |
| メニコン | 59,900 | 2,816.00 | 168,678,400 | |
| シンシア | 2,000 | 511.00 | 1,022,000 | |
| 松風 | 7,500 | 1,832.00 | 13,740,000 | |
| セイコーホールディングス | 25,500 | 2,109.00 | 53,779,500 | |
| ニプロ | 134,600 | 1,069.00 | 143,887,400 | |
| 中本パックス | 5,000 | 1,683.00 | 8,415,000 | |
| スノーピーク | 23,500 | 2,364.00 | 55,554,000 | |
| パラマウントベッドホールディングス | 34,600 | 1,977.00 | 68,404,200 | |
| トランザクション | 9,900 | 1,073.00 | 10,622,700 | |
| 粧美堂 | 5,300 | 394.00 | 2,088,200 | |
| ニホンフラッシュ | 15,500 | 1,014.00 | 15,717,000 | |
| 前田工繊 | 19,900 | 3,540.00 | 70,446,000 | |
| 永大産業 | 23,600 | 288.00 | 6,796,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| アートネイチャー | 15,400 | 688.00 | 10,595,200 | |
| バンダイナムコホールディングス | 161,800 | 8,058.00 | 1,303,784,400 | |
| アイフィスジャパン | 4,600 | 668.00 | 3,072,800 | |
| 共立印刷 | 30,200 | 134.00 | 4,046,800 | |
| ＳＨＯＥＩ | 16,900 | 4,245.00 | 71,740,500 | |
| フランスベッドホールディングス | 23,200 | 874.00 | 20,276,800 | |
| パイロットコーポレーション | 30,500 | 4,040.00 | 123,220,000 | |
| 萩原工業 | 11,700 | 1,198.00 | 14,016,600 | |
| フジシールインターナショナル | 43,800 | 2,198.00 | 96,272,400 | |
| タカラトミー | 75,600 | 1,114.00 | 84,218,400 | |
| 広済堂ホールディングス | 11,200 | 752.00 | 8,422,400 | |
| エステールホールディングス | 4,500 | 632.00 | 2,844,000 | |
| タカノ | 6,200 | 680.00 | 4,216,000 | |
| プロネクサス | 14,000 | 1,066.00 | 14,924,000 | |
| ホクシン | 12,700 | 158.00 | 2,006,600 | |
| ウッドワン | 5,500 | 1,013.00 | 5,571,500 | |
| 大建工業 | 10,600 | 2,069.00 | 21,931,400 | |
| 凸版印刷 | 274,400 | 2,163.00 | 593,527,200 | |
| 大日本印刷 | 213,400 | 2,806.00 | 598,800,400 | |
| 共同印刷 | 5,500 | 2,680.00 | 14,740,000 | |
| ＮＩＳＳＨＡ | 37,100 | 1,503.00 | 55,761,300 | |
| 光村印刷 | 1,600 | 1,366.00 | 2,185,600 | |
| ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ | 8,800 | 1,776.00 | 15,628,800 | |
| アシックス | 159,600 | 2,214.00 | 353,354,400 | |
| ツツミ | 4,500 | 1,787.00 | 8,041,500 | |
| ローランド | 12,500 | 4,185.00 | 52,312,500 | |
| 小松ウオール工業 | 5,500 | 1,872.00 | 10,296,000 | |
| ヤマハ | 107,400 | 5,230.00 | 561,702,000 | |
| 河合楽器製作所 | 5,100 | 3,110.00 | 15,861,000 | |
| クリナップ | 16,800 | 525.00 | 8,820,000 | |
| ピジョン | 109,100 | 2,283.00 | 249,075,300 | |
| 兼松サステック | 1,200 | 1,615.00 | 1,938,000 | |
| キングジム | 14,500 | 875.00 | 12,687,500 | |
| リンテック | 38,700 | 2,675.00 | 103,522,500 | |
| イトーキ | 33,300 | 340.00 | 11,322,000 | |
| 任天堂 | 101,900 | 54,780.00 | 5,582,082,000 | |
| 三菱鉛筆 | 29,700 | 1,189.00 | 35,313,300 | |
| タカラスタンダード | 37,300 | 1,351.00 | 50,392,300 | |
| コクヨ | 86,600 | 1,671.00 | 144,708,600 | |
| ナカバヤシ | 16,100 | 503.00 | 8,098,300 | |
| グローブライド | 16,100 | 2,883.00 | 46,416,300 | |
| オカムラ | 62,000 | 1,190.00 | 73,780,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 美津濃 | 17,900 | 2,167.00 | 38,789,300 | |
| 東京電力ホールディングス | 1,351,200 | 291.00 | 393,199,200 | |
| 中部電力 | 552,300 | 1,223.00 | 675,462,900 | |
| 関西電力 | 684,000 | 1,092.00 | 746,928,000 | |
| 中国電力 | 282,100 | 954.00 | 269,123,400 | |
| 北陸電力 | 165,100 | 582.00 | 96,088,200 | |
| 東北電力 | 422,800 | 809.00 | 342,045,200 | |
| 四国電力 | 162,600 | 803.00 | 130,567,800 | |
| 九州電力 | 372,100 | 847.00 | 315,168,700 | |
| 北海道電力 | 156,900 | 503.00 | 78,920,700 | |
| 沖縄電力 | 38,300 | 1,404.00 | 53,773,200 | |
| 電源開発 | 153,900 | 1,475.00 | 227,002,500 | |
| エフオン | 10,900 | 541.00 | 5,896,900 | |
| イーレックス | 26,600 | 1,582.00 | 42,081,200 | |
| レノバ | 35,200 | 1,587.00 | 55,862,400 | |
| 東京瓦斯 | 346,100 | 2,192.00 | 758,651,200 | |
| 大阪瓦斯 | 327,000 | 1,922.00 | 628,494,000 | |
| 東邦瓦斯 | 82,900 | 2,920.00 | 242,068,000 | |
| 北海道瓦斯 | 8,900 | 1,487.00 | 13,234,300 | |
| 広島ガス | 34,400 | 359.00 | 12,349,600 | |
| 西部ガスホールディングス | 20,300 | 2,126.00 | 43,157,800 | |
| 静岡ガス | 47,000 | 965.00 | 45,355,000 | |
| メタウォーター | 20,200 | 1,876.00 | 37,895,200 | |
| ＳＢＳホールディングス | 13,400 | 3,570.00 | 47,838,000 | |
| 東武鉄道 | 176,400 | 2,647.00 | 466,930,800 | |
| 相鉄ホールディングス | 57,800 | 2,105.00 | 121,669,000 | |
| 東急 | 455,300 | 1,501.00 | 683,405,300 | |
| 京浜急行電鉄 | 231,900 | 1,164.00 | 269,931,600 | |
| 小田急電鉄 | 268,500 | 2,053.00 | 551,230,500 | |
| 京王電鉄 | 93,700 | 5,160.00 | 483,492,000 | |
| 京成電鉄 | 125,600 | 3,020.00 | 379,312,000 | |
| 富士急行 | 21,500 | 3,985.00 | 85,677,500 | |
| 新京成電鉄 | 4,200 | 2,008.00 | 8,433,600 | |
| 東日本旅客鉄道 | 317,800 | 6,645.00 | 2,111,781,000 | |
| 西日本旅客鉄道 | 218,800 | 4,798.00 | 1,049,802,400 | |
| 東海旅客鉄道 | 150,100 | 14,760.00 | 2,215,476,000 | |
| 西武ホールディングス | 235,700 | 1,099.00 | 259,034,300 | |
| 鴻池運輸 | 28,700 | 1,146.00 | 32,890,200 | |
| 西日本鉄道 | 50,000 | 2,541.00 | 127,050,000 | |
| ハマキョウレックス | 12,800 | 2,839.00 | 36,339,200 | |
| サカイ引越センター | 8,300 | 4,310.00 | 35,773,000 | |
| 近鉄グループホールディングス | 171,000 | 3,325.00 | 568,575,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 阪急阪神ホールディングス | 213,800 | 3,270.00 | 699,126,000 | |
| 南海電気鉄道 | 76,300 | 2,224.00 | 169,691,200 | |
| 京阪ホールディングス | 76,100 | 2,732.00 | 207,905,200 | |
| 神戸電鉄 | 4,100 | 3,125.00 | 12,812,500 | |
| 名古屋鉄道 | 140,600 | 1,833.00 | 257,719,800 | |
| 山陽電気鉄道 | 13,100 | 1,970.00 | 25,807,000 | |
| アルプス物流 | 11,900 | 1,017.00 | 12,102,300 | |
| ヤマトホールディングス | 239,600 | 2,378.00 | 569,768,800 | |
| 山九 | 45,000 | 4,640.00 | 208,800,000 | |
| 丸運 | 9,700 | 241.00 | 2,337,700 | |
| 丸全昭和運輸 | 13,900 | 3,110.00 | 43,229,000 | |
| センコーグループホールディングス | 85,700 | 920.00 | 78,844,000 | |
| トナミホールディングス | 4,100 | 3,620.00 | 14,842,000 | |
| ニッコンホールディングス | 57,400 | 2,108.00 | 120,999,200 | |
| 日本石油輸送 | 1,900 | 2,608.00 | 4,955,200 | |
| 福山通運 | 28,100 | 3,635.00 | 102,143,500 | |
| セイノーホールディングス | 116,400 | 1,107.00 | 128,854,800 | |
| エスライン | 5,100 | 880.00 | 4,488,000 | |
| 神奈川中央交通 | 4,200 | 3,305.00 | 13,881,000 | |
| 日立物流 | 33,000 | 5,230.00 | 172,590,000 | |
| 丸和運輸機関 | 36,100 | 1,435.00 | 51,803,500 | |
| Ｃ＆Ｆロジホールディングス | 17,300 | 1,381.00 | 23,891,300 | |
| 九州旅客鉄道 | 132,300 | 2,369.00 | 313,418,700 | |
| ＳＧホールディングス | 323,100 | 2,512.00 | 811,627,200 | |
| ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス | 59,200 | 6,980.00 | 413,216,000 | |
| 日本郵船 | 143,300 | 8,550.00 | 1,225,215,000 | |
| 商船三井 | 95,000 | 8,280.00 | 786,600,000 | |
| 川崎汽船 | 52,700 | 6,610.00 | 348,347,000 | |
| ＮＳユナイテッド海運 | 10,200 | 3,040.00 | 31,008,000 | |
| 飯野海運 | 84,600 | 526.00 | 44,499,600 | |
| 共栄タンカー | 6,400 | 873.00 | 5,587,200 | |
| 乾汽船 | 11,700 | 2,336.00 | 27,331,200 | |
| 日本航空 | 392,000 | 2,128.00 | 834,176,000 | |
| ＡＮＡホールディングス | 434,300 | 2,360.00 | 1,024,948,000 | |
| パスコ | 3,200 | 1,304.00 | 4,172,800 | |
| トランコム | 4,800 | 8,410.00 | 40,368,000 | |
| 日新 | 13,600 | 1,594.00 | 21,678,400 | |
| 三菱倉庫 | 54,200 | 2,725.00 | 147,695,000 | |
| 三井倉庫ホールディングス | 18,100 | 2,335.00 | 42,263,500 | |
| 住友倉庫 | 60,400 | 1,966.00 | 118,746,400 | |
| 澁澤倉庫 | 10,200 | 2,110.00 | 21,522,000 | |
| 東陽倉庫 | 28,700 | 309.00 | 8,868,300 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日本トランスシティ | 37,600 | 628.00 | 23,612,800 | |
| ケイヒン | 3,000 | 1,365.00 | 4,095,000 | |
| 中央倉庫 | 10,400 | 957.00 | 9,952,800 | |
| 川西倉庫 | 3,100 | 1,067.00 | 3,307,700 | |
| 安田倉庫 | 14,000 | 951.00 | 13,314,000 | |
| ファイズホールディングス | 3,600 | 552.00 | 1,987,200 | |
| 東洋埠頭 | 5,200 | 1,418.00 | 7,373,600 | |
| 上組 | 94,000 | 2,205.00 | 207,270,000 | |
| サンリツ | 4,700 | 841.00 | 3,952,700 | |
| キムラユニティー | 4,500 | 1,269.00 | 5,710,500 | |
| キユーソー流通システム | 8,500 | 854.00 | 7,259,000 | |
| 近鉄エクスプレス | 32,300 | 2,793.00 | 90,213,900 | |
| 東海運 | 9,700 | 305.00 | 2,958,500 | |
| エーアイテイー | 10,700 | 1,461.00 | 15,632,700 | |
| 内外トランスライン | 6,600 | 1,899.00 | 12,533,400 | |
| 日本コンセプト | 5,400 | 1,505.00 | 8,127,000 | |
| ＮＥＣネッツエスアイ | 58,700 | 1,797.00 | 105,483,900 | |
| クロスキャット | 4,800 | 1,440.00 | 6,912,000 | |
| システナ | 253,200 | 372.00 | 94,190,400 | |
| デジタルアーツ | 9,500 | 6,810.00 | 64,695,000 | |
| 日鉄ソリューションズ | 25,700 | 3,420.00 | 87,894,000 | |
| キューブシステム | 9,100 | 934.00 | 8,499,400 | |
| ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ | 2,600 | 1,550.00 | 4,030,000 | |
| コア | 7,600 | 1,505.00 | 11,438,000 | |
| ラクーンホールディングス | 12,700 | 1,248.00 | 15,849,600 | |
| ソリトンシステムズ | 9,000 | 1,348.00 | 12,132,000 | |
| ソフトクリエイトホールディングス | 7,800 | 3,810.00 | 29,718,000 | |
| ＴＩＳ | 169,000 | 3,040.00 | 513,760,000 | |
| ＪＮＳホールディングス | 8,200 | 410.00 | 3,362,000 | |
| グリー | 108,900 | 932.00 | 101,494,800 | |
| GMOペパボ | 1,900 | 2,280.00 | 4,332,000 | |
| コーエーテクモホールディングス | 56,600 | 4,210.00 | 238,286,000 | |
| 三菱総合研究所 | 7,600 | 3,875.00 | 29,450,000 | |
| 電算 | 2,000 | 2,274.00 | 4,548,000 | |
| ＡＧＳ | 9,200 | 840.00 | 7,728,000 | |
| ファインデックス | 15,100 | 938.00 | 14,163,800 | |
| ブレインパッド | 13,900 | 1,161.00 | 16,137,900 | |
| ＫＬａｂ | 32,500 | 460.00 | 14,950,000 | |
| ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス | 25,900 | 925.00 | 23,957,500 | |
| ネクソン | 399,600 | 2,080.00 | 831,168,000 | |
| アイスタイル | 54,800 | 218.00 | 11,946,400 | |
| エムアップホールディングス | 20,600 | 776.00 | 15,985,600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| エイチーム | 12,400 | 752.00 | 9,324,800 | |
| エニグモ | 19,400 | 631.00 | 12,241,400 | |
| テクノスジャパン | 14,100 | 502.00 | 7,078,200 | |
| コロプラ | 58,500 | 676.00 | 39,546,000 | |
| ブロードリーフ | 88,200 | 365.00 | 32,193,000 | |
| クロス・マーケティンググループ | 6,900 | 885.00 | 6,106,500 | |
| デジタルハーツホールディングス | 8,100 | 1,848.00 | 14,968,800 | |
| システム情報 | 13,500 | 893.00 | 12,055,500 | |
| メディアドゥ | 6,300 | 2,907.00 | 18,314,100 | |
| じげん | 50,700 | 293.00 | 14,855,100 | |
| ブイキューブ | 18,200 | 822.00 | 14,960,400 | |
| エンカレッジ・テクノロジ | 4,200 | 559.00 | 2,347,800 | |
| サイバーリンクス | 6,100 | 903.00 | 5,508,300 | |
| フィックスターズ | 19,100 | 787.00 | 15,031,700 | |
| ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ | 7,200 | 1,937.00 | 13,946,400 | |
| オプティム | 12,500 | 1,086.00 | 13,575,000 | |
| セレス | 6,600 | 2,063.00 | 13,615,800 | |
| ＳＨＩＦＴ | 9,000 | 20,740.00 | 186,660,000 | |
| ティーガイア | 15,800 | 1,648.00 | 26,038,400 | |
| セック | 2,700 | 2,224.00 | 6,004,800 | |
| テクマトリックス | 30,000 | 1,562.00 | 46,860,000 | |
| プロシップ | 6,000 | 1,432.00 | 8,592,000 | |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 48,100 | 2,496.00 | 120,057,600 | |
| GMOペイメントゲートウェイ | 34,300 | 10,740.00 | 368,382,000 | |
| ザッパラス | 7,200 | 487.00 | 3,506,400 | |
| システムリサーチ | 5,300 | 1,776.00 | 9,412,800 | |
| インターネットイニシアティブ | 47,200 | 4,100.00 | 193,520,000 | |
| さくらインターネット | 19,300 | 529.00 | 10,209,700 | |
| ヴィンクス | 5,200 | 897.00 | 4,664,400 | |
| GMOグローバルサイン・ホールディングス | 4,000 | 3,605.00 | 14,420,000 | |
| ＳＲＡホールディングス | 8,600 | 2,781.00 | 23,916,600 | |
| システムインテグレータ | 5,900 | 524.00 | 3,091,600 | |
| 朝日ネット | 16,500 | 593.00 | 9,784,500 | |
| ｅＢＡＳＥ | 21,500 | 537.00 | 11,545,500 | |
| アバント | 19,100 | 1,030.00 | 19,673,000 | |
| アドソル日進 | 6,400 | 1,688.00 | 10,803,200 | |
| ＯＤＫソリューションズ | 4,000 | 638.00 | 2,552,000 | |
| フリービット | 10,700 | 889.00 | 9,512,300 | |
| コムチュア | 19,900 | 2,924.00 | 58,187,600 | |
| サイバーコム | 2,900 | 1,037.00 | 3,007,300 | |
| アステリア | 12,900 | 892.00 | 11,506,800 | |
| アイル | 10,000 | 1,302.00 | 13,020,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| マークラインズ | 9,000 | 2,655.00 | 23,895,000 | |
| メディカル・データ・ビジョン | 22,600 | 1,123.00 | 25,379,800 | |
| ｇｕｍｉ | 24,800 | 604.00 | 14,979,200 | |
| ショーケース | 4,200 | 476.00 | 1,999,200 | |
| モバイルファクトリー | 4,200 | 829.00 | 3,481,800 | |
| テラスカイ | 6,600 | 1,480.00 | 9,768,000 | |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 8,000 | 1,213.00 | 9,704,000 | |
| ＰＣＩホールディングス | 8,100 | 1,086.00 | 8,796,600 | |
| パイプドＨＤ | 3,300 | 2,337.00 | 7,712,100 | |
| アイビーシー | 3,200 | 665.00 | 2,128,000 | |
| ネオジャパン | 5,100 | 1,100.00 | 5,610,000 | |
| ＰＲ　ＴＩＭＥＳ | 3,800 | 2,978.00 | 11,316,400 | |
| ラクス | 61,000 | 2,547.00 | 155,367,000 | |
| ランドコンピュータ | 4,300 | 834.00 | 3,586,200 | |
| ダブルスタンダード | 5,400 | 2,536.00 | 13,694,400 | |
| オープンドア | 10,600 | 1,655.00 | 17,543,000 | |
| マイネット | 6,300 | 501.00 | 3,156,300 | |
| アカツキ | 8,000 | 2,762.00 | 22,096,000 | |
| ベネフィットジャパン | 1,400 | 2,175.00 | 3,045,000 | |
| Ｕｂｉｃｏｍホールディングス | 4,700 | 2,125.00 | 9,987,500 | |
| カナミックネットワーク | 19,300 | 439.00 | 8,472,700 | |
| ノムラシステムコーポレーション | 9,900 | 256.00 | 2,534,400 | |
| チェンジ | 32,800 | 1,517.00 | 49,757,600 | |
| シンクロ・フード | 9,600 | 301.00 | 2,889,600 | |
| オークネット | 9,500 | 1,542.00 | 14,649,000 | |
| キャピタル・アセット・プランニング | 3,800 | 722.00 | 2,743,600 | |
| セグエグループ | 4,800 | 690.00 | 3,312,000 | |
| エイトレッド | 2,600 | 2,255.00 | 5,863,000 | |
| マクロミル | 36,400 | 1,100.00 | 40,040,000 | |
| ビーグリー | 4,300 | 1,157.00 | 4,975,100 | |
| オロ | 5,700 | 2,319.00 | 13,218,300 | |
| ユーザーローカル | 5,500 | 1,552.00 | 8,536,000 | |
| テモナ | 4,200 | 410.00 | 1,722,000 | |
| ニーズウェル | 4,300 | 607.00 | 2,610,100 | |
| マネーフォワード | 27,000 | 4,890.00 | 132,030,000 | |
| サインポスト | 5,700 | 928.00 | 5,289,600 | |
| 電算システムホールディングス | 7,300 | 2,651.00 | 19,352,300 | |
| ソルクシーズ | 15,500 | 412.00 | 6,386,000 | |
| フェイス | 5,200 | 652.00 | 3,390,400 | |
| プロトコーポレーション | 18,900 | 1,323.00 | 25,004,700 | |
| ハイマックス | 4,900 | 1,118.00 | 5,478,200 | |
| 野村総合研究所 | 342,300 | 4,375.00 | 1,497,562,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| サイバネットシステム | 12,900 | 644.00 | 8,307,600 | |
| ＣＥホールディングス | 9,800 | 471.00 | 4,615,800 | |
| 日本システム技術 | 3,600 | 2,237.00 | 8,053,200 | |
| インテージホールディングス | 22,200 | 1,720.00 | 38,184,000 | |
| 東邦システムサイエンス | 4,900 | 973.00 | 4,767,700 | |
| ソースネクスト | 77,400 | 161.00 | 12,461,400 | |
| インフォコム | 19,500 | 1,954.00 | 38,103,000 | |
| シンプレクス・ホールディングス | 19,000 | 2,362.00 | 44,878,000 | |
| ＨＥＲＯＺ | 5,200 | 1,118.00 | 5,813,600 | |
| ラクスル | 19,400 | 4,265.00 | 82,741,000 | |
| ＩＰＳ | 5,000 | 1,900.00 | 9,500,000 | |
| ＦＩＧ | 19,800 | 273.00 | 5,405,400 | |
| システムサポート | 5,400 | 1,007.00 | 5,437,800 | |
| イーソル | 11,100 | 573.00 | 6,360,300 | |
| アルテリア・ネットワークス | 22,500 | 1,379.00 | 31,027,500 | |
| ＥｄｕＬａｂ | 1,700 | 805.00 | 1,368,500 | |
| 東海ソフト | 3,000 | 919.00 | 2,757,000 | |
| ウイングアーク１ｓｔ | 10,200 | 1,460.00 | 14,892,000 | |
| ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス | 4,100 | 2,158.00 | 8,847,800 | |
| サーバーワークス | 3,100 | 2,570.00 | 7,967,000 | |
| 東名 | 1,800 | 907.00 | 1,632,600 | |
| ヴィッツ | 1,800 | 1,333.00 | 2,399,400 | |
| トビラシステムズ | 3,800 | 753.00 | 2,861,400 | |
| Ｓａｎｓａｎ | 63,100 | 1,662.00 | 104,872,200 | |
| Ｌｉｎｋ－Ｕ | 3,400 | 776.00 | 2,638,400 | |
| ギフティ | 16,100 | 1,395.00 | 22,459,500 | |
| ベース | 3,100 | 3,975.00 | 12,322,500 | |
| ＪＭＤＣ | 16,600 | 5,630.00 | 93,458,000 | |
| フォーカスシステムズ | 12,100 | 910.00 | 11,011,000 | |
| クレスコ | 13,000 | 1,762.00 | 22,906,000 | |
| フジ・メディア・ホールディングス | 170,800 | 1,166.00 | 199,152,800 | |
| オービック | 55,800 | 18,530.00 | 1,033,974,000 | |
| ジャストシステム | 25,200 | 5,070.00 | 127,764,000 | |
| ＴＤＣソフト | 15,700 | 1,045.00 | 16,406,500 | |
| Ｚホールディングス | 2,575,200 | 571.10 | 1,470,696,720 | |
| トレンドマイクロ | 94,700 | 5,860.00 | 554,942,000 | |
| ＩＤホールディングス | 11,400 | 843.00 | 9,610,200 | |
| 日本オラクル | 36,000 | 8,860.00 | 318,960,000 | |
| アルファシステムズ | 4,800 | 3,655.00 | 17,544,000 | |
| フューチャー | 37,500 | 1,561.00 | 58,537,500 | |
| ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ | 10,500 | 1,351.00 | 14,185,500 | |
| ＳＢテクノロジー | 7,700 | 2,343.00 | 18,041,100 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| トーセ | 5,100 | 702.00 | 3,580,200 | |
| オービックビジネスコンサルタント | 16,900 | 4,330.00 | 73,177,000 | |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 80,800 | 3,345.00 | 270,276,000 | |
| アイティフォー | 21,700 | 779.00 | 16,904,300 | |
| 東計電算 | 2,100 | 4,585.00 | 9,628,500 | |
| エックスネット | 3,000 | 959.00 | 2,877,000 | |
| 大塚商会 | 95,900 | 4,855.00 | 465,594,500 | |
| サイボウズ | 23,800 | 1,490.00 | 35,462,000 | |
| 電通国際情報サービス | 25,600 | 3,375.00 | 86,400,000 | |
| ＡＣＣＥＳＳ | 20,300 | 602.00 | 12,220,600 | |
| デジタルガレージ | 29,300 | 4,435.00 | 129,945,500 | |
| ＥＭシステムズ | 29,500 | 641.00 | 18,909,500 | |
| ウェザーニューズ | 5,300 | 7,690.00 | 40,757,000 | |
| ＣＩＪ | 11,700 | 818.00 | 9,570,600 | |
| ビジネスエンジニアリング | 2,100 | 3,490.00 | 7,329,000 | |
| 日本エンタープライズ | 19,000 | 171.00 | 3,249,000 | |
| ＷＯＷＯＷ | 8,600 | 1,679.00 | 14,439,400 | |
| スカラ | 16,100 | 648.00 | 10,432,800 | |
| インテリジェント　ウェイブ | 10,700 | 523.00 | 5,596,100 | |
| ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ | 15,400 | 613.00 | 9,440,200 | |
| ネットワンシステムズ | 67,500 | 2,788.00 | 188,190,000 | |
| システムソフト | 39,700 | 105.00 | 4,168,500 | |
| アルゴグラフィックス | 13,800 | 3,260.00 | 44,988,000 | |
| マーベラス | 28,200 | 727.00 | 20,501,400 | |
| エイベックス | 30,700 | 1,330.00 | 40,831,000 | |
| 日本ユニシス | 55,400 | 3,105.00 | 172,017,000 | |
| 兼松エレクトロニクス | 9,700 | 3,790.00 | 36,763,000 | |
| 都築電気 | 9,200 | 1,587.00 | 14,600,400 | |
| ＴＢＳホールディングス | 107,800 | 1,695.00 | 182,721,000 | |
| 日本テレビホールディングス | 148,000 | 1,219.00 | 180,412,000 | |
| 朝日放送グループホールディングス | 17,900 | 691.00 | 12,368,900 | |
| テレビ朝日ホールディングス | 42,700 | 1,488.00 | 63,537,600 | |
| スカパーＪＳＡＴホールディングス | 150,500 | 431.00 | 64,865,500 | |
| テレビ東京ホールディングス | 12,800 | 1,993.00 | 25,510,400 | |
| 日本ＢＳ放送 | 6,200 | 1,104.00 | 6,844,800 | |
| ビジョン | 30,400 | 1,015.00 | 30,856,000 | |
| スマートバリュー | 5,000 | 494.00 | 2,470,000 | |
| ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ | 16,900 | 2,696.00 | 45,562,400 | |
| ワイヤレスゲート | 7,800 | 326.00 | 2,542,800 | |
| コネクシオ | 12,700 | 1,396.00 | 17,729,200 | |
| クロップス | 3,400 | 934.00 | 3,175,600 | |
| 日本電信電話 | 1,853,400 | 3,250.00 | 6,023,550,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ＫＤＤＩ | 1,291,600 | 3,582.00 | 4,626,511,200 | |
| ソフトバンク | 2,683,400 | 1,445.00 | 3,877,513,000 | |
| 光通信 | 20,900 | 15,500.00 | 323,950,000 | |
| エムティーアイ | 17,500 | 559.00 | 9,782,500 | |
| GMOインターネット | 62,800 | 2,565.00 | 161,082,000 | |
| ファイバーゲート | 5,900 | 1,090.00 | 6,431,000 | |
| アイドママーケティングコミュニケーション | 4,500 | 282.00 | 1,269,000 | |
| ＫＡＤＯＫＡＷＡ | 96,800 | 2,496.00 | 241,612,800 | |
| 学研ホールディングス | 25,200 | 1,048.00 | 26,409,600 | |
| ゼンリン | 29,100 | 972.00 | 28,285,200 | |
| 昭文社ホールディングス | 7,600 | 414.00 | 3,146,400 | |
| インプレスホールディングス | 14,700 | 214.00 | 3,145,800 | |
| アイネット | 9,200 | 1,271.00 | 11,693,200 | |
| 松竹 | 11,700 | 11,620.00 | 135,954,000 | |
| 東宝 | 104,600 | 4,540.00 | 474,884,000 | |
| 東映 | 5,800 | 15,590.00 | 90,422,000 | |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 471,800 | 2,297.00 | 1,083,724,600 | |
| ピー・シー・エー | 10,500 | 1,676.00 | 17,598,000 | |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 6,100 | 1,689.00 | 10,302,900 | |
| ＤＴＳ | 34,000 | 2,573.00 | 87,482,000 | |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 82,500 | 5,680.00 | 468,600,000 | |
| シーイーシー | 19,100 | 1,039.00 | 19,844,900 | |
| カプコン | 167,100 | 2,637.00 | 440,642,700 | |
| アイ・エス・ビー | 8,500 | 936.00 | 7,956,000 | |
| ジャステック | 10,400 | 1,028.00 | 10,691,200 | |
| ＳＣＳＫ | 122,700 | 2,023.00 | 248,222,100 | |
| 日本システムウエア | 6,800 | 2,154.00 | 14,647,200 | |
| アイネス | 16,200 | 1,540.00 | 24,948,000 | |
| ＴＫＣ | 30,000 | 3,040.00 | 91,200,000 | |
| 富士ソフト | 18,900 | 5,070.00 | 95,823,000 | |
| ＮＳＤ | 57,000 | 1,998.00 | 113,886,000 | |
| コナミホールディングス | 64,400 | 5,650.00 | 363,860,000 | |
| 福井コンピュータホールディングス | 8,200 | 3,020.00 | 24,764,000 | |
| ＪＢＣＣホールディングス | 12,100 | 1,672.00 | 20,231,200 | |
| ミロク情報サービス | 15,700 | 1,246.00 | 19,562,200 | |
| ソフトバンクグループ | 1,062,400 | 5,527.00 | 5,871,884,800 | |
| ホウスイ | 1,500 | 822.00 | 1,233,000 | |
| 高千穂交易 | 6,900 | 1,492.00 | 10,294,800 | |
| オルバヘルスケアホールディングス | 2,900 | 1,359.00 | 3,941,100 | |
| 伊藤忠食品 | 4,300 | 4,755.00 | 20,446,500 | |
| エレマテック | 14,300 | 1,031.00 | 14,743,300 | |
| ＪＡＬＵＸ | 5,000 | 2,546.00 | 12,730,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| あらた | 14,200 | 4,020.00 | 57,084,000 | |
| トーメンデバイス | 2,700 | 6,640.00 | 17,928,000 | |
| 東京エレクトロン　デバイス | 5,300 | 5,800.00 | 30,740,000 | |
| フィールズ | 15,600 | 492.00 | 7,675,200 | |
| 双日 | 196,400 | 1,775.00 | 348,610,000 | |
| アルフレッサ　ホールディングス | 197,600 | 1,567.00 | 309,639,200 | |
| 横浜冷凍 | 49,900 | 830.00 | 41,417,000 | |
| ラサ商事 | 9,400 | 959.00 | 9,014,600 | |
| アルコニックス | 22,100 | 1,277.00 | 28,221,700 | |
| 神戸物産 | 138,000 | 3,655.00 | 504,390,000 | |
| ハイパー | 4,500 | 487.00 | 2,191,500 | |
| あい　ホールディングス | 25,400 | 1,818.00 | 46,177,200 | |
| ディーブイエックス | 6,100 | 1,037.00 | 6,325,700 | |
| ダイワボウホールディングス | 86,400 | 1,701.00 | 146,966,400 | |
| マクニカ・富士エレホールディングス | 42,400 | 2,491.00 | 105,618,400 | |
| ラクト・ジャパン | 6,100 | 1,976.00 | 12,053,600 | |
| グリムス | 7,900 | 2,124.00 | 16,779,600 | |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 30,900 | 776.00 | 23,978,400 | |
| 八洲電機 | 12,900 | 941.00 | 12,138,900 | |
| メディアスホールディングス | 10,100 | 837.00 | 8,453,700 | |
| レスターホールディングス | 16,900 | 1,920.00 | 32,448,000 | |
| ジューテックホールディングス | 4,100 | 1,208.00 | 4,952,800 | |
| 大光 | 6,800 | 673.00 | 4,576,400 | |
| ＯＣＨＩホールディングス | 5,200 | 1,306.00 | 6,791,200 | |
| ＴＯＫＡＩホールディングス | 86,200 | 857.00 | 73,873,400 | |
| 黒谷 | 4,900 | 660.00 | 3,234,000 | |
| Ｃｏｍｉｎｉｘ | 3,100 | 729.00 | 2,259,900 | |
| 三洋貿易 | 17,900 | 987.00 | 17,667,300 | |
| ビューティガレージ | 2,900 | 2,919.00 | 8,465,100 | |
| ウイン・パートナーズ | 12,900 | 944.00 | 12,177,600 | |
| ミタチ産業 | 4,900 | 984.00 | 4,821,600 | |
| シップヘルスケアホールディングス | 57,000 | 2,567.00 | 146,319,000 | |
| 明治電機工業 | 5,600 | 1,242.00 | 6,955,200 | |
| デリカフーズホールディングス | 6,900 | 577.00 | 3,981,300 | |
| スターティアホールディングス | 4,100 | 778.00 | 3,189,800 | |
| コメダホールディングス | 38,800 | 2,029.00 | 78,725,200 | |
| ピーバンドットコム | 2,500 | 515.00 | 1,287,500 | |
| アセンテック | 6,100 | 770.00 | 4,697,000 | |
| 富士興産 | 4,500 | 1,025.00 | 4,612,500 | |
| 協栄産業 | 1,800 | 1,630.00 | 2,934,000 | |
| フルサト・マルカホールディングス | 17,100 | 2,332.00 | 39,877,200 | |
| ヤマエグループホールディングス | 12,000 | 1,042.00 | 12,504,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 小野建 | 17,200 | 1,621.00 | 27,881,200 | |
| 南陽 | 3,600 | 1,900.00 | 6,840,000 | |
| 佐鳥電機 | 11,100 | 942.00 | 10,456,200 | |
| エコートレーディング | 3,800 | 606.00 | 2,302,800 | |
| 伯東 | 10,800 | 2,437.00 | 26,319,600 | |
| コンドーテック | 13,700 | 992.00 | 13,590,400 | |
| 中山福 | 9,500 | 350.00 | 3,325,000 | |
| ナガイレーベン | 23,600 | 2,098.00 | 49,512,800 | |
| 三菱食品 | 17,100 | 2,752.00 | 47,059,200 | |
| 松田産業 | 13,000 | 2,326.00 | 30,238,000 | |
| 第一興商 | 33,800 | 3,315.00 | 112,047,000 | |
| メディパルホールディングス | 191,900 | 2,044.00 | 392,243,600 | |
| ＳＰＫ | 7,100 | 1,305.00 | 9,265,500 | |
| 萩原電気ホールディングス | 6,600 | 1,989.00 | 13,127,400 | |
| アズワン | 25,500 | 5,840.00 | 148,920,000 | |
| スズデン | 6,200 | 1,711.00 | 10,608,200 | |
| 尾家産業 | 4,900 | 995.00 | 4,875,500 | |
| シモジマ | 10,900 | 1,042.00 | 11,357,800 | |
| ドウシシャ | 16,800 | 1,494.00 | 25,099,200 | |
| 小津産業 | 3,900 | 1,935.00 | 7,546,500 | |
| 高速 | 10,600 | 1,459.00 | 15,465,400 | |
| たけびし | 6,700 | 1,411.00 | 9,453,700 | |
| リックス | 4,000 | 1,496.00 | 5,984,000 | |
| 丸文 | 15,800 | 773.00 | 12,213,400 | |
| ハピネット | 14,900 | 1,466.00 | 21,843,400 | |
| 橋本総業ホールディングス | 3,600 | 1,984.00 | 7,142,400 | |
| 日本ライフライン | 52,700 | 1,060.00 | 55,862,000 | |
| タカショー | 13,600 | 700.00 | 9,520,000 | |
| ＩＤＯＭ | 54,000 | 687.00 | 37,098,000 | |
| 進和 | 10,500 | 2,019.00 | 21,199,500 | |
| エスケイジャパン | 4,400 | 429.00 | 1,887,600 | |
| ダイトロン | 7,500 | 2,005.00 | 15,037,500 | |
| シークス | 25,500 | 1,321.00 | 33,685,500 | |
| 田中商事 | 5,500 | 632.00 | 3,476,000 | |
| オーハシテクニカ | 9,900 | 1,349.00 | 13,355,100 | |
| 白銅 | 5,700 | 2,706.00 | 15,424,200 | |
| ダイコー通産 | 2,100 | 1,134.00 | 2,381,400 | |
| 伊藤忠商事 | 1,243,700 | 3,648.00 | 4,537,017,600 | |
| 丸紅 | 1,754,000 | 1,163.50 | 2,040,779,000 | |
| 高島 | 2,700 | 2,335.00 | 6,304,500 | |
| 長瀬産業 | 97,600 | 1,802.00 | 175,875,200 | |
| 蝶理 | 10,000 | 1,766.00 | 17,660,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 豊田通商 | 178,600 | 4,955.00 | 884,963,000 | |
| 三共生興 | 23,600 | 550.00 | 12,980,000 | |
| 兼松 | 66,300 | 1,255.00 | 83,206,500 | |
| ツカモトコーポレーション | 3,000 | 1,300.00 | 3,900,000 | |
| 三井物産 | 1,380,900 | 2,860.50 | 3,950,064,450 | |
| 日本紙パルプ商事 | 9,300 | 3,935.00 | 36,595,500 | |
| カメイ | 21,100 | 1,018.00 | 21,479,800 | |
| 東都水産 | 900 | 3,950.00 | 3,555,000 | |
| ＯＵＧホールディングス | 2,600 | 2,742.00 | 7,129,200 | |
| スターゼン | 13,200 | 1,969.00 | 25,990,800 | |
| 山善 | 74,800 | 992.00 | 74,201,600 | |
| 椿本興業 | 3,700 | 4,110.00 | 15,207,000 | |
| 住友商事 | 1,122,300 | 1,746.50 | 1,960,096,950 | |
| 内田洋行 | 7,600 | 4,560.00 | 34,656,000 | |
| 三菱商事 | 1,332,500 | 3,891.00 | 5,184,757,500 | |
| 第一実業 | 8,100 | 4,380.00 | 35,478,000 | |
| キヤノンマーケティングジャパン | 44,100 | 2,240.00 | 98,784,000 | |
| 西華産業 | 9,400 | 1,594.00 | 14,983,600 | |
| 佐藤商事 | 14,700 | 1,118.00 | 16,434,600 | |
| 菱洋エレクトロ | 10,500 | 2,368.00 | 24,864,000 | |
| 東京産業 | 16,100 | 724.00 | 11,656,400 | |
| ユアサ商事 | 16,900 | 2,865.00 | 48,418,500 | |
| 神鋼商事 | 4,000 | 3,275.00 | 13,100,000 | |
| トルク | 9,600 | 198.00 | 1,900,800 | |
| 阪和興業 | 35,600 | 3,210.00 | 114,276,000 | |
| 正栄食品工業 | 11,500 | 3,845.00 | 44,217,500 | |
| カナデン | 14,500 | 996.00 | 14,442,000 | |
| 菱電商事 | 14,100 | 1,676.00 | 23,631,600 | |
| 岩谷産業 | 42,700 | 5,790.00 | 247,233,000 | |
| ナイス | 6,100 | 1,714.00 | 10,455,400 | |
| ニチモウ | 2,600 | 2,522.00 | 6,557,200 | |
| 極東貿易 | 5,100 | 2,580.00 | 13,158,000 | |
| アステナホールディングス | 25,100 | 396.00 | 9,939,600 | |
| 三愛石油 | 43,800 | 1,013.00 | 44,369,400 | |
| 稲畑産業 | 39,200 | 1,671.00 | 65,503,200 | |
| ＧＳＩクレオス | 8,500 | 1,180.00 | 10,030,000 | |
| 明和産業 | 16,400 | 1,111.00 | 18,220,400 | |
| クワザワホールディングス | 7,100 | 605.00 | 4,295,500 | |
| ワキタ | 37,900 | 1,018.00 | 38,582,200 | |
| 東邦ホールディングス | 57,100 | 1,720.00 | 98,212,000 | |
| サンゲツ | 47,000 | 1,575.00 | 74,025,000 | |
| ミツウロコグループホールディングス | 26,200 | 1,115.00 | 29,213,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| シナネンホールディングス | 6,600 | 3,120.00 | 20,592,000 | |
| 伊藤忠エネクス | 39,300 | 993.00 | 39,024,900 | |
| サンリオ | 54,900 | 2,292.00 | 125,830,800 | |
| サンワテクノス | 10,800 | 1,343.00 | 14,504,400 | |
| リョーサン | 19,600 | 2,196.00 | 43,041,600 | |
| 新光商事 | 26,700 | 861.00 | 22,988,700 | |
| トーホー | 8,100 | 1,072.00 | 8,683,200 | |
| 三信電気 | 8,200 | 1,480.00 | 12,136,000 | |
| 東陽テクニカ | 17,600 | 1,062.00 | 18,691,200 | |
| モスフードサービス | 23,300 | 2,980.00 | 69,434,000 | |
| 加賀電子 | 16,100 | 2,995.00 | 48,219,500 | |
| ソーダニッカ | 18,300 | 815.00 | 14,914,500 | |
| 立花エレテック | 14,200 | 1,520.00 | 21,584,000 | |
| フォーバル | 7,800 | 872.00 | 6,801,600 | |
| ＰＡＬＴＡＣ | 24,900 | 4,080.00 | 101,592,000 | |
| 三谷産業 | 20,900 | 308.00 | 6,437,200 | |
| 西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス | 4,000 | 2,959.00 | 11,836,000 | |
| ヤマシタヘルスケアホールディングス | 1,600 | 2,020.00 | 3,232,000 | |
| コーア商事ホールディングス | 13,400 | 593.00 | 7,946,200 | |
| 国際紙パルプ商事 | 37,100 | 308.00 | 11,426,800 | |
| ヤマタネ | 8,300 | 1,585.00 | 13,155,500 | |
| 丸紅建材リース | 1,600 | 1,770.00 | 2,832,000 | |
| 日鉄物産 | 12,700 | 5,110.00 | 64,897,000 | |
| 泉州電業 | 5,000 | 6,160.00 | 30,800,000 | |
| トラスコ中山 | 37,000 | 2,510.00 | 92,870,000 | |
| オートバックスセブン | 59,800 | 1,357.00 | 81,148,600 | |
| モリト | 13,000 | 668.00 | 8,684,000 | |
| 加藤産業 | 25,700 | 3,210.00 | 82,497,000 | |
| 北恵 | 4,500 | 852.00 | 3,834,000 | |
| イノテック | 10,800 | 1,443.00 | 15,584,400 | |
| イエローハット | 30,800 | 1,572.00 | 48,417,600 | |
| ＪＫホールディングス | 14,300 | 1,075.00 | 15,372,500 | |
| 日伝 | 14,800 | 2,164.00 | 32,027,200 | |
| 北沢産業 | 12,200 | 231.00 | 2,818,200 | |
| 杉本商事 | 8,300 | 2,130.00 | 17,679,000 | |
| 因幡電機産業 | 47,500 | 2,649.00 | 125,827,500 | |
| 東テク | 5,900 | 2,385.00 | 14,071,500 | |
| ミスミグループ本社 | 223,100 | 3,850.00 | 858,935,000 | |
| アルテック | 12,100 | 249.00 | 3,012,900 | |
| タキヒヨー | 5,400 | 1,379.00 | 7,446,600 | |
| 蔵王産業 | 3,400 | 1,781.00 | 6,055,400 | |
| スズケン | 69,500 | 3,270.00 | 227,265,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ジェコス | 12,300 | 797.00 | 9,803,100 | |
| グローセル | 20,800 | 398.00 | 8,278,400 | |
| ローソン | 39,400 | 4,870.00 | 191,878,000 | |
| サンエー | 13,500 | 4,000.00 | 54,000,000 | |
| カワチ薬品 | 14,000 | 2,174.00 | 30,436,000 | |
| エービーシー・マート | 27,800 | 5,240.00 | 145,672,000 | |
| ハードオフコーポレーション | 8,400 | 720.00 | 6,048,000 | |
| アスクル | 29,000 | 1,328.00 | 38,512,000 | |
| ゲオホールディングス | 24,100 | 1,156.00 | 27,859,600 | |
| アダストリア | 19,400 | 1,604.00 | 31,117,600 | |
| くら寿司 | 18,700 | 3,505.00 | 65,543,500 | |
| キャンドゥ | 8,600 | 2,218.00 | 19,074,800 | |
| アイケイ | 6,100 | 376.00 | 2,293,600 | |
| パルグループホールディングス | 15,800 | 1,588.00 | 25,090,400 | |
| エディオン | 82,000 | 1,063.00 | 87,166,000 | |
| サーラコーポレーション | 36,700 | 623.00 | 22,864,100 | |
| ワッツ | 9,200 | 691.00 | 6,357,200 | |
| ハローズ | 8,200 | 2,801.00 | 22,968,200 | |
| フジオフードグループ本社 | 15,000 | 1,249.00 | 18,735,000 | |
| あみやき亭 | 4,400 | 2,867.00 | 12,614,800 | |
| 大黒天物産 | 5,800 | 4,615.00 | 26,767,000 | |
| ハニーズホールディングス | 14,500 | 1,001.00 | 14,514,500 | |
| ファーマライズホールディングス | 4,900 | 701.00 | 3,434,900 | |
| アルペン | 13,800 | 1,985.00 | 27,393,000 | |
| ハブ | 6,300 | 561.00 | 3,534,300 | |
| クオールホールディングス | 22,100 | 1,285.00 | 28,398,500 | |
| ジンズホールディングス | 12,200 | 7,070.00 | 86,254,000 | |
| ビックカメラ | 105,900 | 988.00 | 104,629,200 | |
| ＤＣＭホールディングス | 110,100 | 1,059.00 | 116,595,900 | |
| ＭｏｎｏｔａＲＯ | 225,000 | 2,061.00 | 463,725,000 | |
| 東京一番フーズ | 5,200 | 586.00 | 3,047,200 | |
| きちりホールディングス | 4,700 | 358.00 | 1,682,600 | |
| アークランドサービスホールディングス | 13,200 | 2,140.00 | 28,248,000 | |
| Ｊ．フロント　リテイリング | 212,700 | 1,025.00 | 218,017,500 | |
| ドトール・日レスホールディングス | 30,900 | 1,560.00 | 48,204,000 | |
| マツキヨココカラ＆カンパニー | 109,400 | 3,820.00 | 417,908,000 | |
| ブロンコビリー | 10,300 | 2,194.00 | 22,598,200 | |
| ＺＯＺＯ | 122,400 | 2,886.00 | 353,246,400 | |
| トレジャー・ファクトリー | 5,600 | 825.00 | 4,620,000 | |
| 物語コーポレーション | 9,500 | 6,140.00 | 58,330,000 | |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 311,800 | 891.00 | 277,813,800 | |
| Ｈａｍｅｅ | 4,900 | 1,078.00 | 5,282,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| マーケットエンタープライズ | 1,700 | 668.00 | 1,135,600 | |
| ウエルシアホールディングス | 94,100 | 3,115.00 | 293,121,500 | |
| クリエイトＳＤホールディングス | 26,300 | 3,055.00 | 80,346,500 | |
| 丸善ＣＨＩホールディングス | 20,800 | 356.00 | 7,404,800 | |
| ミサワ | 4,200 | 715.00 | 3,003,000 | |
| ティーライフ | 2,700 | 1,355.00 | 3,658,500 | |
| チムニー | 5,400 | 1,134.00 | 6,123,600 | |
| シュッピン | 15,200 | 1,178.00 | 17,905,600 | |
| オイシックス・ラ・大地 | 25,700 | 2,683.00 | 68,953,100 | |
| ネクステージ | 36,100 | 2,786.00 | 100,574,600 | |
| ジョイフル本田 | 52,300 | 1,504.00 | 78,659,200 | |
| 鳥貴族ホールディングス | 6,700 | 1,743.00 | 11,678,100 | |
| ホットランド | 13,600 | 1,214.00 | 16,510,400 | |
| すかいらーくホールディングス | 229,800 | 1,469.00 | 337,576,200 | |
| ＳＦＰホールディングス | 8,700 | 1,382.00 | 12,023,400 | |
| 綿半ホールディングス | 13,700 | 1,241.00 | 17,001,700 | |
| ヨシックスホールディングス | 3,700 | 1,922.00 | 7,111,400 | |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 52,000 | 1,036.00 | 53,872,000 | |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 9,600 | 1,082.00 | 10,387,200 | |
| ＢＥＥＮＯＳ | 9,100 | 1,971.00 | 17,936,100 | |
| あさひ | 15,000 | 1,365.00 | 20,475,000 | |
| 日本調剤 | 11,100 | 1,308.00 | 14,518,800 | |
| コスモス薬品 | 18,000 | 14,780.00 | 266,040,000 | |
| トーエル | 9,100 | 815.00 | 7,416,500 | |
| セブン&アイ・ホールディングス | 695,700 | 5,236.00 | 3,642,685,200 | |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス | 94,700 | 722.00 | 68,373,400 | |
| ツルハホールディングス | 38,800 | 9,730.00 | 377,524,000 | |
| サンマルクホールディングス | 14,300 | 1,452.00 | 20,763,600 | |
| フェリシモ | 4,200 | 1,124.00 | 4,720,800 | |
| トリドールホールディングス | 44,400 | 2,287.00 | 101,542,800 | |
| ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ | 17,000 | 465.00 | 7,905,000 | |
| ウイルプラスホールディングス | 3,200 | 1,027.00 | 3,286,400 | |
| ＪＭホールディングス | 12,200 | 1,566.00 | 19,105,200 | |
| サツドラホールディングス | 8,600 | 620.00 | 5,332,000 | |
| アレンザホールディングス | 13,900 | 1,054.00 | 14,650,600 | |
| 串カツ田中ホールディングス | 4,900 | 2,049.00 | 10,040,100 | |
| バロックジャパンリミテッド | 12,800 | 870.00 | 11,136,000 | |
| クスリのアオキホールディングス | 17,700 | 6,560.00 | 116,112,000 | |
| 力の源ホールディングス | 9,100 | 546.00 | 4,968,600 | |
| ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ | 104,200 | 3,525.00 | 367,305,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| メディカルシステムネットワーク | 17,800 | 522.00 | 9,291,600 | |
| はるやまホールディングス | 9,200 | 495.00 | 4,554,000 | |
| ノジマ | 28,900 | 2,291.00 | 66,209,900 | |
| カッパ・クリエイト | 24,900 | 1,327.00 | 33,042,300 | |
| ライトオン | 13,300 | 695.00 | 9,243,500 | |
| 良品計画 | 204,800 | 1,535.00 | 314,368,000 | |
| 三城ホールディングス | 23,800 | 229.00 | 5,450,200 | |
| アドヴァングループ | 18,500 | 971.00 | 17,963,500 | |
| アルビス | 5,900 | 2,150.00 | 12,685,000 | |
| コナカ | 21,000 | 336.00 | 7,056,000 | |
| ハウス　オブ　ローゼ | 2,400 | 1,670.00 | 4,008,000 | |
| Ｇ－７ホールディングス | 20,000 | 1,430.00 | 28,600,000 | |
| イオン北海道 | 31,400 | 1,100.00 | 34,540,000 | |
| コジマ | 31,300 | 523.00 | 16,369,900 | |
| ヒマラヤ | 6,600 | 982.00 | 6,481,200 | |
| コーナン商事 | 25,400 | 3,325.00 | 84,455,000 | |
| エコス | 6,700 | 1,968.00 | 13,185,600 | |
| ワタミ | 21,500 | 877.00 | 18,855,500 | |
| マルシェ | 4,300 | 399.00 | 1,715,700 | |
| 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 | 355,700 | 1,484.00 | 527,858,800 | |
| 西松屋チェーン | 39,300 | 1,378.00 | 54,155,400 | |
| ゼンショーホールディングス | 87,000 | 2,723.00 | 236,901,000 | |
| 幸楽苑ホールディングス | 11,300 | 1,348.00 | 15,232,400 | |
| ハークスレイ | 8,300 | 433.00 | 3,593,900 | |
| サイゼリヤ | 26,500 | 2,639.00 | 69,933,500 | |
| ＶＴホールディングス | 67,800 | 450.00 | 30,510,000 | |
| 魚力 | 5,100 | 2,003.00 | 10,215,300 | |
| フジ・コーポレーション | 9,700 | 1,125.00 | 10,912,500 | |
| ユナイテッドアローズ | 18,800 | 1,822.00 | 34,253,600 | |
| ハイデイ日高 | 25,900 | 1,628.00 | 42,165,200 | |
| ＹＵ－ＷＡ　Ｃｒｅａｔｉｏｎ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ | 12,400 | 203.00 | 2,517,200 | |
| コロワイド | 73,100 | 1,642.00 | 120,030,200 | |
| ピーシーデポコーポレーション | 21,900 | 297.00 | 6,504,300 | |
| 壱番屋 | 12,600 | 4,605.00 | 58,023,000 | |
| ＰＬＡＮＴ | 5,100 | 687.00 | 3,503,700 | |
| スギホールディングス | 35,600 | 6,780.00 | 241,368,000 | |
| 薬王堂ホールディングス | 9,000 | 2,235.00 | 20,115,000 | |
| スクロール | 27,800 | 850.00 | 23,630,000 | |
| ヨンドシーホールディングス | 16,600 | 1,718.00 | 28,518,800 | |
| 木曽路 | 23,900 | 2,186.00 | 52,245,400 | |
| ＳＲＳホールディングス | 24,900 | 767.00 | 19,098,300 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| リテールパートナーズ | 21,900 | 1,230.00 | 26,937,000 | |
| ケーヨー | 33,100 | 836.00 | 27,671,600 | |
| 上新電機 | 20,600 | 2,047.00 | 42,168,200 | |
| 日本瓦斯 | 86,700 | 1,497.00 | 129,789,900 | |
| ロイヤルホールディングス | 30,500 | 1,769.00 | 53,954,500 | |
| いなげや | 22,200 | 1,361.00 | 30,214,200 | |
| チヨダ | 17,800 | 735.00 | 13,083,000 | |
| ライフコーポレーション | 16,700 | 3,060.00 | 51,102,000 | |
| リンガーハット | 21,900 | 2,199.00 | 48,158,100 | |
| ＭｒＭａｘＨＤ | 22,900 | 588.00 | 13,465,200 | |
| ＡＯＫＩホールディングス | 35,000 | 599.00 | 20,965,000 | |
| オークワ | 28,100 | 891.00 | 25,037,100 | |
| コメリ | 27,600 | 2,483.00 | 68,530,800 | |
| 青山商事 | 37,300 | 678.00 | 25,289,400 | |
| しまむら | 20,700 | 9,890.00 | 204,723,000 | |
| はせがわ | 11,100 | 276.00 | 3,063,600 | |
| 高島屋 | 129,700 | 1,089.00 | 141,243,300 | |
| 松屋 | 36,100 | 726.00 | 26,208,600 | |
| エイチ・ツー・オー　リテイリング | 84,500 | 798.00 | 67,431,000 | |
| 近鉄百貨店 | 7,000 | 2,571.00 | 17,997,000 | |
| 丸井グループ | 140,500 | 2,209.00 | 310,364,500 | |
| アクシアル　リテイリング | 13,900 | 3,170.00 | 44,063,000 | |
| イオン | 684,300 | 2,457.00 | 1,681,325,100 | |
| イズミ | 32,200 | 3,125.00 | 100,625,000 | |
| 平和堂 | 32,900 | 1,895.00 | 62,345,500 | |
| フジ | 21,600 | 1,865.00 | 40,284,000 | |
| ヤオコー | 20,200 | 6,610.00 | 133,522,000 | |
| ゼビオホールディングス | 24,600 | 881.00 | 21,672,600 | |
| ケーズホールディングス | 164,300 | 1,089.00 | 178,922,700 | |
| Ｏｌｙｍｐｉｃグループ | 9,800 | 666.00 | 6,526,800 | |
| 日産東京販売ホールディングス | 27,900 | 225.00 | 6,277,500 | |
| シルバーライフ | 3,900 | 1,065.00 | 4,153,500 | |
| Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ | 7,900 | 4,145.00 | 32,745,500 | |
| ナルミヤ・インターナショナル | 4,400 | 1,167.00 | 5,134,800 | |
| ブックオフグループホールディングス | 10,400 | 1,011.00 | 10,514,400 | |
| ギフト | 2,900 | 2,321.00 | 6,730,900 | |
| アインホールディングス | 25,900 | 5,700.00 | 147,630,000 | |
| 元気寿司 | 5,100 | 2,433.00 | 12,408,300 | |
| ヤマダホールディングス | 651,200 | 385.00 | 250,712,000 | |
| アークランドサカモト | 28,100 | 1,528.00 | 42,936,800 | |
| ニトリホールディングス | 70,600 | 16,440.00 | 1,160,664,000 | |
| グルメ杵屋 | 14,500 | 977.00 | 14,166,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 愛眼 | 13,000 | 177.00 | 2,301,000 | |
| ケーユーホールディングス | 9,600 | 984.00 | 9,446,400 | |
| 吉野家ホールディングス | 62,200 | 2,360.00 | 146,792,000 | |
| 松屋フーズホールディングス | 8,700 | 3,515.00 | 30,580,500 | |
| サガミホールディングス | 27,600 | 1,026.00 | 28,317,600 | |
| 関西スーパーマーケット | 13,800 | 1,015.00 | 14,007,000 | |
| 王将フードサービス | 11,800 | 5,900.00 | 69,620,000 | |
| プレナス | 20,100 | 1,950.00 | 39,195,000 | |
| ミニストップ | 13,300 | 1,407.00 | 18,713,100 | |
| アークス | 34,100 | 2,078.00 | 70,859,800 | |
| バローホールディングス | 39,500 | 2,145.00 | 84,727,500 | |
| ベルク | 8,000 | 5,230.00 | 41,840,000 | |
| 大庄 | 9,900 | 988.00 | 9,781,200 | |
| ファーストリテイリング | 23,800 | 67,640.00 | 1,609,832,000 | |
| サンドラッグ | 67,000 | 2,905.00 | 194,635,000 | |
| サックスバー　ホールディングス | 17,500 | 510.00 | 8,925,000 | |
| ヤマザワ | 4,400 | 1,577.00 | 6,938,800 | |
| やまや | 3,600 | 2,405.00 | 8,658,000 | |
| ベルーナ | 38,700 | 712.00 | 27,554,400 | |
| 島根銀行 | 5,800 | 557.00 | 3,230,600 | |
| じもとホールディングス | 12,700 | 652.00 | 8,280,400 | |
| めぶきフィナンシャルグループ | 925,200 | 250.00 | 231,300,000 | |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 22,300 | 1,560.00 | 34,788,000 | |
| 九州フィナンシャルグループ | 363,600 | 431.00 | 156,711,600 | |
| ゆうちょ銀行 | 420,300 | 1,098.00 | 461,489,400 | |
| 富山第一銀行 | 42,400 | 297.00 | 12,592,800 | |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 1,017,000 | 455.00 | 462,735,000 | |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 116,300 | 770.00 | 89,551,000 | |
| 三十三フィナンシャルグループ | 16,500 | 1,468.00 | 24,222,000 | |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 29,000 | 2,566.00 | 74,414,000 | |
| ひろぎんホールディングス | 262,600 | 691.00 | 181,456,600 | |
| おきなわフィナンシャルグループ | 16,100 | 2,220.00 | 35,742,000 | |
| 十六フィナンシャルグループ | 23,900 | 2,209.00 | 52,795,100 | |
| 北國フィナンシャルホールディングス | 16,500 | 2,711.00 | 44,731,500 | |
| 新生銀行 | 116,200 | 2,066.00 | 240,069,200 | |
| あおぞら銀行 | 99,500 | 2,573.00 | 256,013,500 | |
| 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ | 11,167,300 | 684.30 | 7,641,783,390 | |
| りそなホールディングス | 2,038,100 | 483.80 | 986,032,780 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 336,600 | 4,045.00 | 1,361,547,000 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 1,232,600 | 4,158.00 | 5,125,150,800 | |
| 千葉銀行 | 594,300 | 705.00 | 418,981,500 | |
| 群馬銀行 | 342,100 | 367.00 | 125,550,700 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 武蔵野銀行 | 26,500 | 1,790.00 | 47,435,000 | |
| 千葉興業銀行 | 41,900 | 269.00 | 11,271,100 | |
| 筑波銀行 | 69,400 | 182.00 | 12,630,800 | |
| 七十七銀行 | 55,900 | 1,343.00 | 75,073,700 | |
| 青森銀行 | 13,800 | 1,852.00 | 25,557,600 | |
| 秋田銀行 | 11,400 | 1,646.00 | 18,764,400 | |
| 山形銀行 | 20,000 | 900.00 | 18,000,000 | |
| 岩手銀行 | 11,700 | 1,881.00 | 22,007,700 | |
| 東邦銀行 | 148,600 | 211.00 | 31,354,600 | |
| 東北銀行 | 8,500 | 1,003.00 | 8,525,500 | |
| みちのく銀行 | 11,400 | 843.00 | 9,610,200 | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 150,000 | 2,129.00 | 319,350,000 | |
| 静岡銀行 | 433,700 | 867.00 | 376,017,900 | |
| スルガ銀行 | 156,100 | 478.00 | 74,615,800 | |
| 八十二銀行 | 401,100 | 397.00 | 159,236,700 | |
| 山梨中央銀行 | 19,300 | 902.00 | 17,408,600 | |
| 大垣共立銀行 | 35,200 | 1,966.00 | 69,203,200 | |
| 福井銀行 | 15,200 | 1,361.00 | 20,687,200 | |
| 清水銀行 | 7,300 | 1,552.00 | 11,329,600 | |
| 富山銀行 | 3,200 | 1,933.00 | 6,185,600 | |
| 滋賀銀行 | 33,500 | 2,106.00 | 70,551,000 | |
| 南都銀行 | 27,800 | 1,914.00 | 53,209,200 | |
| 百五銀行 | 170,900 | 345.00 | 58,960,500 | |
| 京都銀行 | 63,800 | 5,190.00 | 331,122,000 | |
| 紀陽銀行 | 62,700 | 1,400.00 | 87,780,000 | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 111,100 | 893.00 | 99,212,300 | |
| 山陰合同銀行 | 105,600 | 632.00 | 66,739,200 | |
| 中国銀行 | 142,300 | 902.00 | 128,354,600 | |
| 鳥取銀行 | 5,700 | 1,156.00 | 6,589,200 | |
| 伊予銀行 | 235,900 | 583.00 | 137,529,700 | |
| 百十四銀行 | 18,900 | 1,510.00 | 28,539,000 | |
| 四国銀行 | 27,100 | 779.00 | 21,110,900 | |
| 阿波銀行 | 27,300 | 2,165.00 | 59,104,500 | |
| 大分銀行 | 10,200 | 1,882.00 | 19,196,400 | |
| 宮崎銀行 | 11,100 | 2,049.00 | 22,743,900 | |
| 佐賀銀行 | 10,100 | 1,449.00 | 14,634,900 | |
| 琉球銀行 | 38,700 | 773.00 | 29,915,100 | |
| セブン銀行 | 528,800 | 239.00 | 126,383,200 | |
| みずほフィナンシャルグループ | 2,277,300 | 1,565.50 | 3,565,113,150 | |
| 高知銀行 | 6,500 | 751.00 | 4,881,500 | |
| 山口フィナンシャルグループ | 207,400 | 694.00 | 143,935,600 | |
| 長野銀行 | 5,800 | 1,187.00 | 6,884,600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 名古屋銀行 | 13,300 | 2,856.00 | 37,984,800 | |
| 北洋銀行 | 268,400 | 248.00 | 66,563,200 | |
| 愛知銀行 | 6,400 | 4,665.00 | 29,856,000 | |
| 中京銀行 | 6,400 | 1,724.00 | 11,033,600 | |
| 大光銀行 | 6,100 | 1,337.00 | 8,155,700 | |
| 愛媛銀行 | 24,900 | 871.00 | 21,687,900 | |
| トマト銀行 | 6,400 | 1,044.00 | 6,681,600 | |
| 京葉銀行 | 75,900 | 465.00 | 35,293,500 | |
| 栃木銀行 | 86,000 | 213.00 | 18,318,000 | |
| 北日本銀行 | 5,500 | 1,586.00 | 8,723,000 | |
| 東和銀行 | 31,300 | 530.00 | 16,589,000 | |
| 福島銀行 | 20,400 | 248.00 | 5,059,200 | |
| 大東銀行 | 8,500 | 721.00 | 6,128,500 | |
| トモニホールディングス | 137,700 | 317.00 | 43,650,900 | |
| フィデアホールディングス | 16,300 | 1,363.00 | 22,216,900 | |
| 池田泉州ホールディングス | 204,800 | 175.00 | 35,840,000 | |
| ＦＰＧ | 60,200 | 688.00 | 41,417,600 | |
| ジャパンインベストメントアドバイザー | 13,900 | 1,061.00 | 14,747,900 | |
| マーキュリアホールディングス | 7,400 | 520.00 | 3,848,000 | |
| ＳＢＩホールディングス | 219,700 | 3,115.00 | 684,365,500 | |
| ジャフコ　グループ | 22,700 | 6,110.00 | 138,697,000 | |
| 大和証券グループ本社 | 1,333,800 | 710.50 | 947,664,900 | |
| 野村ホールディングス | 2,719,100 | 512.30 | 1,392,994,930 | |
| 岡三証券グループ | 140,500 | 386.00 | 54,233,000 | |
| 丸三証券 | 53,200 | 529.00 | 28,142,800 | |
| 東洋証券 | 60,000 | 149.00 | 8,940,000 | |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 205,000 | 401.00 | 82,205,000 | |
| 光世証券 | 4,100 | 490.00 | 2,009,000 | |
| 水戸証券 | 48,200 | 277.00 | 13,351,400 | |
| いちよし証券 | 33,600 | 668.00 | 22,444,800 | |
| 松井証券 | 87,400 | 801.00 | 70,007,400 | |
| マネックスグループ | 145,400 | 612.00 | 88,984,800 | |
| 極東証券 | 24,100 | 750.00 | 18,075,000 | |
| 岩井コスモホールディングス | 17,000 | 1,368.00 | 23,256,000 | |
| アイザワ証券グループ | 29,500 | 960.00 | 28,320,000 | |
| マネーパートナーズグループ | 19,800 | 219.00 | 4,336,200 | |
| スパークス・グループ | 82,800 | 269.00 | 22,273,200 | |
| かんぽ生命保険 | 179,200 | 2,016.00 | 361,267,200 | |
| ＳＯＭＰＯホールディングス | 292,300 | 5,274.00 | 1,541,590,200 | |
| アニコム　ホールディングス | 54,700 | 693.00 | 37,907,100 | |
| ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス | 399,300 | 3,912.00 | 1,562,061,600 | |
| 第一生命ホールディングス | 876,500 | 2,574.00 | 2,256,111,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 東京海上ホールディングス | 586,400 | 6,801.00 | 3,988,106,400 | |
| Ｔ＆Ｄホールディングス | 462,200 | 1,663.00 | 768,638,600 | |
| アドバンスクリエイト | 8,500 | 1,016.00 | 8,636,000 | |
| 全国保証 | 42,600 | 5,220.00 | 222,372,000 | |
| あんしん保証 | 7,000 | 273.00 | 1,911,000 | |
| イントラスト | 8,200 | 687.00 | 5,633,400 | |
| 日本モーゲージサービス | 10,300 | 1,076.00 | 11,082,800 | |
| Ｃａｓａ | 6,700 | 886.00 | 5,936,200 | |
| アルヒ | 26,700 | 1,128.00 | 30,117,600 | |
| プレミアグループ | 9,100 | 3,420.00 | 31,122,000 | |
| クレディセゾン | 114,700 | 1,252.00 | 143,604,400 | |
| 芙蓉総合リース | 18,700 | 7,600.00 | 142,120,000 | |
| みずほリース | 27,600 | 3,160.00 | 87,216,000 | |
| 東京センチュリー | 34,600 | 5,600.00 | 193,760,000 | |
| 日本証券金融 | 70,400 | 930.00 | 65,472,000 | |
| アイフル | 300,100 | 340.00 | 102,034,000 | |
| リコーリース | 15,900 | 3,725.00 | 59,227,500 | |
| イオンフィナンシャルサービス | 97,200 | 1,172.00 | 113,918,400 | |
| アコム | 352,700 | 322.00 | 113,569,400 | |
| ジャックス | 19,800 | 3,005.00 | 59,499,000 | |
| オリエントコーポレーション | 485,400 | 126.00 | 61,160,400 | |
| オリックス | 1,081,200 | 2,479.00 | 2,680,294,800 | |
| 三菱ＨＣキャピタル | 658,600 | 603.00 | 397,135,800 | |
| 九州リースサービス | 9,500 | 582.00 | 5,529,000 | |
| 日本取引所グループ | 451,100 | 2,364.50 | 1,066,625,950 | |
| イー・ギャランティ | 26,400 | 1,924.00 | 50,793,600 | |
| アサックス | 9,900 | 690.00 | 6,831,000 | |
| ＮＥＣキャピタルソリューション | 7,500 | 2,001.00 | 15,007,500 | |
| いちご | 203,400 | 290.00 | 58,986,000 | |
| 日本駐車場開発 | 208,400 | 135.00 | 28,134,000 | |
| スター・マイカ・ホールディングス | 11,100 | 1,246.00 | 13,830,600 | |
| ＳＲＥホールディングス | 4,600 | 4,945.00 | 22,747,000 | |
| ＡＤワークスグループ | 36,000 | 139.00 | 5,004,000 | |
| ヒューリック | 426,600 | 1,052.00 | 448,783,200 | |
| 三栄建築設計 | 8,400 | 1,570.00 | 13,188,000 | |
| 野村不動産ホールディングス | 92,600 | 2,647.00 | 245,112,200 | |
| 三重交通グループホールディングス | 40,400 | 462.00 | 18,664,800 | |
| サムティ | 29,300 | 2,090.00 | 61,237,000 | |
| ディア・ライフ | 26,800 | 522.00 | 13,989,600 | |
| 地主 | 12,500 | 1,672.00 | 20,900,000 | |
| プレサンスコーポレーション | 24,000 | 2,067.00 | 49,608,000 | |
| ハウスコム | 5,000 | 1,225.00 | 6,125,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日本管理センター | 10,600 | 951.00 | 10,080,600 | |
| サンセイランディック | 8,200 | 800.00 | 6,560,000 | |
| フージャースホールディングス | 23,300 | 666.00 | 15,517,800 | |
| オープンハウスグループ | 56,800 | 5,830.00 | 331,144,000 | |
| 東急不動産ホールディングス | 526,700 | 644.00 | 339,194,800 | |
| 飯田グループホールディングス | 149,100 | 2,598.00 | 387,361,800 | |
| イーグランド | 4,400 | 1,416.00 | 6,230,400 | |
| ムゲンエステート | 15,900 | 474.00 | 7,536,600 | |
| Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス | 8,800 | 822.00 | 7,233,600 | |
| シーアールイー | 6,200 | 1,649.00 | 10,223,800 | |
| ケイアイスター不動産 | 8,200 | 7,140.00 | 58,548,000 | |
| グッドコムアセット | 9,500 | 1,064.00 | 10,108,000 | |
| ジェイ・エス・ビー | 4,400 | 2,939.00 | 12,931,600 | |
| テンポイノベーション | 7,600 | 816.00 | 6,201,600 | |
| フェイスネットワーク | 3,600 | 1,289.00 | 4,640,400 | |
| パーク２４ | 96,500 | 1,708.00 | 164,822,000 | |
| パラカ | 6,100 | 1,570.00 | 9,577,000 | |
| 三井不動産 | 812,400 | 2,323.50 | 1,887,611,400 | |
| 三菱地所 | 1,170,800 | 1,622.00 | 1,899,037,600 | |
| 平和不動産 | 30,900 | 3,880.00 | 119,892,000 | |
| 東京建物 | 176,700 | 1,652.00 | 291,908,400 | |
| 京阪神ビルディング | 29,700 | 1,469.00 | 43,629,300 | |
| 住友不動産 | 374,000 | 3,406.00 | 1,273,844,000 | |
| テーオーシー | 35,400 | 688.00 | 24,355,200 | |
| 東京楽天地 | 3,500 | 3,865.00 | 13,527,500 | |
| スターツコーポレーション | 24,800 | 2,453.00 | 60,834,400 | |
| フジ住宅 | 23,900 | 651.00 | 15,558,900 | |
| 空港施設 | 22,100 | 550.00 | 12,155,000 | |
| 明和地所 | 12,400 | 599.00 | 7,427,600 | |
| ゴールドクレスト | 15,300 | 1,599.00 | 24,464,700 | |
| エスリード | 8,300 | 1,688.00 | 14,010,400 | |
| 日神グループホールディングス | 33,300 | 490.00 | 16,317,000 | |
| 日本エスコン | 33,200 | 753.00 | 24,999,600 | |
| タカラレーベン | 74,600 | 296.00 | 22,081,600 | |
| ＡＶＡＮＴＩＡ | 12,000 | 831.00 | 9,972,000 | |
| イオンモール | 90,100 | 1,612.00 | 145,241,200 | |
| 毎日コムネット | 9,200 | 700.00 | 6,440,000 | |
| ファースト住建 | 8,600 | 1,138.00 | 9,786,800 | |
| カチタス | 44,400 | 3,660.00 | 162,504,000 | |
| トーセイ | 26,300 | 1,034.00 | 27,194,200 | |
| 穴吹興産 | 5,000 | 1,888.00 | 9,440,000 | |
| サンフロンティア不動産 | 26,400 | 1,010.00 | 26,664,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ＦＪネクストホールディングス | 19,600 | 974.00 | 19,090,400 | |
| インテリックス | 4,000 | 613.00 | 2,452,000 | |
| ランドビジネス | 7,500 | 259.00 | 1,942,500 | |
| サンネクスタグループ | 8,000 | 1,005.00 | 8,040,000 | |
| グランディハウス | 17,100 | 483.00 | 8,259,300 | |
| 日本空港ビルデング | 68,200 | 4,800.00 | 327,360,000 | |
| 明豊ファシリティワークス | 8,300 | 773.00 | 6,415,900 | |
| 日本工営 | 10,200 | 3,030.00 | 30,906,000 | |
| ＬＩＦＵＬＬ | 54,000 | 231.00 | 12,474,000 | |
| ミクシィ | 39,600 | 2,147.00 | 85,021,200 | |
| ジェイエイシーリクルートメント | 14,100 | 1,982.00 | 27,946,200 | |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 283,100 | 2,235.00 | 632,728,500 | |
| メンバーズ | 5,300 | 2,229.00 | 11,813,700 | |
| 中広 | 3,600 | 374.00 | 1,346,400 | |
| ＵＴグループ | 25,000 | 3,520.00 | 88,000,000 | |
| アイティメディア | 8,300 | 1,533.00 | 12,723,900 | |
| Ｅ・Ｊホールディングス | 9,300 | 1,137.00 | 10,574,100 | |
| 夢真ビーネックスグループ | 46,100 | 1,488.00 | 68,596,800 | |
| コシダカホールディングス | 46,700 | 603.00 | 28,160,100 | |
| アルトナー | 4,500 | 867.00 | 3,901,500 | |
| パソナグループ | 18,800 | 2,686.00 | 50,496,800 | |
| ＣＤＳ | 4,500 | 1,568.00 | 7,056,000 | |
| リンクアンドモチベーション | 38,000 | 474.00 | 18,012,000 | |
| エス・エム・エス | 58,700 | 3,470.00 | 203,689,000 | |
| サニーサイドアップグループ | 6,400 | 714.00 | 4,569,600 | |
| パーソルホールディングス | 172,600 | 3,070.00 | 529,882,000 | |
| リニカル | 10,100 | 667.00 | 6,736,700 | |
| クックパッド | 55,400 | 260.00 | 14,404,000 | |
| アイ・ケイ・ケイホールディングス | 8,900 | 587.00 | 5,224,300 | |
| 学情 | 7,300 | 1,010.00 | 7,373,000 | |
| スタジオアリス | 7,900 | 2,106.00 | 16,637,400 | |
| シミックホールディングス | 9,800 | 1,422.00 | 13,935,600 | |
| エプコ | 4,100 | 729.00 | 2,988,900 | |
| ＮＪＳ | 4,000 | 1,945.00 | 7,780,000 | |
| 綜合警備保障 | 68,700 | 4,265.00 | 293,005,500 | |
| カカクコム | 126,700 | 2,582.00 | 327,139,400 | |
| アイロムグループ | 6,200 | 1,547.00 | 9,591,400 | |
| セントケア・ホールディング | 11,600 | 737.00 | 8,549,200 | |
| サイネックス | 3,400 | 589.00 | 2,002,600 | |
| ルネサンス | 12,300 | 1,033.00 | 12,705,900 | |
| ディップ | 30,400 | 3,380.00 | 102,752,000 | |
| デジタルホールディングス | 12,300 | 1,307.00 | 16,076,100 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 新日本科学 | 21,200 | 1,235.00 | 26,182,000 | |
| キャリアデザインセンター | 4,700 | 960.00 | 4,512,000 | |
| ベネフィット・ワン | 62,800 | 3,785.00 | 237,698,000 | |
| エムスリー | 304,500 | 4,615.00 | 1,405,267,500 | |
| ツカダ・グローバルホールディング | 11,000 | 267.00 | 2,937,000 | |
| アウトソーシング | 99,000 | 1,346.00 | 133,254,000 | |
| ウェルネット | 18,100 | 429.00 | 7,764,900 | |
| ワールドホールディングス | 7,000 | 2,347.00 | 16,429,000 | |
| ディー・エヌ・エー | 65,900 | 1,796.00 | 118,356,400 | |
| 博報堂ＤＹホールディングス | 240,400 | 1,908.00 | 458,683,200 | |
| ぐるなび | 29,100 | 386.00 | 11,232,600 | |
| タカミヤ | 21,600 | 397.00 | 8,575,200 | |
| ジャパンベストレスキューシステム | 11,700 | 853.00 | 9,980,100 | |
| ファンコミュニケーションズ | 43,900 | 378.00 | 16,594,200 | |
| ライク | 4,800 | 1,819.00 | 8,731,200 | |
| ビジネス・ブレークスルー | 7,100 | 397.00 | 2,818,700 | |
| エスプール | 49,000 | 1,131.00 | 55,419,000 | |
| ＷＤＢホールディングス | 8,000 | 2,790.00 | 22,320,000 | |
| 手間いらず | 2,200 | 4,480.00 | 9,856,000 | |
| ティア | 10,800 | 431.00 | 4,654,800 | |
| ＣＤＧ | 2,100 | 1,359.00 | 2,853,900 | |
| アドウェイズ | 26,100 | 816.00 | 21,297,600 | |
| バリューコマース | 13,600 | 3,700.00 | 50,320,000 | |
| インフォマート | 189,400 | 773.00 | 146,406,200 | |
| ＪＰホールディングス | 45,600 | 229.00 | 10,442,400 | |
| エコナックホールディングス | 34,700 | 89.00 | 3,088,300 | |
| ＣＬホールディングス | 3,900 | 1,230.00 | 4,797,000 | |
| プレステージ・インターナショナル | 65,100 | 693.00 | 45,114,300 | |
| アミューズ | 9,500 | 2,003.00 | 19,028,500 | |
| ドリームインキュベータ | 5,000 | 1,900.00 | 9,500,000 | |
| クイック | 12,000 | 1,250.00 | 15,000,000 | |
| ＴＡＣ | 10,800 | 216.00 | 2,332,800 | |
| 電通グループ | 177,900 | 4,245.00 | 755,185,500 | |
| イオンファンタジー | 6,800 | 1,863.00 | 12,668,400 | |
| シーティーエス | 19,800 | 752.00 | 14,889,600 | |
| ネクシィーズグループ | 6,500 | 674.00 | 4,381,000 | |
| Ｈ．Ｕ．グループホールディングス | 45,200 | 2,905.00 | 131,306,000 | |
| アルプス技研 | 15,400 | 1,811.00 | 27,889,400 | |
| ダイオーズ | 3,700 | 997.00 | 3,688,900 | |
| 日本空調サービス | 18,400 | 775.00 | 14,260,000 | |
| オリエンタルランド | 203,900 | 18,735.00 | 3,820,066,500 | |
| ダスキン | 40,100 | 2,674.00 | 107,227,400 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 明光ネットワークジャパン | 20,800 | 559.00 | 11,627,200 | |
| ファルコホールディングス | 8,400 | 2,004.00 | 16,833,600 | |
| ラウンドワン | 48,400 | 1,357.00 | 65,678,800 | |
| リゾートトラスト | 79,200 | 1,870.00 | 148,104,000 | |
| ビー・エム・エル | 22,300 | 3,580.00 | 79,834,000 | |
| りらいあコミュニケーションズ | 26,400 | 993.00 | 26,215,200 | |
| リソー教育 | 79,600 | 365.00 | 29,054,000 | |
| 早稲田アカデミー | 9,900 | 1,025.00 | 10,147,500 | |
| ユー・エス・エス | 193,300 | 1,878.00 | 363,017,400 | |
| 東京個別指導学院 | 15,700 | 576.00 | 9,043,200 | |
| サイバーエージェント | 425,400 | 1,815.00 | 772,101,000 | |
| 楽天グループ | 886,700 | 1,072.00 | 950,542,400 | |
| クリーク・アンド・リバー社 | 9,200 | 1,812.00 | 16,670,400 | |
| モーニングスター | 30,700 | 616.00 | 18,911,200 | |
| テー・オー・ダブリュー | 31,200 | 290.00 | 9,048,000 | |
| 山田コンサルティンググループ | 9,200 | 1,075.00 | 9,890,000 | |
| セントラルスポーツ | 6,600 | 2,370.00 | 15,642,000 | |
| フルキャストホールディングス | 14,800 | 2,099.00 | 31,065,200 | |
| エン・ジャパン | 28,000 | 2,912.00 | 81,536,000 | |
| リソルホールディングス | 1,900 | 4,265.00 | 8,103,500 | |
| テクノプロ・ホールディングス | 103,400 | 3,100.00 | 320,540,000 | |
| アトラグループ | 3,800 | 253.00 | 961,400 | |
| インターワークス | 5,800 | 374.00 | 2,169,200 | |
| アイ・アールジャパンホールディングス | 8,000 | 5,340.00 | 42,720,000 | |
| ＫｅｅＰｅｒ技研 | 11,200 | 1,853.00 | 20,753,600 | |
| ファーストロジック | 3,700 | 783.00 | 2,897,100 | |
| 三機サービス | 3,600 | 962.00 | 3,463,200 | |
| Ｇｕｎｏｓｙ | 11,300 | 847.00 | 9,571,100 | |
| デザインワン・ジャパン | 5,900 | 188.00 | 1,109,200 | |
| イー・ガーディアン | 7,100 | 2,903.00 | 20,611,300 | |
| リブセンス | 11,300 | 177.00 | 2,000,100 | |
| ジャパンマテリアル | 53,200 | 1,770.00 | 94,164,000 | |
| ベクトル | 24,500 | 1,151.00 | 28,199,500 | |
| ウチヤマホールディングス | 9,500 | 304.00 | 2,888,000 | |
| チャーム・ケア・コーポレーション | 13,100 | 1,257.00 | 16,466,700 | |
| キャリアリンク | 6,600 | 1,516.00 | 10,005,600 | |
| ＩＢＪ | 14,500 | 770.00 | 11,165,000 | |
| アサンテ | 7,800 | 1,670.00 | 13,026,000 | |
| バリューＨＲ | 7,000 | 2,393.00 | 16,751,000 | |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 14,300 | 4,800.00 | 68,640,000 | |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 6,900 | 1,482.00 | 10,225,800 | |
| ＥＲＩホールディングス | 5,100 | 1,161.00 | 5,921,100 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| アビスト | 2,800 | 2,874.00 | 8,047,200 | |
| シグマクシス・ホールディングス | 10,500 | 2,217.00 | 23,278,500 | |
| ウィルグループ | 12,900 | 1,247.00 | 16,086,300 | |
| エスクロー・エージェント・ジャパン | 24,900 | 175.00 | 4,357,500 | |
| メドピア | 13,400 | 2,966.00 | 39,744,400 | |
| レアジョブ | 3,600 | 760.00 | 2,736,000 | |
| リクルートホールディングス | 1,330,900 | 6,146.00 | 8,179,711,400 | |
| エラン | 24,100 | 981.00 | 23,642,100 | |
| 土木管理総合試験所 | 8,900 | 310.00 | 2,759,000 | |
| ネットマーケティング | 9,100 | 410.00 | 3,731,000 | |
| 日本郵政 | 2,253,100 | 966.10 | 2,176,719,910 | |
| ベルシステム２４ホールディングス | 25,000 | 1,449.00 | 36,225,000 | |
| 鎌倉新書 | 20,100 | 520.00 | 10,452,000 | |
| ＳＭＮ | 4,200 | 608.00 | 2,553,600 | |
| グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ | 3,500 | 812.00 | 2,842,000 | |
| エアトリ | 11,300 | 2,634.00 | 29,764,200 | |
| アトラエ | 12,100 | 1,893.00 | 22,905,300 | |
| ストライク | 6,600 | 4,525.00 | 29,865,000 | |
| ソラスト | 42,600 | 1,071.00 | 45,624,600 | |
| セラク | 5,600 | 1,208.00 | 6,764,800 | |
| インソース | 16,800 | 2,039.00 | 34,255,200 | |
| ベイカレント・コンサルティング | 12,200 | 44,650.00 | 544,730,000 | |
| Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ | 3,400 | 2,857.00 | 9,713,800 | |
| アイモバイル | 5,200 | 1,131.00 | 5,881,200 | |
| キャリアインデックス | 6,200 | 751.00 | 4,656,200 | |
| ＭＳ－Ｊａｐａｎ | 7,300 | 844.00 | 6,161,200 | |
| 船場 | 3,900 | 736.00 | 2,870,400 | |
| ジャパンエレベーターサービスホールディングス | 54,900 | 1,751.00 | 96,129,900 | |
| フルテック | 2,600 | 1,381.00 | 3,590,600 | |
| ＧａｍｅＷｉｔｈ | 5,800 | 437.00 | 2,534,600 | |
| ソウルドアウト | 4,400 | 1,031.00 | 4,536,400 | |
| ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ | 3,000 | 676.00 | 2,028,000 | |
| ウェルビー | 11,500 | 1,187.00 | 13,650,500 | |
| エル・ティー・エス | 2,300 | 2,437.00 | 5,605,100 | |
| ミダックホールディングス | 7,600 | 3,080.00 | 23,408,000 | |
| 日総工産 | 13,800 | 842.00 | 11,619,600 | |
| キュービーネットホールディングス | 8,100 | 1,700.00 | 13,770,000 | |
| ＲＰＡホールディングス | 25,100 | 336.00 | 8,433,600 | |
| スプリックス | 5,100 | 1,500.00 | 7,650,000 | |
| マネジメントソリューションズ | 8,500 | 3,430.00 | 29,155,000 | |
| プロレド・パートナーズ | 4,100 | 857.00 | 3,513,700 | |
| テノ．ホールディングス | 2,600 | 714.00 | 1,856,400 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| フロンティア・マネジメント | 4,900 | 658.00 | 3,224,200 | |
| ピアラ | 3,300 | 592.00 | 1,953,600 | |
| コプロ・ホールディングス | 3,600 | 1,137.00 | 4,093,200 | |
| ギークス | 3,100 | 1,464.00 | 4,538,400 | |
| カーブスホールディングス | 47,700 | 704.00 | 33,580,800 | |
| フォーラムエンジニアリング | 12,400 | 831.00 | 10,304,400 | |
| ダイレクトマーケティングミックス | 20,100 | 1,366.00 | 27,456,600 | |
| ポピンズホールディングス | 4,100 | 2,553.00 | 10,467,300 | |
| ＬＩＴＡＬＩＣＯ | 14,000 | 3,255.00 | 45,570,000 | |
| アドバンテッジリスクマネジメント | 9,200 | 740.00 | 6,808,000 | |
| リログループ | 94,500 | 2,036.00 | 192,402,000 | |
| 東祥 | 13,100 | 1,420.00 | 18,602,000 | |
| ＴＲＥホールディングス | 23,800 | 1,531.00 | 36,437,800 | |
| 人・夢・技術グループ | 7,000 | 1,877.00 | 13,139,000 | |
| エイチ・アイ・エス | 38,500 | 1,924.00 | 74,074,000 | |
| ラックランド | 5,100 | 2,703.00 | 13,785,300 | |
| 共立メンテナンス | 30,900 | 4,005.00 | 123,754,500 | |
| イチネンホールディングス | 17,900 | 1,268.00 | 22,697,200 | |
| 建設技術研究所 | 10,400 | 2,409.00 | 25,053,600 | |
| スペース | 12,700 | 887.00 | 11,264,900 | |
| 燦ホールディングス | 7,700 | 1,507.00 | 11,603,900 | |
| スバル興業 | 1,100 | 8,660.00 | 9,526,000 | |
| 東京テアトル | 6,700 | 1,205.00 | 8,073,500 | |
| タナベ経営 | 7,100 | 639.00 | 4,536,900 | |
| ナガワ | 5,500 | 10,200.00 | 56,100,000 | |
| 東京都競馬 | 13,000 | 4,085.00 | 53,105,000 | |
| カナモト | 30,500 | 2,282.00 | 69,601,000 | |
| 西尾レントオール | 16,000 | 2,768.00 | 44,288,000 | |
| トランス・コスモス | 22,000 | 3,100.00 | 68,200,000 | |
| 乃村工藝社 | 74,300 | 961.00 | 71,402,300 | |
| 藤田観光 | 7,500 | 2,224.00 | 16,680,000 | |
| ＫＮＴ－ＣＴホールディングス | 10,700 | 1,344.00 | 14,380,800 | |
| 日本管財 | 18,600 | 2,810.00 | 52,266,000 | |
| トーカイ | 15,300 | 1,901.00 | 29,085,300 | |
| セコム | 170,000 | 7,718.00 | 1,312,060,000 | |
| セントラル警備保障 | 8,400 | 2,234.00 | 18,765,600 | |
| 丹青社 | 35,700 | 740.00 | 26,418,000 | |
| メイテック | 20,900 | 6,560.00 | 137,104,000 | |
| 応用地質 | 19,600 | 2,055.00 | 40,278,000 | |
| 船井総研ホールディングス | 35,400 | 2,450.00 | 86,730,000 | |
| 進学会ホールディングス | 6,800 | 300.00 | 2,040,000 | |
| オオバ | 12,500 | 728.00 | 9,100,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| いであ | 4,800 | 1,721.00 | 8,260,800 | |
| 学究社 | 5,700 | 1,523.00 | 8,681,100 | |
| ベネッセホールディングス | 57,600 | 2,265.00 | 130,464,000 | |
| イオンディライト | 21,300 | 3,065.00 | 65,284,500 | |
| ナック | 8,500 | 945.00 | 8,032,500 | |
| ダイセキ | 31,700 | 4,675.00 | 148,197,500 | |
| ステップ | 6,500 | 1,840.00 | 11,960,000 | |
| 合　計 | 195,880,500 | | 478,384,690,050 | |

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス　マザーファンド

### 貸借対照表

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 192,267,526 |
| コール・ローン | 5,760,175,683 |
| 国債証券 | 296,954,980,057 |
| 派生商品評価勘定 | 446,323 |
| 未収利息 | 1,736,253,585 |
| 前払金 | 102,462,940 |
| 前払費用 | 82,341,517 |
| 差入委託証拠金 | 380,319,082 |
| 流動資産合計 | 305,209,246,713 |
| 資産合計 | 305,209,246,713 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 155,073,816 |
| 未払解約金 | 56,545,310 |
| 未払利息 | 8,637 |
| 流動負債合計 | 211,627,763 |
| 負債合計 | 211,627,763 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 99,838,150,047 |

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 205,159,468,903 |
| 元本等合計 | 304,997,618,950 |
| 純資産合計 | 304,997,618,950 |
| 負債純資産合計 | 305,209,246,713 |

**注記表**

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券<br>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br>債券先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。<br><br>(2)為替予約取引<br>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。<br><br>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。 |
| 3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。<br>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。 |
| 4.収益及び費用の計上基準 | (1)派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。<br><br>(2)為替予約取引による為替差損益<br>約定日基準で計上しております。 |

**（貸借対照表に関する注記）**

| | | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|---|
| 1． | 計算期間の末日における受益権の総数 | 99,838,150,047口 |
| 2． | 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 3.0549円<br>(1万口当たり純資産額) (30,549円) |

**（金融商品に関する注記）**

**1．金融商品の状況に関する事項**

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2.金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。<br>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。 |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。 |

**2．金融商品の時価等に関する事項**

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 |

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| ３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | (2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。<br><br>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（重要な後発事象に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（その他の注記）
元本の移動

| 区分 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2021年 1月21日 |
| 期首元本額 | 94,925,048,586円 |
| 期中追加設定元本額 | 18,464,979,910円 |
| 期中一部解約元本額 | 13,551,878,449円 |
| 期末元本額 | 99,838,150,047円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| 外国債券オープン（毎月決算型） | 1,353,264,978円 |
| グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型） | 583,951,881円 |
| 財産四分法ファンド（毎月決算型） | 397,686,870円 |

| 区分 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 2,132,380,782円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 9,598,073円 |
| ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン | 8,075,275,758円 |
| 世界経済インデックスファンド | 12,400,849,452円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 1,914,914,780円 |
| ＤＣマイセレクション５０ | 1,636,612,404円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 1,139,329,552円 |
| ＤＣ外国債券インデックス・オープン | 2,263,400,969円 |
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 907,524,757円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 719,713,675円 |
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 393,832,613円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 33,892,851円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 88,370,664円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 44,880,089円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 12,155,146,927円 |
| 外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 647,490,776円 |
| マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,905,905円 |
| マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,288,528円 |
| 外国債券インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用） | 24,592,578円 |
| バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 51,768,994円 |
| バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 80,695,705円 |
| バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 77,774,842円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 85,922,076円 |
| バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,396,835,506円 |
| バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 457,581,750円 |
| バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,819,540,276円 |
| 世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用） | 121,017,203円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 58,059,740円 |
| バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 473,071,649円 |
| バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 171,577,863円 |
| バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 221,234,597円 |
| ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用） | 757,627,819円 |
| グローバル債券ファンド・シリーズ１（適格機関投資家専用） | 2,053,507,055円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ１ | 722,945,345円 |
| 外国債券ファンド・シリーズ１ | 668,070,931円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 681,973,907円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 1,818,091,465円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 259,544,875円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 556,972,964円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 511,465,046円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 3,873,065,760円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 775,215,048円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 245,900,131円 |

| 区分 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 106,355,945円 |
| ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり） | 1,379,145,123円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 196,130,892円 |
| 外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用） | 18,833,306,990円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 223,789,556円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 268,877,633円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 446,074,324円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 4,182,998円 |
| グローバル経済コア | 834,754,898円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 14,729,148円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 1,419,108円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 230,570,686円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 31,206,999円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 6,802,858円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 5,780,467円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 3,369,648円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 3,997,019円 |
| ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用） | 374,194,107円 |
| ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用） | 10,881,146,851円 |
| 外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用） | 334,300,420円 |
| 外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用） | 334,038,008円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 316,825,189円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 59,323,945円 |
| ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用） | 82,461,826円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券 | △6,841,377,416 |
| 合計 | △6,841,377,416 |

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2022年 1月20日現在）

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

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 債券先物取引<br>買建 | 5,719,800,575 | － | 5,617,337,635 | △102,462,940 |
| 合計 | | 5,719,800,575 | － | 5,617,337,635 | △102,462,940 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

### 通貨関連

（2022年 1月20日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価<br>(円) | 評価損益<br>(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 5,795,734,941 | － | 5,743,570,388 | △52,164,553 |
| | アメリカドル | 2,852,889,903 | － | 2,829,535,660 | △23,354,243 |
| | カナダドル | 221,045,074 | － | 220,270,385 | △774,689 |
| | ユーロ | 2,355,595,919 | － | 2,331,055,340 | △24,540,579 |
| | イギリスポンド | 366,204,045 | － | 362,709,003 | △3,495,042 |
| 合計 | | 5,795,734,941 | － | 5,743,570,388 | △52,164,553 |

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第１　有価証券明細表

#### (1)株式

該当事項はありません。

#### (2)株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 国債証券 | アメリカドル | T 0.125% 01/15/24 | 10,000,000.00 | 9,819,140.60 | |
| | | T 0.125% 02/15/24 | 4,710,000.00 | 4,619,847.67 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 0.125% 03/31/23 | 8,000,000.00 | 7,944,531.28 | |
| | | T 0.125% 04/30/23 | 5,000,000.00 | 4,959,667.95 | |
| | | T 0.125% 05/15/23 | 7,500,000.00 | 7,436,572.27 | |
| | | T 0.125% 05/31/23 | 6,800,000.00 | 6,737,312.50 | |
| | | T 0.125% 07/31/23 | 5,000,000.00 | 4,942,871.10 | |
| | | T 0.125% 09/15/23 | 8,060,000.00 | 7,954,369.91 | |
| | | T 0.125% 10/15/23 | 8,000,000.00 | 7,885,000.00 | |
| | | T 0.125% 12/15/23 | 3,250,000.00 | 3,195,727.53 | |
| | | T 0.125% 12/31/22 | 6,400,000.00 | 6,373,374.97 | |
| | | T 0.25% 03/15/24 | 13,000,000.00 | 12,765,898.47 | |
| | | T 0.25% 04/15/23 | 10,150,000.00 | 10,091,518.54 | |
| | | T 0.25% 05/15/24 | 10,000,000.00 | 9,795,312.50 | |
| | | T 0.25% 06/15/23 | 8,000,000.00 | 7,937,500.00 | |
| | | T 0.25% 06/15/24 | 9,000,000.00 | 8,803,125.00 | |
| | | T 0.25% 06/30/25 | 1,000,000.00 | 960,742.19 | |
| | | T 0.25% 07/31/25 | 10,000,000.00 | 9,592,578.10 | |
| | | T 0.25% 09/30/23 | 12,000,000.00 | 11,861,015.64 | |
| | | T 0.25% 09/30/25 | 7,500,000.00 | 7,173,632.85 | |
| | | T 0.25% 10/31/25 | 3,600,000.00 | 3,437,015.61 | |
| | | T 0.25% 11/15/23 | 11,000,000.00 | 10,855,625.00 | |
| | | T 0.375% 01/31/26 | 8,000,000.00 | 7,638,437.52 | |
| | | T 0.375% 04/15/24 | 7,000,000.00 | 6,884,609.41 | |
| | | T 0.375% 04/30/25 | 8,000,000.00 | 7,741,562.48 | |
| | | T 0.375% 07/15/24 | 9,010,000.00 | 8,830,503.95 | |
| | | T 0.375% 07/31/27 | 9,500,000.00 | 8,853,925.80 | |
| | | T 0.375% 08/15/24 | 5,000,000.00 | 4,893,554.70 | |
| | | T 0.375% 09/30/27 | 8,000,000.00 | 7,426,250.00 | |
| | | T 0.375% 11/30/25 | 3,000,000.00 | 2,872,968.75 | |
| | | T 0.375% 12/31/25 | 4,000,000.00 | 3,826,406.24 | |
| | | T 0.5% 02/28/26 | 11,500,000.00 | 11,020,234.37 | |
| | | T 0.5% 03/15/23 | 7,770,000.00 | 7,756,493.56 | |
| | | T 0.5% 03/31/25 | 7,220,000.00 | 7,026,526.59 | |
| | | T 0.5% 04/30/27 | 2,940,000.00 | 2,769,457.03 | |
| | | T 0.5% 05/31/27 | 3,500,000.00 | 3,290,683.58 | |
| | | T 0.5% 06/30/27 | 7,100,000.00 | 6,668,453.12 | |
| | | T 0.5% 08/31/27 | 4,660,000.00 | 4,362,560.96 | |
| | | T 0.5% 10/31/27 | 7,500,000.00 | 6,999,316.42 | |
| | | T 0.625% 05/15/30 | 14,100,000.00 | 12,822,187.50 | |
| | | T 0.625% 07/31/26 | 8,000,000.00 | 7,659,375.04 | |
| | | T 0.625% 08/15/30 | 15,950,000.00 | 14,458,425.86 | |
| | | T 0.625% 11/30/27 | 2,500,000.00 | 2,347,070.32 | |
| | | T 0.625% 12/31/27 | 10,000,000.00 | 9,376,562.50 | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 0.75% 01/31/28 | 8,500,000.00 | 8,019,218.75 | |
| | | T 0.75% 03/31/26 | 11,000,000.00 | 10,639,921.93 | |
| | | T 0.75% 04/30/26 | 3,000,000.00 | 2,898,281.25 | |
| | | T 0.75% 08/31/26 | 11,830,000.00 | 11,380,829.68 | |
| | | T 0.75% 11/15/24 | 5,860,000.00 | 5,772,328.89 | |
| | | T 0.875% 06/30/26 | 8,000,000.00 | 7,754,375.04 | |
| | | T 0.875% 09/30/26 | 6,000,000.00 | 5,799,375.00 | |
| | | T 0.875% 11/15/30 | 11,150,000.00 | 10,302,425.83 | |
| | | T 1.125% 02/15/31 | 15,050,000.00 | 14,186,976.56 | |
| | | T 1.125% 02/29/28 | 8,000,000.00 | 7,720,000.00 | |
| | | T 1.125% 05/15/40 | 6,260,000.00 | 5,236,392.21 | |
| | | T 1.125% 08/15/40 | 7,300,000.00 | 6,082,953.12 | |
| | | T 1.125% 08/31/28 | 10,210,000.00 | 9,791,230.51 | |
| | | T 1.25% 03/31/28 | 5,150,000.00 | 4,998,115.22 | |
| | | T 1.25% 04/30/28 | 8,000,000.00 | 7,759,375.04 | |
| | | T 1.25% 05/15/50 | 8,650,000.00 | 6,957,843.75 | |
| | | T 1.25% 06/30/28 | 9,500,000.00 | 9,199,414.11 | |
| | | T 1.25% 07/31/23 | 4,550,000.00 | 4,576,215.82 | |
| | | T 1.25% 08/15/31 | 12,680,000.00 | 12,032,131.24 | |
| | | T 1.25% 09/30/28 | 14,500,000.00 | 14,010,625.00 | |
| | | T 1.375% 01/31/25 | 4,000,000.00 | 4,004,843.76 | |
| | | T 1.375% 06/30/23 | 5,000,000.00 | 5,038,964.85 | |
| | | T 1.375% 08/15/50 | 9,900,000.00 | 8,213,132.86 | |
| | | T 1.375% 08/31/23 | 2,500,000.00 | 2,518,457.02 | |
| | | T 1.375% 09/30/23 | 4,000,000.00 | 4,029,140.64 | |
| | | T 1.375% 11/15/31 | 4,030,000.00 | 3,860,928.92 | |
| | | T 1.375% 11/15/40 | 6,000,000.00 | 5,215,781.28 | |
| | | T 1.5% 01/15/23 | 6,200,000.00 | 6,255,582.00 | |
| | | T 1.5% 01/31/27 | 6,000,000.00 | 5,962,500.00 | |
| | | T 1.5% 02/15/30 | 6,470,000.00 | 6,328,468.75 | |
| | | T 1.5% 02/28/23 | 7,800,000.00 | 7,874,953.16 | |
| | | T 1.5% 03/31/23 | 4,000,000.00 | 4,038,203.12 | |
| | | T 1.5% 08/15/26 | 7,500,000.00 | 7,466,308.57 | |
| | | T 1.5% 09/30/24 | 8,500,000.00 | 8,555,449.24 | |
| | | T 1.625% 02/15/26 | 8,100,000.00 | 8,129,425.76 | |
| | | T 1.625% 04/30/23 | 3,500,000.00 | 3,538,281.25 | |
| | | T 1.625% 05/15/26 | 2,270,000.00 | 2,274,876.95 | |
| | | T 1.625% 05/15/31 | 11,150,000.00 | 10,962,714.89 | |
| | | T 1.625% 05/31/23 | 1,000,000.00 | 1,011,230.47 | |
| | | T 1.625% 08/15/29 | 6,750,000.00 | 6,675,644.56 | |
| | | T 1.625% 10/31/23 | 2,500,000.00 | 2,528,759.77 | |
| | | T 1.625% 10/31/26 | 2,800,000.00 | 2,802,843.76 | |
| | | T 1.625% 11/15/50 | 6,900,000.00 | 6,090,328.12 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 1.625% 11/30/26 | 4,780,000.00 | 4,783,921.08 | |
| | | T 1.75% 01/31/23 | 7,550,000.00 | 7,639,361.34 | |
| | | T 1.75% 05/15/23 | 3,690,000.00 | 3,737,061.92 | |
| | | T 1.75% 06/30/24 | 2,400,000.00 | 2,432,718.74 | |
| | | T 1.75% 08/15/41 | 14,500,000.00 | 13,403,437.50 | |
| | | T 1.75% 11/15/29 | 3,000,000.00 | 2,993,671.89 | |
| | | T 1.875% 02/15/41 | 7,900,000.00 | 7,468,585.97 | |
| | | T 1.875% 02/15/51 | 13,600,000.00 | 12,743,624.99 | |
| | | T 1.875% 07/31/26 | 5,190,000.00 | 5,255,888.65 | |
| | | T 1.875% 08/31/24 | 6,000,000.00 | 6,100,312.50 | |
| | | T 1% 07/31/28 | 7,000,000.00 | 6,664,218.75 | |
| | | T 2.125% 02/29/24 | 5,100,000.00 | 5,211,363.29 | |
| | | T 2.125% 03/31/24 | 7,400,000.00 | 7,561,585.95 | |
| | | T 2.125% 05/15/25 | 2,400,000.00 | 2,457,375.00 | |
| | | T 2.125% 05/31/26 | 3,600,000.00 | 3,683,531.26 | |
| | | T 2.125% 07/31/24 | 4,800,000.00 | 4,911,562.51 | |
| | | T 2.125% 09/30/24 | 5,000,000.00 | 5,115,820.30 | |
| | | T 2.125% 11/30/23 | 2,680,000.00 | 2,735,275.00 | |
| | | T 2.25% 01/31/24 | 4,000,000.00 | 4,096,250.00 | |
| | | T 2.25% 02/15/27 | 8,950,000.00 | 9,218,150.41 | |
| | | T 2.25% 03/31/26 | 7,500,000.00 | 7,711,523.47 | |
| | | T 2.25% 04/30/24 | 7,000,000.00 | 7,175,273.42 | |
| | | T 2.25% 05/15/41 | 4,600,000.00 | 4,619,406.25 | |
| | | T 2.25% 08/15/27 | 8,550,000.00 | 8,807,168.01 | |
| | | T 2.25% 08/15/46 | 4,190,000.00 | 4,213,896.11 | |
| | | T 2.25% 08/15/49 | 5,500,000.00 | 5,590,664.09 | |
| | | T 2.25% 10/31/24 | 6,300,000.00 | 6,468,082.04 | |
| | | T 2.25% 11/15/24 | 10,150,000.00 | 10,421,591.77 | |
| | | T 2.25% 11/15/25 | 4,400,000.00 | 4,523,406.27 | |
| | | T 2.25% 11/15/27 | 7,650,000.00 | 7,878,005.87 | |
| | | T 2.25% 12/31/23 | 4,500,000.00 | 4,605,556.63 | |
| | | T 2.25% 12/31/24 | 5,400,000.00 | 5,545,757.82 | |
| | | T 2.375% 01/31/23 | 5,000,000.00 | 5,091,308.60 | |
| | | T 2.375% 02/29/24 | 5,760,000.00 | 5,915,475.01 | |
| | | T 2.375% 04/30/26 | 2,600,000.00 | 2,687,140.63 | |
| | | T 2.375% 05/15/27 | 5,840,000.00 | 6,053,525.00 | |
| | | T 2.375% 05/15/29 | 8,010,000.00 | 8,331,651.56 | |
| | | T 2.375% 05/15/51 | 2,750,000.00 | 2,881,269.54 | |
| | | T 2.375% 08/15/24 | 5,000,000.00 | 5,147,070.30 | |
| | | T 2.375% 11/15/49 | 6,100,000.00 | 6,372,593.75 | |
| | | T 2.5% 01/31/24 | 3,470,000.00 | 3,570,711.33 | |
| | | T 2.5% 01/31/25 | 5,000,000.00 | 5,174,023.45 | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 2.5% 02/15/45 | 5,210,000.00 | 5,461,545.31 | |
| | | T 2.5% 02/15/46 | 4,000,000.00 | 4,208,437.52 | |
| | | T 2.5% 03/31/23 | 4,050,000.00 | 4,136,932.60 | |
| | | T 2.5% 05/15/24 | 7,900,000.00 | 8,143,789.10 | |
| | | T 2.5% 05/15/46 | 5,050,000.00 | 5,314,335.93 | |
| | | T 2.5% 08/15/23 | 4,550,000.00 | 4,663,927.72 | |
| | | T 2.625% 01/31/26 | 4,690,000.00 | 4,891,889.86 | |
| | | T 2.625% 02/15/29 | 7,490,000.00 | 7,907,216.44 | |
| | | T 2.625% 02/28/23 | 1,400,000.00 | 1,430,734.38 | |
| | | T 2.625% 03/31/25 | 7,250,000.00 | 7,535,468.75 | |
| | | T 2.625% 06/30/23 | 4,900,000.00 | 5,026,423.82 | |
| | | T 2.625% 12/31/23 | 3,500,000.00 | 3,606,708.98 | |
| | | T 2.625% 12/31/25 | 5,820,000.00 | 6,071,669.54 | |
| | | T 2.75% 02/15/24 | 3,000,000.00 | 3,103,828.14 | |
| | | T 2.75% 02/15/28 | 6,550,000.00 | 6,936,347.68 | |
| | | T 2.75% 04/30/23 | 3,600,000.00 | 3,690,984.38 | |
| | | T 2.75% 05/31/23 | 3,880,000.00 | 3,983,062.50 | |
| | | T 2.75% 06/30/25 | 5,500,000.00 | 5,745,781.25 | |
| | | T 2.75% 07/31/23 | 1,000,000.00 | 1,028,535.16 | |
| | | T 2.75% 08/15/42 | 1,300,000.00 | 1,415,070.31 | |
| | | T 2.75% 08/15/47 | 7,050,000.00 | 7,811,179.68 | |
| | | T 2.75% 08/31/23 | 1,500,000.00 | 1,543,974.61 | |
| | | T 2.75% 08/31/25 | 6,900,000.00 | 7,214,273.47 | |
| | | T 2.75% 11/15/23 | 2,320,000.00 | 2,393,542.19 | |
| | | T 2.75% 11/15/42 | 3,920,000.00 | 4,266,675.00 | |
| | | T 2.75% 11/15/47 | 3,050,000.00 | 3,380,972.67 | |
| | | T 2.875% 04/30/25 | 4,000,000.00 | 4,190,937.52 | |
| | | T 2.875% 05/15/28 | 7,260,000.00 | 7,747,497.67 | |
| | | T 2.875% 05/15/43 | 4,150,000.00 | 4,608,445.31 | |
| | | T 2.875% 05/15/49 | 5,570,000.00 | 6,382,436.74 | |
| | | T 2.875% 05/31/25 | 3,820,000.00 | 4,003,837.50 | |
| | | T 2.875% 07/31/25 | 5,460,000.00 | 5,731,293.75 | |
| | | T 2.875% 08/15/28 | 3,920,000.00 | 4,189,806.26 | |
| | | T 2.875% 08/15/45 | 2,300,000.00 | 2,576,000.00 | |
| | | T 2.875% 09/30/23 | 4,750,000.00 | 4,904,003.93 | |
| | | T 2.875% 10/31/23 | 2,500,000.00 | 2,583,642.57 | |
| | | T 2.875% 11/30/23 | 4,020,000.00 | 4,158,501.58 | |
| | | T 2.875% 11/30/25 | 7,500,000.00 | 7,889,062.50 | |
| | | T 2% 02/15/23 | 5,000,000.00 | 5,074,121.10 | |
| | | T 2% 02/15/25 | 8,460,000.00 | 8,626,556.25 | |
| | | T 2% 02/15/50 | 5,000,000.00 | 4,823,046.90 | |
| | | T 2% 04/30/24 | 6,230,000.00 | 6,351,436.34 | |
| | | T 2% 05/31/24 | 3,310,000.00 | 3,374,777.72 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 2% 06/30/24 | 5,500,000.00 | 5,609,140.62 | |
| | | T 2% 08/15/25 | 6,890,000.00 | 7,021,340.62 | |
| | | T 2% 08/15/51 | 15,150,000.00 | 14,622,117.17 | |
| | | T 2% 11/15/26 | 10,220,000.00 | 10,402,442.94 | |
| | | T 2% 11/15/41 | 2,900,000.00 | 2,797,593.75 | |
| | | T 3.125% 02/15/42 | 1,050,000.00 | 1,209,304.68 | |
| | | T 3.125% 02/15/43 | 2,000,000.00 | 2,304,062.50 | |
| | | T 3.125% 05/15/48 | 5,930,000.00 | 7,059,942.99 | |
| | | T 3.125% 08/15/44 | 4,140,000.00 | 4,803,046.87 | |
| | | T 3.125% 11/15/28 | 8,400,000.00 | 9,125,812.50 | |
| | | T 3.125% 11/15/41 | 1,750,000.00 | 2,011,132.81 | |
| | | T 3.375% 05/15/44 | 3,010,000.00 | 3,623,757.81 | |
| | | T 3.375% 11/15/48 | 5,300,000.00 | 6,608,437.50 | |
| | | T 3.5% 02/15/39 | 770,000.00 | 926,466.41 | |
| | | T 3.625% 02/15/44 | 2,400,000.00 | 2,988,750.00 | |
| | | T 3.625% 08/15/43 | 2,000,000.00 | 2,482,968.76 | |
| | | T 3.75% 08/15/41 | 2,000,000.00 | 2,499,218.76 | |
| | | T 3.75% 11/15/43 | 3,000,000.00 | 3,796,640.64 | |
| | | T 3.875% 08/15/40 | 1,450,000.00 | 1,830,625.00 | |
| | | T 3% 02/15/47 | 800,000.00 | 922,750.00 | |
| | | T 3% 02/15/48 | 4,450,000.00 | 5,173,820.31 | |
| | | T 3% 02/15/49 | 7,000,000.00 | 8,192,734.41 | |
| | | T 3% 05/15/42 | 1,620,000.00 | 1,833,257.82 | |
| | | T 3% 05/15/45 | 3,500,000.00 | 3,993,281.25 | |
| | | T 3% 05/15/47 | 3,210,000.00 | 3,710,057.81 | |
| | | T 3% 08/15/48 | 5,450,000.00 | 6,350,101.56 | |
| | | T 3% 09/30/25 | 4,200,000.00 | 4,432,148.44 | |
| | | T 3% 10/31/25 | 5,000,000.00 | 5,278,906.25 | |
| | | T 3% 11/15/44 | 2,800,000.00 | 3,186,750.00 | |
| | | T 4.25% 05/15/39 | 900,000.00 | 1,184,203.12 | |
| | | T 4.25% 11/15/40 | 2,350,000.00 | 3,111,179.68 | |
| | | T 4.375% 02/15/38 | 1,000,000.00 | 1,322,812.50 | |
| | | T 4.375% 05/15/40 | 1,900,000.00 | 2,550,601.57 | |
| | | T 4.375% 05/15/41 | 1,950,000.00 | 2,629,757.81 | |
| | | T 4.375% 11/15/39 | 1,260,000.00 | 1,684,462.50 | |
| | | T 4.5% 02/15/36 | 1,090,000.00 | 1,443,142.97 | |
| | | T 4.5% 05/15/38 | 550,000.00 | 738,375.00 | |
| | | T 4.5% 08/15/39 | 1,700,000.00 | 2,303,632.82 | |
| | | T 4.625% 02/15/40 | 1,380,000.00 | 1,900,950.00 | |
| | | T 4.75% 02/15/41 | 750,000.00 | 1,055,976.56 | |
| | | T 5.0% 05/15/37 | 1,100,000.00 | 1,540,171.87 | |
| | | T 5.25% 11/15/28 | 1,300,000.00 | 1,591,687.50 | |
| | | | | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | T 5.375% 02/15/31 | 1,950,000.00 | 2,539,265.62 | |
| | T 6.0% 02/15/26 | 1,700,000.00 | 2,001,285.15 | |
| | T 6.125% 11/15/27 | 1,450,000.00 | 1,806,835.93 | |
| | T 6.25% 05/15/30 | 1,050,000.00 | 1,412,988.28 | |
| | T 6.25% 08/15/23 | 1,650,000.00 | 1,788,541.98 | |
| アメリカドル 小計 | | 1,224,640,000.00 | 1,231,692,803.67<br>(140,794,804,387) | |
| カナダドル | CAN 0.25% 02/01/23 | 3,060,000.00 | 3,034,143.00 | |
| | CAN 0.25% 03/01/26 | 2,280,000.00 | 2,154,828.00 | |
| | CAN 0.25% 04/01/24 | 2,400,000.00 | 2,342,592.00 | |
| | CAN 0.25% 05/01/23 | 2,600,000.00 | 2,570,828.00 | |
| | CAN 0.25% 08/01/23 | 1,360,000.00 | 1,340,348.00 | |
| | CAN 0.5% 09/01/25 | 2,480,000.00 | 2,385,735.20 | |
| | CAN 0.5% 12/01/30 | 4,420,000.00 | 3,941,800.20 | |
| | CAN 1.25% 03/01/25 | 1,440,000.00 | 1,428,379.20 | |
| | CAN 1.25% 06/01/30 | 3,620,000.00 | 3,469,770.00 | |
| | CAN 1.5% 06/01/23 | 1,070,000.00 | 1,074,836.40 | |
| | CAN 1.5% 06/01/26 | 1,360,000.00 | 1,352,846.40 | |
| | CAN 1.5% 06/01/31 | 3,260,000.00 | 3,158,711.80 | |
| | CAN 1.5% 09/01/24 | 1,200,000.00 | 1,202,508.00 | |
| | CAN 1.5% 12/01/31 | 1,240,000.00 | 1,194,293.60 | |
| | CAN 1.75% 03/01/23 | 3,620,000.00 | 3,646,027.80 | |
| | CAN 1.75% 12/01/53 | 1,680,000.00 | 1,538,208.00 | |
| | CAN 1% 06/01/27 | 1,730,000.00 | 1,669,865.20 | |
| | CAN 1% 09/01/26 | 1,530,000.00 | 1,483,656.30 | |
| | CAN 2.25% 03/01/24 | 2,300,000.00 | 2,343,838.00 | |
| | CAN 2.25% 06/01/25 | 1,800,000.00 | 1,842,102.00 | |
| | CAN 2.25% 06/01/29 | 1,260,000.00 | 1,304,175.60 | |
| | CAN 2.5% 06/01/24 | 1,330,000.00 | 1,364,473.60 | |
| | CAN 2.75% 12/01/48 | 1,880,000.00 | 2,141,564.40 | |
| | CAN 2.75% 12/01/64 | 760,000.00 | 887,908.00 | |
| | CAN 2% 06/01/28 | 1,310,000.00 | 1,331,968.70 | |
| | CAN 2% 09/01/23 | 3,460,000.00 | 3,503,146.20 | |
| | CAN 2% 12/01/51 | 4,710,000.00 | 4,625,643.90 | |
| | CAN 3.5% 12/01/45 | 1,300,000.00 | 1,647,269.00 | |
| | CAN 4.0% 06/01/41 | 1,050,000.00 | 1,370,607.00 | |
| | CAN 5.75% 06/01/29 | 1,170,000.00 | 1,492,276.50 | |
| | CAN 5.75% 06/01/33 | 960,000.00 | 1,326,220.80 | |
| | CAN 5% 06/01/37 | 820,000.00 | 1,139,070.20 | |
| カナダドル 小計 | | 64,460,000.00 | 65,309,641.00<br>(5,971,260,476) | |
| メキシコペソ | MBONO 10% 11/20/36 | 8,550,000.00 | 10,183,648.50 | |
| | MBONO 10% 12/05/24 | 30,560,000.00 | 32,529,592.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | MBONO 5.5% 03/04/27 | 3,000,000.00 | 2,732,100.00 | |
| | | MBONO 5.75% 03/05/26 | 47,710,000.00 | 44,655,605.80 | |
| | | MBONO 6.75% 03/09/23 | 22,180,000.00 | 22,160,481.60 | |
| | | MBONO 7.5% 06/03/27 | 38,910,000.00 | 38,709,224.40 | |
| | | MBONO 7.75% 05/29/31 | 31,580,000.00 | 31,659,581.60 | |
| | | MBONO 7.75% 11/13/42 | 24,190,000.00 | 23,517,276.10 | |
| | | MBONO 7.75% 11/23/34 | 10,600,000.00 | 10,587,068.00 | |
| | | MBONO 8.5% 05/31/29 | 38,660,000.00 | 40,489,004.60 | |
| | | MBONO 8.5% 11/18/38 | 28,220,000.00 | 29,528,843.60 | |
| | | MBONO 8% 09/05/24 | 34,470,000.00 | 34,895,704.50 | |
| | | MBONO 8% 11/07/47 | 27,200,000.00 | 27,038,704.00 | |
| | | MBONO 8% 12/07/23 | 34,870,000.00 | 35,279,722.50 | |
| | メキシコペソ 小計 | | 380,700,000.00 | 383,966,557.20<br>(2,140,767,143) | |
| | ユーロ | BGB 0.1% 06/22/30 | 1,370,000.00 | 1,364,876.20 | |
| | | BGB 0.2% 10/22/23 | 1,030,000.00 | 1,044,687.80 | |
| | | BGB 0.4% 06/22/40 | 1,140,000.00 | 1,069,388.40 | |
| | | BGB 0.5% 10/22/24 | 1,620,000.00 | 1,665,716.40 | |
| | | BGB 0.65% 06/22/71 | 640,000.00 | 516,716.80 | |
| | | BGB 0.8% 06/22/25 | 2,680,000.00 | 2,790,201.60 | |
| | | BGB 0.8% 06/22/27 | 1,690,000.00 | 1,780,347.40 | |
| | | BGB 0.8% 06/22/28 | 2,160,000.00 | 2,283,487.20 | |
| | | BGB 0.9% 06/22/29 | 2,360,000.00 | 2,512,810.00 | |
| | | BGB 0% 10/22/27 | 430,000.00 | 433,556.10 | |
| | | BGB 0% 10/22/31 | 1,020,000.00 | 990,766.80 | |
| | | BGB 1.25% 04/22/33 | 1,500,000.00 | 1,658,040.00 | |
| | | BGB 1.45% 06/22/37 | 1,050,000.00 | 1,178,709.00 | |
| | | BGB 1.6% 06/22/47 | 1,380,000.00 | 1,589,042.40 | |
| | | BGB 1.7% 06/22/50 | 1,300,000.00 | 1,531,660.00 | |
| | | BGB 1.9% 06/22/38 | 1,050,000.00 | 1,256,881.50 | |
| | | BGB 1% 06/22/26 | 2,280,000.00 | 2,408,797.20 | |
| | | BGB 1% 06/22/31 | 2,770,000.00 | 2,966,032.90 | |
| | | BGB 2.15% 06/22/66 | 880,000.00 | 1,203,611.20 | |
| | | BGB 2.25% 06/22/23 | 1,180,000.00 | 1,228,911.00 | |
| | | BGB 2.25% 06/22/57 | 770,000.00 | 1,044,720.60 | |
| | | BGB 2.6% 06/22/24 | 2,140,000.00 | 2,304,566.00 | |
| | | BGB 3.75% 06/22/45 | 1,200,000.00 | 1,939,932.00 | |
| | | BGB 3% 06/22/34 | 1,030,000.00 | 1,349,742.90 | |
| | | BGB 4.25% 03/28/41 | 1,870,000.00 | 3,041,985.10 | |
| | | BGB 4.5% 03/28/26 | 1,140,000.00 | 1,374,178.80 | |
| | | BGB 4% 03/28/32 | 1,080,000.00 | 1,489,698.00 | |
| | | BGB 5.5% 03/28/28 | 2,780,000.00 | 3,764,147.80 | |
| | | BGB 5% 03/28/35 | 2,220,000.00 | 3,515,925.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | BKO 0% 03/10/23 | 1,210,000.00 | 1,219,099.20 | |
| | | BKO 0% 06/16/23 | 1,090,000.00 | 1,099,679.20 | |
| | | BKO 0% 09/15/23 | 3,150,000.00 | 3,182,004.00 | |
| | | BTPS 0.05% 01/15/23 | 2,030,000.00 | 2,039,541.00 | |
| | | BTPS 0.25% 03/15/28 | 1,680,000.00 | 1,625,080.80 | |
| | | BTPS 0.3% 08/15/23 | 2,900,000.00 | 2,926,245.00 | |
| | | BTPS 0.35% 02/01/25 | 580,000.00 | 583,329.20 | |
| | | BTPS 0.5% 02/01/26 | 3,710,000.00 | 3,726,398.20 | |
| | | BTPS 0.5% 07/15/28 | 2,280,000.00 | 2,230,182.00 | |
| | | BTPS 0.6% 06/15/23 | 1,110,000.00 | 1,125,118.20 | |
| | | BTPS 0.6% 08/01/31 | 3,160,000.00 | 2,965,122.80 | |
| | | BTPS 0.65% 10/15/23 | 670,000.00 | 680,103.60 | |
| | | BTPS 0.85% 01/15/27 | 2,250,000.00 | 2,280,735.00 | |
| | | BTPS 0.9% 04/01/31 | 3,800,000.00 | 3,684,556.00 | |
| | | BTPS 0.95% 03/01/23 | 2,000,000.00 | 2,029,420.00 | |
| | | BTPS 0.95% 03/01/37 | 1,020,000.00 | 920,244.00 | |
| | | BTPS 0.95% 03/15/23 | 2,580,000.00 | 2,619,809.40 | |
| | | BTPS 0.95% 08/01/30 | 2,230,000.00 | 2,193,205.00 | |
| | | BTPS 0.95% 09/15/27 | 2,380,000.00 | 2,414,057.80 | |
| | | BTPS 0.95% 12/01/31 | 2,140,000.00 | 2,064,479.40 | |
| | | BTPS 0% 01/15/24 | 1,000,000.00 | 1,001,990.00 | |
| | | BTPS 0% 04/15/24 | 3,000,000.00 | 3,000,540.00 | |
| | | BTPS 0% 08/01/26 | 2,580,000.00 | 2,520,866.40 | |
| | | BTPS 1.25% 12/01/26 | 1,950,000.00 | 2,018,796.00 | |
| | | BTPS 1.35% 04/01/30 | 1,940,000.00 | 1,979,692.40 | |
| | | BTPS 1.45% 03/01/36 | 1,700,000.00 | 1,665,915.00 | |
| | | BTPS 1.45% 05/15/25 | 2,300,000.00 | 2,393,656.00 | |
| | | BTPS 1.45% 11/15/24 | 2,400,000.00 | 2,490,168.00 | |
| | | BTPS 1.5% 04/30/45 | 1,850,000.00 | 1,692,306.00 | |
| | | BTPS 1.5% 06/01/25 | 2,410,000.00 | 2,513,316.70 | |
| | | BTPS 1.6% 06/01/26 | 2,830,000.00 | 2,971,301.90 | |
| | | BTPS 1.65% 03/01/32 | 3,010,000.00 | 3,103,490.60 | |
| | | BTPS 1.65% 12/01/30 | 2,540,000.00 | 2,634,386.40 | |
| | | BTPS 1.7% 09/01/51 | 1,680,000.00 | 1,529,085.60 | |
| | | BTPS 1.75% 07/01/24 | 3,200,000.00 | 3,333,088.00 | |
| | | BTPS 1.8% 03/01/41 | 1,810,000.00 | 1,783,700.70 | |
| | | BTPS 1.85% 05/15/24 | 2,450,000.00 | 2,556,673.00 | |
| | | BTPS 1.85% 07/01/25 | 2,700,000.00 | 2,848,041.00 | |
| | | BTPS 2.05% 08/01/27 | 2,740,000.00 | 2,945,938.40 | |
| | | BTPS 2.1% 07/15/26 | 3,200,000.00 | 3,433,216.00 | |
| | | BTPS 2.15% 03/01/72 | 730,000.00 | 663,650.30 | |
| | | BTPS 2.2% 06/01/27 | 2,280,000.00 | 2,469,855.60 | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | BTPS 2.25% 09/01/36 | 1,840,000.00 | 1,984,440.00 | |
| | | BTPS 2.45% 09/01/33 | 2,640,000.00 | 2,920,816.80 | |
| | | BTPS 2.45% 09/01/50 | 1,810,000.00 | 1,936,681.90 | |
| | | BTPS 2.45% 10/01/23 | 2,910,000.00 | 3,042,608.70 | |
| | | BTPS 2.5% 11/15/25 | 2,950,000.00 | 3,195,971.00 | |
| | | BTPS 2.5% 12/01/24 | 2,950,000.00 | 3,150,688.50 | |
| | | BTPS 2.7% 03/01/47 | 2,210,000.00 | 2,502,449.30 | |
| | | BTPS 2.8% 03/01/67 | 1,130,000.00 | 1,221,010.20 | |
| | | BTPS 2.8% 12/01/28 | 1,890,000.00 | 2,133,583.20 | |
| | | BTPS 2.95% 09/01/38 | 2,050,000.00 | 2,408,258.00 | |
| | | BTPS 2% 02/01/28 | 2,260,000.00 | 2,427,240.00 | |
| | | BTPS 2% 12/01/25 | 2,090,000.00 | 2,224,972.20 | |
| | | BTPS 3.1% 03/01/40 | 1,420,000.00 | 1,701,486.60 | |
| | | BTPS 3.25% 09/01/46 | 1,950,000.00 | 2,415,055.50 | |
| | | BTPS 3.35% 03/01/35 | 2,220,000.00 | 2,683,269.60 | |
| | | BTPS 3.45% 03/01/48 | 2,120,000.00 | 2,718,136.80 | |
| | | BTPS 3.5% 03/01/30 | 3,960,000.00 | 4,720,438.80 | |
| | | BTPS 3.75% 09/01/24 | 2,150,000.00 | 2,357,303.00 | |
| | | BTPS 3.85% 09/01/49 | 1,860,000.00 | 2,544,814.80 | |
| | | BTPS 3% 08/01/29 | 3,360,000.00 | 3,855,734.40 | |
| | | BTPS 4.5% 03/01/24 | 2,750,000.00 | 3,015,512.50 | |
| | | BTPS 4.5% 03/01/26 | 2,080,000.00 | 2,430,854.40 | |
| | | BTPS 4.5% 05/01/23 | 3,580,000.00 | 3,804,394.40 | |
| | | BTPS 4.75% 08/01/23 | 3,650,000.00 | 3,932,254.50 | |
| | | BTPS 4.75% 09/01/28 | 3,630,000.00 | 4,544,215.50 | |
| | | BTPS 4.75% 09/01/44 | 2,100,000.00 | 3,177,993.00 | |
| | | BTPS 4% 02/01/37 | 3,550,000.00 | 4,644,252.00 | |
| | | BTPS 5.0% 08/01/39 | 3,000,000.00 | 4,457,550.00 | |
| | | BTPS 5.25% 11/01/29 | 3,560,000.00 | 4,709,595.20 | |
| | | BTPS 5.75% 02/01/33 | 2,280,000.00 | 3,302,101.20 | |
| | | BTPS 5% 03/01/25 | 3,660,000.00 | 4,208,048.40 | |
| | | BTPS 5% 08/01/34 | 2,970,000.00 | 4,154,079.60 | |
| | | BTPS 5% 09/01/40 | 2,880,000.00 | 4,339,382.40 | |
| | | BTPS 6.5% 11/01/27 | 3,600,000.00 | 4,783,248.00 | |
| | | BTPS 6% 05/01/31 | 2,940,000.00 | 4,190,264.40 | |
| | | BTPS 7.25% 11/01/26 | 1,400,000.00 | 1,848,308.00 | |
| | | BTPS 9% 11/01/23 | 800,000.00 | 930,848.00 | |
| | | DBR 0.25% 02/15/27 | 3,890,000.00 | 4,005,922.00 | |
| | | DBR 0.25% 02/15/29 | 3,080,000.00 | 3,183,857.60 | |
| | | DBR 0.25% 08/15/28 | 2,630,000.00 | 2,717,026.70 | |
| | | DBR 0.5% 02/15/25 | 3,080,000.00 | 3,177,605.20 | |
| | | DBR 0.5% 02/15/26 | 3,000,000.00 | 3,111,540.00 | |
| | | DBR 0.5% 02/15/28 | 2,710,000.00 | 2,838,806.30 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | DBR 0.5% 08/15/27 | 4,040,000.00 | 4,222,406.00 | |
| | | DBR 0% 02/15/30 | 3,570,000.00 | 3,615,696.00 | |
| | | DBR 0% 02/15/31 | 3,120,000.00 | 3,145,053.60 | |
| | | DBR 0% 05/15/35 | 2,820,000.00 | 2,784,552.60 | |
| | | DBR 0% 05/15/36 | 2,650,000.00 | 2,599,888.50 | |
| | | DBR 0% 08/15/26 | 4,350,000.00 | 4,425,081.00 | |
| | | DBR 0% 08/15/29 | 3,500,000.00 | 3,550,925.00 | |
| | | DBR 0% 08/15/30 | 4,190,000.00 | 4,236,509.00 | |
| | | DBR 0% 08/15/30 | 670,000.00 | 680,659.70 | |
| | | DBR 0% 08/15/31 | 3,450,000.00 | 3,466,663.50 | |
| | | DBR 0% 08/15/50 | 4,420,000.00 | 4,103,307.00 | |
| | | DBR 0% 08/15/52 | 920,000.00 | 841,864.40 | |
| | | DBR 0% 11/15/27 | 2,960,000.00 | 3,009,787.20 | |
| | | DBR 0% 11/15/28 | 2,500,000.00 | 2,538,775.00 | |
| | | DBR 1.25% 08/15/48 | 3,580,000.00 | 4,526,444.60 | |
| | | DBR 1.5% 02/15/23 | 2,960,000.00 | 3,029,796.80 | |
| | | DBR 1.5% 05/15/23 | 3,020,000.00 | 3,105,828.40 | |
| | | DBR 1.5% 05/15/24 | 2,290,000.00 | 2,401,981.00 | |
| | | DBR 1.75% 02/15/24 | 1,650,000.00 | 1,732,071.00 | |
| | | DBR 1% 08/15/24 | 2,000,000.00 | 2,081,340.00 | |
| | | DBR 1% 08/15/25 | 2,720,000.00 | 2,862,337.60 | |
| | | DBR 2.5% 07/04/44 | 3,540,000.00 | 5,414,642.40 | |
| | | DBR 2.5% 08/15/46 | 3,810,000.00 | 5,961,583.20 | |
| | | DBR 2% 08/15/23 | 2,860,000.00 | 2,980,720.60 | |
| | | DBR 3.25% 07/04/42 | 2,230,000.00 | 3,661,057.90 | |
| | | DBR 4.0% 01/04/37 | 2,930,000.00 | 4,685,187.20 | |
| | | DBR 4.25% 07/04/39 | 2,310,000.00 | 4,004,523.60 | |
| | | DBR 4.75% 07/04/28 | 2,550,000.00 | 3,393,718.50 | |
| | | DBR 4.75% 07/04/34 | 2,990,000.00 | 4,799,936.70 | |
| | | DBR 4.75% 07/04/40 | 2,680,000.00 | 4,998,200.00 | |
| | | DBR 5.5% 01/04/31 | 2,840,000.00 | 4,305,070.80 | |
| | | DBR 5.625% 01/04/28 | 2,360,000.00 | 3,210,119.20 | |
| | | DBR 6.25% 01/04/24 | 3,230,000.00 | 3,670,249.00 | |
| | | DBR 6.25% 01/04/30 | 1,250,000.00 | 1,904,525.00 | |
| | | DBR 6.5% 07/04/27 | 980,000.00 | 1,351,077.00 | |
| | | FRTR 0.25% 11/25/26 | 4,680,000.00 | 4,781,041.20 | |
| | | FRTR 0.5% 05/25/25 | 5,590,000.00 | 5,751,774.60 | |
| | | FRTR 0.5% 05/25/26 | 5,090,000.00 | 5,254,763.30 | |
| | | FRTR 0.5% 05/25/29 | 5,350,000.00 | 5,523,126.00 | |
| | | FRTR 0.5% 05/25/40 | 2,760,000.00 | 2,649,572.40 | |
| | | FRTR 0.5% 05/25/72 | 990,000.00 | 752,746.50 | |
| | | FRTR 0.5% 06/25/44 | 1,530,000.00 | 1,438,200.00 | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | FRTR 0.75% 05/25/28 | 6,290,000.00 | 6,609,532.00 | |
| | | FRTR 0.75% 05/25/52 | 3,800,000.00 | 3,574,432.00 | |
| | | FRTR 0.75% 05/25/53 | 1,240,000.00 | 1,153,485.20 | |
| | | FRTR 0.75% 11/25/28 | 5,850,000.00 | 6,148,467.00 | |
| | | FRTR 0% 02/25/23 | 2,050,000.00 | 2,064,616.50 | |
| | | FRTR 0% 02/25/24 | 4,850,000.00 | 4,903,592.50 | |
| | | FRTR 0% 02/25/26 | 5,210,000.00 | 5,266,163.80 | |
| | | FRTR 0% 02/25/27 | 2,560,000.00 | 2,577,433.60 | |
| | | FRTR 0% 03/25/23 | 5,060,000.00 | 5,098,557.20 | |
| | | FRTR 0% 03/25/24 | 5,950,000.00 | 6,019,496.00 | |
| | | FRTR 0% 03/25/25 | 6,390,000.00 | 6,465,849.30 | |
| | | FRTR 0% 11/25/29 | 5,260,000.00 | 5,210,661.20 | |
| | | FRTR 0% 11/25/30 | 6,040,000.00 | 5,920,226.80 | |
| | | FRTR 0% 11/25/31 | 5,830,000.00 | 5,645,189.00 | |
| | | FRTR 1.25% 05/25/34 | 5,090,000.00 | 5,553,393.60 | |
| | | FRTR 1.25% 05/25/36 | 5,130,000.00 | 5,604,678.90 | |
| | | FRTR 1.5% 05/25/31 | 5,890,000.00 | 6,568,586.90 | |
| | | FRTR 1.5% 05/25/50 | 3,890,000.00 | 4,441,991.00 | |
| | | FRTR 1.75% 05/25/23 | 5,380,000.00 | 5,553,451.20 | |
| | | FRTR 1.75% 05/25/66 | 1,780,000.00 | 2,199,332.40 | |
| | | FRTR 1.75% 06/25/39 | 3,820,000.00 | 4,543,469.80 | |
| | | FRTR 1.75% 11/25/24 | 4,160,000.00 | 4,421,248.00 | |
| | | FRTR 1% 05/25/27 | 4,650,000.00 | 4,936,347.00 | |
| | | FRTR 1% 11/25/25 | 5,280,000.00 | 5,545,742.40 | |
| | | FRTR 2.25% 05/25/24 | 4,100,000.00 | 4,368,222.00 | |
| | | FRTR 2.5% 05/25/30 | 6,380,000.00 | 7,636,604.80 | |
| | | FRTR 2.75% 10/25/27 | 5,970,000.00 | 6,970,213.80 | |
| | | FRTR 2% 05/25/48 | 3,560,000.00 | 4,506,639.60 | |
| | | FRTR 3.25% 05/25/45 | 3,350,000.00 | 5,086,372.00 | |
| | | FRTR 3.5% 04/25/26 | 6,350,000.00 | 7,375,144.00 | |
| | | FRTR 4.25% 10/25/23 | 5,650,000.00 | 6,137,086.50 | |
| | | FRTR 4.5% 04/25/41 | 4,520,000.00 | 7,621,714.40 | |
| | | FRTR 4.75% 04/25/35 | 3,130,000.00 | 4,854,285.70 | |
| | | FRTR 4% 04/25/55 | 2,420,000.00 | 4,497,061.80 | |
| | | FRTR 4% 04/25/60 | 2,030,000.00 | 3,950,420.60 | |
| | | FRTR 4% 10/25/38 | 3,370,000.00 | 5,204,358.40 | |
| | | FRTR 5.5% 04/25/29 | 5,170,000.00 | 7,235,776.90 | |
| | | FRTR 5.75% 10/25/32 | 4,340,000.00 | 6,842,183.60 | |
| | | FRTR 6.0% 10/25/25 | 1,900,000.00 | 2,359,363.00 | |
| | | FRTR 8.5% 04/25/23 | 1,000,000.00 | 1,116,010.00 | |
| | | IRISH 0.2% 05/15/27 | 930,000.00 | 946,098.30 | |
| | | IRISH 0.2% 10/18/30 | 1,030,000.00 | 1,025,169.30 | |
| | | IRISH 0.4% 05/15/35 | 610,000.00 | 595,457.60 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | IRISH 0.55% 04/22/41 | 500,000.00 | 481,350.00 | |
| | | IRISH 0.9% 05/15/28 | 810,000.00 | 857,741.40 | |
| | | IRISH 0% 10/18/31 | 1,300,000.00 | 1,253,811.00 | |
| | | IRISH 1.1% 05/15/29 | 1,200,000.00 | 1,288,572.00 | |
| | | IRISH 1.3% 05/15/33 | 670,000.00 | 731,479.20 | |
| | | IRISH 1.35% 03/18/31 | 620,000.00 | 682,310.00 | |
| | | IRISH 1.5% 05/15/50 | 870,000.00 | 989,390.10 | |
| | | IRISH 1.7% 05/15/37 | 820,000.00 | 946,731.00 | |
| | | IRISH 1% 05/15/26 | 1,640,000.00 | 1,727,887.60 | |
| | | IRISH 2.4% 05/15/30 | 1,210,000.00 | 1,435,652.90 | |
| | | IRISH 2% 02/18/45 | 1,150,000.00 | 1,447,758.00 | |
| | | IRISH 3.4% 03/18/24 | 970,000.00 | 1,052,847.70 | |
| | | IRISH 3.9% 03/20/23 | 1,010,000.00 | 1,062,823.00 | |
| | | IRISH 5.4% 03/13/25 | 1,160,000.00 | 1,372,419.20 | |
| | | NETHER 0.25% 07/15/25 | 2,310,000.00 | 2,361,928.80 | |
| | | NETHER 0.25% 07/15/29 | 2,070,000.00 | 2,117,361.60 | |
| | | NETHER 0.5% 01/15/40 | 1,440,000.00 | 1,493,755.20 | |
| | | NETHER 0.5% 07/15/26 | 2,320,000.00 | 2,407,116.00 | |
| | | NETHER 0.75% 07/15/27 | 2,110,000.00 | 2,225,037.20 | |
| | | NETHER 0.75% 07/15/28 | 1,620,000.00 | 1,716,843.60 | |
| | | NETHER 0% 01/15/24 | 1,830,000.00 | 1,851,594.00 | |
| | | NETHER 0% 01/15/27 | 1,840,000.00 | 1,862,319.20 | |
| | | NETHER 0% 01/15/29 | 600,000.00 | 602,400.00 | |
| | | NETHER 0% 01/15/38 | 960,000.00 | 910,387.20 | |
| | | NETHER 0% 01/15/52 | 1,230,000.00 | 1,087,652.10 | |
| | | NETHER 0% 07/15/30 | 1,920,000.00 | 1,916,966.40 | |
| | | NETHER 0% 07/15/31 | 1,370,000.00 | 1,357,300.10 | |
| | | NETHER 1.75% 07/15/23 | 1,940,000.00 | 2,009,995.20 | |
| | | NETHER 2.5% 01/15/33 | 2,020,000.00 | 2,536,594.80 | |
| | | NETHER 2.75% 01/15/47 | 2,430,000.00 | 3,855,000.60 | |
| | | NETHER 2% 07/15/24 | 1,990,000.00 | 2,115,927.20 | |
| | | NETHER 3.75% 01/15/23 | 1,560,000.00 | 1,628,406.00 | |
| | | NETHER 3.75% 01/15/42 | 2,250,000.00 | 3,758,085.00 | |
| | | NETHER 4% 01/15/37 | 2,180,000.00 | 3,387,916.20 | |
| | | NETHER 5.5% 01/15/28 | 1,730,000.00 | 2,324,687.50 | |
| | | NETHER 7.5% 01/15/23 | 200,000.00 | 216,160.00 | |
| | | OBL 0% 04/05/24 | 3,330,000.00 | 3,374,355.60 | |
| | | OBL 0% 04/10/26 | 3,070,000.00 | 3,121,207.60 | |
| | | OBL 0% 04/11/25 | 3,750,000.00 | 3,809,587.50 | |
| | | OBL 0% 04/14/23 | 2,220,000.00 | 2,238,315.00 | |
| | | OBL 0% 10/09/26 | 2,900,000.00 | 2,947,676.00 | |
| | | OBL 0% 10/10/25 | 3,500,000.00 | 3,557,820.00 | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | OBL 0% 10/13/23 | 1,510,000.00 | 1,527,229.10 | |
| | | OBL 0% 10/18/24 | 4,190,000.00 | 4,253,646.10 | |
| | | RAGB 0.25% 10/20/36 | 730,000.00 | 701,325.60 | |
| | | RAGB 0.5% 02/20/29 | 1,770,000.00 | 1,829,118.00 | |
| | | RAGB 0.5% 04/20/27 | 890,000.00 | 921,577.20 | |
| | | RAGB 0.75% 02/20/28 | 1,620,000.00 | 1,701,550.80 | |
| | | RAGB 0.75% 03/20/51 | 680,000.00 | 682,624.80 | |
| | | RAGB 0.75% 10/20/26 | 2,080,000.00 | 2,177,302.40 | |
| | | RAGB 0.85% 06/30/20 | 330,000.00 | 274,259.70 | |
| | | RAGB 0% 02/20/30 | 1,450,000.00 | 1,434,804.00 | |
| | | RAGB 0% 02/20/31 | 1,200,000.00 | 1,176,492.00 | |
| | | RAGB 0% 04/20/23 | 1,140,000.00 | 1,149,416.40 | |
| | | RAGB 0% 04/20/25 | 930,000.00 | 942,071.40 | |
| | | RAGB 0% 07/15/23 | 1,120,000.00 | 1,130,438.40 | |
| | | RAGB 0% 07/15/24 | 1,440,000.00 | 1,459,008.00 | |
| | | RAGB 0% 10/20/40 | 510,000.00 | 454,971.00 | |
| | | RAGB 1.2% 10/20/25 | 700,000.00 | 741,951.00 | |
| | | RAGB 1.5% 02/20/47 | 1,030,000.00 | 1,232,158.10 | |
| | | RAGB 1.5% 11/02/86 | 330,000.00 | 402,699.00 | |
| | | RAGB 1.65% 10/21/24 | 990,000.00 | 1,049,716.80 | |
| | | RAGB 1.75% 10/20/23 | 1,330,000.00 | 1,385,607.30 | |
| | | RAGB 2.1% 09/20/17 | 810,000.00 | 1,191,979.80 | |
| | | RAGB 2.4% 05/23/34 | 1,080,000.00 | 1,350,496.80 | |
| | | RAGB 3.15% 06/20/44 | 830,000.00 | 1,283,429.00 | |
| | | RAGB 3.8% 01/26/62 | 470,000.00 | 943,825.80 | |
| | | RAGB 4.15% 03/15/37 | 1,820,000.00 | 2,822,619.80 | |
| | | RAGB 4.85% 03/15/26 | 1,370,000.00 | 1,669,975.20 | |
| | | RAGB 6.25% 07/15/27 | 1,180,000.00 | 1,601,590.40 | |
| | | RFGB 0.125% 04/15/36 | 540,000.00 | 514,884.60 | |
| | | RFGB 0.125% 04/15/52 | 460,000.00 | 399,339.80 | |
| | | RFGB 0.125% 09/15/31 | 400,000.00 | 396,456.00 | |
| | | RFGB 0.25% 09/15/40 | 500,000.00 | 476,265.00 | |
| | | RFGB 0.5% 04/15/26 | 620,000.00 | 641,886.00 | |
| | | RFGB 0.5% 09/15/27 | 870,000.00 | 902,842.50 | |
| | | RFGB 0.5% 09/15/28 | 650,000.00 | 673,666.50 | |
| | | RFGB 0.5% 09/15/29 | 760,000.00 | 787,793.20 | |
| | | RFGB 0.75% 04/15/31 | 800,000.00 | 843,784.00 | |
| | | RFGB 0.875% 09/15/25 | 690,000.00 | 722,043.60 | |
| | | RFGB 0% 09/15/23 | 540,000.00 | 545,869.80 | |
| | | RFGB 0% 09/15/24 | 420,000.00 | 425,871.60 | |
| | | RFGB 0% 09/15/26 | 590,000.00 | 596,478.20 | |
| | | RFGB 0% 09/15/30 | 630,000.00 | 623,196.00 | |
| | | RFGB 1.125% 04/15/34 | 560,000.00 | 612,858.40 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | RFGB 1.375% 04/15/47 | 490,000.00 | 589,612.10 | |
| | | RFGB 1.5% 04/15/23 | 650,000.00 | 667,225.00 | |
| | | RFGB 2.625% 07/04/42 | 640,000.00 | 908,384.00 | |
| | | RFGB 2.75% 07/04/28 | 420,000.00 | 498,061.20 | |
| | | RFGB 2% 04/15/24 | 730,000.00 | 773,011.60 | |
| | | RFGB 4% 07/04/25 | 830,000.00 | 958,791.10 | |
| | | SPGB 0.1% 04/30/31 | 3,180,000.00 | 3,033,592.80 | |
| | | SPGB 0.25% 07/30/24 | 2,290,000.00 | 2,325,266.00 | |
| | | SPGB 0.35% 07/30/23 | 3,590,000.00 | 3,638,321.40 | |
| | | SPGB 0.5% 04/30/30 | 2,900,000.00 | 2,910,179.00 | |
| | | SPGB 0.5% 10/31/31 | 1,710,000.00 | 1,680,622.20 | |
| | | SPGB 0.6% 10/31/29 | 2,950,000.00 | 2,999,206.00 | |
| | | SPGB 0.8% 07/30/27 | 2,440,000.00 | 2,527,400.80 | |
| | | SPGB 0.85% 07/30/37 | 960,000.00 | 924,230.40 | |
| | | SPGB 0% 01/31/25 | 2,280,000.00 | 2,299,288.80 | |
| | | SPGB 0% 01/31/26 | 2,220,000.00 | 2,225,305.80 | |
| | | SPGB 0% 01/31/28 | 1,930,000.00 | 1,903,346.70 | |
| | | SPGB 0% 04/30/23 | 2,380,000.00 | 2,396,588.60 | |
| | | SPGB 0% 05/31/24 | 2,110,000.00 | 2,127,091.00 | |
| | | SPGB 1.2% 10/31/40 | 2,260,000.00 | 2,249,265.00 | |
| | | SPGB 1.25% 10/31/30 | 3,050,000.00 | 3,237,300.50 | |
| | | SPGB 1.3% 10/31/26 | 2,750,000.00 | 2,923,195.00 | |
| | | SPGB 1.4% 04/30/28 | 2,490,000.00 | 2,673,587.70 | |
| | | SPGB 1.4% 07/30/28 | 1,470,000.00 | 1,581,014.40 | |
| | | SPGB 1.45% 04/30/29 | 4,490,000.00 | 4,851,759.30 | |
| | | SPGB 1.45% 10/31/27 | 3,040,000.00 | 3,264,169.60 | |
| | | SPGB 1.45% 10/31/71 | 660,000.00 | 567,864.00 | |
| | | SPGB 1.5% 04/30/27 | 2,650,000.00 | 2,849,704.00 | |
| | | SPGB 1.6% 04/30/25 | 3,050,000.00 | 3,235,623.00 | |
| | | SPGB 1.85% 07/30/35 | 2,750,000.00 | 3,061,162.50 | |
| | | SPGB 1.95% 04/30/26 | 2,810,000.00 | 3,052,446.80 | |
| | | SPGB 1.95% 07/30/30 | 2,940,000.00 | 3,299,415.00 | |
| | | SPGB 1% 07/30/42 | 650,000.00 | 623,792.00 | |
| | | SPGB 1% 10/31/50 | 2,470,000.00 | 2,204,647.90 | |
| | | SPGB 2.15% 10/31/25 | 2,810,000.00 | 3,056,858.50 | |
| | | SPGB 2.35% 07/30/33 | 2,440,000.00 | 2,855,044.00 | |
| | | SPGB 2.7% 10/31/48 | 1,850,000.00 | 2,392,938.00 | |
| | | SPGB 2.75% 10/31/24 | 3,050,000.00 | 3,317,454.50 | |
| | | SPGB 2.9% 10/31/46 | 2,200,000.00 | 2,926,550.00 | |
| | | SPGB 3.45% 07/30/66 | 1,780,000.00 | 2,653,552.80 | |
| | | SPGB 3.8% 04/30/24 | 2,520,000.00 | 2,764,314.00 | |
| | | SPGB 4.2% 01/31/37 | 2,530,000.00 | 3,672,902.20 | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | SPGB 4.4% 10/31/23 | 2,690,000.00 | 2,925,401.90 | |
| | | SPGB 4.65% 07/30/25 | 2,840,000.00 | 3,333,421.60 | |
| | | SPGB 4.7% 07/30/41 | 2,640,000.00 | 4,273,579.20 | |
| | | SPGB 4.8% 01/31/24 | 2,400,000.00 | 2,659,560.00 | |
| | | SPGB 4.9% 07/30/40 | 2,250,000.00 | 3,684,487.50 | |
| | | SPGB 5.15% 10/31/28 | 4,290,000.00 | 5,701,581.60 | |
| | | SPGB 5.15% 10/31/44 | 1,910,000.00 | 3,390,250.00 | |
| | | SPGB 5.4% 01/31/23 | 2,100,000.00 | 2,229,507.00 | |
| | | SPGB 5.75% 07/30/32 | 2,860,000.00 | 4,337,247.20 | |
| | | SPGB 5.9% 07/30/26 | 3,480,000.00 | 4,419,217.20 | |
| | | SPGB 6.0% 01/31/29 | 1,050,000.00 | 1,471,533.00 | |
| | ユーロ 小計 | | 782,910,000.00 | 887,820,926.30<br>(115,203,643,396) | |
| | イギリスポンド | UKT 0.125% 01/30/26 | 1,520,000.00 | 1,468,852.00 | |
| | | UKT 0.125% 01/31/23 | 4,510,000.00 | 4,480,234.00 | |
| | | UKT 0.125% 01/31/24 | 2,970,000.00 | 2,923,935.30 | |
| | | UKT 0.125% 01/31/28 | 2,260,000.00 | 2,133,711.20 | |
| | | UKT 0.25% 01/31/25 | 620,000.00 | 606,688.60 | |
| | | UKT 0.25% 07/31/31 | 3,270,000.00 | 2,975,536.50 | |
| | | UKT 0.375% 10/22/26 | 1,910,000.00 | 1,849,987.80 | |
| | | UKT 0.375% 10/22/30 | 2,420,000.00 | 2,254,012.20 | |
| | | UKT 0.5% 01/31/29 | 350,000.00 | 334,309.50 | |
| | | UKT 0.5% 10/22/61 | 1,340,000.00 | 1,035,659.20 | |
| | | UKT 0.625% 06/07/25 | 1,700,000.00 | 1,683,000.00 | |
| | | UKT 0.625% 07/31/35 | 2,360,000.00 | 2,131,740.80 | |
| | | UKT 0.625% 10/22/50 | 1,590,000.00 | 1,309,253.70 | |
| | | UKT 0.75% 07/22/23 | 2,360,000.00 | 2,359,126.80 | |
| | | UKT 0.875% 01/31/46 | 1,170,000.00 | 1,035,929.70 | |
| | | UKT 0.875% 07/31/33 | 200,000.00 | 190,826.00 | |
| | | UKT 0.875% 10/22/29 | 1,700,000.00 | 1,665,031.00 | |
| | | UKT 1.125% 01/31/39 | 500,000.00 | 475,730.00 | |
| | | UKT 1.25% 07/22/27 | 950,000.00 | 960,868.00 | |
| | | UKT 1.25% 07/31/51 | 550,000.00 | 530,112.00 | |
| | | UKT 1.25% 10/22/41 | 2,800,000.00 | 2,702,140.00 | |
| | | UKT 1.5% 07/22/26 | 1,600,000.00 | 1,637,216.00 | |
| | | UKT 1.5% 07/22/47 | 2,370,000.00 | 2,409,768.60 | |
| | | UKT 1.5% 07/31/53 | 200,000.00 | 208,102.00 | |
| | | UKT 1.625% 10/22/28 | 1,620,000.00 | 1,676,813.40 | |
| | | UKT 1.625% 10/22/54 | 1,860,000.00 | 1,992,766.80 | |
| | | UKT 1.625% 10/22/71 | 1,320,000.00 | 1,567,420.80 | |
| | | UKT 1.75% 01/22/49 | 1,300,000.00 | 1,401,920.00 | |
| | | UKT 1.75% 07/22/57 | 2,210,000.00 | 2,487,576.00 | |
| | | UKT 1.75% 09/07/37 | 2,630,000.00 | 2,749,559.80 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | UKT 1% 04/22/24 | 1,600,000.00 | 1,604,256.00 | |
| | | UKT 2.25% 09/07/23 | 2,500,000.00 | 2,557,100.00 | |
| | | UKT 2.5% 07/22/65 | 1,920,000.00 | 2,757,676.80 | |
| | | UKT 2.75% 09/07/24 | 1,470,000.00 | 1,539,413.40 | |
| | | UKT 2% 09/07/25 | 1,780,000.00 | 1,846,127.00 | |
| | | UKT 3.25% 01/22/44 | 2,580,000.00 | 3,455,265.00 | |
| | | UKT 3.5% 01/22/45 | 2,290,000.00 | 3,210,992.20 | |
| | | UKT 3.5% 07/22/68 | 1,930,000.00 | 3,506,153.80 | |
| | | UKT 3.75% 07/22/52 | 1,600,000.00 | 2,540,160.00 | |
| | | UKT 4.25% 03/07/36 | 2,090,000.00 | 2,863,132.80 | |
| | | UKT 4.25% 06/07/32 | 2,100,000.00 | 2,704,947.00 | |
| | | UKT 4.25% 09/07/39 | 1,620,000.00 | 2,338,696.80 | |
| | | UKT 4.25% 12/07/27 | 1,370,000.00 | 1,617,490.50 | |
| | | UKT 4.25% 12/07/40 | 1,750,000.00 | 2,565,097.50 | |
| | | UKT 4.25% 12/07/46 | 1,920,000.00 | 3,048,345.60 | |
| | | UKT 4.25% 12/07/49 | 1,510,000.00 | 2,501,813.30 | |
| | | UKT 4.25% 12/07/55 | 1,910,000.00 | 3,420,370.70 | |
| | | UKT 4.5% 09/07/34 | 2,110,000.00 | 2,881,458.20 | |
| | | UKT 4.5% 12/07/42 | 2,210,000.00 | 3,433,257.10 | |
| | | UKT 4.75% 12/07/30 | 1,460,000.00 | 1,897,445.20 | |
| | | UKT 4.75% 12/07/38 | 1,650,000.00 | 2,484,372.00 | |
| | | UKT 4% 01/22/60 | 1,540,000.00 | 2,810,176.60 | |
| | | UKT 5% 03/07/25 | 1,800,000.00 | 2,022,768.00 | |
| | | UKT 6.0% 12/07/28 | 1,250,000.00 | 1,654,912.50 | |
| | イギリスポンド 小計 | | 96,120,000.00 | 112,499,255.70<br>(17,520,634,082) | |
| | スウェーデンクローナ | SGB 0.125% 05/12/31 | 6,470,000.00 | 6,321,190.00 | |
| | | SGB 0.75% 05/12/28 | 7,380,000.00 | 7,590,772.80 | |
| | | SGB 0.75% 11/12/29 | 8,060,000.00 | 8,326,463.60 | |
| | | SGB 1.5% 11/13/23 | 12,500,000.00 | 12,873,000.00 | |
| | | SGB 1% 11/12/26 | 10,030,000.00 | 10,405,021.70 | |
| | | SGB 2.25% 06/01/32 | 4,680,000.00 | 5,549,731.20 | |
| | | SGB 2.5% 05/12/25 | 9,300,000.00 | 10,043,907.00 | |
| | | SGB 3.5% 03/30/39 | 5,310,000.00 | 7,796,460.60 | |
| | スウェーデンクローナ 小計 | | 63,730,000.00 | 68,906,546.90<br>(865,466,229) | |
| | ノルウェークローネ | NGB 1.25% 09/17/31 | 3,240,000.00 | 3,051,885.60 | |
| | | NGB 1.375% 08/19/30 | 6,480,000.00 | 6,209,654.40 | |
| | | NGB 1.5% 02/19/26 | 6,360,000.00 | 6,296,972.40 | |
| | | NGB 1.75% 02/17/27 | 6,060,000.00 | 6,043,638.00 | |
| | | NGB 1.75% 03/13/25 | 5,720,000.00 | 5,732,641.20 | |
| | | NGB 1.75% 09/06/29 | 6,540,000.00 | 6,476,954.40 | |
| | | | | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | NGB 2% 04/26/28 | 4,510,000.00 | 4,550,499.80 | |
| | NGB 2% 05/24/23 | 10,660,000.00 | 10,771,290.40 | |
| | NGB 3% 03/14/24 | 7,360,000.00 | 7,587,424.00 | |
| ノルウェークローネ 小計 | | 56,930,000.00 | 56,720,960.20<br>(739,074,111) | |
| デンマーククローネ | DGB 0.25% 11/15/52 | 5,870,000.00 | 5,648,759.70 | |
| | DGB 0.5% 11/15/27 | 8,850,000.00 | 9,169,750.50 | |
| | DGB 0.5% 11/15/29 | 12,410,000.00 | 12,887,660.90 | |
| | DGB 0% 11/15/24 | 2,130,000.00 | 2,155,858.20 | |
| | DGB 0% 11/15/31 | 5,830,000.00 | 5,735,787.20 | |
| | DGB 1.5% 11/15/23 | 7,420,000.00 | 7,700,847.00 | |
| | DGB 1.75% 11/15/25 | 7,280,000.00 | 7,850,606.40 | |
| | DGB 4.5% 11/15/39 | 13,980,000.00 | 24,548,320.80 | |
| デンマーククローネ 小計 | | 63,770,000.00 | 75,697,590.70<br>(1,319,409,005) | |
| ポーランドズロチ | POLGB 0.25% 10/25/26 | 2,570,000.00 | 2,172,498.10 | |
| | POLGB 0.75% 04/25/25 | 3,560,000.00 | 3,273,064.00 | |
| | POLGB 0% 04/25/23 | 1,230,000.00 | 1,186,076.70 | |
| | POLGB 1.25% 10/25/30 | 4,150,000.00 | 3,332,740.50 | |
| | POLGB 2.25% 10/25/24 | 3,930,000.00 | 3,831,514.20 | |
| | POLGB 2.5% 01/25/23 | 5,860,000.00 | 5,837,263.20 | |
| | POLGB 2.5% 04/25/24 | 2,890,000.00 | 2,851,100.60 | |
| | POLGB 2.5% 07/25/26 | 6,060,000.00 | 5,749,303.80 | |
| | POLGB 2.5% 07/25/27 | 3,780,000.00 | 3,514,606.20 | |
| | POLGB 2.75% 04/25/28 | 5,380,000.00 | 5,032,236.80 | |
| | POLGB 2.75% 10/25/29 | 6,220,000.00 | 5,715,247.00 | |
| | POLGB 3.25% 07/25/25 | 4,910,000.00 | 4,866,792.00 | |
| | POLGB 4% 10/25/23 | 3,760,000.00 | 3,825,123.20 | |
| | POLGB 5.75% 04/25/29 | 600,000.00 | 669,276.00 | |
| ポーランドズロチ 小計 | | 54,900,000.00 | 51,856,842.30<br>(1,487,217,937) | |
| オーストラリアドル | ACGB 0.25% 11/21/24 | 2,930,000.00 | 2,858,888.90 | |
| | ACGB 0.25% 11/21/25 | 2,340,000.00 | 2,234,793.60 | |
| | ACGB 0.5% 09/21/26 | 2,040,000.00 | 1,940,896.80 | |
| | ACGB 1.25% 05/21/32 | 2,740,000.00 | 2,554,447.20 | |
| | ACGB 1.5% 06/21/31 | 3,190,000.00 | 3,069,194.70 | |
| | ACGB 1.75% 06/21/51 | 1,760,000.00 | 1,459,550.40 | |
| | ACGB 1.75% 11/21/32 | 2,010,000.00 | 1,960,674.60 | |
| | ACGB 1% 11/21/31 | 3,250,000.00 | 2,973,295.00 | |
| | ACGB 1% 12/21/30 | 3,310,000.00 | 3,057,778.00 | |
| | ACGB 2.25% 05/21/28 | 2,230,000.00 | 2,298,371.80 | |
| | ACGB 2.5% 05/21/30 | 3,470,000.00 | 3,632,881.80 | |
| | ACGB 2.75% 04/21/24 | 1,380,000.00 | 1,437,794.40 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | ACGB 2.75% 05/21/41 | 1,630,000.00 | 1,696,944.10 | |
| | ACGB 2.75% 06/21/35 | 1,050,000.00 | 1,124,487.00 | |
| | ACGB 2.75% 11/21/27 | 1,930,000.00 | 2,043,754.20 | |
| | ACGB 2.75% 11/21/28 | 1,660,000.00 | 1,763,285.20 | |
| | ACGB 2.75% 11/21/29 | 1,410,000.00 | 1,501,734.60 | |
| | ACGB 3.25% 04/21/25 | 2,560,000.00 | 2,716,134.40 | |
| | ACGB 3.25% 04/21/29 | 2,200,000.00 | 2,414,170.00 | |
| | ACGB 3.25% 06/21/39 | 980,000.00 | 1,102,039.40 | |
| | ACGB 3.75% 04/21/37 | 1,620,000.00 | 1,931,169.60 | |
| | ACGB 3% 03/21/47 | 1,680,000.00 | 1,811,812.80 | |
| | ACGB 4.25% 04/21/26 | 1,890,000.00 | 2,102,530.50 | |
| | ACGB 4.5% 04/21/33 | 2,310,000.00 | 2,891,773.50 | |
| | ACGB 4.75% 04/21/27 | 2,320,000.00 | 2,684,100.80 | |
| | ACGB 5.5% 04/21/23 | 2,500,000.00 | 2,652,000.00 | |
| オーストラリアドル 小計 | | 56,390,000.00 | 57,914,503.30<br>(4,788,371,132) | |
| シンガポールドル | SIGB 0.5% 11/01/25 | 750,000.00 | 723,967.50 | |
| | SIGB 1.625% 07/01/31 | 300,000.00 | 294,126.00 | |
| | SIGB 1.75% 02/01/23 | 800,000.00 | 809,152.00 | |
| | SIGB 1.875% 03/01/50 | 810,000.00 | 755,827.20 | |
| | SIGB 1.875% 10/01/51 | 320,000.00 | 300,563.20 | |
| | SIGB 2.125% 06/01/26 | 1,080,000.00 | 1,106,406.00 | |
| | SIGB 2.25% 08/01/36 | 890,000.00 | 909,313.00 | |
| | SIGB 2.375% 06/01/25 | 730,000.00 | 754,710.50 | |
| | SIGB 2.375% 07/01/39 | 430,000.00 | 447,470.90 | |
| | SIGB 2.625% 05/01/28 | 530,000.00 | 558,360.30 | |
| | SIGB 2.75% 03/01/46 | 760,000.00 | 837,482.00 | |
| | SIGB 2.75% 04/01/42 | 750,000.00 | 825,990.00 | |
| | SIGB 2.75% 07/01/23 | 1,070,000.00 | 1,100,141.90 | |
| | SIGB 2.875% 07/01/29 | 950,000.00 | 1,019,274.00 | |
| | SIGB 2.875% 09/01/30 | 1,020,000.00 | 1,101,732.60 | |
| | SIGB 2% 02/01/24 | 410,000.00 | 418,351.70 | |
| | SIGB 3.375% 09/01/33 | 830,000.00 | 949,461.90 | |
| | SIGB 3.5% 03/01/27 | 880,000.00 | 957,756.80 | |
| | SIGB 3% 09/01/24 | 1,590,000.00 | 1,662,297.30 | |
| シンガポールドル 小計 | | 14,900,000.00 | 15,532,384.80<br>(1,318,388,821) | |
| マレーシアリンギット | MGS 2.632% 04/15/31 | 790,000.00 | 725,133.10 | |
| | MGS 3.478% 06/14/24 | 1,920,000.00 | 1,948,396.80 | |
| | MGS 3.48% 03/15/23 | 2,330,000.00 | 2,366,464.50 | |
| | MGS 3.502% 05/31/27 | 1,510,000.00 | 1,521,808.20 | |
| | MGS 3.733% 06/15/28 | 2,630,000.00 | 2,667,346.00 | |
| | MGS 3.757% 04/20/23 | 1,090,000.00 | 1,111,603.80 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | MGS 3.757% 05/22/40 | 1,520,000.00 | 1,422,340.00 | |
| | | MGS 3.8% 08/17/23 | 930,000.00 | 951,194.70 | |
| | | MGS 3.828% 07/05/34 | 660,000.00 | 645,354.60 | |
| | | MGS 3.844% 04/15/33 | 1,670,000.00 | 1,656,205.80 | |
| | | MGS 3.882% 03/14/25 | 1,030,000.00 | 1,058,129.30 | |
| | | MGS 3.885% 08/15/29 | 1,500,000.00 | 1,527,630.00 | |
| | | MGS 3.892% 03/15/27 | 1,130,000.00 | 1,159,628.60 | |
| | | MGS 3.899% 11/16/27 | 1,970,000.00 | 2,024,963.00 | |
| | | MGS 3.9% 11/30/26 | 1,440,000.00 | 1,480,176.00 | |
| | | MGS 3.906% 07/15/26 | 600,000.00 | 616,626.00 | |
| | | MGS 3.955% 09/15/25 | 3,120,000.00 | 3,215,784.00 | |
| | | MGS 4.059% 09/30/24 | 1,780,000.00 | 1,832,866.00 | |
| | | MGS 4.065% 06/15/50 | 1,560,000.00 | 1,496,196.00 | |
| | | MGS 4.181% 07/15/24 | 1,280,000.00 | 1,319,232.00 | |
| | | MGS 4.232% 06/30/31 | 3,000,000.00 | 3,122,430.00 | |
| | | MGS 4.254% 05/31/35 | 2,030,000.00 | 2,080,222.20 | |
| | | MGS 4.392% 04/15/26 | 2,910,000.00 | 3,043,539.90 | |
| | | MGS 4.498% 04/15/30 | 2,860,000.00 | 3,024,793.20 | |
| | | MGS 4.642% 11/07/33 | 2,830,000.00 | 3,007,837.20 | |
| | | MGS 4.736% 03/15/46 | 1,480,000.00 | 1,549,604.40 | |
| | | MGS 4.762% 04/07/37 | 2,280,000.00 | 2,463,448.80 | |
| | | MGS 4.893% 06/08/38 | 2,310,000.00 | 2,499,951.30 | |
| | | MGS 4.921% 07/06/48 | 1,680,000.00 | 1,797,784.80 | |
| | | MGS 4.935% 09/30/43 | 1,030,000.00 | 1,111,854.10 | |
| マレーシアリンギット 小計 | | | 52,870,000.00 | 54,448,544.30<br>(1,486,227,465) | |
| イスラエルシェケル | | ILGOV 0.15% 07/31/23 | 700,000.00 | 699,779.43 | |
| | | ILGOV 0.5% 02/27/26 | 860,000.00 | 850,931.12 | |
| | | ILGOV 0.5% 04/30/25 | 2,420,000.00 | 2,411,820.14 | |
| | | ILGOV 1.5% 05/31/37 | 2,190,000.00 | 2,039,839.58 | |
| | | ILGOV 1.5% 11/30/23 | 1,750,000.00 | 1,792,007.17 | |
| | | ILGOV 1.75% 08/31/25 | 1,080,000.00 | 1,129,131.14 | |
| | | ILGOV 1% 03/31/30 | 2,650,000.00 | 2,593,337.16 | |
| | | ILGOV 2.25% 09/28/28 | 2,360,000.00 | 2,544,660.32 | |
| | | ILGOV 2% 03/31/27 | 2,750,000.00 | 2,909,735.40 | |
| | | ILGOV 3.75% 03/31/24 | 4,080,000.00 | 4,379,438.54 | |
| | | ILGOV 3.75% 03/31/47 | 3,130,000.00 | 3,880,704.83 | |
| | | ILGOV 4.25% 03/31/23 | 3,430,000.00 | 3,598,929.90 | |
| | | ILGOV 5.5% 01/31/42 | 2,410,000.00 | 3,717,563.57 | |
| | | ILGOV 6.25% 10/30/26 | 3,060,000.00 | 3,838,709.10 | |
| イスラエルシェケル 小計 | | | 32,870,000.00 | 36,386,587.40<br>(1,328,219,599) | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 香港・オフショア人民元 | CGB 1.99% 04/09/25 | 15,020,000.00 | 14,827,744.00 | |
| | | CGB 2.47% 09/02/24 | 3,600,000.00 | 3,617,280.00 | |
| | | CGB 2.56% 10/21/23 | 15,660,000.00 | 15,766,644.60 | |
| | | CGB 2.68% 05/21/30 | 9,780,000.00 | 9,689,046.00 | |
| | | CGB 2.84% 04/08/24 | 11,650,000.00 | 11,797,722.00 | |
| | | CGB 2.85% 06/04/27 | 12,330,000.00 | 12,517,169.40 | |
| | | CGB 2.91% 10/14/28 | 4,750,000.00 | 4,814,220.00 | |
| | | CGB 3.01% 05/13/28 | 1,050,000.00 | 1,071,556.50 | |
| | | CGB 3.02% 05/27/31 | 2,900,000.00 | 2,959,508.00 | |
| | | CGB 3.03% 03/11/26 | 14,760,000.00 | 15,103,612.80 | |
| | | CGB 3.27% 11/19/30 | 3,950,000.00 | 4,105,748.50 | |
| | | CGB 3.28% 12/03/27 | 1,060,000.00 | 1,102,188.00 | |
| | | CGB 3.39% 03/16/50 | 5,520,000.00 | 5,541,859.20 | |
| | | CGB 3.53% 10/18/51 | 650,000.00 | 678,970.50 | |
| | | CGB 3.72% 04/12/51 | 540,000.00 | 577,060.20 | |
| | | CGB 3.81% 09/14/50 | 920,000.00 | 996,203.60 | |
| | | CGB 3.86% 07/22/49 | 760,000.00 | 825,937.60 | |
| | | CGB 4.08% 10/22/48 | 4,110,000.00 | 4,639,450.20 | |
| | 香港・オフショア人民元 小計 | | 109,010,000.00 | 110,631,921.10<br>(1,991,496,274) | |
| 合計 | | | | 296,954,980,057<br>(296,954,980,057) | |

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入債券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|
| アメリカドル | 国債証券　219銘柄 | 100.0% | 47.4% |
| カナダドル | 国債証券　32銘柄 | 100.0% | 2.0% |
| メキシコペソ | 国債証券　14銘柄 | 100.0% | 0.7% |
| ユーロ | 国債証券　337銘柄 | 100.0% | 38.8% |
| イギリスポンド | 国債証券　54銘柄 | 100.0% | 5.9% |
| スウェーデンクローナ | 国債証券　8銘柄 | 100.0% | 0.3% |
| ノルウェークローネ | 国債証券　9銘柄 | 100.0% | 0.2% |
| デンマーククローネ | 国債証券　8銘柄 | 100.0% | 0.4% |
| ポーランドズロチ | 国債証券　14銘柄 | 100.0% | 0.5% |
| オーストラリアドル | 国債証券　26銘柄 | 100.0% | 1.6% |
| シンガポールドル | 国債証券　19銘柄 | 100.0% | 0.4% |
| マレーシアリンギット | 国債証券　30銘柄 | 100.0% | 0.5% |

| | | | |
|---|---|---|---|
| イスラエルシェケル | 国債証券　　14銘柄 | 100.0% | 0.4% |
| 香港・オフショア人民元 | 国債証券　　18銘柄 | 100.0% | 0.7% |

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス　マザーファンド

### 貸借対照表

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 6,982,564,563 |
| コール・ローン | 1,611,216,265 |
| 株式 | 496,932,605,771 |
| 投資信託受益証券 | 286,914,422 |
| 投資証券 | 11,459,377,813 |
| 派生商品評価勘定 | 36,342,183 |
| 未収入金 | △1 |
| 未収配当金 | 303,442,435 |
| 前払金 | 150,522,201 |
| 差入委託証拠金 | 1,362,153,783 |
| 流動資産合計 | 519,125,139,435 |
| 資産合計 | 519,125,139,435 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 188,217,377 |
| 未払解約金 | 1,052,475,375 |
| 未払利息 | 2,415 |
| 流動負債合計 | 1,240,695,167 |
| 負債合計 | 1,240,695,167 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 125,379,065,422 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 392,505,378,846 |
| 元本等合計 | 517,884,444,268 |
| 純資産合計 | 517,884,444,268 |
| 負債純資産合計 | 519,125,139,435 |

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| | 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。<br>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。<br><br>(2)派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。<br><br>(3)為替予約取引による為替差損益<br>約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| | | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|---|
| 1． 計算期間の末日における受益権の総数 | | 125,379,065,422口 |
| 2． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 | 4.1305円 |
| | (1万口当たり純資産額) | (41,305円) |

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2.金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。<br>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。 |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。 |

## ２．金融商品の時価等に関する事項

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

### （関連当事者との取引に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

### （重要な後発事象に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

### （その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2021年 1月21日 |
| 期首元本額 | 146,425,163,104円 |
| 期中追加設定元本額 | 13,345,927,484円 |
| 期中一部解約元本額 | 34,392,025,166円 |
| 期末元本額 | 125,379,065,422円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 1,888,139,255円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 7,121,235円 |
| ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン | 30,124,202,302円 |
| 世界経済インデックスファンド | 9,577,066,256円 |
| 外国株式インデックス・オープン | 844,357,673円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 820,311,369円 |
| ＤＣマイセレクション５０ | 3,838,482,563円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 4,401,337,576円 |
| ＤＣ外国株式インデックス・オープン | 11,671,773,715円 |
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 397,448,857円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 1,818,968,962円 |
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 1,524,794,553円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 52,371,368円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 165,230,872円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 118,814,732円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 9,504,209,076円 |
| 外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 1,667,254,267円 |
| マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 4,370,105円 |
| マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 4,613,649円 |
| 外国株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用） | 30,784,916円 |
| バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 16,645,660円 |
| バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 59,655,188円 |
| バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 11,656,656円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 38,621,871円 |
| バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 314,575,085円 |
| バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 186,426,802円 |
| バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,365,542,500円 |
| 世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用） | 173,287,225円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 35,625,550円 |
| バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 181,169,829円 |
| バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 60,531,925円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ１ | 1,153,399,892円 |
| ＦＯＦｓ用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用） | 1,193,867,847円 |
| 外国株式ファンド・シリーズ１ | 1,153,299,782円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 709,679,705円 |

| 区分 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 1,532,976,315円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 1,458,128,299円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 8,127,220,507円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 1,237,650,305円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 1,065,193,705円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 658,548,355円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 599,690,957円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 29,266,580円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 158,957,370円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 431,357,615円 |
| 外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用） | 17,488,738,858円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 174,573,949円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 643,957,427円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 125,114,641円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 3,776,110円 |
| ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード） | 152,792,028円 |
| グローバル経済コア | 649,159,006円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 12,587,631円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 4,853,834円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 480,458,252円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 63,437,074円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 18,457,901円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 12,680,293円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 6,567,996円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 7,205,423円 |
| ＦＯＦｓ用　外国株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用） | 342,046,177円 |
| 外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用） | 514,529,362円 |
| 外株インデックス・ファンド２（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用） | 1,056,919,591円 |
| 世界株式ファンド（適格機関投資家専用） | 1,091,055,460円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 195,849,150円 |
| ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 111,785,723円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 44,450,123円 |
| ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用） | 80,706,930円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用） | 248,911,281円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０５（適格機関投資家専用） | 260,033,035円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用） | 252,448,023円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用） | 250,931,421円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用） | 239,889,089円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用） | 236,166,458円 |
| ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド２０２１－１１（適格機関投資家専用） | 194,354,350円 |

**（有価証券に関する注記）**

**売買目的有価証券**

| 種類 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式 | 28,215,953,716 |
| 投資信託受益証券 | 19,727,833 |
| 投資証券 | 916,257,055 |
| 合計 | 29,151,938,604 |

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

**（デリバティブ取引に関する注記）**

**株式関連**

（2022年 1月20日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 8,481,294,417 | － | 8,330,772,216 | △150,522,201 |
| 合計 | | 8,481,294,417 | － | 8,330,772,216 | △150,522,201 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

**通貨関連**

（2022年 1月20日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 439,050,817 | － | 437,732,484 | △1,318,333 |
| | アメリカドル | 281,039,500 | － | 280,056,560 | △982,940 |
| | カナダドル | 80,527,526 | － | 80,274,486 | △253,040 |
| | イギリスポンド | 77,483,791 | － | 77,401,438 | △82,353 |
| | 売建 | 769,701,500 | － | 769,736,160 | △34,660 |
| | アメリカドル | 457,200,000 | － | 457,220,800 | △20,800 |
| | ユーロ | 142,728,300 | － | 142,741,280 | △12,980 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | イギリスポンド | 62,284,000 | － | 62,291,640 | △7,640 |
| | オーストラリアドル | 107,489,200 | － | 107,482,440 | 6,760 |
| 合計 | | 1,208,752,317 | － | 1,207,468,644 | △1,352,993 |

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第１　有価証券明細表

#### (1)株式

| 通 貨 | 銘　柄 | 株式数（株） | 評価額 | | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | 単価 | 金額 | |
| アメリカドル | BAKER HUGHES CO | 69,980 | 26.29 | 1,839,774.20 | |
| | CHENIERE ENERGY INC | 19,034 | 108.33 | 2,061,953.22 | |
| | CHEVRON CORP | 153,051 | 128.91 | 19,729,804.41 | |
| | CONOCOPHILLIPS | 107,649 | 87.28 | 9,395,604.72 | |
| | COTERRA ENERGY INC | 64,000 | 20.88 | 1,336,320.00 | |
| | DEVON ENERGY CORPORATION | 51,677 | 48.93 | 2,528,555.61 | |
| | DIAMONDBACK ENERGY INC | 13,267 | 125.71 | 1,667,794.57 | |
| | EOG RESOURCES INC | 46,119 | 105.13 | 4,848,490.47 | |
| | EXXON MOBIL | 334,998 | 73.11 | 24,491,703.78 | |
| | HALLIBURTON CO | 68,269 | 28.38 | 1,937,474.22 | |
| | HESS CORP | 22,781 | 91.23 | 2,078,310.63 | |
| | KINDER MORGAN INC | 159,310 | 17.43 | 2,776,773.30 | |
| | MARATHON PETROLEUM CORP | 49,827 | 73.35 | 3,654,810.45 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 69,966 | 35.83 | 2,506,881.78 | |
| | ONEOK INC | 33,279 | 60.21 | 2,003,728.59 | |
| | PHILLIPS 66 | 35,503 | 87.24 | 3,097,281.72 | |
| | PIONEER NATURAL RESOURCES | 18,224 | 219.06 | 3,992,149.44 | |
| | SCHLUMBERGER | 107,126 | 37.10 | 3,974,374.60 | |
| | VALERO ENERGY CORP | 30,763 | 84.21 | 2,590,552.23 | |
| | WILLIAMS COS | 98,553 | 29.03 | 2,860,993.59 | |
| | AIR PRODUCTS&CHEMICALS | 17,541 | 285.57 | 5,009,183.37 | |
| | ALBEMARLE CORP | 9,440 | 219.69 | 2,073,873.60 | |
| | AMCOR PLC | 111,485 | 12.41 | 1,383,528.85 | |
| | AVERY DENNISON CORP | 6,638 | 206.25 | 1,369,087.50 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| BALL CORP | 25,605 | 91.75 | 2,349,258.75 | |
| CELANESE CORP-SERIES A | 8,582 | 168.10 | 1,442,634.20 | |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 14,951 | 66.90 | 1,000,221.90 | |
| CORTEVA INC | 58,500 | 47.22 | 2,762,370.00 | |
| CROWN HOLDINGS INC | 11,212 | 116.48 | 1,305,973.76 | |
| DOW INC | 60,946 | 59.84 | 3,647,008.64 | |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 40,980 | 81.58 | 3,343,148.40 | |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY | 11,075 | 127.51 | 1,412,173.25 | |
| ECOLAB INC | 19,895 | 214.80 | 4,273,446.00 | |
| FMC CORP | 10,507 | 111.05 | 1,166,802.35 | |
| FREEPORT-MCMORAN INC | 113,194 | 44.08 | 4,989,591.52 | |
| INT'L PAPER CO | 30,800 | 49.35 | 1,519,980.00 | |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 19,494 | 139.38 | 2,717,073.72 | |
| LINDE PLC | 40,841 | 322.19 | 13,158,561.79 | |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 19,803 | 100.88 | 1,997,726.64 | |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 4,631 | 390.36 | 1,807,757.16 | |
| MOSAIC CO/THE | 31,911 | 41.94 | 1,338,347.34 | |
| NEWMONT CORPORATION | 65,375 | 64.95 | 4,246,106.25 | |
| NUCOR CORP | 23,355 | 104.25 | 2,434,758.75 | |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 7,687 | 137.12 | 1,054,041.44 | |
| PPG INDUSTRIES INC | 19,278 | 161.55 | 3,114,360.90 | |
| RPM INTERNATIONAL INC | 10,456 | 90.53 | 946,581.68 | |
| SEALED AIR CORP | 11,690 | 68.64 | 802,401.60 | |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 19,719 | 303.79 | 5,990,435.01 | |
| STEEL DYNAMICS INC | 15,552 | 58.96 | 916,945.92 | |
| VULCAN MATERIALS CO | 10,247 | 188.22 | 1,928,690.34 | |
| WESTROCK CO | 21,356 | 46.27 | 988,142.12 | |
| 3 M COMPANY | 46,302 | 178.48 | 8,263,980.96 | |
| ALLEGION PLC | 7,601 | 122.93 | 934,390.93 | |
| AMETEK INC | 18,006 | 138.84 | 2,499,953.04 | |
| BOEING CO | 44,447 | 217.08 | 9,648,554.76 | |
| CARRIER GLOBAL CORP | 67,383 | 48.79 | 3,287,616.57 | |
| CATERPILLAR | 43,764 | 221.66 | 9,700,728.24 | |
| CUMMINS INC | 11,214 | 231.10 | 2,591,555.40 | |
| DEERE&CO | 23,252 | 375.90 | 8,740,426.80 | |
| DOVER CORP | 10,672 | 177.60 | 1,895,347.20 | |
| EATON CORP | 31,624 | 163.39 | 5,167,045.36 | |
| EMERSON ELECTRIC CO | 46,305 | 94.92 | 4,395,270.60 | |
| FASTENAL CO | 44,846 | 58.02 | 2,601,964.92 | |
| FORTIVE CORP | 25,722 | 72.24 | 1,858,157.28 | |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 10,310 | 96.95 | 999,554.50 | |
| GENERAC HOLDINGS INC | 5,211 | 291.36 | 1,518,276.96 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GENERAL DYNAMICS CORP | 18,970 | 210.36 | 3,990,529.20 | |
| GENERAL ELECTRIC CO | 87,737 | 100.62 | 8,828,096.94 | |
| GRAINGER (WW) INC | 3,236 | 497.31 | 1,609,295.16 | |
| HEICO CORP | 3,640 | 146.85 | 534,534.00 | |
| HEICO CORP-CLASS A | 6,449 | 124.45 | 802,578.05 | |
| HONEYWELL INTL INC | 54,581 | 210.73 | 11,501,854.13 | |
| HOWMET AEROSPACE INC | 31,594 | 33.83 | 1,068,825.02 | |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC | 3,522 | 193.68 | 682,140.96 | |
| IDEX CORP | 5,916 | 216.10 | 1,278,447.60 | |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 25,097 | 242.23 | 6,079,246.31 | |
| INGERSOLL-RAND INC | 31,562 | 58.38 | 1,842,589.56 | |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD | 17,700 | 58.54 | 1,036,158.00 | |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 56,689 | 73.71 | 4,178,546.19 | |
| KORNIT DIGITAL LTD | 2,776 | 103.60 | 287,593.60 | |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 15,684 | 227.67 | 3,570,776.28 | |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 2,526 | 290.77 | 734,485.02 | |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 19,938 | 377.33 | 7,523,205.54 | |
| MASCO CORP | 19,462 | 65.59 | 1,276,512.58 | |
| NORDSON CORP | 4,121 | 236.94 | 976,429.74 | |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 12,113 | 401.65 | 4,865,186.45 | |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 33,153 | 83.10 | 2,755,014.30 | |
| OWENS CORNING | 8,642 | 91.30 | 789,014.60 | |
| PACCAR INC | 28,106 | 94.16 | 2,646,460.96 | |
| PARKER HANNIFIN CORP | 10,508 | 323.09 | 3,395,029.72 | |
| PENTAIR PLC | 14,533 | 66.30 | 963,537.90 | |
| PLUG POWER INC | 41,884 | 20.99 | 879,145.16 | |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP | 119,143 | 89.70 | 10,687,127.10 | |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 9,098 | 315.63 | 2,871,601.74 | |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 8,314 | 442.48 | 3,678,778.72 | |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 13,828 | 60.40 | 835,211.20 | |
| SMITH (A.O.) CORP | 9,016 | 79.55 | 717,222.80 | |
| SNAP-ON INC | 4,000 | 212.61 | 850,440.00 | |
| STANLEY BLACK&DECKER | 12,598 | 182.18 | 2,295,103.64 | |
| SUNRUN INC | 13,917 | 27.71 | 385,640.07 | |
| TEXTRON | 18,893 | 74.81 | 1,413,385.33 | |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 18,638 | 175.70 | 3,274,696.60 | |
| TRANSDIGM GROUP INC | 4,075 | 630.25 | 2,568,268.75 | |
| UNITED RENTALS INC | 5,393 | 307.30 | 1,657,268.90 | |
| WABTEC CORP | 15,024 | 91.92 | 1,381,006.08 | |
| XYLEM INC | 13,269 | 108.51 | 1,439,819.19 | |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 11,364 | 87.05 | 989,236.20 | |
| CINTAS CORP | 7,423 | 387.84 | 2,878,936.32 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CLARIVATE PLC | 27,357 | 16.36 | 447,560.52 | |
| COPART INC | 16,617 | 131.90 | 2,191,782.30 | |
| COSTAR GROUP INC | 32,116 | 73.15 | 2,349,285.40 | |
| EQUIFAX INC | 9,509 | 233.92 | 2,224,345.28 | |
| IHS MARKIT LTD | 30,929 | 119.17 | 3,685,808.93 | |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 10,661 | 128.98 | 1,375,055.78 | |
| LEIDOS HOLDINGS | 11,220 | 93.63 | 1,050,528.60 | |
| REPUBLIC SERVICES INC | 18,483 | 129.15 | 2,387,079.45 | |
| ROBERT HALF INTL INC | 9,566 | 110.74 | 1,059,338.84 | |
| ROLLINS INC | 17,468 | 31.99 | 558,801.32 | |
| TRANSUNION | 15,741 | 104.12 | 1,638,952.92 | |
| VERISK ANALYTICS INC | 12,503 | 199.86 | 2,498,849.58 | |
| WASTE CONNECTIONS INC | 21,275 | 124.53 | 2,649,375.75 | |
| WASTE MANAGEMENT INC | 32,770 | 155.08 | 5,081,971.60 | |
| AMERCO | 734 | 647.23 | 475,066.82 | |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 11,292 | 107.51 | 1,214,002.92 | |
| CSX CORP | 176,986 | 35.25 | 6,238,756.50 | |
| DELTA AIR LINES INC | 14,609 | 38.82 | 567,121.38 | |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 14,272 | 119.02 | 1,698,653.44 | |
| FEDEX CORP | 19,524 | 252.19 | 4,923,757.56 | |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 7,052 | 200.65 | 1,414,983.80 | |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION | 10,700 | 57.34 | 613,538.00 | |
| LYFT INC-A | 21,288 | 36.91 | 785,740.08 | |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 19,853 | 278.06 | 5,520,325.18 | |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 8,003 | 312.43 | 2,500,377.29 | |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 13,533 | 44.43 | 601,271.19 | |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 93,848 | 37.86 | 3,553,085.28 | |
| UNION PACIFIC CORP | 51,560 | 239.49 | 12,348,104.40 | |
| UNITED PARCEL SERVICE B | 57,890 | 203.76 | 11,795,666.40 | |
| APTIV PLC | 22,055 | 145.88 | 3,217,383.40 | |
| BORGWARNER INC | 19,781 | 46.48 | 919,420.88 | |
| FORD MOTOR COMPANY | 305,209 | 22.45 | 6,851,942.05 | |
| GENERAL MOTORS CO | 103,796 | 56.24 | 5,837,487.04 | |
| LEAR CORP | 5,287 | 178.84 | 945,527.08 | |
| LUCID GROUP INC | 31,234 | 40.03 | 1,250,297.02 | |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A | 13,363 | 69.40 | 927,392.20 | |
| TESLA INC | 66,715 | 995.65 | 66,424,789.75 | |
| DR HORTON INC | 27,764 | 90.33 | 2,507,922.12 | |
| GARMIN LTD | 12,854 | 131.23 | 1,686,830.42 | |
| HASBRO INC | 10,572 | 99.13 | 1,048,002.36 | |
| LENNAR CORP-CL A | 22,762 | 96.86 | 2,204,727.32 | |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 9,305 | 330.95 | 3,079,489.75 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 5,062 | 161.88 | 819,436.56 | |
| NEWELL BRANDS INC | 31,461 | 23.30 | 733,041.30 | |
| NIKE B | 100,716 | 145.11 | 14,614,898.76 | |
| NVR INC | 247 | 5,355.00 | 1,322,685.00 | |
| PELOTON INTERACTIVE INC-A | 21,736 | 31.84 | 692,074.24 | |
| PULTE GROUP INC | 21,609 | 53.10 | 1,147,437.90 | |
| VF CORP | 25,718 | 70.41 | 1,810,804.38 | |
| WHIRLPOOL CORP | 5,220 | 206.87 | 1,079,861.40 | |
| AIRBNB INC-CLASS A | 18,489 | 154.58 | 2,858,029.62 | |
| ARAMARK | 20,955 | 34.49 | 722,737.95 | |
| BOOKING HOLDINGS INC | 3,268 | 2,377.09 | 7,768,330.12 | |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC | 17,560 | 77.80 | 1,366,168.00 | |
| CARNIVAL CORPORATION | 70,520 | 21.22 | 1,496,434.40 | |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 2,164 | 1,467.68 | 3,176,059.52 | |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 10,712 | 138.56 | 1,484,254.72 | |
| DOMINO'S PIZZA INC | 2,848 | 469.39 | 1,336,822.72 | |
| DRAFTKINGS INC - CL A | 27,674 | 21.40 | 592,223.60 | |
| EXPEDIA GROUP INC | 11,638 | 176.46 | 2,053,641.48 | |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 21,878 | 142.21 | 3,111,270.38 | |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 29,370 | 43.92 | 1,289,930.40 | |
| MARRIOTT INTL A | 21,139 | 154.20 | 3,259,633.80 | |
| MCDONALD'S CORP | 59,079 | 255.22 | 15,078,142.38 | |
| MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR | 17,662 | 11.08 | 195,694.96 | |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 33,064 | 42.21 | 1,395,631.44 | |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 19,267 | 81.63 | 1,572,765.21 | |
| STARBUCKS CORP | 94,298 | 96.87 | 9,134,647.26 | |
| VAIL RESORTS INC | 3,014 | 287.84 | 867,549.76 | |
| WYNN RESORTS LTD | 9,302 | 89.06 | 828,436.12 | |
| YUM BRANDS INC | 24,252 | 124.50 | 3,019,374.00 | |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 61,643 | 82.15 | 5,063,972.45 | |
| ALPHABET INC-CL A | 23,897 | 2,702.33 | 64,577,580.01 | |
| ALPHABET INC-CL C | 22,844 | 2,713.04 | 61,976,685.76 | |
| AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A | 38,290 | 18.32 | 701,472.80 | |
| CABLE ONE INC | 445 | 1,582.31 | 704,127.95 | |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 10,148 | 581.30 | 5,899,032.40 | |
| COMCAST CORP-CL A | 362,493 | 50.33 | 18,244,272.69 | |
| DISCOVERY INC - A | 12,804 | 28.58 | 365,938.32 | |
| DISCOVERY INC-C | 28,190 | 27.78 | 783,118.20 | |
| DISH NETWORK CORPORATION-A | 20,132 | 34.05 | 685,494.60 | |
| ELECTRONIC ARTS INC | 23,411 | 136.91 | 3,205,200.01 | |
| FOX CORP - CLASS A | 27,658 | 39.66 | 1,096,916.28 | |
| FOX CORP- CLASS B | 15,092 | 36.48 | 550,556.16 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| IAC/INTERACTIVECORP | 6,721 | 131.80 | 885,827.80 | |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS | 33,834 | 36.48 | 1,234,264.32 | |
| LIBERTY BROADBAND-A | 2,579 | 142.05 | 366,346.95 | |
| LIBERTY BROADBAND-C | 11,268 | 144.76 | 1,631,155.68 | |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 15,379 | 61.93 | 952,421.47 | |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C | 13,584 | 47.72 | 648,228.48 | |
| LIBERTY SIRIUSXM-A | 6,384 | 47.67 | 304,325.28 | |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT | 13,908 | 113.28 | 1,575,498.24 | |
| MATCH GROUP INC | 20,191 | 116.27 | 2,347,607.57 | |
| META PLATFORMS INC-CLASS A | 188,974 | 319.59 | 60,394,200.66 | |
| NETFLIX INC | 35,107 | 515.86 | 18,110,297.02 | |
| NEWS CORP-CLASS A | 33,479 | 22.03 | 737,542.37 | |
| OMNICOM GROUP | 18,031 | 76.97 | 1,387,846.07 | |
| PINTEREST INC- CLASS A | 45,767 | 31.64 | 1,448,067.88 | |
| ROKU INC | 9,122 | 166.49 | 1,518,721.78 | |
| SEA LTD-ADR | 10,483 | 167.83 | 1,759,361.89 | |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 60,468 | 6.10 | 368,854.80 | |
| SNAP INC - A | 83,375 | 35.05 | 2,922,293.75 | |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE | 9,738 | 163.36 | 1,590,799.68 | |
| THE WALT DISNEY CO | 143,808 | 150.11 | 21,587,018.88 | |
| TWITTER INC | 63,066 | 37.35 | 2,355,515.10 | |
| VIACOMCBS INC-CLASS B | 48,586 | 35.07 | 1,703,911.02 | |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A | 17,304 | 48.97 | 847,376.88 | |
| ADVANCE AUTO PARTS | 5,324 | 234.34 | 1,247,626.16 | |
| AMAZON.COM | 36,161 | 3,125.98 | 113,038,562.78 | |
| AUTOZONE INC | 1,639 | 1,945.89 | 3,189,313.71 | |
| BATH & BODY WORKS INC | 19,806 | 55.57 | 1,100,619.42 | |
| BEST BUY COMPANY INC | 18,175 | 99.35 | 1,805,686.25 | |
| BURLINGTON STORES INC | 5,108 | 224.00 | 1,144,192.00 | |
| CARMAX INC | 12,051 | 107.63 | 1,297,049.13 | |
| CARVANA CO | 5,700 | 157.13 | 895,641.00 | |
| CHEWY INC - CLASS A | 6,878 | 42.19 | 290,182.82 | |
| DOLLAR GENERAL CORP | 18,686 | 219.94 | 4,109,798.84 | |
| DOLLAR TREE INC | 17,931 | 131.32 | 2,354,698.92 | |
| DOORDASH INC - A | 8,334 | 131.76 | 1,098,087.84 | |
| EBAY | 51,021 | 62.29 | 3,178,098.09 | |
| ETSY INC | 10,294 | 163.14 | 1,679,363.16 | |
| FIVERR INTERNATIONAL LTD | 1,486 | 82.50 | 122,595.00 | |
| GENUINE PARTS CO | 12,119 | 134.35 | 1,628,187.65 | |
| HOME DEPOT | 83,616 | 359.69 | 30,075,839.04 | |
| LKQ CORP | 22,779 | 54.74 | 1,246,922.46 | |
| LOWES COMPANIES | 54,763 | 234.70 | 12,852,876.10 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| MERCADOLIBRE INC | 3,567 | 1,060.94 | 3,784,372.98 | |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 5,407 | 659.59 | 3,566,403.13 | |
| POOL CORP | 3,304 | 490.66 | 1,621,140.64 | |
| ROSS STORES INC | 28,076 | 99.03 | 2,780,366.28 | |
| TARGET (DAYTON HUDSON) | 38,552 | 223.84 | 8,629,479.68 | |
| TJX COMPANIES INC | 96,126 | 68.51 | 6,585,592.26 | |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 8,922 | 220.66 | 1,968,728.52 | |
| ULTA BEAUTY INC | 3,990 | 371.68 | 1,483,003.20 | |
| WAYFAIR INC- CLASS A | 6,000 | 156.02 | 936,120.00 | |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 34,970 | 490.16 | 17,140,895.20 | |
| KROGER CO | 56,126 | 48.58 | 2,726,601.08 | |
| SYSCO CORP | 40,288 | 77.69 | 3,129,974.72 | |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 59,767 | 53.53 | 3,199,327.51 | |
| WALMART INC | 122,250 | 143.94 | 17,596,665.00 | |
| ALTRIA GROUP INC | 147,613 | 50.09 | 7,393,935.17 | |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 45,402 | 71.00 | 3,223,542.00 | |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 24,006 | 66.77 | 1,602,880.62 | |
| BUNGE LIMITED | 11,604 | 96.76 | 1,122,803.04 | |
| CAMPBELL SOUP CO (US) | 15,869 | 46.04 | 730,608.76 | |
| COCA-COLA CO | 323,723 | 61.00 | 19,747,103.00 | |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE | 15,394 | 58.26 | 896,854.44 | |
| CONAGRA BRANDS INC | 41,157 | 35.56 | 1,463,542.92 | |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 12,940 | 242.81 | 3,141,961.40 | |
| GENERAL MILLS INC | 49,646 | 69.15 | 3,433,020.90 | |
| HERSHEY FOODS CORPORATION | 11,352 | 199.64 | 2,266,313.28 | |
| HORMEL FOODS CORP | 23,338 | 49.15 | 1,147,062.70 | |
| JM SMUCKER CO | 9,145 | 143.40 | 1,311,393.00 | |
| KELLOGG CO | 21,630 | 66.60 | 1,440,558.00 | |
| KEURIG DR PEPPER INC | 52,526 | 38.38 | 2,015,947.88 | |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 52,188 | 37.22 | 1,942,437.36 | |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 21,088 | 96.06 | 2,025,713.28 | |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO-B | 14,669 | 50.24 | 736,970.56 | |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 111,937 | 67.60 | 7,566,941.20 | |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 32,267 | 86.73 | 2,798,516.91 | |
| PEPSICO INC | 109,176 | 175.21 | 19,128,726.96 | |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 124,866 | 101.49 | 12,672,650.34 | |
| TYSON FOODS INC | 21,804 | 92.71 | 2,021,448.84 | |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 17,995 | 102.93 | 1,852,225.35 | |
| CLOROX COMPANY | 9,570 | 181.13 | 1,733,414.10 | |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 63,788 | 84.06 | 5,362,019.28 | |
| ESTEE LAUDER CO-CL A | 18,438 | 309.52 | 5,706,929.76 | |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 27,550 | 142.68 | 3,930,834.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| PROCTER & GAMBLE CO | 192,348 | 162.00 | 31,160,376.00 | |
| ABBOTT LABORATORIES | 140,430 | 126.05 | 17,701,201.50 | |
| ABIOMED INC | 3,781 | 302.02 | 1,141,937.62 | |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 5,943 | 497.59 | 2,957,177.37 | |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 12,896 | 132.39 | 1,707,301.44 | |
| ANTHEM INC | 19,533 | 448.29 | 8,756,448.57 | |
| BAXTER INTERNATIONAL | 40,994 | 85.60 | 3,509,086.40 | |
| BECTON DICKINSON & CO | 23,131 | 263.87 | 6,103,576.97 | |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 112,802 | 44.05 | 4,968,928.10 | |
| CARDINAL HEALTH | 24,692 | 52.07 | 1,285,712.44 | |
| CENTENE CORP | 44,550 | 77.61 | 3,457,525.50 | |
| CERNER CORP | 22,894 | 91.77 | 2,100,982.38 | |
| CIGNA CORP | 27,283 | 238.80 | 6,515,180.40 | |
| CVS HEALTH CORP | 105,249 | 103.45 | 10,888,009.05 | |
| DAVITA INC | 5,784 | 109.62 | 634,042.08 | |
| DENTSPLY SIRONA INC | 17,774 | 53.02 | 942,377.48 | |
| DEXCOM INC | 7,647 | 435.23 | 3,328,203.81 | |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 48,336 | 116.16 | 5,614,709.76 | |
| HCA HEALTHCARE INC | 20,149 | 245.33 | 4,943,154.17 | |
| HENRY SCHEIN INC | 11,747 | 74.55 | 875,738.85 | |
| HOLOGIC INC | 21,687 | 70.42 | 1,527,198.54 | |
| HUMANA INC | 9,953 | 377.84 | 3,760,641.52 | |
| IDEXX LABORATORIES INC | 6,751 | 519.13 | 3,504,646.63 | |
| INMODE LTD | 5,500 | 44.92 | 247,060.00 | |
| INSULET CORP | 5,311 | 235.02 | 1,248,191.22 | |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 28,389 | 293.46 | 8,331,035.94 | |
| LABORATORY CRP OF AMER | 7,595 | 272.02 | 2,065,991.90 | |
| MASIMO CORP | 4,147 | 223.25 | 925,817.75 | |
| MCKESSON CORP | 12,089 | 251.15 | 3,036,152.35 | |
| MEDTRONIC PLC | 106,382 | 107.76 | 11,463,724.32 | |
| MOLINA HEALTHCARE INC | 4,940 | 280.44 | 1,385,373.60 | |
| NOVOCURE LTD | 7,933 | 64.18 | 509,139.94 | |
| OAK STREET HEALTH INC | 7,613 | 19.50 | 148,453.50 | |
| QUEST DIAGNOSTICS | 10,005 | 138.98 | 1,390,494.90 | |
| RESMED INC | 11,440 | 241.39 | 2,761,501.60 | |
| STERIS PLC | 8,018 | 231.86 | 1,859,053.48 | |
| STRYKER CORP | 27,043 | 258.30 | 6,985,206.90 | |
| TELADOC HEALTH INC | 11,375 | 75.51 | 858,926.25 | |
| TELEFLEX INC | 3,934 | 332.86 | 1,309,471.24 | |
| THE COOPER COS INC | 4,134 | 398.15 | 1,645,952.10 | |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 74,840 | 462.52 | 34,614,996.80 | |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 6,102 | 129.42 | 789,720.84 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A | 11,255 | 220.13 | 2,477,563.15 | |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 17,300 | 123.27 | 2,132,571.00 | |
| 10X GENOMICS INC-CLASS A | 5,655 | 89.64 | 506,914.20 | |
| ABBVIE INC | 139,675 | 135.21 | 18,885,456.75 | |
| AGILENT TECHNOLOGIES | 23,785 | 140.43 | 3,340,127.55 | |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 9,643 | 138.62 | 1,336,712.66 | |
| AMGEN | 44,845 | 231.30 | 10,372,648.50 | |
| AVANTOR INC | 42,980 | 37.15 | 1,596,707.00 | |
| BIO-RAD LABORATORIES-A | 1,853 | 598.44 | 1,108,909.32 | |
| BIO-TECHNE CORP | 3,245 | 379.83 | 1,232,548.35 | |
| BIOGEN INC | 11,860 | 230.81 | 2,737,406.60 | |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 14,783 | 86.00 | 1,271,338.00 | |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 175,578 | 64.72 | 11,363,408.16 | |
| CATALENT INC | 13,739 | 102.56 | 1,409,071.84 | |
| CHARLES RIVER LABORATORIES | 4,204 | 336.68 | 1,415,402.72 | |
| DANAHER CORP | 50,501 | 287.03 | 14,495,302.03 | |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC | 36,061 | 26.39 | 951,649.79 | |
| EXACT SCIENCES CORP | 14,756 | 76.13 | 1,123,374.28 | |
| GILEAD SCIENCES INC | 100,025 | 69.07 | 6,908,726.75 | |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC | 17,926 | 88.04 | 1,578,205.04 | |
| ILLUMINA INC | 11,258 | 384.36 | 4,327,124.88 | |
| INCYTE CORP | 15,212 | 74.78 | 1,137,553.36 | |
| IQVIA HOLDINGS INC | 15,126 | 240.28 | 3,634,475.28 | |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 4,971 | 140.64 | 699,121.44 | |
| JOHNSON & JOHNSON | 208,850 | 166.58 | 34,790,233.00 | |
| LILLY (ELI) & CO | 64,377 | 245.05 | 15,775,583.85 | |
| MERCK & CO | 200,094 | 81.29 | 16,265,641.26 | |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 1,808 | 1,469.07 | 2,656,078.56 | |
| MODERNA INC | 27,309 | 174.07 | 4,753,677.63 | |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 8,474 | 72.83 | 617,161.42 | |
| NOVAVAX INC | 5,754 | 92.33 | 531,266.82 | |
| PERKINELMER INC | 9,372 | 176.80 | 1,656,969.60 | |
| PFIZER | 442,966 | 53.54 | 23,716,399.64 | |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 8,116 | 618.11 | 5,016,580.76 | |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A | 26,128 | 39.97 | 1,044,336.16 | |
| SEAGEN INC | 10,071 | 132.55 | 1,334,911.05 | |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR | 80,401 | 8.84 | 710,744.84 | |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 31,080 | 593.37 | 18,441,939.60 | |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 21,153 | 230.84 | 4,882,958.52 | |
| VIATRIS INC | 103,541 | 14.72 | 1,524,123.52 | |
| WATERS CORP | 4,749 | 324.46 | 1,540,860.54 | |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 5,767 | 375.45 | 2,165,220.15 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ZOETIS INC | 37,880 | 200.58 | 7,597,970.40 | |
| BANK OF AMERICA CORP | 599,876 | 46.44 | 27,858,241.44 | |
| CITIGROUP | 160,167 | 64.24 | 10,289,128.08 | |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 36,041 | 54.36 | 1,959,188.76 | |
| FIFTH THIRD BANCORP | 57,022 | 47.97 | 2,735,345.34 | |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A | 950 | 897.89 | 852,995.50 | |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 13,787 | 174.03 | 2,399,351.61 | |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 114,112 | 17.11 | 1,952,456.32 | |
| JPMORGAN CHASE & CO | 236,784 | 148.93 | 35,264,241.12 | |
| KEY CORP | 71,472 | 25.59 | 1,828,968.48 | |
| M & T BANK CORP | 10,537 | 175.92 | 1,853,669.04 | |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 33,857 | 208.52 | 7,059,861.64 | |
| REGIONS FINL CORP | 70,814 | 23.65 | 1,674,751.10 | |
| SIGNATURE BANK | 4,686 | 351.43 | 1,646,800.98 | |
| SVB FINANCIAL GROUP | 4,545 | 655.00 | 2,976,975.00 | |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 107,118 | 64.58 | 6,917,680.44 | |
| US BANCORP | 112,812 | 57.37 | 6,472,024.44 | |
| WELLS FARGO & CO | 326,420 | 55.57 | 18,139,159.40 | |
| ALLY FINANCIAL INC | 27,761 | 48.99 | 1,360,011.39 | |
| AMERICAN EXPRESS | 53,334 | 161.39 | 8,607,574.26 | |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 9,404 | 311.83 | 2,932,449.32 | |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 26,880 | 67.05 | 1,802,304.00 | |
| BANK NEW YORK CO | 64,343 | 59.24 | 3,811,679.32 | |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 105,144 | 314.75 | 33,094,074.00 | |
| BLACKROCK INC | 12,198 | 825.50 | 10,069,449.00 | |
| BLACKSTONE INC | 54,507 | 112.26 | 6,118,955.82 | |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 35,046 | 151.61 | 5,313,324.06 | |
| CARLYLE GROUP INC/THE | 12,595 | 50.59 | 637,181.05 | |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 8,875 | 120.29 | 1,067,573.75 | |
| CME GROUP INC | 28,556 | 229.62 | 6,557,028.72 | |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A | 2,868 | 219.50 | 629,526.00 | |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 23,403 | 118.50 | 2,773,255.50 | |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 32,815 | 34.39 | 1,128,507.85 | |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 3,148 | 429.50 | 1,352,066.00 | |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 26,070 | 33.82 | 881,687.40 | |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR | 4,316 | 48.50 | 209,326.00 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 26,636 | 347.32 | 9,251,215.52 | |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 44,703 | 125.81 | 5,624,084.43 | |
| INVESCO LTD | 26,420 | 23.25 | 614,265.00 | |
| KKR & CO INC | 39,913 | 66.88 | 2,669,381.44 | |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 3,207 | 373.42 | 1,197,557.94 | |
| MOODY'S CORP | 13,365 | 346.63 | 4,632,709.95 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| MORGAN STANLEY | 108,132 | 95.73 | 10,351,476.36 | |
| MSCI INC | 6,518 | 513.40 | 3,346,341.20 | |
| NASDAQ INC | 9,657 | 181.11 | 1,748,979.27 | |
| NORTHERN TRUST CORP | 15,902 | 125.84 | 2,001,107.68 | |
| PRICE T ROWE GROUP INC | 17,907 | 167.79 | 3,004,615.53 | |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 15,486 | 102.21 | 1,582,824.06 | |
| ROBINHOOD MARKETS INC - A | 13,050 | 13.89 | 181,264.50 | |
| S&P GLOBAL INC | 19,238 | 422.95 | 8,136,712.10 | |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 115,518 | 91.51 | 10,571,052.18 | |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 9,550 | 59.92 | 572,236.00 | |
| SOFI TECHNOLOGIES INC | 38,996 | 13.71 | 534,635.16 | |
| STATE STREET CORP | 29,894 | 93.88 | 2,806,448.72 | |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 45,369 | 45.64 | 2,070,641.16 | |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 9,061 | 91.00 | 824,551.00 | |
| UPSTART HOLDINGS INC | 1,362 | 106.01 | 144,385.62 | |
| AFLAC | 50,591 | 62.76 | 3,175,091.16 | |
| ALLEGHANY CORP | 906 | 660.50 | 598,413.00 | |
| ALLSTATE CORP | 23,095 | 120.93 | 2,792,878.35 | |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 6,319 | 130.57 | 825,071.83 | |
| AMERICAN INT'L GROUP | 65,898 | 58.84 | 3,877,438.32 | |
| AON PLC | 17,508 | 270.63 | 4,738,190.04 | |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 34,031 | 45.92 | 1,562,703.52 | |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 16,359 | 154.59 | 2,528,937.81 | |
| ASSURANT INC | 4,726 | 151.53 | 716,130.78 | |
| BROWN & BROWN INC | 19,873 | 64.63 | 1,284,391.99 | |
| CHUBB LTD | 34,591 | 191.88 | 6,637,321.08 | |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 12,791 | 114.97 | 1,470,581.27 | |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 2,166 | 176.21 | 381,670.86 | |
| EVEREST RE GROUP LTD | 3,288 | 287.34 | 944,773.92 | |
| FNF GROUP | 20,461 | 52.76 | 1,079,522.36 | |
| GLOBE LIFE INC | 8,106 | 104.10 | 843,834.60 | |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS | 27,721 | 70.46 | 1,953,221.66 | |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 13,484 | 71.38 | 962,487.92 | |
| LOEWS CORP | 18,851 | 59.59 | 1,123,331.09 | |
| MARKEL CORP | 1,156 | 1,237.74 | 1,430,827.44 | |
| MARSH & MCLENNAN COS | 40,497 | 158.27 | 6,409,460.19 | |
| METLIFE INC | 57,127 | 66.76 | 3,813,798.52 | |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 20,719 | 74.59 | 1,545,430.21 | |
| PROGRESSIVE CORP | 45,110 | 107.63 | 4,855,189.30 | |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 31,037 | 113.19 | 3,513,078.03 | |
| TRAVELERS COS INC/THE | 19,772 | 160.07 | 3,164,904.04 | |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 10,061 | 226.56 | 2,279,420.16 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| WR BERKLEY CORP | 11,715 | 82.53 | 966,838.95 | |
| CBRE GROUP INC-A | 25,382 | 98.89 | 2,510,025.98 | |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 98,700 | 5.50 | 542,850.00 | |
| WEYERHAEUSER CO | 58,295 | 39.18 | 2,283,998.10 | |
| ZILLOW GROUP INC-A | 5,497 | 53.05 | 291,615.85 | |
| ZILLOW GROUP INC-C | 13,427 | 54.22 | 728,011.94 | |
| ACCENTURE PLC-CL A | 50,238 | 343.74 | 17,268,810.12 | |
| ADOBE INC | 37,856 | 516.58 | 19,555,652.48 | |
| AFFIRM HOLDINGS INC | 6,631 | 64.30 | 426,373.30 | |
| AKAMAI TECHNOLOGIES,INC | 13,673 | 113.17 | 1,547,373.41 | |
| ANSYS INC | 6,794 | 337.10 | 2,290,257.40 | |
| ASANA INC - CL A | 4,986 | 53.08 | 264,656.88 | |
| AUTODESK INC | 17,467 | 254.35 | 4,442,731.45 | |
| AUTOMATIC DATA PROCESS | 33,910 | 224.83 | 7,623,985.30 | |
| AVALARA INC | 6,847 | 103.92 | 711,540.24 | |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B | 13,996 | 38.88 | 544,164.48 | |
| BILL.COM HOLDINGS INC | 5,794 | 167.94 | 973,044.36 | |
| BLACK KNIGHT INC | 11,543 | 73.91 | 853,143.13 | |
| BLOCK INC | 31,267 | 128.14 | 4,006,553.38 | |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC | 9,742 | 160.48 | 1,563,396.16 | |
| CADENCE DESIGN SYSTEMS | 21,922 | 153.17 | 3,357,792.74 | |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC | 10,668 | 79.40 | 847,039.20 | |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH | 8,124 | 124.88 | 1,014,525.12 | |
| CITRIX SYSTEMS INC | 10,444 | 104.70 | 1,093,486.80 | |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A | 18,620 | 94.32 | 1,756,238.40 | |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 42,997 | 86.04 | 3,699,461.88 | |
| COUPA SOFTWARE INC | 6,059 | 133.09 | 806,392.31 | |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 15,466 | 175.71 | 2,717,530.86 | |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 3,100 | 141.77 | 439,487.00 | |
| DATADOG INC - CLASS A | 15,147 | 130.91 | 1,982,893.77 | |
| DOCUSIGN INC | 14,969 | 126.99 | 1,900,913.31 | |
| DROPBOX INC-CLASS A | 28,845 | 24.49 | 706,414.05 | |
| DYNATRACE INC | 14,790 | 50.55 | 747,634.50 | |
| EPAM SYSTEMS INC | 4,403 | 493.98 | 2,174,993.94 | |
| FAIR ISAAC CORP | 2,125 | 438.80 | 932,450.00 | |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES | 48,175 | 113.30 | 5,458,227.50 | |
| FISERV INC | 46,421 | 106.05 | 4,922,947.05 | |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 6,523 | 237.58 | 1,549,734.34 | |
| FORTINET INC | 10,645 | 307.16 | 3,269,718.20 | |
| GARTNER INC | 6,968 | 280.05 | 1,951,388.40 | |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 24,126 | 145.86 | 3,519,018.36 | |
| GODADDY INC - CLASS A | 13,798 | 73.72 | 1,017,188.56 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC | 6,318 | 101.66 | 642,287.88 | |
| HUBSPOT INC | 3,646 | 452.96 | 1,651,492.16 | |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 71,479 | 131.58 | 9,405,206.82 | |
| INTUIT INC | 21,612 | 545.35 | 11,786,104.20 | |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 6,291 | 166.42 | 1,046,948.22 | |
| MASTERCARD INC-CLASS A | 70,070 | 360.73 | 25,276,351.10 | |
| MICROSOFT CORP | 566,188 | 303.33 | 171,741,806.04 | |
| MONGODB INC | 4,623 | 384.59 | 1,777,959.57 | |
| NORTONLIFELOCK INC | 50,376 | 26.36 | 1,327,911.36 | |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC | 22,967 | 55.24 | 1,268,697.08 | |
| OKTA INC | 10,230 | 197.42 | 2,019,606.60 | |
| ORACLE CORP | 132,454 | 83.38 | 11,044,014.52 | |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A | 125,244 | 14.56 | 1,823,552.64 | |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 7,648 | 519.61 | 3,973,977.28 | |
| PAYCHEX INC | 25,433 | 121.27 | 3,084,259.91 | |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 4,235 | 329.76 | 1,396,533.60 | |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 88,224 | 173.55 | 15,311,275.20 | |
| PTC INC | 8,304 | 117.36 | 974,557.44 | |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A | 6,393 | 168.77 | 1,078,946.61 | |
| SALESFORCE.COM INC | 77,524 | 226.27 | 17,541,355.48 | |
| SERVICENOW INC | 15,788 | 521.29 | 8,230,126.52 | |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A | 16,606 | 282.56 | 4,692,191.36 | |
| SPLUNK INC | 13,355 | 118.78 | 1,586,306.90 | |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 19,335 | 81.84 | 1,582,376.40 | |
| SYNOPSYS INC | 12,038 | 312.14 | 3,757,541.32 | |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A | 33,090 | 69.00 | 2,283,210.00 | |
| TWILIO INC - A | 12,842 | 203.69 | 2,615,786.98 | |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 3,339 | 466.74 | 1,558,444.86 | |
| UNITY SOFTWARE INC | 4,329 | 113.07 | 489,480.03 | |
| VERISIGN INC | 7,790 | 217.24 | 1,692,299.60 | |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 134,076 | 214.68 | 28,783,435.68 | |
| VMWARE INC-CLASS A | 16,717 | 124.21 | 2,076,418.57 | |
| WESTERN UNION CO | 29,297 | 18.77 | 549,904.69 | |
| WIX.COM LTD | 5,010 | 134.22 | 672,442.20 | |
| WORKDAY INC-CLASS A | 15,585 | 249.46 | 3,887,834.10 | |
| ZENDESK INC | 10,500 | 97.57 | 1,024,485.00 | |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A | 17,028 | 157.23 | 2,677,312.44 | |
| ZSCALER INC | 6,234 | 253.11 | 1,577,887.74 | |
| AMPHENOL CORPORATION | 48,807 | 78.51 | 3,831,837.57 | |
| APPLE INC | 1,311,983 | 166.23 | 218,090,934.09 | |
| ARISTA NETWORKS INC | 18,880 | 125.31 | 2,365,852.80 | |
| ARROW ELECTRONICS INC | 6,100 | 128.44 | 783,484.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CDW CORP/DE | 10,882 | 189.40 | 2,061,050.80 | |
| CISCO SYSTEMS | 333,162 | 58.90 | 19,623,241.80 | |
| COGNEX CORP | 14,352 | 68.85 | 988,135.20 | |
| CORNING | 64,989 | 35.96 | 2,337,004.44 | |
| DELL TECHNOLOGIES -C | 22,481 | 57.96 | 1,302,998.76 | |
| F5 INC | 4,150 | 222.80 | 924,620.00 | |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRIS | 109,149 | 16.74 | 1,827,154.26 | |
| HP INC | 98,163 | 36.60 | 3,592,765.80 | |
| IPG PHOTONICS CORP | 3,207 | 153.58 | 492,531.06 | |
| JUNIPER NETWORKS INC | 25,321 | 33.57 | 850,025.97 | |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 14,989 | 180.45 | 2,704,765.05 | |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 12,961 | 244.25 | 3,165,724.25 | |
| NETAPP INC | 18,303 | 89.41 | 1,636,471.23 | |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS | 15,060 | 102.36 | 1,541,541.60 | |
| TE CONNECTIVITY LTD | 26,068 | 156.99 | 4,092,415.32 | |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 3,899 | 416.80 | 1,625,103.20 | |
| TRIMBLE IMS HOLDINGS | 21,176 | 73.94 | 1,565,753.44 | |
| WESTERN DIGITAL CORP | 25,790 | 61.94 | 1,597,432.60 | |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 4,162 | 513.11 | 2,135,563.82 | |
| AT&T INC | 564,705 | 27.28 | 15,405,152.40 | |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 15,516 | 27.44 | 425,759.04 | |
| LIBERTY GLOBAL PLC-C | 27,487 | 27.88 | 766,337.56 | |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC | 73,769 | 12.10 | 892,604.90 | |
| T-MOBILE US INC | 49,657 | 105.38 | 5,232,854.66 | |
| VERIZON COMMUNICATIONS | 327,018 | 53.50 | 17,495,463.00 | |
| AES CORP | 54,375 | 23.07 | 1,254,431.25 | |
| ALLIANT ENERGY CORPORATION | 20,778 | 59.42 | 1,234,628.76 | |
| AMEREN CORPORATION | 20,898 | 87.64 | 1,831,500.72 | |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 38,104 | 90.30 | 3,440,791.20 | |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 14,174 | 161.02 | 2,282,297.48 | |
| ATMOS ENERGY CORP | 11,419 | 105.34 | 1,202,877.46 | |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 48,162 | 27.35 | 1,317,230.70 | |
| CMS ENERGY CORP | 23,697 | 63.44 | 1,503,337.68 | |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 27,507 | 82.15 | 2,259,700.05 | |
| DOMINION ENERGY INC | 62,375 | 79.03 | 4,929,496.25 | |
| DTE ENERGY COMPANY | 16,240 | 118.67 | 1,927,200.80 | |
| DUKE ENERGY CORP | 59,845 | 102.17 | 6,114,363.65 | |
| EDISON INTL | 28,027 | 63.50 | 1,779,714.50 | |
| ENTERGY CORP | 16,926 | 110.35 | 1,867,784.10 | |
| ESSENTIAL UTILITIES INC | 20,834 | 48.28 | 1,005,865.52 | |
| EVERGY INC | 18,475 | 64.91 | 1,199,212.25 | |
| EVERSOURCE ENERGY | 26,753 | 86.87 | 2,324,033.11 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | EXELON CORP | 77,196 | 56.49 | 4,360,802.04 | |
| | FIRSTENERGY CORP | 45,787 | 41.42 | 1,896,497.54 | |
| | NEXTERA ENERGY INC | 155,150 | 82.59 | 12,813,838.50 | |
| | NISOURCE INC | 35,781 | 27.94 | 999,721.14 | |
| | NRG ENERGY INC | 19,068 | 39.87 | 760,241.16 | |
| | PG&E CORP | 118,132 | 12.64 | 1,493,188.48 | |
| | PPL CORPORATION | 63,429 | 29.82 | 1,891,452.78 | |
| | PUBLIC SERVICE ENTERPRISE | 39,468 | 65.55 | 2,587,127.40 | |
| | SEMPRA ENERGY | 25,825 | 135.87 | 3,508,842.75 | |
| | SOUTHERN CO | 84,113 | 68.33 | 5,747,441.29 | |
| | UGI CORP | 18,019 | 46.07 | 830,135.33 | |
| | VISTRA CORP | 37,797 | 22.48 | 849,676.56 | |
| | WEC ENERGY GROUP INC | 24,561 | 96.03 | 2,358,592.83 | |
| | XCEL ENERGY INC | 43,741 | 68.12 | 2,979,636.92 | |
| | ADVANCED MICRO DEVICES | 95,955 | 128.27 | 12,308,147.85 | |
| | ANALOG DEVICES | 42,907 | 163.06 | 6,996,415.42 | |
| | APPLIED MATERIALS | 71,368 | 143.07 | 10,210,619.76 | |
| | BROADCOM INC | 32,767 | 563.97 | 18,479,604.99 | |
| | ENPHASE ENERGY INC | 10,113 | 134.58 | 1,361,007.54 | |
| | ENTEGRIS INC | 10,491 | 127.42 | 1,336,763.22 | |
| | INTEL CORP | 318,822 | 53.62 | 17,095,235.64 | |
| | KLA CORP | 12,119 | 393.19 | 4,765,069.61 | |
| | LAM RESEARCH CORP | 11,353 | 642.73 | 7,296,913.69 | |
| | MARVELL TECHNOLOGY INC | 63,360 | 76.89 | 4,871,750.40 | |
| | MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 44,808 | 76.66 | 3,434,981.28 | |
| | MICRON TECHNOLOGY | 89,326 | 90.00 | 8,039,340.00 | |
| | MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 3,531 | 413.97 | 1,461,728.07 | |
| | NVIDIA CORP | 197,988 | 250.67 | 49,629,651.96 | |
| | NXP SEMICONDUCTORS NV | 20,848 | 210.95 | 4,397,885.60 | |
| | ON SEMICONDUCTOR CORP | 31,766 | 59.01 | 1,874,511.66 | |
| | QORVO INC | 8,556 | 141.69 | 1,212,299.64 | |
| | QUALCOMM | 89,260 | 172.47 | 15,394,672.20 | |
| | SKYWORKS SOLUTIONS INC | 13,372 | 145.88 | 1,950,707.36 | |
| | SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC | 3,750 | 232.09 | 870,337.50 | |
| | TERADYNE INC | 12,318 | 148.32 | 1,827,005.76 | |
| | TEXAS INSTRUMENTS | 73,023 | 178.30 | 13,020,000.90 | |
| | XILINX INC | 19,302 | 189.09 | 3,649,815.18 | |
| **アメリカドル 小計** | | 25,174,910 | | 3,156,804,300.44<br>(360,854,299,583) | |
| **カナダドル** | CAMECO CORP | 26,880 | 27.29 | 733,555.20 | |
| | CANADIAN NATURAL RESOURCES | 93,194 | 66.26 | 6,175,034.44 | |
| | CENOVUS ENERGY INC | 96,666 | 18.58 | 1,796,054.28 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ENBRIDGE | 163,399 | 52.72 | 8,614,395.28 | |
| IMPERIAL OIL | 16,573 | 51.52 | 853,840.96 | |
| KEYERA CORP | 18,607 | 28.90 | 537,742.30 | |
| PARKLAND CORP | 14,075 | 34.05 | 479,253.75 | |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 45,666 | 40.17 | 1,834,403.22 | |
| SUNCOR ENERGY | 116,208 | 35.55 | 4,131,194.40 | |
| TC ENERGY CORP | 77,328 | 63.65 | 4,921,927.20 | |
| TOURMALINE OIL CORP | 22,173 | 47.65 | 1,056,543.45 | |
| AGNICO EAGLE MINES | 20,293 | 67.90 | 1,377,894.70 | |
| BARRICK GOLD CORP | 139,009 | 25.22 | 3,505,806.98 | |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B | 13,139 | 65.66 | 862,706.74 | |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 43,000 | 35.30 | 1,517,900.00 | |
| FRANCO-NEVADA CORP | 15,363 | 172.17 | 2,645,047.71 | |
| IVANHOE MINES LTD-CL A | 51,847 | 11.91 | 617,497.77 | |
| KINROSS GOLD CORP | 108,451 | 7.41 | 803,621.91 | |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD | 23,428 | 53.45 | 1,252,226.60 | |
| LUNDIN MINING CORP | 62,243 | 10.84 | 674,714.12 | |
| NUTRIEN LTD | 44,786 | 92.31 | 4,134,195.66 | |
| PAN AMERICAN SILVER CORP | 18,411 | 31.16 | 573,686.76 | |
| TECK RESOURCES LTD-CL B | 40,561 | 43.21 | 1,752,640.81 | |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 7,800 | 120.33 | 938,574.00 | |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 34,238 | 52.83 | 1,808,793.54 | |
| BALLARD POWER SYSTEMS INC | 19,724 | 13.07 | 257,792.68 | |
| CAE INC | 25,999 | 31.91 | 829,628.09 | |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD | 7,705 | 107.28 | 826,592.40 | |
| WSP GLOBAL INC | 8,602 | 170.87 | 1,469,823.74 | |
| GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | 13,505 | 41.27 | 557,351.35 | |
| RITCHIE BROS AUCTIONEERS | 10,245 | 78.01 | 799,212.45 | |
| THOMSON REUTERS CORP | 13,293 | 134.29 | 1,785,116.97 | |
| AIR CANADA | 13,805 | 22.37 | 308,817.85 | |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 55,489 | 154.05 | 8,548,080.45 | |
| CP RAILWAY LIMITED | 73,737 | 94.91 | 6,998,378.67 | |
| TFI INTERNATIONAL INC | 5,837 | 124.60 | 727,290.20 | |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 23,282 | 105.99 | 2,467,659.18 | |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 17,079 | 50.57 | 863,685.03 | |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 23,073 | 70.20 | 1,619,724.60 | |
| QUEBECOR INC -CL B | 15,200 | 29.99 | 455,848.00 | |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 35,422 | 37.61 | 1,332,221.42 | |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A | 3,579 | 183.69 | 657,426.51 | |
| DOLLARAMA INC | 22,000 | 63.08 | 1,387,760.00 | |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 66,914 | 50.48 | 3,377,818.72 | |
| EMPIRE CO LTD 'A' | 15,253 | 37.67 | 574,580.51 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | LOBLAW COMPANIES LTD | 12,913 | 95.77 | 1,236,678.01 | |
| | METRO INC | 18,840 | 66.48 | 1,252,483.20 | |
| | WESTON (GEORGE) LTD | 6,883 | 137.35 | 945,380.05 | |
| | SAPUTO INC | 14,489 | 27.34 | 396,129.26 | |
| | BAUSCH HEALTH COS INC | 20,800 | 31.99 | 665,392.00 | |
| | CANOPY GROWTH CORP | 20,989 | 9.53 | 200,025.17 | |
| | BANK MONTREAL | 51,389 | 146.61 | 7,534,141.29 | |
| | BANK NOVA SCOTIA | 96,500 | 91.10 | 8,791,150.00 | |
| | CANADIAN IMPERIAL BANK | 34,494 | 163.33 | 5,633,905.02 | |
| | NATIONAL BANK OF CANADA | 27,289 | 99.60 | 2,717,984.40 | |
| | ROYAL BANK OF CANADA | 114,053 | 147.00 | 16,765,791.00 | |
| | TORONTO-DOMINION BANK | 145,443 | 101.63 | 14,781,372.09 | |
| | BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A | 110,505 | 68.78 | 7,600,533.90 | |
| | IGM FINANCIAL INC | 7,685 | 47.48 | 364,883.80 | |
| | ONEX CORP | 6,603 | 94.30 | 622,662.90 | |
| | TMX GROUP LTD | 4,685 | 126.06 | 590,591.10 | |
| | FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 2,133 | 622.96 | 1,328,773.68 | |
| | GREAT-WEST LIFECO INC | 23,788 | 38.66 | 919,644.08 | |
| | IA FINANCIAL CORP INC | 10,099 | 79.67 | 804,587.33 | |
| | INTACT FINANCIAL CORP | 13,312 | 161.30 | 2,147,225.60 | |
| | MANULIFE FINANCIAL CORP | 147,886 | 25.66 | 3,794,754.76 | |
| | POWER CORP OF CANADA | 43,577 | 42.09 | 1,834,155.93 | |
| | SUN LIFE FINANCIAL INC | 45,702 | 71.44 | 3,264,950.88 | |
| | FIRSTSERVICE CORP | 2,690 | 202.38 | 544,402.20 | |
| | BLACKBERRY LIMITED | 39,400 | 11.14 | 438,916.00 | |
| | CGI INC - CL A | 18,428 | 106.13 | 1,955,763.64 | |
| | CONSTELLATION SOFTWARE INC | 1,661 | 2,066.68 | 3,432,755.48 | |
| | LIGHTSPEED COMMERCE INC | 8,296 | 40.62 | 336,983.52 | |
| | NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG | 4,301 | 77.76 | 334,445.76 | |
| | OPEN TEXT CORP | 20,463 | 58.04 | 1,187,672.52 | |
| | SHOPIFY INC - CLASS A | 9,030 | 1,289.82 | 11,647,074.60 | |
| | BCE INC | 6,203 | 66.29 | 411,196.87 | |
| | ROGERS COMMUNICATIONS -CL B | 30,584 | 62.18 | 1,901,713.12 | |
| | TELUS CORP | 32,908 | 29.76 | 979,342.08 | |
| | ALGONQUIN POWER & UTILITIES | 51,818 | 17.71 | 917,696.78 | |
| | ALTAGAS INCOME LTD | 24,395 | 26.88 | 655,737.60 | |
| | BROOKFIELD RENEWABLE COR-A | 11,295 | 41.77 | 471,792.15 | |
| | CANADIAN UTILITIES LTD A | 10,324 | 35.53 | 366,811.72 | |
| | EMERA INC | 18,723 | 59.73 | 1,118,324.79 | |
| | FORTIS INC | 36,823 | 58.14 | 2,140,889.22 | |
| | HYDRO ONE LTD | 23,269 | 31.67 | 736,929.23 | |
| | NORTHLAND POWER INC | 17,854 | 36.15 | 645,422.10 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| カナダドル 小計 | | 3,131,603 | | 203,861,125.43<br>(18,639,022,698) | |
| ユーロ | ENI | 197,669 | 13.42 | 2,652,717.98 | |
| | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 49,194 | 9.82 | 483,380.24 | |
| | NESTE OIL OYJ | 32,126 | 43.64 | 1,401,978.64 | |
| | OMV AG | 12,549 | 56.08 | 703,747.92 | |
| | REPSOL SA | 111,112 | 11.13 | 1,236,898.78 | |
| | TENARIS SA | 40,648 | 10.72 | 435,949.80 | |
| | TOTALENERGIES SE | 199,789 | 51.26 | 10,241,184.14 | |
| | AIR LIQUIDE | 36,913 | 155.80 | 5,751,045.40 | |
| | AKZO NOBEL | 15,301 | 95.62 | 1,463,081.62 | |
| | ARCELORMITTAL | 55,231 | 31.62 | 1,746,404.22 | |
| | ARKEMA | 4,369 | 133.30 | 582,387.70 | |
| | BASF SE | 74,374 | 67.80 | 5,042,557.20 | |
| | COVESTRO AG | 14,454 | 54.00 | 780,516.00 | |
| | CRH PLC | 59,653 | 45.97 | 2,742,248.41 | |
| | EVONIK INDUSTRIES AG | 19,754 | 29.32 | 579,187.28 | |
| | FUCHS PETROLUB SE -PREF | 5,762 | 39.48 | 227,483.76 | |
| | HEIDELBERGCEMENT AG | 13,041 | 64.70 | 843,752.70 | |
| | KONINKLIJKE DSM NV | 13,707 | 179.00 | 2,453,553.00 | |
| | LANXESS | 7,293 | 56.32 | 410,741.76 | |
| | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 19,504 | 47.51 | 926,635.04 | |
| | SOLVAY SA | 5,356 | 109.50 | 586,482.00 | |
| | STORA ENSO OYJ R | 42,169 | 17.07 | 720,035.67 | |
| | SYMRISE AG | 9,776 | 114.65 | 1,120,818.40 | |
| | UMICORE | 17,605 | 34.18 | 601,738.90 | |
| | UPM KYMMENE OYJ | 42,324 | 35.17 | 1,488,535.08 | |
| | VOESTALPINE AG | 7,152 | 33.72 | 241,165.44 | |
| | ACS ACTIV. CONST. Y SVCS | 20,729 | 22.84 | 473,450.36 | |
| | ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS | 20,729 | 0.44 | 9,278.30 | |
| | AIRBUS SE | 45,872 | 115.12 | 5,280,784.64 | |
| | ALSTOM | 24,388 | 33.54 | 817,973.52 | |
| | BOUYGUES ORD | 16,606 | 32.60 | 541,355.60 | |
| | BRENNTAG SE | 12,514 | 78.18 | 978,344.52 | |
| | CNH INDUSTRIAL NV | 81,026 | 14.23 | 1,152,999.98 | |
| | DAIMLER TRUCK HOLDING AG | 33,388 | 32.80 | 1,095,293.34 | |
| | DASSAULT AVIATION SA | 2,130 | 103.20 | 219,816.00 | |
| | EIFFAGE | 5,924 | 94.72 | 561,121.28 | |
| | FERROVIAL SA | 41,914 | 26.03 | 1,091,021.42 | |
| | GEA GROUP AG | 13,382 | 43.41 | 580,912.62 | |
| | IMCD NV | 4,641 | 160.45 | 744,648.45 | |
| | KINGSPAN GROUP PLC | 12,398 | 88.38 | 1,095,735.24 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| KION GROUP AG | 5,887 | 88.26 | 519,586.62 | |
| KNORR-BREMSE AG | 6,822 | 91.32 | 622,985.04 | |
| KONE OYJ-B | 26,311 | 59.66 | 1,569,714.26 | |
| LEGRAND SA | 21,768 | 95.40 | 2,076,667.20 | |
| MTU AERO ENGINES AG | 4,753 | 198.05 | 941,331.65 | |
| PRYSMIAN SPA | 21,155 | 31.85 | 673,786.75 | |
| RATIONAL AG | 483 | 785.20 | 379,251.60 | |
| SAFRAN SA | 26,190 | 112.18 | 2,937,994.20 | |
| SAINT-GOBAIN | 40,093 | 65.37 | 2,620,879.41 | |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 42,968 | 159.52 | 6,854,255.36 | |
| SIEMENS | 61,210 | 144.34 | 8,835,051.40 | |
| SIEMENS ENERGY AG | 26,851 | 22.40 | 601,462.40 | |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY | 22,435 | 18.39 | 412,579.65 | |
| THALES SA | 9,665 | 83.40 | 806,061.00 | |
| VINCI S.A. | 41,084 | 98.19 | 4,034,037.96 | |
| WARTSILA OYJ | 41,917 | 12.73 | 533,603.41 | |
| BUREAU VERITAS SA | 25,073 | 26.41 | 662,177.93 | |
| RANDSTAD NV | 7,558 | 60.90 | 460,282.20 | |
| TELEPERFORMANCE | 4,734 | 348.90 | 1,651,692.60 | |
| WOLTERS KLUWER | 20,839 | 91.38 | 1,904,267.82 | |
| ADP | 2,382 | 128.00 | 304,896.00 | |
| AENA SME SA | 6,542 | 147.05 | 962,001.10 | |
| ATLANTIA SPA | 35,937 | 17.06 | 613,264.90 | |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 23,272 | 6.82 | 158,715.04 | |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 78,714 | 53.81 | 4,235,600.34 | |
| GETLINK | 29,362 | 14.25 | 418,555.31 | |
| INPOST SA | 12,480 | 8.21 | 102,573.12 | |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 26,107 | 97.86 | 2,554,831.02 | |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD | 4,991 | 81.50 | 406,766.50 | |
| CONTINENTAL AG | 8,168 | 94.02 | 767,955.36 | |
| DAIMLER AG | 66,777 | 74.50 | 4,974,886.50 | |
| FAURECIA | 10,948 | 43.09 | 471,749.32 | |
| FERRARI NV | 10,170 | 210.80 | 2,143,836.00 | |
| MICHELIN | 13,839 | 153.40 | 2,122,902.60 | |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE | 11,745 | 87.88 | 1,032,150.60 | |
| RENAULT SA | 17,362 | 33.94 | 589,266.28 | |
| STELLANTIS NV | 159,744 | 18.99 | 3,033,538.56 | |
| VALEO SA | 21,538 | 26.97 | 580,879.86 | |
| VOLKSWAGEN AG-PFD | 15,167 | 191.70 | 2,907,513.90 | |
| VOLKSWAGEN STAMM | 2,486 | 267.00 | 663,762.00 | |
| ADIDAS AG | 15,395 | 253.60 | 3,904,172.00 | |
| ESSILORLUXOTTICA | 22,072 | 174.56 | 3,852,888.32 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| HERMES INTERNATIONAL | 2,539 | 1,368.50 | 3,474,621.50 | |
| KERING | 5,855 | 680.80 | 3,986,084.00 | |
| LVMH | 21,933 | 697.70 | 15,302,654.10 | |
| MONCLER SPA | 14,361 | 58.38 | 838,395.18 | |
| PUMA SE | 9,220 | 94.36 | 869,999.20 | |
| SEB SA | 2,282 | 130.60 | 298,029.20 | |
| ACCOR | 14,436 | 31.58 | 455,888.88 | |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC | 13,048 | 134.00 | 1,748,432.00 | |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM | 8,108 | 36.39 | 295,050.12 | |
| SODEXO | 8,135 | 84.20 | 684,967.00 | |
| BOLLORE | 83,646 | 4.81 | 402,671.84 | |
| PUBLICIS GROUPE | 17,077 | 60.70 | 1,036,573.90 | |
| SCOUT24 SE | 7,492 | 58.14 | 435,584.88 | |
| UBISOFT ENTERTAINMENT | 7,071 | 52.00 | 367,692.00 | |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP NV | 61,243 | 21.73 | 1,330,810.39 | |
| VIVENDI SE | 61,243 | 11.58 | 709,193.94 | |
| DELIVERY HERO SE | 13,414 | 78.54 | 1,053,535.56 | |
| INDITEX | 87,326 | 28.59 | 2,496,650.34 | |
| JUST EAT TAKEAWAY | 15,572 | 47.13 | 733,908.36 | |
| PROSUS | 75,024 | 73.00 | 5,476,752.00 | |
| ZALANDO SE | 17,664 | 68.44 | 1,208,924.16 | |
| CARREFOUR | 52,544 | 17.47 | 917,943.68 | |
| COLRUYT SA | 5,424 | 36.79 | 199,548.96 | |
| HELLOFRESH SE | 13,805 | 56.42 | 778,878.10 | |
| JERONIMO MARTINS | 24,901 | 21.87 | 544,584.87 | |
| KESKO OYJ-B SHS | 20,083 | 27.35 | 549,270.05 | |
| KONINKLIJKE AHOLD NV | 79,170 | 29.91 | 2,368,370.55 | |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 60,098 | 58.50 | 3,515,733.00 | |
| DANONE (GROUPE) | 51,543 | 57.16 | 2,946,197.88 | |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV | 49,077 | 11.37 | 558,250.87 | |
| HEINEKEN HOLDING NV | 9,251 | 81.90 | 757,656.90 | |
| HEINEKEN NV | 20,157 | 99.82 | 2,012,071.74 | |
| JDE PEET'S BV | 7,000 | 26.43 | 185,010.00 | |
| KERRY GROUP PLC-A | 13,050 | 111.90 | 1,460,295.00 | |
| PERNOD-RICARD | 16,970 | 198.65 | 3,371,090.50 | |
| REMY COINTREAU | 1,382 | 191.70 | 264,929.40 | |
| BEIERSDORF AG | 7,430 | 89.10 | 662,013.00 | |
| HENKEL AG & CO KGAA | 8,780 | 74.65 | 655,427.00 | |
| HENKEL AG & CO KGAA -PFD | 14,439 | 77.52 | 1,119,311.28 | |
| LOREAL | 19,839 | 377.25 | 7,484,262.75 | |
| AMPLIFON SPA | 11,650 | 39.74 | 462,971.00 | |
| BIOMERIEUX | 3,044 | 102.35 | 311,553.40 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR | 3,430 | 141.95 | 486,888.50 | |
| DIASORIN SPA | 2,070 | 145.15 | 300,460.50 | |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA | 14,472 | 59.82 | 865,715.04 | |
| FRESENIUS SE&CO KGAA | 33,689 | 37.11 | 1,250,367.23 | |
| KONINKLIJKE PHILIPS | 71,755 | 30.00 | 2,153,008.77 | |
| ORPEA | 4,336 | 86.18 | 373,676.48 | |
| SARTORIUS AG-VORZUG | 1,824 | 455.90 | 831,561.60 | |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 21,567 | 59.44 | 1,281,942.48 | |
| ARGENX SE | 3,428 | 252.00 | 863,856.00 | |
| BAYER | 79,047 | 52.12 | 4,119,929.64 | |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 10,220 | 92.60 | 946,372.00 | |
| GRIFOLS SA | 27,685 | 16.81 | 465,523.27 | |
| IPSEN | 3,532 | 84.16 | 297,253.12 | |
| MERCK KGAA | 10,555 | 190.00 | 2,005,450.00 | |
| ORION OYJ-CLASS B | 9,854 | 36.10 | 355,729.40 | |
| QIAGEN N.V. | 17,038 | 43.56 | 742,175.28 | |
| RECORDATI SPA | 9,859 | 51.20 | 504,780.80 | |
| SANOFI | 90,684 | 91.73 | 8,318,443.32 | |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 1,939 | 374.30 | 725,767.70 | |
| UCB (GROUPE) | 9,389 | 91.52 | 859,281.28 | |
| ABN AMRO BANK NV-CVA | 39,921 | 14.55 | 581,169.91 | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA | 534,866 | 5.69 | 3,044,457.27 | |
| BANCO SANTANDER SA | 1,404,532 | 3.13 | 4,402,505.55 | |
| BNP PARIBAS | 89,478 | 65.40 | 5,851,861.20 | |
| CAIXABANK | 380,168 | 2.77 | 1,055,726.53 | |
| COMMERZBANK AG | 61,889 | 7.41 | 458,845.04 | |
| CREDIT AGRICOLE SA | 89,515 | 13.54 | 1,212,033.10 | |
| ERSTE GROUP BANK AG | 23,905 | 43.42 | 1,037,955.10 | |
| FINECOBANK SPA | 53,120 | 15.22 | 808,486.40 | |
| ING GROEP NV-CVA | 301,618 | 13.30 | 4,013,329.10 | |
| INTESA SANPAOLO | 1,346,514 | 2.53 | 3,412,066.47 | |
| KBC GROEP NV | 21,052 | 80.36 | 1,691,738.72 | |
| MEDIOBANCA | 53,990 | 10.35 | 558,796.50 | |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG | 12,490 | 25.36 | 316,746.40 | |
| SOCIETE GENERALE | 63,329 | 33.67 | 2,132,604.07 | |
| UNICREDIT SPA | 168,352 | 13.57 | 2,284,873.34 | |
| AMUNDI SA | 4,626 | 72.90 | 337,235.40 | |
| DEUTSCHE BANK NAMEN | 160,613 | 11.78 | 1,892,663.59 | |
| DEUTSCHE BOERSE | 14,999 | 158.15 | 2,372,091.85 | |
| EURAZEO SA | 3,357 | 78.25 | 262,685.25 | |
| EURONEXT NV | 6,480 | 86.20 | 558,576.00 | |
| EXOR NV | 7,825 | 78.28 | 612,541.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 8,515 | 97.74 | 832,256.10 | |
| SOFINA | 1,238 | 376.40 | 465,983.20 | |
| WENDEL | 2,023 | 101.20 | 204,727.60 | |
| AEGON | 114,647 | 4.98 | 571,744.58 | |
| AGEAS | 11,086 | 43.76 | 485,123.36 | |
| ALLIANZ SE-REG | 32,896 | 223.80 | 7,362,124.80 | |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 85,637 | 18.72 | 1,603,124.64 | |
| AXA SA | 155,519 | 28.00 | 4,355,309.59 | |
| CNP ASSURANCES | 16,287 | 21.80 | 355,056.60 | |
| HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE | 4,333 | 173.40 | 751,342.20 | |
| MUENCHENER RUECKVERSICH. | 11,376 | 272.80 | 3,103,372.80 | |
| NN GROUP NV | 22,611 | 51.04 | 1,154,065.44 | |
| POSTE ITALIANE SPA | 46,035 | 11.59 | 533,545.65 | |
| SAMPO OYJ-A SHS | 38,655 | 44.45 | 1,718,214.75 | |
| AROUNDTOWN SA | 64,068 | 5.54 | 354,936.72 | |
| LEG IMMOBILIEN SE | 5,275 | 115.80 | 610,845.00 | |
| VONOVIA SE | 59,080 | 47.93 | 2,831,704.40 | |
| ADYEN NV | 1,566 | 1,842.80 | 2,885,824.80 | |
| AMADEUS IT GROUP SA-A SHS | 35,584 | 62.46 | 2,222,576.64 | |
| BECHTLE AG | 7,659 | 53.66 | 410,981.94 | |
| CAPGEMINI SA | 12,715 | 205.40 | 2,611,661.00 | |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 52,767 | 45.80 | 2,416,728.60 | |
| EDENRED | 18,664 | 41.07 | 766,530.48 | |
| NEMETSCHEK SE | 5,455 | 83.80 | 457,129.00 | |
| NEXI SPA | 31,458 | 13.64 | 429,244.41 | |
| SAP SE | 83,616 | 121.42 | 10,152,654.72 | |
| WORLDLINE SA | 20,332 | 45.80 | 931,205.60 | |
| NOKIA OYJ | 427,600 | 5.11 | 2,185,891.20 | |
| CELLNEX TELECOM SA | 41,435 | 42.68 | 1,768,445.80 | |
| DEUTSCHE TELEKOM | 269,906 | 16.19 | 4,371,937.38 | |
| ELISA A | 10,227 | 53.60 | 548,167.20 | |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | 30,375 | 9.60 | 291,721.50 | |
| KPN (KON.) | 282,927 | 2.90 | 821,902.93 | |
| ORANGE | 153,815 | 9.95 | 1,531,074.51 | |
| PROXIMUS | 13,141 | 17.48 | 229,770.38 | |
| TELECOM ITALIA ORD | 852,552 | 0.41 | 349,887.34 | |
| TELEFONICA | 417,939 | 4.02 | 1,683,249.32 | |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 98,715 | 2.58 | 255,573.13 | |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 9,513 | 34.48 | 328,008.24 | |
| E.ON SE | 170,377 | 12.09 | 2,060,539.43 | |
| EDP RENOVAVEIS SA | 21,466 | 19.21 | 412,361.86 | |
| ELECTRICITE DE FRANCE | 39,521 | 8.29 | 327,629.09 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | ELIA GROUP SA/NV | 2,925 | 113.30 | 331,402.50 | |
| | ENAGAS | 15,690 | 19.89 | 312,074.10 | |
| | ENDESA | 25,972 | 19.58 | 508,531.76 | |
| | ENEL | 651,071 | 6.81 | 4,434,444.58 | |
| | ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 225,753 | 4.51 | 1,019,274.79 | |
| | ENGIE | 141,564 | 13.50 | 1,911,680.25 | |
| | FORTUM OYJ | 32,550 | 25.43 | 827,746.50 | |
| | IBERDROLA SA | 459,476 | 9.99 | 4,592,922.09 | |
| | IBERDROLA SA-RTS | 459,476 | 0.16 | 76,273.01 | |
| | NATURGY ENERGY GROUP SA | 10,010 | 29.06 | 290,890.60 | |
| | RED ELECTRICA CORPORACION SA | 39,632 | 17.80 | 705,449.60 | |
| | RWE STAMM | 49,680 | 35.77 | 1,777,053.60 | |
| | SNAM SPA | 147,559 | 5.08 | 749,894.83 | |
| | SUEZ | 32,549 | 19.83 | 645,446.67 | |
| | TERNA SPA | 102,810 | 6.81 | 700,547.34 | |
| | UNIPER SE | 7,335 | 40.51 | 297,140.85 | |
| | VEOLIA ENVIRONNEMENT | 51,027 | 32.28 | 1,647,151.56 | |
| | VERBUND AG | 6,430 | 91.10 | 585,773.00 | |
| | ASM INTERNATIONAL NV | 3,483 | 348.10 | 1,212,432.30 | |
| | ASML HOLDING NV | 32,819 | 626.20 | 20,551,257.80 | |
| | INFINEON TECHNOLOGIES | 105,296 | 38.03 | 4,004,406.88 | |
| | STMICROELECTRONICS | 55,076 | 41.35 | 2,277,392.60 | |
| ユーロ 小計 | | 15,247,587 | | 394,189,655.26<br>(51,150,049,666) | |
| イギリスポンド | BP PLC | 1,615,015 | 3.94 | 6,364,774.11 | |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 327,167 | 18.69 | 6,116,059.89 | |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 295,308 | 18.71 | 5,526,393.91 | |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 102,156 | 35.17 | 3,593,337.30 | |
| | ANTOFAGASTA PLC | 35,856 | 14.82 | 531,565.20 | |
| | BHP GROUP PLC | 167,196 | 24.73 | 4,135,593.06 | |
| | CRODA INTERNATIONAL PLC | 10,924 | 83.20 | 908,876.80 | |
| | EVRAZ PLC | 43,000 | 5.67 | 243,896.00 | |
| | GLENCORE PLC | 767,331 | 4.19 | 3,215,884.22 | |
| | JOHNSON MATTHEY PLC | 16,848 | 20.06 | 337,970.88 | |
| | MONDI PLC | 36,710 | 18.78 | 689,597.35 | |
| | RIO TINTO PLC REG | 87,100 | 56.54 | 4,924,634.00 | |
| | ASHTEAD GROUP PLC | 34,104 | 52.16 | 1,778,864.64 | |
| | BAE SYSTEMS PLC | 260,104 | 5.98 | 1,556,462.33 | |
| | BUNZL PLC | 24,880 | 27.23 | 677,482.40 | |
| | DCC PLC | 9,127 | 63.06 | 575,548.62 | |
| | FERGUSON PLC | 17,761 | 119.05 | 2,114,447.05 | |
| | MELROSE INDUSTRIES PLC | 319,777 | 1.62 | 520,596.95 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 635,909 | 1.23 | 783,058.34 | |
| SMITHS GROUP PLC | 37,146 | 16.01 | 594,707.46 | |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 5,514 | 132.30 | 729,502.20 | |
| EXPERIAN PLC | 74,115 | 30.61 | 2,268,660.15 | |
| INTERTEK GROUP PLC | 13,890 | 53.64 | 745,059.60 | |
| RELX PLC | 149,517 | 22.60 | 3,379,084.20 | |
| RENTOKIL INITIAL PLC | 140,480 | 5.16 | 724,876.80 | |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 73,202 | 6.74 | 493,967.09 | |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE | 7,688 | 44.53 | 342,346.64 | |
| BURBERRY GROUP PLC | 29,776 | 18.66 | 555,769.04 | |
| PERSIMMON PLC | 25,686 | 25.62 | 658,075.32 | |
| TAYLOR WIMPEY PLC | 264,104 | 1.60 | 424,151.02 | |
| COMPASS GROUP PLC | 142,427 | 17.09 | 2,434,789.56 | |
| ENTAIN PLC | 49,630 | 17.09 | 848,424.85 | |
| INTERCONTINENTAL HOTELS | 16,041 | 48.59 | 779,432.19 | |
| WHITBREAD PLC | 17,434 | 30.72 | 535,572.48 | |
| AUTO TRADER GROUP PLC | 72,462 | 6.88 | 498,973.33 | |
| INFORMA PLC | 110,598 | 5.69 | 629,302.62 | |
| PEARSON | 66,305 | 6.60 | 437,613.00 | |
| WPP PLC | 95,821 | 12.06 | 1,155,601.26 | |
| JD SPORTS FASHION PLC | 206,825 | 1.91 | 396,690.35 | |
| KINGFISHER PLC | 153,717 | 3.37 | 518,487.44 | |
| NEXT PLC | 11,468 | 75.40 | 864,687.20 | |
| OCADO GROUP PLC | 35,862 | 14.55 | 521,971.41 | |
| SAINSBURY (J) PLC | 148,335 | 2.91 | 432,099.85 | |
| TESCO PLC | 601,050 | 2.87 | 1,730,122.42 | |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 25,740 | 21.31 | 548,519.40 | |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO | 173,638 | 31.35 | 5,444,419.49 | |
| COCA-COLA HBC AG-CDI | 17,960 | 26.36 | 473,425.60 | |
| DIAGEO | 186,926 | 37.09 | 6,934,019.97 | |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 68,756 | 17.44 | 1,199,448.42 | |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 57,728 | 63.66 | 3,674,964.48 | |
| UNILEVER PLC | 204,424 | 36.75 | 7,513,604.12 | |
| SMITH & NEPHEW PLC | 68,595 | 12.63 | 866,354.85 | |
| ASTRAZENECA | 122,229 | 87.33 | 10,674,258.57 | |
| GLAXOSMITHKLINE | 401,546 | 16.66 | 6,691,362.54 | |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 16,454 | 20.20 | 332,370.80 | |
| BARCLAYS | 1,339,545 | 2.06 | 2,772,188.37 | |
| HSBC HOLDINGS PLC (GB) | 1,632,150 | 5.12 | 8,364,768.75 | |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 5,443,807 | 0.53 | 2,933,123.21 | |
| NATWEST GROUP PLC | 443,701 | 2.49 | 1,107,477.69 | |
| STANDARD CHARTERED PLC | 212,446 | 5.14 | 1,092,397.33 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 3I GROUP PLC | 74,757 | 14.10 | 1,054,073.70 | |
| | ABRDN PLC | 153,430 | 2.38 | 365,623.69 | |
| | HARGREAVES LANSDOWN PLC | 33,079 | 13.47 | 445,574.13 | |
| | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP | 24,732 | 74.40 | 1,840,060.80 | |
| | M&G PLC | 229,107 | 2.15 | 494,412.90 | |
| | SCHRODERS PLC | 11,794 | 34.19 | 403,236.86 | |
| | ST JAMES'S PLACE PLC | 40,934 | 16.25 | 665,382.17 | |
| | ADMIRAL GROUP PLC | 16,255 | 32.66 | 530,888.30 | |
| | AVIVA PIC | 296,550 | 4.41 | 1,307,785.50 | |
| | LEGAL & GENERAL GROUP | 460,759 | 2.99 | 1,380,894.72 | |
| | PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | 51,001 | 6.98 | 356,292.98 | |
| | PRUDENTIAL | 210,968 | 12.86 | 2,714,103.32 | |
| | AVEVA GROUP PLC | 10,917 | 29.74 | 324,671.58 | |
| | SAGE GROUP PLC | 76,660 | 8.00 | 613,739.96 | |
| | HALMA PLC | 31,069 | 25.67 | 797,541.23 | |
| | BT GROUP PLC | 648,635 | 1.89 | 1,231,757.86 | |
| | VODAFONE GROUP PLC | 2,204,746 | 1.20 | 2,664,656.01 | |
| | NATIONAL GRID PLC | 286,046 | 10.89 | 3,115,040.94 | |
| | SEVERN TRENT PLC | 22,468 | 29.15 | 654,942.20 | |
| | SSE PLC | 81,663 | 15.67 | 1,280,067.52 | |
| | UNITED UTILITIES GROUP PLC | 58,580 | 10.70 | 626,806.00 | |
| イギリスポンド 小計 | | 22,795,161 | | 150,785,266.49<br>(23,483,297,403) | |
| スイスフラン | CLARIANT AG-REG | 17,398 | 20.04 | 348,655.92 | |
| | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 574 | 976.00 | 560,224.00 | |
| | GIVAUDAN-REG | 748 | 4,201.00 | 3,142,348.00 | |
| | HOLCIM LTD | 40,627 | 50.80 | 2,063,851.60 | |
| | SIKA AG-BR | 10,926 | 331.90 | 3,626,339.40 | |
| | ABB LTD | 127,656 | 34.00 | 4,340,304.00 | |
| | GEBERIT AG-REG | 2,964 | 647.80 | 1,920,079.20 | |
| | SCHINDLER HOLDING AG-REG | 1,375 | 230.80 | 317,350.00 | |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 3,092 | 233.80 | 722,909.60 | |
| | VAT GROUP AG | 1,956 | 383.20 | 749,539.20 | |
| | ADECCO GROUP AG-REG | 10,450 | 50.38 | 526,471.00 | |
| | SGS SA | 506 | 2,837.00 | 1,435,522.00 | |
| | KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG | 4,577 | 264.00 | 1,208,328.00 | |
| | CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD) | 41,341 | 141.00 | 5,829,081.00 | |
| | SWATCH GROUP AG(BEARER) | 2,483 | 297.00 | 737,451.00 | |
| | SWATCH GROUP AG/THE-REG | 3,938 | 56.60 | 222,890.80 | |
| | BARRY CALLEBAUT AG-REG | 280 | 2,228.00 | 623,840.00 | |
| | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG | 8 | 106,200.00 | 849,600.00 | |
| | LINDT & SPRUENGLI AG-PC | 82 | 10,540.00 | 864,280.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | NESTLE SA - REGISTERED | 222,591 | 120.16 | 26,746,534.56 | |
| | ALCON INC | 39,333 | 72.20 | 2,839,842.60 | |
| | SONOVA HOLDING AG-REG | 4,007 | 326.70 | 1,309,086.90 | |
| | STRAUMANN HOLDING AG-REG | 854 | 1,592.00 | 1,359,568.00 | |
| | BACHEM HOLDING AG-REG B | 370 | 550.00 | 203,500.00 | |
| | LONZA GROUP AG-REG | 5,895 | 654.20 | 3,856,509.00 | |
| | NOVARTIS | 172,649 | 81.46 | 14,063,987.54 | |
| | ROCHE HOLDING AG-BR | 2,799 | 393.40 | 1,101,126.60 | |
| | ROCHE HOLDING GENUSS | 55,594 | 365.70 | 20,330,725.80 | |
| | VIFOR PHARMA AG | 4,486 | 162.00 | 726,732.00 | |
| | CREDIT SUISSE GROUP AG | 213,343 | 9.06 | 1,933,740.95 | |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 18,897 | 63.30 | 1,196,180.10 | |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 1,833 | 1,328.50 | 2,435,140.50 | |
| | UBS GROUP AG | 284,265 | 17.66 | 5,020,119.90 | |
| | BALOISE HOLDING AG - REG | 4,362 | 158.60 | 691,813.20 | |
| | SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 2,419 | 594.40 | 1,437,853.60 | |
| | SWISS RE LTD | 24,674 | 97.48 | 2,405,221.52 | |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 11,660 | 439.60 | 5,125,736.00 | |
| | SWISS PRIME SITE-REG | 5,679 | 87.40 | 496,344.60 | |
| | TEMENOS AG - REG | 5,150 | 113.70 | 585,555.00 | |
| | LOGITECH INTERNATIONAL-REG | 14,686 | 72.86 | 1,070,021.96 | |
| | SWISSCOM | 2,187 | 518.40 | 1,133,740.80 | |
| スイスフラン 小計 | | 1,368,714 | | 126,158,145.85<br>(15,753,367,672) | |
| スウェーデンクローナ | LUNDIN ENERGY AB | 17,222 | 367.90 | 6,335,973.80 | |
| | BOLIDEN AB | 23,903 | 397.80 | 9,508,613.40 | |
| | SCA SV CELLULOSA B | 43,887 | 160.00 | 7,021,920.00 | |
| | ALFA LAVAL AB | 27,268 | 324.10 | 8,837,558.80 | |
| | ASSA ABLOY AB-B | 78,158 | 258.20 | 20,180,395.60 | |
| | ATLAS COPCO A | 51,320 | 576.00 | 29,560,320.00 | |
| | ATLAS COPCO B | 31,902 | 494.00 | 15,759,588.00 | |
| | EPIROC AB-A | 46,999 | 218.30 | 10,259,881.70 | |
| | EPIROC AB-B | 37,972 | 183.40 | 6,964,064.80 | |
| | HUSQVARNA AB-B SHS | 38,712 | 129.75 | 5,022,882.00 | |
| | INVESTMENT AB LATOUR-B SHS | 14,002 | 295.00 | 4,130,590.00 | |
| | LIFCO AB-B SHS | 17,970 | 216.00 | 3,881,520.00 | |
| | NIBE INDUSTRIER AB-B SHS | 107,624 | 95.38 | 10,265,177.12 | |
| | SANDVIK AB | 87,644 | 246.60 | 21,613,010.40 | |
| | SKANSKA B | 25,507 | 233.50 | 5,955,884.50 | |
| | SKF AB-B | 24,865 | 222.20 | 5,525,003.00 | |
| | VOLVO AB-A SHS | 13,514 | 220.60 | 2,981,188.40 | |
| | VOLVO B | 111,799 | 218.20 | 24,394,541.80 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | SECURITAS B | 29,533 | 116.90 | 3,452,407.70 | |
| | ELECTROLUX AB-SER B | 21,269 | 206.20 | 4,385,667.80 | |
| | EVOLUTION AB | 14,096 | 1,211.60 | 17,078,713.60 | |
| | EMBRACER GROUP AB | 37,510 | 88.50 | 3,319,635.00 | |
| | HENNES & MAURITZ B | 55,229 | 174.76 | 9,651,820.04 | |
| | SWEDISH MATCH AB | 127,270 | 72.78 | 9,262,710.60 | |
| | ESSITY AKTIEBOLAG-B | 49,474 | 273.60 | 13,536,086.40 | |
| | GETINGE AB-B SHS | 17,796 | 331.70 | 5,902,933.20 | |
| | NORDEA BANK ABP | 253,851 | 109.40 | 27,771,299.40 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A | 120,740 | 123.65 | 14,929,501.00 | |
| | SVENSKA HANDELSBK A | 110,736 | 103.15 | 11,422,418.40 | |
| | SWEDBANK AB-A | 72,526 | 184.00 | 13,344,784.00 | |
| | EQT AB | 23,207 | 408.00 | 9,468,456.00 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-A SHS | 11,818 | 287.80 | 3,401,220.40 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 11,168 | 281.70 | 3,146,025.60 | |
| | INVESTOR AB-A SHS | 38,925 | 213.70 | 8,318,272.50 | |
| | INVESTOR AB-B SHS | 142,777 | 205.30 | 29,312,118.10 | |
| | KINNEVIK AB - B | 18,792 | 280.80 | 5,276,793.60 | |
| | LUNDBERGS AB-B SHS | 7,280 | 477.80 | 3,478,384.00 | |
| | FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS | 9,450 | 559.00 | 5,282,550.00 | |
| | SAGAX AB-B | 12,402 | 257.40 | 3,192,274.80 | |
| | SINCH AB | 44,150 | 94.18 | 4,158,047.00 | |
| | ERICSSON (LM) B | 225,508 | 103.58 | 23,358,118.64 | |
| | HEXAGON AB-B SHS | 153,838 | 125.90 | 19,368,204.20 | |
| | TELE2 AB-B SHS | 32,829 | 130.90 | 4,297,316.10 | |
| | TELIA CO AB | 230,643 | 36.88 | 8,506,113.84 | |
| スウェーデンクローナ 小計 | | 2,673,085 | | 462,819,985.24<br>(5,813,019,014) | |
| ノルウェークローネ | AKER BP ASA | 6,114 | 307.00 | 1,876,998.00 | |
| | EQUINOR ASA | 76,370 | 249.70 | 19,069,589.00 | |
| | NORSK HYDRO | 96,800 | 72.62 | 7,029,616.00 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 12,498 | 471.70 | 5,895,306.60 | |
| | ADEVINTA ASA | 19,117 | 104.45 | 1,996,770.65 | |
| | SCHIBSTED ASA-B SHS | 9,274 | 272.00 | 2,522,528.00 | |
| | SCHIBSTED ASA-CL A | 7,082 | 302.00 | 2,138,764.00 | |
| | MOWI ASA | 31,968 | 207.30 | 6,626,966.40 | |
| | ORKLA | 69,804 | 86.18 | 6,015,708.72 | |
| | DNB BANK ASA | 71,795 | 214.00 | 15,364,130.00 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 18,574 | 221.80 | 4,119,713.20 | |
| | TELENOR ASA | 51,193 | 143.60 | 7,351,314.80 | |
| ノルウェークローネ 小計 | | 470,589 | | 80,007,405.37<br>(1,042,496,491) | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| デンマーククローネ | CHR HANSEN HOLDING A/S | 8,483 | 551.80 | 4,680,919.40 | |
| | NOVOZYMES A/S | 17,111 | 469.10 | 8,026,770.10 | |
| | ROCKWOOL INTL A/S-B SHS | 755 | 2,514.00 | 1,898,070.00 | |
| | VESTAS WIND SYSYEMS A/S | 81,654 | 182.60 | 14,910,020.40 | |
| | A P MOLLER - MAERSK A/S - A | 219 | 20,860.00 | 4,568,340.00 | |
| | A P MOLLER-MAERSK A/S-B | 434 | 22,320.00 | 9,686,880.00 | |
| | DSV A/S | 16,380 | 1,369.50 | 22,432,410.00 | |
| | PANDORA A/S | 8,163 | 786.80 | 6,422,648.40 | |
| | CARLSBERG AS-B | 8,646 | 1,109.00 | 9,588,414.00 | |
| | AMBU A/S-B | 13,555 | 140.30 | 1,901,766.50 | |
| | COLOPLAST-B | 9,208 | 991.00 | 9,125,128.00 | |
| | DEMANT A/S | 8,512 | 301.70 | 2,568,070.40 | |
| | GN STORE NORD A/S | 9,226 | 389.00 | 3,588,914.00 | |
| | GENMAB A/S | 5,250 | 2,293.00 | 12,038,250.00 | |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 132,369 | 641.90 | 84,967,661.10 | |
| | DANSKE BANK A/S | 56,132 | 128.80 | 7,229,801.60 | |
| | TRYG A/S | 29,772 | 165.75 | 4,934,709.00 | |
| | ORSTED A/S | 15,439 | 734.00 | 11,332,226.00 | |
| デンマーククローネ 小計 | | 421,308 | | 219,900,998.90<br>(3,832,874,410) | |
| オーストラリアドル | AMPOL LTD | 20,629 | 31.14 | 642,387.06 | |
| | SANTOS | 273,225 | 7.20 | 1,967,220.00 | |
| | WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 12,813 | 28.52 | 365,426.76 | |
| | WOODSIDE PETROLEUM LTD | 74,404 | 25.42 | 1,891,349.68 | |
| | BHP GROUP LTD | 234,548 | 46.56 | 10,920,554.88 | |
| | BLUESCOPE STEEL LTD | 34,770 | 19.88 | 691,227.60 | |
| | EVOLUTION MINING LTD | 122,154 | 3.81 | 465,406.74 | |
| | FORTESCUE METALS GROUP LTD | 138,483 | 20.44 | 2,830,592.52 | |
| | JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 36,948 | 49.85 | 1,841,857.80 | |
| | NEWCREST MINING LIMITED | 61,178 | 23.97 | 1,466,436.66 | |
| | NORTHERN STAR RESOURCES LTD | 101,628 | 8.75 | 889,245.00 | |
| | ORICA LTD | 38,288 | 13.92 | 532,968.96 | |
| | RIO TINTO LTD | 28,818 | 109.91 | 3,167,386.38 | |
| | SOUTH32 LTD | 341,133 | 4.10 | 1,398,645.30 | |
| | REECE LTD | 16,814 | 23.24 | 390,757.36 | |
| | BRAMBLES LTD | 108,007 | 10.41 | 1,124,352.87 | |
| | AURIZON HOLDINGS LTD | 119,591 | 3.65 | 436,507.15 | |
| | QANTAS AIRWAYS LIMITED | 85,000 | 5.09 | 432,650.00 | |
| | TRANSURBAN GROUP | 233,493 | 13.02 | 3,040,078.86 | |
| | ARISTOCRAT LEISURE LTD | 46,210 | 43.35 | 2,003,203.50 | |
| | CROWN RESORTS LTD | 30,328 | 12.55 | 380,616.40 | |
| | DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | 3,541 | 105.64 | 374,071.24 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | IDP EDUCATION LTD | 17,793 | 31.62 | 562,614.66 | |
| | TABCORP HOLDINGS LTD | 182,013 | 5.16 | 939,187.08 | |
| | REA GROUP LTD | 3,586 | 153.84 | 551,670.24 | |
| | SEEK LTD | 28,001 | 30.29 | 848,150.29 | |
| | WESFARMERS LTD | 87,120 | 54.61 | 4,757,623.20 | |
| | COLES GROUP LTD | 108,486 | 16.46 | 1,785,679.56 | |
| | ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI | 109,901 | 6.41 | 704,465.41 | |
| | WOOLWORTHS GROUP LTD | 99,901 | 35.40 | 3,536,495.40 | |
| | TREASURY WINE ESTATES LTD | 70,538 | 11.58 | 816,830.04 | |
| | COCHLEAR LIMITED | 4,783 | 195.58 | 935,459.14 | |
| | RAMSAY HEALTH CARE LTD | 16,248 | 65.73 | 1,067,981.04 | |
| | SONIC HEALTHCARE LTD | 37,251 | 39.89 | 1,485,942.39 | |
| | CSL LIMITED | 35,618 | 270.40 | 9,631,107.20 | |
| | AUST AND NZ BANKING GROUP | 225,511 | 28.56 | 6,440,594.16 | |
| | COMMONWEALTH BANK OF AUST | 141,979 | 99.33 | 14,102,774.07 | |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK | 262,008 | 29.07 | 7,616,572.56 | |
| | WESTPAC BANKING | 283,793 | 21.24 | 6,027,763.32 | |
| | ASX LTD | 14,549 | 89.77 | 1,306,063.73 | |
| | MACQUARIE GROUP LIMITED | 27,074 | 199.19 | 5,392,870.06 | |
| | MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD | 10,912 | 19.80 | 216,057.60 | |
| | INSURANCE AUSTRALIA GRP. | 229,407 | 4.45 | 1,020,861.15 | |
| | MEDIBANK PRIVATE LTD | 232,183 | 3.39 | 787,100.37 | |
| | QBE INSURANCE GROUP | 111,591 | 12.08 | 1,348,019.28 | |
| | SUNCORP GROUP LIMITED | 94,864 | 11.69 | 1,108,960.16 | |
| | AFTERPAY LTD | 16,621 | 66.47 | 1,104,797.87 | |
| | COMPUTERSHARE LIMITED | 44,376 | 20.94 | 929,233.44 | |
| | WISETECH GLOBAL LTD | 13,801 | 52.00 | 717,652.00 | |
| | XERO LTD | 11,340 | 117.72 | 1,334,944.80 | |
| | TELSTRA CORP | 308,467 | 4.19 | 1,292,476.73 | |
| | AUSNET SERVICES | 187,145 | 2.52 | 471,605.40 | |
| | ORIGIN ENERGY LIMITED | 165,595 | 5.78 | 957,139.10 | |
| オーストラリアドル 小計 | | 5,344,458 | | 117,051,634.17<br>(9,677,829,113) | |
| ニュージーランドドル | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 117,871 | 7.50 | 884,032.50 | |
| | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 39,980 | 30.40 | 1,215,392.00 | |
| | RYMAN HEALTHCARE LTD | 36,317 | 11.50 | 417,645.50 | |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 173,118 | 4.52 | 783,358.95 | |
| | MERCURY NZ LTD | 64,613 | 6.07 | 392,200.91 | |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 110,544 | 4.61 | 509,607.84 | |
| ニュージーランドドル 小計 | | 542,443 | | 4,202,237.70<br>(325,631,399) | |
| 香港ドル | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 229,496 | 55.35 | 12,702,603.60 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 107,000 | 133.20 | 14,252,400.00 | |
| | XINYI GLASS HOLDING CO LTD | 172,000 | 20.35 | 3,500,200.00 | |
| | MTR CORP | 125,000 | 42.75 | 5,343,750.00 | |
| | SITC INTERNATIONAL HOLDINGS | 120,000 | 31.00 | 3,720,000.00 | |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 174,000 | 44.50 | 7,743,000.00 | |
| | SANDS CHINA LTD | 198,000 | 20.50 | 4,059,000.00 | |
| | CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU | 172,200 | 13.30 | 2,290,260.00 | |
| | BUDWEISER BREWING CO APAC LT | 145,900 | 19.54 | 2,850,886.00 | |
| | WH GROUP LTD | 809,301 | 4.96 | 4,014,132.96 | |
| | BOC HONG KONG HOLDINGS -R | 281,500 | 29.40 | 8,276,100.00 | |
| | HANG SENG BANK | 59,400 | 154.80 | 9,195,120.00 | |
| | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 95,800 | 456.40 | 43,723,120.00 | |
| | AIA GROUP LTD | 968,400 | 83.85 | 81,200,340.00 | |
| | CK ASSET HOLDINGS LTD | 164,496 | 53.05 | 8,726,512.80 | |
| | ESR CAYMAN LTD | 157,000 | 25.90 | 4,066,300.00 | |
| | HANG LUNG PROPERTIES LTD | 173,000 | 16.30 | 2,819,900.00 | |
| | HENDERSON LAND DEVELOPMEN | 125,228 | 33.70 | 4,220,183.60 | |
| | NEW WORLD DEVELOPMENT | 136,375 | 30.55 | 4,166,256.25 | |
| | SINO LAND CO | 315,400 | 9.80 | 3,090,920.00 | |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 108,000 | 94.70 | 10,227,600.00 | |
| | SWIRE PACIFIC A | 40,500 | 46.20 | 1,871,100.00 | |
| | SWIRE PROPERTIES LTD | 96,200 | 20.50 | 1,972,100.00 | |
| | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 119,000 | 39.25 | 4,670,750.00 | |
| | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 67,500 | 49.00 | 3,307,500.00 | |
| | CLP HOLDINGS | 137,500 | 77.60 | 10,670,000.00 | |
| | HONG KONG & CHINA GAS | 904,657 | 12.06 | 10,910,163.42 | |
| | POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED | 112,000 | 48.70 | 5,454,400.00 | |
| 香港ドル 小計 | | 6,314,853 | | 279,044,598.63<br>(4,093,584,261) | |
| シンガポールドル | KEPPEL CORP LTD | 137,300 | 5.32 | 730,436.00 | |
| | SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING | 147,400 | 3.71 | 546,854.00 | |
| | SINGAPORE AIRLINES | 108,332 | 5.07 | 549,243.24 | |
| | GENTING SINGAPORE LTD | 615,000 | 0.78 | 479,700.00 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 178,600 | 4.29 | 766,194.00 | |
| | DBS GROUP | 141,500 | 35.93 | 5,084,095.00 | |
| | OCBC BANK | 257,100 | 12.23 | 3,144,333.00 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK | 93,900 | 29.89 | 2,806,671.00 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 78,300 | 9.57 | 749,331.00 | |
| | CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI | 223,500 | 3.68 | 822,480.00 | |
| | CITY DEVELOPMENTS LTD | 42,800 | 7.10 | 303,880.00 | |
| | UOL GROUP LIMITED | 47,500 | 7.20 | 342,000.00 | |
| | VENTURE CORP LTD | 25,700 | 18.21 | 467,997.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 584,543 | 2.47 | 1,443,821.21 | |
| シンガポールドル 小計 | | 2,681,475 | | 18,237,035.45<br>(1,547,959,568) | |
| イスラエルシェケル | ICL LTD | 67,756 | 32.80 | 2,222,396.80 | |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 2,146 | 559.30 | 1,200,257.80 | |
| | BANK HAPOALIM BM | 98,310 | 34.75 | 3,416,272.50 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 108,864 | 34.69 | 3,776,492.16 | |
| | ISRAEL DISCOUNT BANK-A | 99,500 | 21.92 | 2,181,040.00 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 12,503 | 125.30 | 1,566,625.90 | |
| | AZRIELI GROUP | 4,323 | 302.10 | 1,305,978.30 | |
| | NICE LTD | 4,991 | 808.00 | 4,032,728.00 | |
| イスラエルシェケル 小計 | | 398,393 | | 19,701,791.46<br>(719,174,493) | |
| 合　計 | | 86,564,579 | | 496,932,605,771<br>(496,932,605,771) | |

(2)株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 投資信託受益証券 | オーストラリアドル | APA GROUP | 82,693 | 825,276.14 | |
| | | LENDLEASE GROUP | 64,786 | 680,900.86 | |
| | | SYDNEY AIRPORT | 110,617 | 956,837.05 | |
| | オーストラリアドル 小計 | | 258,096 | 2,463,014.05<br>(203,642,001) | |
| | 香港ドル | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS | 220,500 | 1,708,875.00 | |
| | | HKT TRUST AND HKT LTD | 375,000 | 3,967,500.00 | |
| | 香港ドル 小計 | | 595,500 | 5,676,375.00<br>(83,272,421) | |
| 投資信託受益証券合計 | | | 853,596 | 286,914,422<br>(286,914,422) | |
| 投資証券 | アメリカドル | AGNC INVESTMENT CORP | 46,260 | 696,675.60 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 10,971 | 2,263,756.14 | |
| | | AMERICAN TOWER CORPORATION | 36,371 | 9,056,379.00 | |
| | | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC | 95,067 | 740,571.93 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 11,332 | 2,787,332.04 | |
| | | BOSTON PROPERTIES | 11,259 | 1,351,530.36 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 7,749 | 1,259,212.50 | |
| | | CROWN CASTLE INTL CORP | 34,399 | 6,301,552.81 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 22,174 | 3,435,417.82 | |
| | | DUKE REALTY CORP | 31,540 | 1,834,366.40 | |
| | | EQUINIX INC | 7,120 | 5,201,088.80 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 14,090 | 1,102,119.80 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL PPTY | 29,400 | 2,623,068.00 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST | 4,770 | 1,619,224.20 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 10,868 | 2,156,319.88 | |
| | | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 45,265 | 1,615,960.50 | |
| | | HOST HOTELS AND RESORTS INC | 56,773 | 985,011.55 | |
| | | INVITATION HOMES INC | 46,840 | 2,007,094.00 | |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 23,326 | 1,008,616.24 | |
| | | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 50,036 | 1,167,339.88 | |
| | | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 9,603 | 2,008,563.48 | |
| | | PROLOGIS INC | 59,030 | 9,066,417.70 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 12,441 | 4,441,934.64 | |
| | | REALTY INCOME CORP | 41,563 | 2,849,974.91 | |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 12,511 | 912,302.12 | |
| | | SBA COMMUNICATIONS CORP | 8,583 | 2,757,117.09 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP | 25,518 | 3,791,719.62 | |
| | | SUN COMMUNITIES INC | 9,065 | 1,758,428.70 | |
| | | UDR INC | 24,265 | 1,394,266.90 | |
| | | VENTAS INC | 31,565 | 1,602,555.05 | |
| | | VICI PROPERTIES INC | 43,921 | 1,221,003.80 | |
| | | VORNADO REALTY TRUST | 11,390 | 502,412.90 | |
| | | WELLTOWER INC | 32,739 | 2,800,166.67 | |
| | | WP CAREY INC | 14,258 | 1,105,850.48 | |
| | アメリカドル 小計 | | 932,062 | 85,425,351.51<br>(9,764,971,931) | |
| | カナダドル | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 4,887 | 275,675.67 | |
| | | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 15,490 | 351,313.20 | |
| | カナダドル 小計 | | 20,377 | 626,988.87<br>(57,325,592) | |
| | ユーロ | COVIVIO(FP) | 4,962 | 381,379.32 | |
| | | GECINA SA | 3,139 | 382,487.15 | |
| | | KLEPIERRE | 17,225 | 407,371.25 | |
| | | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 10,455 | 696,616.65 | |
| | ユーロ 小計 | | 35,781 | 1,867,854.37<br>(242,372,783) | |
| | イギリスポンド | BRITISH LAND CO PLC | 79,414 | 439,000.59 | |
| | | LAND SECURITIES GROUP PLC | 66,349 | 534,507.54 | |
| | | SEGRO PLC | 93,383 | 1,232,655.60 | |
| | イギリスポンド 小計 | | 239,146 | 2,206,163.73<br>(343,587,939) | |
| | オーストラリアドル | DEXUS | 94,090 | 1,032,167.30 | |
| | | GOODMAN GROUP | 124,848 | 2,861,516.16 | |
| | | GPT GROUP | 167,884 | 903,215.92 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | MIRVAC GROUP | 266,683 | 762,713.38 | |
| | | SCENTRE GROUP | 382,183 | 1,161,836.32 | |
| | | STOCKLAND | 207,412 | 869,056.28 | |
| | | VICINITY CENTERS | 365,149 | 620,753.30 | |
| | オーストラリアドル 小計 | | 1,608,249 | 8,211,258.66<br>(678,906,866) | |
| | 香港ドル | LINK REIT | 170,500 | 11,423,500.00 | |
| | 香港ドル 小計 | | 170,500 | 11,423,500.00<br>(167,582,745) | |
| | シンガポールドル | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 284,138 | 815,476.06 | |
| | | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 340,429 | 684,262.29 | |
| | | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 220,000 | 407,000.00 | |
| | | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 283,189 | 504,076.42 | |
| | シンガポールドル 小計 | | 1,127,756 | 2,410,814.77<br>(204,629,957) | |
| 投資証券合計 | | | 4,133,871 | 11,459,377,813<br>(11,459,377,813) | |
| 合計 | | | | 11,746,292,235<br>(11,746,292,235) | |

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入株式<br>時価比率 | 組入投資信託<br>受益証券<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|---|---|
| アメリカドル | 株式　607銘柄 | 97.4% | — | — | 70.9% |
| | 投資証券　34銘柄 | — | — | 2.6% | 1.9% |
| カナダドル | 株式　87銘柄 | 99.7% | — | — | 3.7% |
| | 投資証券　2銘柄 | — | — | 0.3% | 0.0% |
| ユーロ | 株式　230銘柄 | 99.5% | — | — | 10.1% |
| | 投資証券　4銘柄 | — | — | 0.5% | 0.0% |
| イギリスポンド | 株式　81銘柄 | 98.6% | — | — | 4.6% |
| | 投資証券　3銘柄 | — | — | 1.4% | 0.1% |
| スイスフラン | 株式　41銘柄 | 100.0% | — | — | 3.1% |
| スウェーデンクローナ | 株式　44銘柄 | 100.0% | — | — | 1.1% |
| ノルウェークローネ | 株式　12銘柄 | 100.0% | — | — | 0.2% |
| デンマーククローネ | 株式　18銘柄 | 100.0% | — | — | 0.8% |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| オーストラリアドル | 株式　53銘柄 | 91.6% | — | — | 1.9% |
| | 投資信託受益証券　3銘柄 | — | 1.9% | — | 0.0% |
| | 投資証券　7銘柄 | — | — | 6.4% | 0.1% |
| ニュージーランドドル | 株式　6銘柄 | 100.0% | — | — | 0.1% |
| 香港ドル | 株式　28銘柄 | 94.2% | — | — | 0.8% |
| | 投資信託受益証券　2銘柄 | — | 1.9% | — | 0.0% |
| | 投資証券　1銘柄 | — | — | 3.9% | 0.0% |
| シンガポールドル | 株式　14銘柄 | 88.3% | — | — | 0.3% |
| | 投資証券　4銘柄 | — | — | 11.7% | 0.0% |
| イスラエルシェケル | 株式　8銘柄 | 100.0% | — | — | 0.1% |

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国債券インデックス　マザーファンド

### 貸借対照表

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 846,392,872 |
| コール・ローン | 786,610,655 |
| 国債証券 | 79,826,672,000 |
| 未収利息 | 1,076,235,045 |
| 前払費用 | 171,782,130 |
| 流動資産合計 | 82,707,692,702 |
| 資産合計 | 82,707,692,702 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 17,220,350 |
| 未払利息 | 1,179 |
| 流動負債合計 | 17,221,529 |
| 負債合計 | 17,221,529 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 47,259,879,384 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 35,430,591,789 |
| 元本等合計 | 82,690,471,173 |

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 純資産合計 | 82,690,471,173 |
| 負債純資産合計 | 82,707,692,702 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券<br>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 |
| 3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。<br>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。 |
| 4.収益及び費用の計上基準 | 為替予約取引による為替差損益<br>約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| | | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|---|
| 1. | 計算期間の末日における受益権の総数 | 47,259,879,384口 |
| 2. | 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.7497円<br>(1万口当たり純資産額) (17,497円) |

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 1 .金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2 .金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。<br>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。 |
| 3 .金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。 |

## ２．金融商品の時価等に関する事項

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2 .時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

## （関連当事者との取引に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

**（重要な後発事象に関する注記）**

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

**（その他の注記）**
**元本の移動**

| 区分 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2021年 1月21日 |
| 期首元本額 | 36,785,091,133円 |
| 期中追加設定元本額 | 12,016,409,255円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,541,621,004円 |
| 期末元本額 | 47,259,879,384円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| ＳＭＴ　新興国債券インデックス・オープン | 5,093,843,939円 |
| 世界経済インデックスファンド | 10,932,053,540円 |
| ＤＣ新興国債券インデックス・オープン | 5,032,396,590円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 10,348,937,998円 |
| 新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用） | 1,801,706,652円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 146,670,330円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 399,809,303円 |
| 新興国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 73,041,406円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 227,137,108円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 487,361,674円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 423,802,219円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 3,295,753,185円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 148,300,289円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 203,205,510円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 91,898,611円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 165,124,941円 |
| 外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用） | 3,976,730,415円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 293,001,606円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 350,859,247円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 585,842,487円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 7,246,843円 |
| グローバル経済コア | 728,627,109円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 43,103,997円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 5,601,256円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 10,928,104円 |

| 区分 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 6,945,937円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 3,436,102円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 3,565,594円 |
| ＦＯＦｓ用　新興国債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用） | 78,614,789円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 410,132,566円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 77,767,247円 |
| ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用） | 16,254,903円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用） | 300,810,171円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０５（適格機関投資家専用） | 311,357,275円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用） | 302,274,976円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用） | 300,458,970円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用） | 289,902,869円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用） | 285,373,626円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券 | △1,414,918,599 |
| 合計 | △1,414,918,599 |

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 国債証券 | メキシコペソ | MBONO 10% 11/20/36 | 31,800,000.00 | 37,876,026.00 | |
| | | MBONO 10% 12/05/24 | 100,250,000.00 | 106,711,112.50 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | MBONO 5.75% 03/05/26 | 172,100,000.00 | 161,082,158.00 | |
| | MBONO 6.75% 03/09/23 | 88,100,000.00 | 88,022,472.00 | |
| | MBONO 7.5% 06/03/27 | 159,500,000.00 | 158,676,980.00 | |
| | MBONO 7.75% 05/29/31 | 115,600,000.00 | 115,891,312.00 | |
| | MBONO 7.75% 11/13/42 | 108,500,000.00 | 105,482,615.00 | |
| | MBONO 7.75% 11/23/34 | 33,800,000.00 | 33,758,764.00 | |
| | MBONO 8.5% 05/31/29 | 136,900,000.00 | 143,376,739.00 | |
| | MBONO 8.5% 11/18/38 | 82,000,000.00 | 85,803,160.00 | |
| | MBONO 8% 09/05/24 | 128,400,000.00 | 129,985,740.00 | |
| | MBONO 8% 11/07/47 | 85,100,000.00 | 84,595,357.00 | |
| | MBONO 8% 12/07/23 | 105,950,000.00 | 107,194,912.50 | |
| メキシコペソ 小計 | | 1,348,000,000.00 | 1,358,457,348.00<br>(7,573,943,098) | |
| ブラジルレアル | BLTN 0% 01/01/24 | 92,100,000.00 | 74,237,656.28 | |
| | BLTN 0% 07/01/23 | 70,000,000.00 | 59,448,542.99 | |
| | BLTN 0% 07/01/24 | 41,850,000.00 | 32,123,461.54 | |
| | BNTNF 10% 01/01/23 | 56,600,000.00 | 55,646,462.23 | |
| | BNTNF 10% 01/01/25 | 31,800,000.00 | 30,820,179.76 | |
| | BNTNF 10% 01/01/27 | 41,200,000.00 | 39,352,791.52 | |
| | BNTNF 10% 01/01/29 | 23,100,000.00 | 21,620,619.24 | |
| | BNTNF 10% 01/01/31 | 16,850,000.00 | 15,620,931.38 | |
| | BRAZIL 10.25% 01/10/28 | 1,400,000.00 | 1,362,375.00 | |
| | BRAZIL 8.5% 01/05/24 | 1,900,000.00 | 1,828,750.00 | |
| ブラジルレアル 小計 | | 376,800,000.00 | 332,061,769.94<br>(6,968,083,798) | |
| チリペソ | BTPCL 2.3% 10/01/28 | 715,000,000.00 | 568,886,518.20 | |
| | BTPCL 2.5% 03/01/25 | 2,685,000,000.00 | 2,421,742,371.21 | |
| | BTPCL 4.5% 03/01/26 | 1,820,000,000.00 | 1,721,149,317.16 | |
| | BTPCL 4.7% 09/01/30 | 1,940,000,000.00 | 1,766,144,641.84 | |
| | BTPCL 4% 03/01/23 | 840,000,000.00 | 821,207,473.80 | |
| | BTPCL 5% 03/01/35 | 2,040,000,000.00 | 1,824,708,461.28 | |
| | BTPCL 5% 10/01/28 | 660,000,000.00 | 622,059,583.86 | |
| | BTPCL 6% 01/01/43 | 1,520,000,000.00 | 1,473,179,002.24 | |
| チリペソ 小計 | | 12,220,000,000.00 | 11,219,077,369.59<br>(1,583,483,018) | |
| コロンビアペソ | COLOM 9.85% 06/28/27 | 62,800,000,000.00 | 69,132,752,000.00 | |
| | COLTES 6.25% 11/26/25 | 6,300,000,000.00 | 5,946,822,000.00 | |
| | COLTES 7.25% 10/18/34 | 32,500,000,000.00 | 27,452,750,000.00 | |
| | COLTES 7.25% 10/26/50 | 8,900,000,000.00 | 6,898,212,000.00 | |
| コロンビアペソ 小計 | | 110,500,000,000.00 | 109,430,536,000.00<br>(3,128,400,163) | |
| ペルーヌエボソル | PERUGB 5.35% 08/12/40 | 4,500,000.00 | 3,763,305.00 | |
| | PERUGB 5.4% 08/12/34 | 6,350,000.00 | 5,708,269.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | PERUGB 5.7% 08/12/24 | 3,700,000.00 | 3,801,417.00 | |
| | PERUGB 5.94% 02/12/29 | 7,400,000.00 | 7,479,772.00 | |
| | PERUGB 6.15% 08/12/32 | 6,300,000.00 | 6,240,024.00 | |
| | PERUGB 6.35% 08/12/28 | 7,700,000.00 | 8,000,223.00 | |
| | PERUGB 6.9% 08/12/37 | 6,950,000.00 | 6,947,289.50 | |
| | PERUGB 6.95% 08/12/31 | 8,550,000.00 | 9,028,885.50 | |
| | PERUGB 8.2% 08/12/26 | 6,050,000.00 | 6,826,578.00 | |
| **ペルーヌエボソル 小計** | | 57,500,000.00 | 57,795,763.00<br>(1,709,500,416) | |
| **ウルグアイペソ** | URUGUA 8.25% 05/21/31 | 25,000,000.00 | 24,167,250.00 | |
| | URUGUA 8.5% 03/15/28 | 12,500,000.00 | 12,367,875.00 | |
| **ウルグアイペソ 小計** | | 37,500,000.00 | 36,535,125.00<br>(93,672,406) | |
| **ドミニカペソ** | DOMREP 8.9% 02/15/23 | 20,400,000.00 | 20,991,396.00 | |
| | DOMREP 9.75% 06/05/26 | 33,000,000.00 | 36,223,440.00 | |
| **ドミニカペソ 小計** | | 53,400,000.00 | 57,214,836.00<br>(113,148,059) | |
| **トルコリラ** | TURKGB 10.4% 03/20/24 | 3,950,000.00 | 3,220,237.50 | |
| | TURKGB 10.5% 08/11/27 | 8,650,000.00 | 5,522,765.50 | |
| | TURKGB 10.6% 02/11/26 | 11,050,000.00 | 7,924,507.50 | |
| | TURKGB 10.7% 08/17/22 | 8,650,000.00 | 8,236,270.50 | |
| | TURKGB 11.7% 11/13/30 | 16,600,000.00 | 10,098,942.00 | |
| | TURKGB 11% 02/24/27 | 7,400,000.00 | 4,902,130.00 | |
| | TURKGB 12.2% 01/18/23 | 9,900,000.00 | 9,164,826.00 | |
| | TURKGB 12.4% 03/08/28 | 4,700,000.00 | 3,165,638.00 | |
| | TURKGB 12.6% 10/01/25 | 17,400,000.00 | 13,526,760.00 | |
| | TURKGB 16.2% 06/14/23 | 7,100,000.00 | 6,636,938.00 | |
| | TURKGB 7.1% 03/08/23 | 6,200,000.00 | 5,326,234.00 | |
| | TURKGB 8.5% 09/14/22 | 5,100,000.00 | 4,763,094.00 | |
| | TURKGB 8% 03/12/25 | 12,400,000.00 | 8,658,176.00 | |
| | TURKGB 9% 07/24/24 | 17,900,000.00 | 13,690,457.00 | |
| **トルコリラ 小計** | | 137,000,000.00 | 104,836,976.00<br>(891,586,062) | |
| **チェココルナ** | CZGB 0.05% 11/29/29 | 31,100,000.00 | 24,194,867.00 | |
| | CZGB 0.25% 02/10/27 | 53,700,000.00 | 45,873,225.00 | |
| | CZGB 0.45% 10/25/23 | 47,000,000.00 | 44,270,710.00 | |
| | CZGB 0.95% 05/15/30 | 54,900,000.00 | 45,736,641.00 | |
| | CZGB 0% 12/12/24 | 12,000,000.00 | 10,827,720.00 | |
| | CZGB 1.2% 03/13/31 | 46,000,000.00 | 38,549,380.00 | |
| | CZGB 1.25% 02/14/25 | 58,500,000.00 | 54,507,960.00 | |
| | CZGB 1.5% 04/24/40 | 22,700,000.00 | 17,062,682.00 | |
| | CZGB 1.75% 06/23/32 | 38,000,000.00 | 33,213,140.00 | |
| | | | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | CZGB 1% 06/26/26 | 72,800,000.00 | 65,369,304.00 | |
| | CZGB 2.4% 09/17/25 | 51,900,000.00 | 49,884,723.00 | |
| | CZGB 2.5% 08/25/28 | 69,300,000.00 | 65,746,989.00 | |
| | CZGB 2.75% 07/23/29 | 58,500,000.00 | 56,606,355.00 | |
| | CZGB 2% 10/13/33 | 59,700,000.00 | 52,671,519.00 | |
| | CZGB 4.2% 12/04/36 | 28,000,000.00 | 31,100,720.00 | |
| | CZGB 4.7% 09/12/22 | 35,800,000.00 | 35,917,066.00 | |
| | CZGB 5.7% 05/25/24 | 37,700,000.00 | 39,244,946.00 | |
| チェココルナ 小計 | | 777,600,000.00 | 710,777,947.00<br>(3,798,610,582) | |
| ハンガリーフォリント | HGB 1.5% 04/22/26 | 610,500,000.00 | 539,749,155.00 | |
| | HGB 1.5% 08/23/23 | 322,500,000.00 | 312,080,025.00 | |
| | HGB 1.5% 08/26/26 | 514,000,000.00 | 449,857,940.00 | |
| | HGB 1.75% 10/26/22 | 130,000,000.00 | 128,315,200.00 | |
| | HGB 1% 11/26/25 | 475,000,000.00 | 417,838,500.00 | |
| | HGB 2.25% 04/20/33 | 542,000,000.00 | 422,228,840.00 | |
| | HGB 2.5% 10/24/24 | 548,000,000.00 | 524,847,000.00 | |
| | HGB 2.75% 12/22/26 | 470,500,000.00 | 433,189,350.00 | |
| | HGB 2% 05/23/29 | 633,000,000.00 | 529,561,470.00 | |
| | HGB 3.25% 10/22/31 | 692,000,000.00 | 608,406,400.00 | |
| | HGB 3% 04/25/41 | 174,000,000.00 | 130,038,900.00 | |
| | HGB 3% 06/26/24 | 402,500,000.00 | 392,039,025.00 | |
| | HGB 3% 08/21/30 | 555,000,000.00 | 485,919,150.00 | |
| | HGB 3% 10/27/27 | 592,000,000.00 | 543,923,680.00 | |
| | HGB 3% 10/27/38 | 380,000,000.00 | 295,180,200.00 | |
| | HGB 5.5% 06/24/25 | 660,000,000.00 | 680,928,600.00 | |
| | HGB 6.0% 11/24/23 | 471,000,000.00 | 487,508,550.00 | |
| | HGB 6.75% 10/22/28 | 382,000,000.00 | 426,059,880.00 | |
| ハンガリーフォリント 小計 | | 8,554,000,000.00 | 7,807,671,865.00<br>(2,847,840,505) | |
| ポーランドズロチ | POLGB 0.25% 10/25/26 | 14,000,000.00 | 11,834,620.00 | |
| | POLGB 0.75% 04/25/25 | 20,050,000.00 | 18,433,970.00 | |
| | POLGB 1.25% 10/25/30 | 18,300,000.00 | 14,696,181.00 | |
| | POLGB 2.25% 10/25/24 | 17,950,000.00 | 17,500,173.00 | |
| | POLGB 2.5% 01/25/23 | 19,600,000.00 | 19,523,952.00 | |
| | POLGB 2.5% 04/25/24 | 14,250,000.00 | 14,058,195.00 | |
| | POLGB 2.5% 07/25/26 | 24,100,000.00 | 22,864,393.00 | |
| | POLGB 2.5% 07/25/27 | 14,400,000.00 | 13,388,976.00 | |
| | POLGB 2.75% 04/25/28 | 17,600,000.00 | 16,462,336.00 | |
| | POLGB 2.75% 10/25/29 | 22,600,000.00 | 20,766,010.00 | |
| | POLGB 3.25% 07/25/25 | 13,250,000.00 | 13,133,400.00 | |
| | POLGB 4% 10/25/23 | 12,700,000.00 | 12,919,964.00 | |
| | POLGB 5.75% 09/23/22 | 7,500,000.00 | 7,692,675.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ポーランドズロチ 小計 | | 216,300,000.00 | 203,274,845.00<br>(5,829,780,262) | |
| ロシアルーブル | RFLB 4.5% 07/16/25 | 270,000,000.00 | 232,729,200.00 | |
| | RFLB 5.7% 05/17/28 | 219,000,000.00 | 182,547,450.00 | |
| | RFLB 6.1% 07/18/35 | 214,500,000.00 | 166,981,815.00 | |
| | RFLB 6.5% 02/28/24 | 149,000,000.00 | 141,155,150.00 | |
| | RFLB 6.9% 05/23/29 | 158,000,000.00 | 139,134,800.00 | |
| | RFLB 6.9% 07/23/31 | 245,000,000.00 | 211,297,800.00 | |
| | RFLB 6% 10/06/27 | 217,500,000.00 | 187,013,025.00 | |
| | RFLB 7.05% 01/19/28 | 200,500,000.00 | 180,544,235.00 | |
| | RFLB 7.1% 10/16/24 | 165,100,000.00 | 156,767,403.00 | |
| | RFLB 7.15% 11/12/25 | 210,400,000.00 | 196,787,120.00 | |
| | RFLB 7.25% 05/10/34 | 160,500,000.00 | 139,776,240.00 | |
| | RFLB 7.4% 07/17/24 | 202,200,000.00 | 193,956,306.00 | |
| | RFLB 7.4% 12/07/22 | 165,100,000.00 | 162,346,132.00 | |
| | RFLB 7.65% 04/10/30 | 221,500,000.00 | 202,738,950.00 | |
| | RFLB 7.7% 03/16/39 | 150,500,000.00 | 134,429,610.00 | |
| | RFLB 7.7% 03/23/33 | 185,000,000.00 | 167,930,050.00 | |
| | RFLB 7.75% 09/16/26 | 141,500,000.00 | 133,645,335.00 | |
| | RFLB 7.95% 10/07/26 | 181,000,000.00 | 172,281,230.00 | |
| | RFLB 7% 01/25/23 | 112,200,000.00 | 109,709,160.00 | |
| | RFLB 7% 08/16/23 | 107,200,000.00 | 103,546,624.00 | |
| | RFLB 8.15% 02/03/27 | 170,000,000.00 | 162,921,200.00 | |
| | RFLB 8.5% 09/17/31 | 116,650,000.00 | 112,389,942.00 | |
| ロシアルーブル 小計 | | 3,962,350,000.00 | 3,590,628,777.00<br>(5,385,943,165) | |
| ルーマニアレイ | ROMGB 3.25% 06/24/26 | 6,000,000.00 | 5,593,140.00 | |
| | ROMGB 3.65% 07/28/25 | 15,000,000.00 | 14,437,050.00 | |
| | ROMGB 3.65% 09/24/31 | 5,000,000.00 | 4,340,200.00 | |
| | ROMGB 3.7% 11/25/24 | 10,000,000.00 | 9,754,200.00 | |
| | ROMGB 4.15% 01/26/28 | 10,500,000.00 | 10,022,670.00 | |
| | ROMGB 4.15% 10/24/30 | 5,400,000.00 | 4,953,528.00 | |
| | ROMGB 4.25% 06/28/23 | 20,000,000.00 | 19,966,400.00 | |
| | ROMGB 4.75% 02/24/25 | 1,400,000.00 | 1,399,832.00 | |
| | ROMGB 4.75% 10/11/34 | 2,500,000.00 | 2,330,175.00 | |
| | ROMGB 4% 10/25/23 | 13,800,000.00 | 13,692,084.00 | |
| | ROMGB 5% 02/12/29 | 6,000,000.00 | 5,954,700.00 | |
| ルーマニアレイ 小計 | | 95,600,000.00 | 92,443,979.00<br>(2,424,870,279) | |
| マレーシアリンギット | MGS 2.632% 04/15/31 | 12,200,000.00 | 11,198,258.00 | |
| | MGS 3.478% 06/14/24 | 5,150,000.00 | 5,226,168.50 | |
| | MGS 3.48% 03/15/23 | 17,600,000.00 | 17,875,440.00 | |
| | MGS 3.502% 05/31/27 | 10,950,000.00 | 11,035,629.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | MGS 3.733% 06/15/28 | 23,100,000.00 | 23,428,020.00 | |
| | MGS 3.757% 04/20/23 | 4,850,000.00 | 4,946,127.00 | |
| | MGS 3.757% 05/22/40 | 12,650,000.00 | 11,837,237.50 | |
| | MGS 3.8% 08/17/23 | 7,100,000.00 | 7,261,809.00 | |
| | MGS 3.828% 07/05/34 | 8,200,000.00 | 8,018,042.00 | |
| | MGS 3.885% 08/15/29 | 29,800,000.00 | 30,348,916.00 | |
| | MGS 3.899% 11/16/27 | 14,800,000.00 | 15,212,920.00 | |
| | MGS 3.9% 11/30/26 | 9,750,000.00 | 10,022,025.00 | |
| | MGS 3.906% 07/15/26 | 8,700,000.00 | 8,941,077.00 | |
| | MGS 3.955% 09/15/25 | 26,000,000.00 | 26,798,200.00 | |
| | MGS 4.059% 09/30/24 | 19,550,000.00 | 20,130,635.00 | |
| | MGS 4.065% 06/15/50 | 11,650,000.00 | 11,173,515.00 | |
| | MGS 4.181% 07/15/24 | 7,600,000.00 | 7,832,940.00 | |
| | MGS 4.254% 05/31/35 | 15,350,000.00 | 15,729,759.00 | |
| | MGS 4.762% 04/07/37 | 7,350,000.00 | 7,941,381.00 | |
| マレーシアリンギット 小計 | | 252,350,000.00 | 254,958,099.00<br>(6,959,336,270) | |
| タイバーツ | THAIGB 0.75% 06/17/24 | 90,500,000.00 | 90,407,690.00 | |
| | THAIGB 0.95% 06/17/25 | 116,700,000.00 | 116,381,409.00 | |
| | THAIGB 1.45% 12/17/24 | 160,000,000.00 | 162,683,200.00 | |
| | THAIGB 1.585% 12/17/35 | 56,800,000.00 | 50,039,664.00 | |
| | THAIGB 1.6% 06/17/35 | 44,100,000.00 | 39,482,289.00 | |
| | THAIGB 1.6% 12/17/29 | 111,100,000.00 | 107,492,583.00 | |
| | THAIGB 2.125% 12/17/26 | 110,600,000.00 | 114,125,928.00 | |
| | THAIGB 2.4% 12/17/23 | 152,000,000.00 | 157,046,400.00 | |
| | THAIGB 2.875% 06/17/46 | 78,500,000.00 | 76,404,050.00 | |
| | THAIGB 2.875% 12/17/28 | 133,200,000.00 | 141,342,516.00 | |
| | THAIGB 2% 06/17/42 | 65,600,000.00 | 56,070,288.00 | |
| | THAIGB 2% 12/17/22 | 65,000,000.00 | 65,897,000.00 | |
| | THAIGB 3.3% 06/17/38 | 128,700,000.00 | 137,474,766.00 | |
| | THAIGB 3.4% 06/17/36 | 129,200,000.00 | 140,794,408.00 | |
| | THAIGB 3.625% 06/16/23 | 99,000,000.00 | 103,214,430.00 | |
| | THAIGB 3.65% 06/20/31 | 175,500,000.00 | 197,962,245.00 | |
| | THAIGB 3.775% 06/25/32 | 95,500,000.00 | 109,018,980.00 | |
| | THAIGB 3.85% 12/12/25 | 105,400,000.00 | 116,117,072.00 | |
| | THAIGB 4.875% 06/22/29 | 105,500,000.00 | 126,893,290.00 | |
| タイバーツ 小計 | | 2,022,900,000.00 | 2,108,848,208.00<br>(7,317,703,281) | |
| フィリピンペソ | PHILIP 3.9% 11/26/22 | 15,000,000.00 | 14,859,900.00 | |
| | PHILIP 6.25% 01/14/36 | 30,000,000.00 | 33,575,400.00 | |
| フィリピンペソ 小計 | | 45,000,000.00 | 48,435,300.00<br>(107,473,087) | |
| | | | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| インドネシアルピア | INDOGB 10.5% 08/15/30 | 7,300,000,000.00 | 9,167,924,000.00 | |
| | INDOGB 11% 09/15/25 | 16,200,000,000.00 | 19,468,188,000.00 | |
| | INDOGB 5.125% 04/15/27 | 19,500,000,000.00 | 19,442,280,000.00 | |
| | INDOGB 5.5% 04/15/26 | 36,500,000,000.00 | 36,887,995,000.00 | |
| | INDOGB 5.625% 05/15/23 | 60,300,000,000.00 | 61,989,606,000.00 | |
| | INDOGB 6.125% 05/15/28 | 34,000,000,000.00 | 34,440,640,000.00 | |
| | INDOGB 6.25% 06/15/36 | 17,800,000,000.00 | 17,647,276,000.00 | |
| | INDOGB 6.375% 04/15/32 | 16,000,000,000.00 | 15,993,760,000.00 | |
| | INDOGB 6.5% 02/15/31 | 62,500,000,000.00 | 62,546,875,000.00 | |
| | INDOGB 6.5% 06/15/25 | 57,300,000,000.00 | 60,162,135,000.00 | |
| | INDOGB 6.625% 05/15/33 | 31,000,000,000.00 | 30,969,930,000.00 | |
| | INDOGB 7.125% 06/15/42 | 22,300,000,000.00 | 22,582,764,000.00 | |
| | INDOGB 7.5% 04/15/40 | 34,000,000,000.00 | 35,600,380,000.00 | |
| | INDOGB 7.5% 05/15/38 | 21,000,000,000.00 | 21,890,820,000.00 | |
| | INDOGB 7.5% 06/15/35 | 33,200,000,000.00 | 34,911,792,000.00 | |
| | INDOGB 7.5% 08/15/32 | 21,900,000,000.00 | 23,268,969,000.00 | |
| | INDOGB 7% 05/15/27 | 40,800,000,000.00 | 43,410,792,000.00 | |
| | INDOGB 7% 09/15/30 | 56,000,000,000.00 | 57,540,560,000.00 | |
| | INDOGB 8.125% 05/15/24 | 45,600,000,000.00 | 49,413,528,000.00 | |
| | INDOGB 8.25% 05/15/29 | 31,700,000,000.00 | 35,215,213,000.00 | |
| | INDOGB 8.25% 05/15/36 | 31,800,000,000.00 | 35,342,202,000.00 | |
| | INDOGB 8.25% 06/15/32 | 13,400,000,000.00 | 14,927,332,000.00 | |
| | INDOGB 8.375% 03/15/24 | 53,600,000,000.00 | 58,086,320,000.00 | |
| | INDOGB 8.375% 03/15/34 | 52,000,000,000.00 | 58,280,040,000.00 | |
| | INDOGB 8.375% 04/15/39 | 21,200,000,000.00 | 23,913,388,000.00 | |
| | INDOGB 8.375% 09/15/26 | 29,100,000,000.00 | 32,726,151,000.00 | |
| | INDOGB 8.75% 05/15/31 | 34,700,000,000.00 | 39,938,312,000.00 | |
| | INDOGB 9.5% 07/15/31 | 11,400,000,000.00 | 13,659,366,000.00 | |
| | INDOGB 9% 03/15/29 | 19,700,000,000.00 | 22,690,066,000.00 | |
| インドネシアルピア 小計 | | 931,800,000,000.00 | 992,114,604,000.00<br>(7,936,916,832) | |
| 南アフリカランド | SAGB 10.5% 12/21/26 | 146,600,000.00 | 162,577,934.00 | |
| | SAGB 6.25% 03/31/36 | 54,800,000.00 | 38,604,956.00 | |
| | SAGB 6.5% 02/28/41 | 34,100,000.00 | 22,896,104.00 | |
| | SAGB 7.75% 02/28/23 | 38,900,000.00 | 39,986,866.00 | |
| | SAGB 7% 02/28/31 | 64,700,000.00 | 54,545,982.00 | |
| | SAGB 8.25% 03/31/32 | 97,200,000.00 | 87,457,644.00 | |
| | SAGB 8.5% 01/31/37 | 97,700,000.00 | 83,326,376.00 | |
| | SAGB 8.75% 01/31/44 | 86,000,000.00 | 72,709,560.00 | |
| | SAGB 8.75% 02/28/48 | 151,100,000.00 | 127,495,158.00 | |
| | SAGB 8.875% 02/28/35 | 78,000,000.00 | 70,357,560.00 | |
| | SAGB 8% 01/31/30 | 138,700,000.00 | 128,229,537.00 | |
| | SAGB 9% 01/31/40 | 64,450,000.00 | 56,581,299.50 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 南アフリカランド 小計 | | 1,052,250,000.00 | 944,768,976.50<br>(7,057,424,254) | |
| | 香港・オフショア人民元 | CGB 1.99% 04/09/25 | 20,000,000.00 | 19,744,000.00 | |
| | | CGB 2.36% 07/02/23 | 18,000,000.00 | 18,047,880.00 | |
| | | CGB 2.68% 05/21/30 | 27,300,000.00 | 27,046,110.00 | |
| | | CGB 2.69% 08/12/26 | 10,000,000.00 | 10,108,800.00 | |
| | | CGB 2.84% 04/08/24 | 11,700,000.00 | 11,848,356.00 | |
| | | CGB 2.85% 06/04/27 | 24,500,000.00 | 24,871,910.00 | |
| | | CGB 2.88% 11/05/23 | 16,900,000.00 | 17,105,504.00 | |
| | | CGB 2.89% 11/18/31 | 5,000,000.00 | 5,068,650.00 | |
| | | CGB 2.91% 10/14/28 | 6,000,000.00 | 6,081,120.00 | |
| | | CGB 2.94% 10/17/24 | 23,000,000.00 | 23,392,150.00 | |
| | | CGB 3.01% 05/13/28 | 15,000,000.00 | 15,307,950.00 | |
| | | CGB 3.02% 05/27/31 | 8,500,000.00 | 8,674,420.00 | |
| | | CGB 3.02% 10/22/25 | 14,300,000.00 | 14,609,023.00 | |
| | | CGB 3.03% 03/11/26 | 17,500,000.00 | 17,907,400.00 | |
| | | CGB 3.12% 12/05/26 | 20,000,000.00 | 20,594,800.00 | |
| | | CGB 3.13% 11/21/29 | 24,300,000.00 | 24,958,530.00 | |
| | | CGB 3.19% 04/11/24 | 24,100,000.00 | 24,589,230.00 | |
| | | CGB 3.22% 12/06/25 | 12,000,000.00 | 12,346,440.00 | |
| | | CGB 3.25% 06/06/26 | 22,000,000.00 | 22,762,080.00 | |
| | | CGB 3.25% 11/22/28 | 14,900,000.00 | 15,438,784.00 | |
| | | CGB 3.27% 11/19/30 | 22,000,000.00 | 22,867,460.00 | |
| | | CGB 3.28% 12/03/27 | 20,000,000.00 | 20,796,000.00 | |
| | | CGB 3.29% 05/23/29 | 14,200,000.00 | 14,756,640.00 | |
| | | CGB 3.29% 10/18/23 | 16,000,000.00 | 16,312,000.00 | |
| | | CGB 3.53% 10/18/51 | 2,200,000.00 | 2,298,054.00 | |
| | | CGB 3.72% 04/12/51 | 7,300,000.00 | 7,800,999.00 | |
| | | CGB 3.81% 09/14/50 | 22,700,000.00 | 24,580,241.00 | |
| | 香港・オフショア人民元 小計 | | 439,400,000.00 | 449,914,531.00<br>(8,098,956,463) | |
| 合計 | | | | 79,826,672,000<br>(79,826,672,000) | |

**有価証券明細表注記**

**1.通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。**

**2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。**

**3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。**

**4.外貨建有価証券の通貨別内訳**

| 通貨 | 銘柄数 | 組入債券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|

| | | | |
|---|---|---|---|
| メキシコペソ | 国債証券　13銘柄 | 100.0% | 9.5% |
| ブラジルレアル | 国債証券　10銘柄 | 100.0% | 8.7% |
| チリペソ | 国債証券　8銘柄 | 100.0% | 2.0% |
| コロンビアペソ | 国債証券　4銘柄 | 100.0% | 3.9% |
| ペルーヌエボソル | 国債証券　9銘柄 | 100.0% | 2.1% |
| ウルグアイペソ | 国債証券　2銘柄 | 100.0% | 0.1% |
| ドミニカペソ | 国債証券　2銘柄 | 100.0% | 0.1% |
| トルコリラ | 国債証券　14銘柄 | 100.0% | 1.1% |
| チェココルナ | 国債証券　17銘柄 | 100.0% | 4.8% |
| ハンガリーフォリント | 国債証券　18銘柄 | 100.0% | 3.6% |
| ポーランドズロチ | 国債証券　13銘柄 | 100.0% | 7.3% |
| ロシアルーブル | 国債証券　22銘柄 | 100.0% | 6.7% |
| ルーマニアレイ | 国債証券　11銘柄 | 100.0% | 3.0% |
| マレーシアリンギット | 国債証券　19銘柄 | 100.0% | 8.7% |
| タイバーツ | 国債証券　19銘柄 | 100.0% | 9.2% |
| フィリピンペソ | 国債証券　2銘柄 | 100.0% | 0.1% |
| インドネシアルピア | 国債証券　29銘柄 | 100.0% | 9.9% |
| 南アフリカランド | 国債証券　12銘柄 | 100.0% | 8.8% |
| 香港・オフショア人民元 | 国債証券　27銘柄 | 100.0% | 10.1% |

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 新興国株式インデックス　マザーファンド

### 貸借対照表

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 6,146,283,330 |
| コール・ローン | 88,268,100 |
| 株式 | 98,138,356,943 |
| 投資信託受益証券 | 185,187,064 |
| 投資証券 | 88,719,771 |
| 派生商品評価勘定 | 134,227,946 |
| 未収入金 | 1,762,520 |
| 未収配当金 | 44,448,918 |
| 差入委託証拠金 | 1,113,128,793 |

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 流動資産合計 | 105,940,383,385 |
| 資産合計 | 105,940,383,385 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 997,537 |
| 前受金 | 133,466,641 |
| 未払金 | 9,315 |
| 未払解約金 | 11,280,457 |
| 未払利息 | 132 |
| 流動負債合計 | 145,754,082 |
| 負債合計 | 145,754,082 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 28,827,989,077 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 76,966,640,226 |
| 元本等合計 | 105,794,629,303 |
| 純資産合計 | 105,794,629,303 |
| 負債純資産合計 | 105,940,383,385 |

**注記表**

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

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

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

（貸借対照表に関する注記）

| | | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|---|
| 1． | 計算期間の末日における受益権の総数 | 28,827,989,077口 |
| 2． | 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 3.6699円<br>(1万口当たり純資産額) (36,699円) |

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 1 .金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2 .金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。<br>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。 |
| 3 .金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。 |

## 2．金融商品の時価等に関する事項

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2 .時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |

| | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| ３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（重要な後発事象に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（その他の注記）
元本の移動

| 区分 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2021年 1月21日 |
| 期首元本額 | 25,006,661,411円 |
| 期中追加設定元本額 | 5,289,079,072円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,467,751,406円 |
| 期末元本額 | 28,827,989,077円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| ＳＭＴ　新興国株式インデックス・オープン | 7,628,838,159円 |
| 世界経済インデックスファンド | 5,241,696,474円 |
| ＤＣ新興国株式インデックス・オープン | 5,164,402,868円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 5,098,877,404円 |
| 新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 209,043,773円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 223,488,884円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 1,291,777,359円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 687,733,620円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 581,136,059円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 330,135,084円 |

| 区分 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 16,163,100円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 81,597,648円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 140,347,565円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 530,216,061円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 95,143,010円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 3,665,385円 |
| グローバル経済コア | 349,222,485円 |
| ｉ－ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード） | 39,066,374円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 10,287,212円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 7,070,824円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 3,671,554円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 3,981,149円 |
| 世界株式ファンド（適格機関投資家専用） | 887,612,285円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 155,056,948円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 37,168,626円 |
| ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用） | 10,589,167円 |

**（有価証券に関する注記）**

**売買目的有価証券**

| 種類 | 2022年 1月20日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式 | △2,051,426,286 |
| 投資信託受益証券 | △19,268,655 |
| 投資証券 | 5,007,399 |
| 合計 | △2,065,687,542 |

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

**（デリバティブ取引に関する注記）**

**株式関連**

（2022年 1月20日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 7,155,086,990 | － | 7,288,553,631 | 133,466,641 |
| 合計 | | 7,155,086,990 | － | 7,288,553,631 | 133,466,641 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

（2022年 1月20日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 66,531,800 | － | 66,299,104 | △232,696 |
| | アメリカドル | 66,531,800 | － | 66,299,104 | △232,696 |
| | 売建 | 77,724,000 | － | 77,727,536 | △3,536 |
| | アメリカドル | 77,724,000 | － | 77,727,536 | △3,536 |
| 合計 | | 144,255,800 | － | 144,026,640 | △236,232 |

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第１　有価証券明細表

#### (1)株式

| 通 貨 | 銘　柄 | 株式数(株) | 評価額 | | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | 単価 | 金額 | |
| アメリカドル | GAZPROM OAO-SPON ADR | 655,305 | 8.29 | 5,436,410.28 | |
| | LUKOIL PJSC-SPON ADR | 44,089 | 85.26 | 3,759,028.14 | |
| | NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S | 10,590 | 210.00 | 2,223,900.00 | |
| | ROSNEFT OJSC-GDR | 134,073 | 7.43 | 996,966.82 | |
| | SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR | 123,206 | 4.71 | 581,285.90 | |
| | TATNEFT-SPONSORED ADR | 29,910 | 38.81 | 1,160,807.10 | |
| | CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR | 16,930 | 8.87 | 150,169.10 | |
| | MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR | 72,204 | 28.81 | 2,080,197.24 | |
| | NOVOLIPET STEEL-GDR REG S | 19,598 | 27.64 | 541,688.72 | |
| | PHOSAGRO PJSC-GDR REG S | 26,818 | 21.70 | 581,950.60 | |
| | POLYUS PJSC-REG S-GDR | 7,938 | 76.35 | 606,066.30 | |
| | SEVERSTAL - GDR REG S | 38,773 | 19.59 | 759,563.07 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| SOUTHERN COPPER CORP | 9,585 | 68.40 | 655,614.00 | |
| 51JOB INC-ADR | 2,701 | 51.88 | 140,127.88 | |
| DIDI GLOBAL INC | 34,321 | 5.01 | 171,948.21 | |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR | 44,721 | 29.88 | 1,336,263.48 | |
| LI AUTO INC - ADR | 60,121 | 29.26 | 1,759,140.46 | |
| NIO INC - ADR | 147,534 | 28.63 | 4,223,898.42 | |
| XPENG INC - ADR | 43,999 | 43.80 | 1,927,156.20 | |
| HUAZHU GROUP LTD-ADR | 19,163 | 34.80 | 666,872.40 | |
| NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR | 156,180 | 1.73 | 270,191.40 | |
| TAL EDUCATION GROUP- ADR | 41,058 | 3.59 | 147,398.22 | |
| TRIP.COM GROUP LTD | 55,661 | 23.47 | 1,306,363.67 | |
| YUM CHINA HOLDINGS INC | 45,333 | 45.53 | 2,064,011.49 | |
| AUTOHOME INC-ADR | 6,571 | 36.49 | 239,775.79 | |
| BAIDU INC - SPON ADR | 30,081 | 154.48 | 4,646,912.88 | |
| BILIBILI INC-SPONSORED ADR | 18,268 | 37.72 | 689,068.96 | |
| HELLO GROUP INC -SPN ADR | 15,529 | 9.22 | 143,177.38 | |
| IQIYI INC-ADR | 28,984 | 4.84 | 140,282.56 | |
| JOYY INC | 6,185 | 50.56 | 312,713.60 | |
| KANZHUN LTD | 6,900 | 28.18 | 194,442.00 | |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR | 64,895 | 6.82 | 442,583.90 | |
| VK CO LTD | 19,368 | 9.00 | 174,312.00 | |
| WEIBO CORP-SPON ADR | 5,249 | 33.55 | 176,103.95 | |
| YANDEX NV-A | 32,725 | 48.34 | 1,581,926.50 | |
| DADA NEXUS LTD-ADR | 7,696 | 11.28 | 86,810.88 | |
| OZON HOLDINGS PLC - ADR | 7,523 | 20.56 | 154,672.88 | |
| PINDUODUO INC-ADR | 48,659 | 64.35 | 3,131,206.65 | |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR | 52,765 | 9.14 | 482,272.10 | |
| MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS | 39,926 | 13.17 | 525,825.42 | |
| RLX TECHNOLOGY INC-ADR | 68,136 | 3.66 | 249,377.76 | |
| BEIGENE LTD-ADR | 4,929 | 236.85 | 1,167,433.65 | |
| HUTCHMED CHINA-ADR | 7,243 | 29.73 | 215,334.39 | |
| I-MAB-SPONSORED ADR | 2,944 | 32.75 | 96,416.00 | |
| LEGEND BIOTECH CORP-ADR | 3,311 | 40.35 | 133,598.85 | |
| ZAI LAB LTD-ADR | 7,677 | 51.97 | 398,973.69 | |
| COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR | 189,281 | 3.29 | 622,734.49 | |
| CREDICORP LTD | 7,637 | 142.42 | 1,087,661.54 | |
| SBERBANK-SPONSORED ADR | 285,355 | 12.78 | 3,646,836.90 | |
| TCS GROUP HOLDING-GDR REG S | 14,044 | 61.06 | 857,526.64 | |
| VTB BANK PJSC -GDR-REG S | 378,037 | 1.15 | 434,742.55 | |
| 360 DIGITECH INC | 8,061 | 20.41 | 164,525.01 | |
| NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS | 2,021 | 31.03 | 62,711.63 | |
| KE HOLDINGS INC | 35,590 | 22.71 | 808,248.90 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B | 54,432 | 0.92 | 50,349.60 | |
| | AGORA INC-ADR | 4,630 | 12.16 | 56,300.80 | |
| | CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR | 12,493 | 4.97 | 62,090.21 | |
| | GDS HOLDINGS LTD - ADR | 9,050 | 42.57 | 385,258.50 | |
| | KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR | 5,558 | 11.52 | 64,028.16 | |
| | SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B | 36,600 | 4.89 | 179,010.60 | |
| | VNET GROUP INC-ADR | 7,475 | 9.31 | 69,592.25 | |
| | MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT-SP ADR | 39,854 | 7.22 | 287,745.88 | |
| | DAQO NEW ENERGY CORP-ADR | 7,835 | 42.75 | 334,946.25 | |
| アメリカドル 小計 | | 3,423,328 | | 58,104,550.80<br>(6,641,931,201) | |
| メキシコペソ | CEMEX SAB-SPONS | 1,545,161 | 13.59 | 20,998,737.99 | |
| | GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B | 323,292 | 95.34 | 30,822,659.28 | |
| | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 14,500 | 239.08 | 3,466,660.00 | |
| | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | 96,852 | 49.00 | 4,745,748.00 | |
| | ALFA S.A.B.-A | 313,500 | 14.82 | 4,646,070.00 | |
| | GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1 | 37,500 | 61.31 | 2,299,125.00 | |
| | GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B | 23,305 | 407.63 | 9,499,817.15 | |
| | GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B | 43,680 | 281.48 | 12,295,046.40 | |
| | PROMOTORA Y OPERADORA DE INF | 42,685 | 152.50 | 6,509,462.50 | |
| | GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO | 288,490 | 42.07 | 12,136,774.30 | |
| | MEGACABLE HOLDINGS-CPO | 31,400 | 66.09 | 2,075,226.00 | |
| | WALMART DE MEXICO-SER V | 567,680 | 71.16 | 40,396,108.80 | |
| | ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM | 50,475 | 123.05 | 6,210,948.75 | |
| | BECLE SAB DE CV | 48,100 | 51.11 | 2,458,391.00 | |
| | FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 207,440 | 166.34 | 34,505,569.60 | |
| | GRUMA S.A.B.-B | 25,960 | 252.18 | 6,546,592.80 | |
| | GRUPO BIMBO SAB- SERIES A | 181,800 | 63.57 | 11,557,026.00 | |
| | KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A | 181,800 | 30.52 | 5,548,536.00 | |
| | GRUPO FINANCIERO BANORTE-O | 282,600 | 141.08 | 39,869,208.00 | |
| | GRUPO FINANCIERO INBURSA-O | 252,500 | 26.32 | 6,645,800.00 | |
| | AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L | 3,658,740 | 19.99 | 73,138,212.60 | |
| | TELESITES SAB DE CV | 74,800 | 22.20 | 1,660,560.00 | |
| メキシコペソ 小計 | | 8,292,260 | | 338,032,280.17<br>(1,884,665,174) | |
| ブラジルレアル | COSAN SA | 118,300 | 21.97 | 2,599,051.00 | |
| | PETROBRAS - PETROLEO BRAS | 375,100 | 34.25 | 12,847,175.00 | |
| | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 544,440 | 31.49 | 17,144,415.60 | |
| | ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | 75,600 | 13.23 | 1,000,188.00 | |
| | BRASKEM SA-PREF A | 19,300 | 49.20 | 949,560.00 | |
| | CIA SIDERURGICA NACIONAL SA | 63,000 | 26.47 | 1,667,610.00 | |
| | GERDAU SA-PREF | 141,800 | 29.04 | 4,117,872.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | SUZANO SA | 90,079 | 61.85 | 5,571,386.15 | |
| | VALE SA | 439,387 | 88.21 | 38,758,327.27 | |
| | WEG SA | 171,144 | 30.50 | 5,219,892.00 | |
| | CCR SA | 125,600 | 11.34 | 1,424,304.00 | |
| | LOCALIZA RENT A CAR | 61,952 | 49.85 | 3,088,307.20 | |
| | RUMO SA | 159,700 | 16.73 | 2,671,781.00 | |
| | ALPARGATAS SA - PREF | 28,600 | 28.50 | 815,100.00 | |
| | AMERICANAS SA | 39,740 | 33.20 | 1,319,368.00 | |
| | LOJAS RENNER S.A. | 115,947 | 24.85 | 2,881,282.95 | |
| | MAGAZINE LUIZA SA | 305,500 | 6.31 | 1,927,705.00 | |
| | VIA S/A | 135,900 | 4.00 | 543,600.00 | |
| | VIBRA ENERGIA SA | 134,600 | 20.52 | 2,761,992.00 | |
| | ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC | 41,500 | 15.04 | 624,160.00 | |
| | RAIA DROGASIL SA | 122,500 | 20.54 | 2,516,150.00 | |
| | AMBEV SA | 534,900 | 14.54 | 7,777,446.00 | |
| | BRF SA | 52,500 | 23.71 | 1,244,775.00 | |
| | JBS SA | 110,000 | 36.61 | 4,027,100.00 | |
| | NATURA &CO HOLDING SA | 100,308 | 20.87 | 2,093,427.96 | |
| | HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE | 100,500 | 10.92 | 1,097,460.00 | |
| | NOTRE DAME INTERMED PAR SA | 54,400 | 63.74 | 3,467,456.00 | |
| | REDE D'OR SAO LUIZ SA | 45,600 | 40.14 | 1,830,384.00 | |
| | HYPERA SA | 35,300 | 28.42 | 1,003,226.00 | |
| | BANCO BRADESCO S.A. | 161,367 | 17.62 | 2,843,286.54 | |
| | BANCO BRADESCO SA-PREF | 531,802 | 21.10 | 11,221,022.20 | |
| | BANCO DO BRASIL S.A. | 88,300 | 31.01 | 2,738,183.00 | |
| | ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 523,681 | 23.48 | 12,296,029.88 | |
| | ITAUSA SA | 528,325 | 9.62 | 5,082,486.50 | |
| | B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO | 715,509 | 12.26 | 8,772,140.34 | |
| | BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 69,000 | 20.68 | 1,426,920.00 | |
| | TOTVS SA | 57,900 | 25.30 | 1,464,870.00 | |
| | TELEFONICA BRASIL S.A. | 52,300 | 48.69 | 2,546,487.00 | |
| | TIM SA | 96,100 | 12.99 | 1,248,339.00 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B | 37,000 | 32.35 | 1,196,950.00 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER | 33,600 | 33.04 | 1,110,144.00 | |
| | CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 113,867 | 12.96 | 1,475,716.32 | |
| | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP | 34,700 | 35.69 | 1,238,443.00 | |
| | ENGIE BRASIL SA | 29,250 | 39.33 | 1,150,402.50 | |
| | EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | 80,900 | 22.20 | 1,795,980.00 | |
| ブラジルレアル 小計 | | 7,496,798 | | 190,597,902.41<br>(3,999,563,563) | |
| チリペソ | EMPRESAS COPEC SA | 44,730 | 6,270.00 | 280,457,100.00 | |
| | EMPRESAS CMPC SA | 135,965 | 1,445.00 | 196,469,425.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B | 15,220 | 46,997.00 | 715,294,340.00 | |
| | FALABELLA SA | 70,837 | 2,620.00 | 185,592,940.00 | |
| | CENCOSUD SA | 137,988 | 1,370.10 | 189,057,358.80 | |
| | CIA CERVECERIAS UNIDAS SA | 7,385 | 6,720.00 | 49,627,200.00 | |
| | BANCO DE CHILE | 4,862,640 | 75.00 | 364,698,000.00 | |
| | BANCO DE CREDITO E INVERSION | 5,718 | 27,550.00 | 157,530,900.00 | |
| | BANCO SANTANDER CHILE | 6,279,821 | 38.80 | 243,657,054.80 | |
| | ENEL AMERICAS SA | 3,491,315 | 96.00 | 335,166,240.00 | |
| | ENEL CHILE SA | 2,561,278 | 32.20 | 82,473,151.60 | |
| チリペソ 小計 | | 17,612,897 | | 2,800,023,710.20<br>(395,200,946) | |
| コロンビアペソ | ECOPETROL SA | 488,979 | 2,990.00 | 1,462,047,210.00 | |
| | BANCOLOMBIA SA | 29,376 | 42,200.00 | 1,239,667,200.00 | |
| | BANCOLOMBIA SA-PREF | 61,565 | 36,180.00 | 2,227,421,700.00 | |
| | GRUPO DE INV SURAMERICANA | 20,820 | 27,250.00 | 567,345,000.00 | |
| | INTERCONEXION ELECTRICA SA | 50,511 | 25,100.00 | 1,267,826,100.00 | |
| コロンビアペソ 小計 | | 651,251 | | 6,764,307,210.00<br>(193,378,014) | |
| ユーロ | OPAP SA | 18,496 | 13.10 | 242,297.60 | |
| | JUMBO SA | 19,341 | 14.38 | 278,123.58 | |
| | ALPHA SERVICES AND HLD | 263,668 | 1.25 | 330,903.34 | |
| | EUROBANK ERGASIAS SERVICES A | 282,775 | 1.00 | 284,895.81 | |
| | HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA | 26,207 | 16.96 | 444,601.75 | |
| | PUBLIC POWER CORP | 20,834 | 8.94 | 186,255.96 | |
| ユーロ 小計 | | 631,321 | | 1,767,078.04<br>(229,296,046) | |
| イギリスポンド | POLYMETAL INTERNATIONAL PLC | 44,689 | 12.18 | 544,535.46 | |
| イギリスポンド 小計 | | 44,689 | | 544,535.46<br>(84,805,952) | |
| トルコリラ | TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | 11,603 | 186.80 | 2,167,440.40 | |
| | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 116,755 | 29.34 | 3,425,591.70 | |
| | ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI | 99,566 | 23.22 | 2,311,922.52 | |
| | KOC HOLDING AS | 89,884 | 32.86 | 2,953,588.24 | |
| | TURK SISE VE CAM FABRIKALARI | 298,748 | 14.22 | 4,248,196.56 | |
| | FORD OTOMOTIV SANAYI AS | 6,501 | 270.40 | 1,757,870.40 | |
| | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | 42,824 | 70.30 | 3,010,527.20 | |
| | AKBANK T.A.S. | 276,321 | 7.88 | 2,177,409.48 | |
| | TURKIYE GARANTI BANKASI | 239,992 | 12.03 | 2,887,103.76 | |
| | TURKIYE IS BANKASI-C | 173,012 | 8.35 | 1,444,650.20 | |
| | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 143,091 | 18.86 | 2,698,696.26 | |
| トルコリラ 小計 | | 1,498,297 | | 29,082,996.72<br>(247,336,345) | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| チェココルナ | KOMERCNI BANKA AS | 7,463 | 970.50 | 7,242,841.50 | |
| | MONETA MONEY BANK AS | 62,031 | 92.30 | 5,725,461.30 | |
| | CEZ AS | 18,145 | 812.50 | 14,742,812.50 | |
| チェココルナ 小計 | | 87,639 | | 27,711,115.30<br>(148,096,513) | |
| ハンガリーフォリント | MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY | 42,355 | 2,660.00 | 112,664,300.00 | |
| | RICHTER GEDEON NYRT | 15,178 | 8,600.00 | 130,530,800.00 | |
| | OTP BANK NYRT | 25,606 | 17,980.00 | 460,395,880.00 | |
| ハンガリーフォリント 小計 | | 83,139 | | 703,590,980.00<br>(256,634,106) | |
| ポーランドズロチ | POLSKI KONCERN NAFTOWY SA | 30,713 | 80.86 | 2,483,453.18 | |
| | POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I | 200,051 | 5.69 | 1,138,290.19 | |
| | KGHM POLSKA MIEDZ SA | 13,132 | 150.05 | 1,970,456.60 | |
| | LPP SA | 124 | 17,500.00 | 2,170,000.00 | |
| | CD PROJEKT SA | 6,704 | 187.74 | 1,258,608.96 | |
| | CYFROWY POLSAT SA | 36,098 | 32.56 | 1,175,350.88 | |
| | ALLEGRO.EU SA | 39,203 | 40.20 | 1,575,960.60 | |
| | DINO POLSKA SA | 5,945 | 342.50 | 2,036,162.50 | |
| | BANK PEKAO SA | 23,647 | 133.50 | 3,156,874.50 | |
| | M BANK SA | 1,423 | 463.00 | 658,849.00 | |
| | PKO BANK POLSKI SA | 93,312 | 47.39 | 4,422,055.68 | |
| | SANTANDER BANK POLSKA SA | 3,615 | 367.30 | 1,327,789.50 | |
| | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | 62,044 | 36.10 | 2,239,788.40 | |
| | ORANGE POLSKA SA | 55,658 | 8.46 | 470,866.68 | |
| | POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA | 63,496 | 7.72 | 490,189.12 | |
| ポーランドズロチ 小計 | | 635,165 | | 26,574,695.79<br>(762,143,672) | |
| 香港ドル | CHINA COAL ENERGY CO - H | 329,000 | 4.69 | 1,543,010.00 | |
| | CHINA OILFIELD SERVICES-H | 192,000 | 7.72 | 1,482,240.00 | |
| | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 2,915,400 | 4.16 | 12,128,064.00 | |
| | CHINA SHENHUA ENERGY CO -H | 411,500 | 20.75 | 8,538,625.00 | |
| | CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H | 236,000 | 5.45 | 1,286,200.00 | |
| | PETROCHINA CO LTD-H | 2,148,000 | 4.02 | 8,634,960.00 | |
| | YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H | 142,000 | 17.42 | 2,473,640.00 | |
| | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 340,000 | 4.58 | 1,557,200.00 | |
| | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H | 144,500 | 41.80 | 6,040,100.00 | |
| | CHINA HONGQIAO GROUP LTD | 219,000 | 8.99 | 1,968,810.00 | |
| | CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H | 468,000 | 4.23 | 1,979,640.00 | |
| | CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 412,000 | 10.80 | 4,449,600.00 | |
| | CHINA RESOURCES CEMENT | 288,000 | 6.75 | 1,944,000.00 | |
| | DONGYUE GROUP | 147,000 | 10.40 | 1,528,800.00 | |
| | GANFENG LITHIUM CO LTD-H | 26,200 | 113.00 | 2,960,600.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| HUABAO INTERNATIONAL HOLDING | 101,000 | 14.14 | 1,428,140.00 | |
| JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H | 83,000 | 13.66 | 1,133,780.00 | |
| LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN | 166,000 | 5.56 | 922,960.00 | |
| MMG LIMITED | 304,000 | 2.70 | 820,800.00 | |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS | 129,000 | 8.23 | 1,061,670.00 | |
| SHANDONG GOLD MINING CO LT-H | 50,750 | 12.98 | 658,735.00 | |
| UNITED CO RUSAL INTERNATIONA | 285,000 | 7.45 | 2,123,250.00 | |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H | 729,000 | 10.10 | 7,362,900.00 | |
| AVICHINA INDUSTRY & TECH-H | 275,000 | 5.29 | 1,454,750.00 | |
| BOC AVIATION LTD | 23,800 | 66.05 | 1,571,990.00 | |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H | 196,000 | 3.91 | 766,360.00 | |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS | 159,500 | 38.00 | 6,061,000.00 | |
| CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L | 128,000 | 15.08 | 1,930,240.00 | |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H | 474,000 | 4.64 | 2,199,360.00 | |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R | 170,000 | 9.61 | 1,633,700.00 | |
| CITIC LTD | 617,000 | 8.77 | 5,411,090.00 | |
| CRRC CORP LTD-H | 409,000 | 3.56 | 1,456,040.00 | |
| FOSUN INTERNATIONAL | 288,000 | 8.69 | 2,502,720.00 | |
| HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS | 78,000 | 21.90 | 1,708,200.00 | |
| SANY HEAVY EQUIPMENT INTL | 160,000 | 7.71 | 1,233,600.00 | |
| SINOTRUK HONG KONG LTD | 54,500 | 12.70 | 692,150.00 | |
| WEICHAI POWER CO LTD-H | 211,800 | 15.88 | 3,363,384.00 | |
| XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H | 141,216 | 13.80 | 1,948,780.80 | |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC | 62,300 | 41.45 | 2,582,335.00 | |
| ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH | 116,200 | 5.71 | 663,502.00 | |
| CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD | 385,074 | 5.86 | 2,256,533.64 | |
| AIR CHINA LIMITED-H | 214,000 | 5.84 | 1,249,760.00 | |
| BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H | 248,000 | 5.05 | 1,252,400.00 | |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDING | 165,547 | 15.22 | 2,519,625.34 | |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H | 176,000 | 4.97 | 874,720.00 | |
| COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H | 518,050 | 15.08 | 7,812,194.00 | |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD | 250,774 | 6.64 | 1,665,139.36 | |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H | 156,000 | 8.37 | 1,305,720.00 | |
| SHENZHEN INTL HOLDINGS-R | 127,922 | 8.60 | 1,100,129.20 | |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H | 88,000 | 6.89 | 606,320.00 | |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R | 368,000 | 7.30 | 2,686,400.00 | |
| BYD CO LTD-H | 88,500 | 258.00 | 22,833,000.00 | |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 266,000 | 6.98 | 1,856,680.00 | |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H | 58,400 | 44.40 | 2,592,960.00 | |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 630,000 | 18.92 | 11,919,600.00 | |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H | 352,750 | 24.80 | 8,748,200.00 | |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 358,344 | 8.12 | 2,909,753.28 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| MINTH GROUP LTD | 64,000 | 36.60 | 2,342,400.00 | |
| YADEA GROUP HOLDINGS LTD | 108,000 | 12.64 | 1,365,120.00 | |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 121,000 | 112.70 | 13,636,700.00 | |
| BOSIDENG INTL HLDGS LTD | 438,000 | 4.17 | 1,826,460.00 | |
| HAIER SMART HOME CO LTD-H | 244,600 | 31.55 | 7,717,130.00 | |
| LI NING CO LTD | 237,500 | 75.10 | 17,836,250.00 | |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 84,800 | 150.70 | 12,779,360.00 | |
| CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN | 70,000 | 11.82 | 827,400.00 | |
| CHINA YUHUA EDUCATION CORP L | 96,000 | 2.36 | 226,560.00 | |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI | 116,000 | 17.48 | 2,027,680.00 | |
| JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD | 57,000 | 15.78 | 899,460.00 | |
| TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD | 68,400 | 15.04 | 1,028,736.00 | |
| ALIBABA PICTURES GROUP LTD | 1,450,000 | 0.83 | 1,203,500.00 | |
| CHINA LITERATURE LTD | 51,600 | 50.25 | 2,592,900.00 | |
| KINGSOFT CORP LTD | 92,000 | 36.40 | 3,348,800.00 | |
| KUAISHOU TECHNOLOGY | 52,300 | 83.75 | 4,380,125.00 | |
| NETEASE INC | 214,130 | 160.90 | 34,453,517.00 | |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 626,300 | 455.80 | 285,467,540.00 | |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 1,652,688 | 124.20 | 205,263,849.60 | |
| CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS | 54,000 | 35.00 | 1,890,000.00 | |
| GOME RETAIL HOLDINGS LTD | 1,206,958 | 0.64 | 772,453.12 | |
| HENGTEN NETWORKS GROUP LTD | 268,000 | 2.28 | 611,040.00 | |
| JD HEALTH INTERNATIONAL INC | 47,300 | 66.05 | 3,124,165.00 | |
| JD.COM INC - CL A | 188,388 | 281.40 | 53,012,383.20 | |
| MEITUAN-CLASS B | 444,200 | 214.40 | 95,236,480.00 | |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD | 114,000 | 7.63 | 869,820.00 | |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS | 68,000 | 61.40 | 4,175,200.00 | |
| SUN ART RETAIL GROUP LTD | 259,000 | 3.02 | 782,180.00 | |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B | 15,200 | 113.63 | 1,727,176.00 | |
| CHINA FEIHE LTD | 346,000 | 10.82 | 3,743,720.00 | |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO | 329,000 | 46.30 | 15,232,700.00 | |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDIN | 148,000 | 56.55 | 8,369,400.00 | |
| DALI FOODS GROUP CO LTD | 246,000 | 4.53 | 1,114,380.00 | |
| HUISHAN DAIRY UNTRADE | 435,000 | — | — | |
| NONGFU SPRING CO LTD-H | 193,000 | 43.35 | 8,366,550.00 | |
| SMOORE INTERNATIONAL HOLDING | 195,000 | 36.00 | 7,020,000.00 | |
| TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO | 228,000 | 15.94 | 3,634,320.00 | |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-H | 68,000 | 67.05 | 4,559,400.00 | |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS | 80,000 | 7.51 | 600,800.00 | |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 560,000 | 7.73 | 4,328,800.00 | |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING | 48,000 | 31.30 | 1,502,400.00 | |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD | 87,500 | 39.30 | 3,438,750.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS | 25,000 | 18.52 | 463,000.00 | |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION T | 422,000 | 6.49 | 2,738,780.00 | |
| HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C | 35,200 | 45.50 | 1,601,600.00 | |
| JINXIN FERTILITY GROUP LTD | 124,000 | 8.53 | 1,057,720.00 | |
| MICROPORT SCIENTIFIC CORP | 66,000 | 26.65 | 1,758,900.00 | |
| PING AN HEALTHCARE AND TECHN | 53,700 | 26.70 | 1,433,790.00 | |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H | 244,000 | 10.18 | 2,483,920.00 | |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H | 128,400 | 15.62 | 2,005,608.00 | |
| SINOPHARM GROUP CO-H | 125,200 | 18.50 | 2,316,200.00 | |
| VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H | 20,500 | 27.45 | 562,725.00 | |
| 3SBIO INC | 119,000 | 6.50 | 773,500.00 | |
| AKESO INC | 25,000 | 26.95 | 673,750.00 | |
| CANSINO BIOLOGICS INC-H | 10,000 | 161.20 | 1,612,000.00 | |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING | 100,000 | 14.20 | 1,420,000.00 | |
| CHINA PHARMACEUTICAL GROUP | 956,160 | 9.72 | 9,293,875.20 | |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE ME | 166,000 | 5.51 | 914,660.00 | |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP | 132,000 | 30.35 | 4,006,200.00 | |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H | 5,100 | 95.50 | 487,050.00 | |
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP | 122,000 | 17.88 | 2,181,360.00 | |
| INNOVENT BIOLOGICS INC | 139,000 | 41.10 | 5,712,900.00 | |
| PHARMARON BEIJING CO LTD-H | 22,300 | 114.20 | 2,546,660.00 | |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H | 73,000 | 34.65 | 2,529,450.00 | |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 1,113,000 | 6.04 | 6,722,520.00 | |
| WUXI APPTEC CO LTD-H | 42,288 | 122.30 | 5,171,822.40 | |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 390,000 | 86.85 | 33,871,500.00 | |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 2,825,000 | 2.91 | 8,220,750.00 | |
| BANK OF CHINA LTD-H | 8,801,200 | 3.00 | 26,403,600.00 | |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H | 1,098,475 | 5.15 | 5,657,146.25 | |
| CHINA BOHAI BANK CO LTD-H | 366,500 | 2.19 | 802,635.00 | |
| CHINA CITIC BANK-H | 951,200 | 3.70 | 3,519,440.00 | |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 10,385,620 | 5.86 | 60,859,733.20 | |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 375,000 | 2.95 | 1,106,250.00 | |
| CHINA MERCHANTS BANK-H | 429,923 | 64.65 | 27,794,521.95 | |
| CHINA MINSHENG BANKING-H | 674,400 | 3.18 | 2,144,592.00 | |
| IND&COMM BK OF CHINA-H | 6,265,515 | 4.67 | 29,259,955.05 | |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H | 1,059,000 | 6.34 | 6,714,060.00 | |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H | 832,000 | 1.44 | 1,198,080.00 | |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-H | 483,000 | 4.60 | 2,221,800.00 | |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H | 203,600 | 22.00 | 4,479,200.00 | |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H | 248,500 | 20.20 | 5,019,700.00 | |
| FAR EAST HORIZON LTD | 240,000 | 6.92 | 1,660,800.00 | |
| GF SECURITIES CO LTD-H | 88,600 | 14.48 | 1,282,928.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H | 357,200 | 7.10 | 2,536,120.00 | |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H | 135,600 | 13.70 | 1,857,720.00 | |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H | 918,000 | 13.68 | 12,558,240.00 | |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 296,600 | 23.65 | 7,014,590.00 | |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY | 184,024 | 11.52 | 2,119,956.48 | |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 96,400 | 22.90 | 2,207,560.00 | |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H | 939,000 | 2.49 | 2,338,110.00 | |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H | 689,288 | 7.28 | 5,018,016.64 | |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 695,000 | 61.40 | 42,673,000.00 | |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H | 45,700 | 27.80 | 1,270,460.00 | |
| A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H | 41,500 | 14.36 | 595,940.00 | |
| AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD | 142,000 | 4.00 | 568,000.00 | |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP | 578,000 | 2.80 | 1,618,400.00 | |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R | 415,540 | 23.35 | 9,702,859.00 | |
| CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD | 80,000 | 8.85 | 708,000.00 | |
| CHINA RESOURCES LAND LTD-R | 367,111 | 38.00 | 13,950,218.00 | |
| CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY | 67,600 | 37.85 | 2,558,660.00 | |
| CHINA VANKE CO LTD-H | 178,400 | 21.10 | 3,764,240.00 | |
| CIFI EVER SUNSHINE SERVICES | 64,000 | 13.00 | 832,000.00 | |
| CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD | 564,000 | 5.20 | 2,932,800.00 | |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO | 1,016,654 | 6.67 | 6,781,082.18 | |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD | 191,000 | 42.50 | 8,117,500.00 | |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS | 72,500 | 13.20 | 957,000.00 | |
| GREENTOWN SERVICE GROUP CO L | 180,000 | 7.44 | 1,339,200.00 | |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H | 436,800 | 3.47 | 1,515,696.00 | |
| HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS | 66,000 | 16.08 | 1,061,280.00 | |
| KWG GROUP HOLDINGS LTD | 152,500 | 4.54 | 692,350.00 | |
| LOGAN GROUP CO LTD | 150,000 | 5.94 | 891,000.00 | |
| LONGFOR PROPERTIES | 197,000 | 42.80 | 8,431,600.00 | |
| POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN | 178,000 | 4.33 | 770,740.00 | |
| SEAZEN GROUP LTD | 204,000 | 5.53 | 1,128,120.00 | |
| SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD | 132,500 | 5.60 | 742,000.00 | |
| SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD | 75,000 | 5.82 | 436,500.00 | |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD | 327,000 | 9.46 | 3,093,420.00 | |
| SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD | 163,000 | 8.53 | 1,390,390.00 | |
| WHARF HOLDINGS | 154,000 | 25.50 | 3,927,000.00 | |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD | 115,600 | 7.68 | 887,808.00 | |
| CHINA YOUZAN LTD | 1,456,000 | 0.37 | 546,000.00 | |
| CHINASOFT INTERNATIONAL LTD | 276,000 | 8.77 | 2,420,520.00 | |
| KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR | 311,000 | 23.45 | 7,292,950.00 | |
| MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN | 88,000 | 16.84 | 1,481,920.00 | |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H | 79,000 | 14.24 | 1,124,960.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | WEIMOB INC | 149,000 | 6.82 | 1,016,180.00 | |
| | AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN | 71,500 | 32.00 | 2,288,000.00 | |
| | BYD ELECTRONIC INTL CO LTD | 60,500 | 25.25 | 1,527,625.00 | |
| | KINGBOARD HOLDINGS LTD | 67,000 | 38.70 | 2,592,900.00 | |
| | KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD | 69,000 | 14.02 | 967,380.00 | |
| | LENOVO GROUP LTD | 732,000 | 8.79 | 6,434,280.00 | |
| | SUNNY OPTICAL TECH | 76,800 | 212.80 | 16,343,040.00 | |
| | XIAOMI CORP-CLASS B | 1,405,800 | 18.32 | 25,754,256.00 | |
| | ZTE CORP-H | 82,908 | 22.55 | 1,869,575.40 | |
| | CHINA TOWER CORP LTD-H | 4,566,000 | 0.93 | 4,246,380.00 | |
| | BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R | 59,500 | 28.20 | 1,677,900.00 | |
| | BEIJING ENTERPRISES WATER GR | 610,000 | 3.06 | 1,866,600.00 | |
| | CGN POWER CO LTD-H | 791,000 | 2.32 | 1,835,120.00 | |
| | CHINA GAS HOLDINGS LTD | 305,600 | 14.02 | 4,284,512.00 | |
| | CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 339,000 | 17.90 | 6,068,100.00 | |
| | CHINA POWER INTERNATIONAL | 666,000 | 4.51 | 3,003,660.00 | |
| | CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED | 106,000 | 40.30 | 4,271,800.00 | |
| | CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R | 175,400 | 22.05 | 3,867,570.00 | |
| | ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED | 83,300 | 129.20 | 10,762,360.00 | |
| | GUANGDONG INVESTMENT LTD-R | 320,000 | 10.36 | 3,315,200.00 | |
| | HUANENG POWER INTL INC-H | 370,000 | 4.39 | 1,624,300.00 | |
| | KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED | 360,000 | 7.67 | 2,761,200.00 | |
| | CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV | 650,000 | — | — | |
| | FLAT GLASS GROUP CO LTD-H | 64,000 | 34.00 | 2,176,000.00 | |
| | HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD | 45,000 | 40.80 | 1,836,000.00 | |
| | XINYI SOLAR HOLDINGS LTD | 531,987 | 12.26 | 6,522,160.62 | |
| 香港ドル 小計 | | 95,375,084 | | 1,582,182,372.91<br>(23,210,615,410) | |
| マレーシアリンギット | DIALOG GROUP BHD | 413,668 | 2.70 | 1,116,903.60 | |
| | PETRONAS DAGANGAN BHD | 25,100 | 19.24 | 482,924.00 | |
| | PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 269,900 | 8.98 | 2,423,702.00 | |
| | PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN | 288,600 | 5.88 | 1,696,968.00 | |
| | HAP SENG CONSOLIDATED | 38,200 | 7.60 | 290,320.00 | |
| | SIME DARBY BERHAD | 336,346 | 2.24 | 753,415.04 | |
| | MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD | 106,594 | 5.66 | 603,322.04 | |
| | MISC BHD | 125,040 | 7.01 | 876,530.40 | |
| | WESTPORTS HOLDINGS BHD | 70,000 | 3.85 | 269,500.00 | |
| | GENTING BHD | 188,500 | 4.53 | 853,905.00 | |
| | GENTING MALAYSIA BERHAD | 369,700 | 2.84 | 1,049,948.00 | |
| | FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD | 5,800 | 25.74 | 149,292.00 | |
| | IOI CORPORATION BHD | 270,340 | 3.85 | 1,040,809.00 | |
| | KUALA LUMPUR KEPONG BHD | 35,146 | 21.40 | 752,124.40 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | NESTLE (MALAYSIA) BERHAD | 7,200 | 131.90 | 949,680.00 | |
| | PPB GROUP BERHAD | 73,480 | 16.60 | 1,219,768.00 | |
| | QL RESOURCES BHD | 124,800 | 5.01 | 625,248.00 | |
| | SIME DARBY PLANTATION BHD | 247,046 | 3.98 | 983,243.08 | |
| | HARTALEGA HOLDINGS BHD | 181,300 | 5.74 | 1,040,662.00 | |
| | IHH HEALTHCARE BHD | 229,300 | 6.56 | 1,504,208.00 | |
| | TOP GLOVE CORP BHD | 504,900 | 2.24 | 1,130,976.00 | |
| | AMMB HOLDINGS BHD | 300,700 | 3.52 | 1,058,464.00 | |
| | CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD | 650,575 | 5.33 | 3,467,564.75 | |
| | HONG LEONG BANK BERHAD | 61,292 | 19.50 | 1,195,194.00 | |
| | HONG LEONG FINANCIAL GROUP | 16,633 | 18.40 | 306,047.20 | |
| | MALAYAN BANKING BHD | 571,105 | 8.32 | 4,751,593.60 | |
| | PUBLIC BANK BERHAD | 1,675,000 | 4.18 | 7,001,500.00 | |
| | RHB BANK BHD | 210,820 | 5.76 | 1,214,323.20 | |
| | INARI AMERTRON BHD | 274,700 | 3.28 | 901,016.00 | |
| | AXIATA GROUP BERHAD | 285,289 | 3.77 | 1,075,539.53 | |
| | DIGI.COM BERHAD | 311,700 | 3.91 | 1,218,747.00 | |
| | MAXIS BHD | 267,900 | 4.44 | 1,189,476.00 | |
| | TELECOM MALAYSIA BHD | 70,552 | 5.12 | 361,226.24 | |
| | PETRONAS GAS BHD | 75,500 | 16.74 | 1,263,870.00 | |
| | TENAGA NATIONAL BHD | 305,275 | 9.07 | 2,768,844.25 | |
| マレーシアリンギット 小計 | | 8,988,001 | | 47,586,854.33<br>(1,298,930,775) | |
| タイバーツ | PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR | 134,400 | 127.50 | 17,136,000.00 | |
| | PTT PCL-NVDR | 1,197,400 | 39.00 | 46,698,600.00 | |
| | THAI OIL PCL-NVDR | 120,100 | 52.50 | 6,305,250.00 | |
| | INDORAMA VENTURES PCL-NVDR | 206,400 | 48.50 | 10,010,400.00 | |
| | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 224,934 | 58.25 | 13,102,405.50 | |
| | SCG PACKAGING PCL-NVDR | 100,600 | 61.25 | 6,161,750.00 | |
| | SIAM CEMENT PCL-NVDR | 81,000 | 380.00 | 30,780,000.00 | |
| | AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR | 527,000 | 61.25 | 32,278,750.00 | |
| | BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO | 817,000 | 8.15 | 6,658,550.00 | |
| | BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR | 809,500 | 9.15 | 7,406,925.00 | |
| | ASSET WORLD CORP PCL-NVDR | 810,300 | 4.62 | 3,743,586.00 | |
| | MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | 362,738 | 30.00 | 10,882,140.00 | |
| | CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR | 182,200 | 32.75 | 5,967,050.00 | |
| | HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR | 471,035 | 14.10 | 6,641,593.50 | |
| | PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR | 289,000 | 25.50 | 7,369,500.00 | |
| | BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR | 177,600 | 30.00 | 5,328,000.00 | |
| | CP ALL PCL-NVDR | 691,700 | 58.00 | 40,118,600.00 | |
| | CARABAO GROUP PCL-NVDR | 46,300 | 111.00 | 5,139,300.00 | |
| | CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR | 556,400 | 25.50 | 14,188,200.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | OSOTSPA PCL-NVDR | 66,000 | 33.00 | 2,178,000.00 | |
| | THAI UNION GROUP PCL-NVDR | 184,900 | 19.50 | 3,605,550.00 | |
| | BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR | 1,176,900 | 21.90 | 25,774,110.00 | |
| | BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR | 82,700 | 135.00 | 11,164,500.00 | |
| | SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR | 73,600 | 28.75 | 2,116,000.00 | |
| | KRUNG THAI BANK - NVDR | 438,650 | 13.70 | 6,009,505.00 | |
| | SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR | 88,700 | 122.50 | 10,865,750.00 | |
| | BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR | 165,100 | 20.10 | 3,318,510.00 | |
| | KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR | 101,500 | 59.75 | 6,064,625.00 | |
| | MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR | 89,800 | 58.00 | 5,208,400.00 | |
| | SRISAWAD CORP PCL-NVDR | 76,300 | 63.75 | 4,864,125.00 | |
| | CENTRAL PATTANA PCL-NVDR | 226,300 | 53.00 | 11,993,900.00 | |
| | LAND & HOUSES PUB - NVDR | 872,000 | 8.90 | 7,760,800.00 | |
| | DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR | 38,900 | 398.00 | 15,482,200.00 | |
| | ADVANCED INFO SERVICE-NVDR | 119,700 | 222.00 | 26,573,400.00 | |
| | INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR | 121,850 | 77.75 | 9,473,837.50 | |
| | TRUE CORP PCL-NVDR | 961,409 | 4.88 | 4,691,675.92 | |
| | B GRIMM POWER PCL-NVDR | 53,400 | 38.00 | 2,029,200.00 | |
| | ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR | 16,900 | 173.00 | 2,923,700.00 | |
| | ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR | 129,400 | 94.75 | 12,260,650.00 | |
| | GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR | 68,200 | 85.25 | 5,814,050.00 | |
| | GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR | 288,200 | 50.75 | 14,626,150.00 | |
| | RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR | 54,300 | 44.50 | 2,416,350.00 | |
| タイバーツ 小計 | | 13,300,316 | | 473,131,588.42<br>(1,641,766,611) | |
| フィリピンペソ | ABOITIZ EQUITY VENTURES INC | 237,940 | 62.30 | 14,823,662.00 | |
| | AYALA CORPORATION | 28,280 | 850.00 | 24,038,000.00 | |
| | GT CAPITAL HOLDINGS INC | 6,858 | 552.00 | 3,785,616.00 | |
| | JG SUMMIT HOLDINGS INC | 303,513 | 58.00 | 17,603,754.00 | |
| | SM INVESTMENTS CORP | 22,805 | 959.00 | 21,869,995.00 | |
| | INTL CONTAINER TERM SVCS INC | 96,110 | 204.40 | 19,644,884.00 | |
| | JOLLIBEE FOODS CORPORATION | 61,010 | 230.40 | 14,056,704.00 | |
| | MONDE NISSIN CORP | 490,500 | 16.58 | 8,132,490.00 | |
| | UNIVERSAL ROBINA CORP | 95,560 | 127.00 | 12,136,120.00 | |
| | BANK OF PHILIPPINE ISLANDS | 212,515 | 94.30 | 20,040,164.50 | |
| | BDO UNIBANK INC | 219,911 | 127.90 | 28,126,616.90 | |
| | METROPOLITAN BANK & TRUST | 161,287 | 58.00 | 9,354,646.00 | |
| | METRO PACIFIC INVESTMENTS CO | 2,355,700 | 3.88 | 9,140,116.00 | |
| | AYALA LAND INC | 794,100 | 35.00 | 27,793,500.00 | |
| | SM PRIME HOLDINGS INC | 1,003,150 | 34.35 | 34,458,202.50 | |
| | GLOBE TELECOM INC | 4,690 | 3,360.00 | 15,758,400.00 | |
| | PLDT INC | 10,460 | 1,888.00 | 19,748,480.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | AC ENERGY CORP | 737,000 | 9.50 | 7,001,500.00 | |
| | MANILA ELECTRIC COMPANY | 29,110 | 309.00 | 8,994,990.00 | |
| フィリピンペソ 小計 | | 6,870,499 | | 316,507,840.90<br>(702,299,248) | |
| インドネシアルピア | ADARO ENERGY PT | 1,439,300 | 2,230.00 | 3,209,639,000.00 | |
| | UNITED TRACTORS TBK PT | 200,900 | 23,250.00 | 4,670,925,000.00 | |
| | ANEKA TAMBANG TBK PT | 985,800 | 1,725.00 | 1,700,505,000.00 | |
| | BARITO PACIFIC TBK PT | 2,882,500 | 820.00 | 2,363,650,000.00 | |
| | INDAH KIAT PULP & PAPER TBK | 244,200 | 7,500.00 | 1,831,500,000.00 | |
| | INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA | 190,000 | 10,675.00 | 2,028,250,000.00 | |
| | MERDEKA COPPER GOLD TBK PT | 1,542,100 | 3,840.00 | 5,921,664,000.00 | |
| | SEMEN INDONESIA PERSERO TBK | 345,600 | 6,675.00 | 2,306,880,000.00 | |
| | ASTRA INTERNATIONAL TBK PT | 2,218,400 | 5,600.00 | 12,423,040,000.00 | |
| | CHAROEN POKPHAND INDONESI PT | 792,300 | 6,400.00 | 5,070,720,000.00 | |
| | GUDANG GARAM TBK PT | 59,600 | 31,125.00 | 1,855,050,000.00 | |
| | INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T | 161,000 | 8,750.00 | 1,408,750,000.00 | |
| | INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT | 429,100 | 6,425.00 | 2,756,967,500.00 | |
| | UNILEVER INDONESIA TBK PT | 746,400 | 4,100.00 | 3,060,240,000.00 | |
| | KALBE FARMA TBK PT | 2,755,900 | 1,700.00 | 4,685,030,000.00 | |
| | BANK CENTRAL ASIA PT | 5,772,500 | 7,675.00 | 44,303,937,500.00 | |
| | BANK MANDIRI | 2,163,796 | 7,025.00 | 15,200,666,900.00 | |
| | BANK NEGARA INDONESIA PT | 810,200 | 7,100.00 | 5,752,420,000.00 | |
| | PT BANK RAKYAT INDONESIA | 7,392,902 | 4,130.00 | 30,532,685,260.00 | |
| | SARANA MENARA NUSANTARA PT | 2,840,600 | 1,030.00 | 2,925,818,000.00 | |
| | TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK | 5,601,300 | 4,250.00 | 23,805,525,000.00 | |
| | TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE | 1,076,100 | 2,960.00 | 3,185,256,000.00 | |
| インドネシアルピア 小計 | | 40,650,498 | | 180,999,119,160.00<br>(1,447,992,953) | |
| 韓国ウォン | GS HOLDINGS CORP | 6,593 | 39,850.00 | 262,731,050.00 | |
| | S-OIL CORPORATION | 4,447 | 95,200.00 | 423,354,400.00 | |
| | SK INNOVATION CO LTD | 5,586 | 261,500.00 | 1,460,739,000.00 | |
| | HANWHA SOLUTIONS CORPORATION | 12,381 | 38,800.00 | 480,382,800.00 | |
| | HYUNDAI STEEL CO | 11,189 | 42,500.00 | 475,532,500.00 | |
| | KOREA ZINC CO LTD | 783 | 555,000.00 | 434,565,000.00 | |
| | KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD | 1,898 | 164,000.00 | 311,272,000.00 | |
| | LG CHEM LTD | 4,869 | 653,000.00 | 3,179,457,000.00 | |
| | LG CHEM LTD-PREFERENCE | 877 | 309,500.00 | 271,431,500.00 | |
| | LOTTE CHEMICAL CORPORATION | 1,930 | 213,000.00 | 411,090,000.00 | |
| | POSCO | 8,093 | 284,500.00 | 2,302,458,500.00 | |
| | POSCO CHEMICAL CO LTD | 3,350 | 125,500.00 | 420,425,000.00 | |
| | SK CHEMICALS CO LTD/NEW | 1,122 | 138,500.00 | 155,397,000.00 | |
| | SK IE TECHNOLOGY CO LTD | 1,500 | 141,500.00 | 212,250,000.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| SKC CO LTD | 1,734 | 153,000.00 | 265,302,000.00 | |
| CJ CORP | 1,230 | 79,700.00 | 98,031,000.00 | |
| DOOSAN BOBCAT INC | 4,308 | 39,650.00 | 170,812,200.00 | |
| DOOSAN HEAVY INDUSTRIES | 37,707 | 19,100.00 | 720,203,700.00 | |
| ECOPRO BM CO LTD | 1,170 | 431,900.00 | 505,323,000.00 | |
| GS ENGINEERING & CONSTRUCT | 6,760 | 40,700.00 | 275,132,000.00 | |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONST | 9,768 | 42,700.00 | 417,093,600.00 | |
| HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL | 5,180 | 51,000.00 | 264,180,000.00 | |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES | 7,139 | 34,800.00 | 248,437,200.00 | |
| KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR | 4,354 | 91,300.00 | 397,520,200.00 | |
| LG CORP | 9,026 | 78,100.00 | 704,930,600.00 | |
| SAMSUNG C&T CORP | 8,727 | 111,000.00 | 968,697,000.00 | |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD | 18,516 | 23,300.00 | 431,422,800.00 | |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES | 59,306 | 5,450.00 | 323,217,700.00 | |
| SK INC | 4,545 | 235,500.00 | 1,070,347,500.00 | |
| S-1 CORPORATION | 840 | 71,100.00 | 59,724,000.00 | |
| CJ LOGISTICS | 862 | 120,000.00 | 103,440,000.00 | |
| HMM CO LTD | 25,309 | 24,350.00 | 616,274,150.00 | |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD | 1,586 | 164,000.00 | 260,104,000.00 | |
| KOREAN AIR LINES CO LTD | 23,739 | 27,550.00 | 654,009,450.00 | |
| STX PAN OCEAN CO LTD | 29,736 | 5,170.00 | 153,735,120.00 | |
| HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO | 7,066 | 36,050.00 | 254,729,300.00 | |
| HANON SYSTEMS | 19,000 | 11,550.00 | 219,450,000.00 | |
| HYUNDAI MOBIS | 7,116 | 240,000.00 | 1,707,840,000.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO | 14,897 | 200,500.00 | 2,986,848,500.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD | 3,051 | 100,500.00 | 306,625,500.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD | 3,449 | 98,500.00 | 339,726,500.00 | |
| KIA CORP | 29,259 | 81,000.00 | 2,369,979,000.00 | |
| COWAY CO LTD | 5,058 | 71,400.00 | 361,141,200.00 | |
| F&F CO LTD / NEW | 320 | 878,000.00 | 280,960,000.00 | |
| HLB INC | 10,012 | 32,850.00 | 328,894,200.00 | |
| LG ELECTRONICS INC | 11,019 | 137,000.00 | 1,509,603,000.00 | |
| KANGWON LAND INC | 7,703 | 25,350.00 | 195,271,050.00 | |
| CHEIL COMMUNICATIONS INC | 5,070 | 22,300.00 | 113,061,000.00 | |
| HYBE CO LTD | 1,547 | 274,500.00 | 424,651,500.00 | |
| KAKAO CORP | 34,497 | 90,400.00 | 3,118,528,800.00 | |
| KAKAO GAMES CORP | 3,021 | 68,000.00 | 205,428,000.00 | |
| KRAFTON INC | 2,345 | 324,500.00 | 760,952,500.00 | |
| NAVER CORP | 13,595 | 332,500.00 | 4,520,337,500.00 | |
| NCSOFT CORPORATION | 1,939 | 582,000.00 | 1,128,498,000.00 | |
| NETMARBLE CORP | 2,465 | 105,500.00 | 260,057,500.00 | |
| PEARL ABYSS CORP | 4,605 | 107,500.00 | 495,037,500.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CJ ENM CO LTD | 830 | 130,300.00 | 108,149,000.00 | |
| HOTEL SHILLA CO LTD | 3,051 | 73,900.00 | 225,468,900.00 | |
| LOTTE SHOPPING CO | 1,034 | 82,400.00 | 85,201,600.00 | |
| BGF RETAIL CO LTD/NEW | 549 | 159,500.00 | 87,565,500.00 | |
| EMART | 1,864 | 142,000.00 | 264,688,000.00 | |
| CJ CHEILJEDANG CORP | 775 | 367,000.00 | 284,425,000.00 | |
| KT&G CORP | 13,223 | 79,000.00 | 1,044,617,000.00 | |
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA | 3,142 | 102,000.00 | 320,484,000.00 | |
| AMOREPACIFIC CORP | 3,762 | 150,000.00 | 564,300,000.00 | |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE | 956 | 955,000.00 | 912,980,000.00 | |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF | 389 | 545,000.00 | 212,005,000.00 | |
| PACIFIC CORP | 3,393 | 41,050.00 | 139,282,650.00 | |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD | 8,851 | 66,800.00 | 591,246,800.00 | |
| SD BIOSENSOR INC | 3,909 | 51,400.00 | 200,922,600.00 | |
| ALTEOGEN INC | 2,841 | 57,100.00 | 162,221,100.00 | |
| CELLTRION INC | 10,890 | 167,000.00 | 1,818,630,000.00 | |
| CELLTRION PHARM INC | 1,968 | 88,900.00 | 174,955,200.00 | |
| GREEN CROSS CORP | 564 | 185,500.00 | 104,622,000.00 | |
| HANMI PHARM CO LTD | 508 | 251,500.00 | 127,762,000.00 | |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD | 1,870 | 816,000.00 | 1,525,920,000.00 | |
| SEEGENE INC | 3,838 | 54,200.00 | 208,019,600.00 | |
| SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO | 3,049 | 24,600.00 | 75,005,400.00 | |
| SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD | 3,197 | 85,200.00 | 272,384,400.00 | |
| SK BIOSCIENCE CO LTD | 2,100 | 186,000.00 | 390,600,000.00 | |
| YUHAN CORPORATION | 6,107 | 59,500.00 | 363,366,500.00 | |
| HANA FINANCIAL GROUP | 33,962 | 46,950.00 | 1,594,515,900.00 | |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA | 28,330 | 10,650.00 | 301,714,500.00 | |
| KAKAOBANK CORP | 10,063 | 41,800.00 | 420,633,400.00 | |
| KB FINANCIAL GROUP INC | 42,887 | 61,900.00 | 2,654,705,300.00 | |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD | 50,883 | 39,500.00 | 2,009,878,500.00 | |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC | 59,406 | 15,050.00 | 894,060,300.00 | |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO | 4,602 | 77,500.00 | 356,655,000.00 | |
| MERITZ SECURITIES CO LTD | 47,904 | 6,460.00 | 309,459,840.00 | |
| MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD | 31,015 | 8,440.00 | 261,766,600.00 | |
| NH INVESTMENT & SECURITIES C | 12,107 | 11,800.00 | 142,862,600.00 | |
| SAMSUNG SECURITIES CO LTD | 5,776 | 41,650.00 | 240,570,400.00 | |
| DB INSURANCE CO LTD | 4,209 | 65,000.00 | 273,585,000.00 | |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INS | 3,108 | 216,500.00 | 672,882,000.00 | |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO | 7,417 | 66,100.00 | 490,263,700.00 | |
| DOUZONE BIZON CO LTD | 1,451 | 58,800.00 | 85,318,800.00 | |
| SAMSUNG SDS CO LTD | 3,725 | 148,000.00 | 551,300,000.00 | |
| ILJIN MATERIALS CO LTD | 2,166 | 107,500.00 | 232,845,000.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | L&F CO LTD | 2,281 | 194,100.00 | 442,742,100.00 | |
| | LG DISPLAY CO LTD | 24,071 | 22,700.00 | 546,411,700.00 | |
| | LG INNOTEK CO LTD | 1,415 | 371,500.00 | 525,672,500.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO | 6,845 | 187,500.00 | 1,283,437,500.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 520,395 | 76,300.00 | 39,706,138,500.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF | 88,687 | 70,600.00 | 6,261,302,200.00 | |
| | SAMSUNG SDI CO LTD | 5,892 | 661,000.00 | 3,894,612,000.00 | |
| | LG UPLUS CORP | 22,125 | 13,200.00 | 292,050,000.00 | |
| | SK TELECOM | 9,599 | 55,800.00 | 535,624,200.00 | |
| | KOREA ELECTRIC POWER CORP | 26,459 | 20,950.00 | 554,316,050.00 | |
| | SK HYNIX INC | 60,303 | 127,000.00 | 7,658,481,000.00 | |
| | SK SQUARE CO LTD | 6,205 | 62,300.00 | 386,571,500.00 | |
| **韓国ウォン 小計** | | 1,719,142 | | 125,241,841,860.00<br>(12,048,265,186) | |
| 新台湾ドル | FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | 112,240 | 98.20 | 11,021,968.00 | |
| | ASIA CEMENT CORP | 234,176 | 44.40 | 10,397,414.40 | |
| | CHINA STEEL | 1,266,261 | 34.05 | 43,116,187.05 | |
| | FORMOSA CHEMICALS & FIBRE | 420,061 | 79.90 | 33,562,873.90 | |
| | FORMOSA PLASTICS CORP | 441,824 | 106.00 | 46,833,344.00 | |
| | NAN YA PLASTICS CORP | 561,752 | 87.40 | 49,097,124.80 | |
| | TAIWAN CEMENT | 589,511 | 47.60 | 28,060,723.60 | |
| | AIRTAC INTERNATIONAL GROUP | 12,557 | 960.00 | 12,054,720.00 | |
| | FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION | 348,028 | 29.15 | 10,145,016.20 | |
| | HIWIN TECHNOLOGIES CORP | 23,207 | 275.00 | 6,381,925.00 | |
| | VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY | 6,000 | 1,495.00 | 8,970,000.00 | |
| | EVERGREEN MARINE | 266,039 | 122.50 | 32,589,777.50 | |
| | TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP | 150,000 | 28.80 | 4,320,000.00 | |
| | WAN HAI LINES LIMITED | 64,900 | 161.50 | 10,481,350.00 | |
| | YANG MING MARINE TRANSPORT | 180,000 | 104.00 | 18,720,000.00 | |
| | CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD | 177,061 | 35.35 | 6,259,106.35 | |
| | ECLAT TEXTILE COMPANY LTD | 19,937 | 608.00 | 12,121,696.00 | |
| | FENG TAY ENTERPRISE CO LTD | 43,448 | 236.50 | 10,275,452.00 | |
| | GIANT MANUFACTURING | 34,464 | 325.50 | 11,218,032.00 | |
| | NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD | 16,000 | 394.50 | 6,312,000.00 | |
| | POU CHEN | 273,780 | 32.55 | 8,911,539.00 | |
| | HOTAI MOTOR COMPANY LTD | 30,000 | 607.00 | 18,210,000.00 | |
| | MOMO.COM INC | 5,000 | 1,505.00 | 7,525,000.00 | |
| | PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 59,544 | 271.50 | 16,166,196.00 | |
| | UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 494,395 | 68.30 | 33,767,178.50 | |
| | ONENESS BIOTECH CO LTD | 20,000 | 246.00 | 4,920,000.00 | |
| | CHANG HWA COMMERCIAL BANK | 587,664 | 18.00 | 10,577,952.00 | |
| | CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD | 2,011,237 | 27.80 | 55,912,388.60 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| E.SUN FINANCIAL HOLDING CO | 1,397,452 | 29.00 | 40,526,108.00 | |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO | 1,248,238 | 25.35 | 31,642,833.30 | |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C | 1,059,344 | 22.40 | 23,729,305.60 | |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT | 1,211,339 | 37.00 | 44,819,543.00 | |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS | 1,156,889 | 16.95 | 19,609,268.55 | |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDING | 1,009,432 | 20.55 | 20,743,827.60 | |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL | 1,078,434 | 27.00 | 29,117,718.00 | |
| THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA | 451,861 | 48.50 | 21,915,258.50 | |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD | 144,167 | 257.50 | 37,123,002.50 | |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD | 1,056,159 | 25.70 | 27,143,286.30 | |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO | 888,123 | 66.10 | 58,704,930.30 | |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL | 1,896,226 | 18.85 | 35,743,860.10 | |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO | 810,435 | 78.80 | 63,862,278.00 | |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING | 1,262,866 | 11.55 | 14,586,102.30 | |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 206,724 | 66.00 | 13,643,784.00 | |
| ACCTON TECHNOLOGY CORP | 48,000 | 267.50 | 12,840,000.00 | |
| ACER INC | 255,803 | 30.70 | 7,853,152.10 | |
| ADVANTECH CO LTD | 43,336 | 389.50 | 16,879,372.00 | |
| ASUSTEK COMPUTER INC | 72,092 | 378.00 | 27,250,776.00 | |
| AU OPTRONICS CORP | 945,090 | 21.75 | 20,555,707.50 | |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 69,700 | 161.50 | 11,256,550.00 | |
| CHIMEI INNOLUX CORPORATION | 1,049,000 | 18.40 | 19,301,600.00 | |
| COMPAL ELECTRONICS | 431,760 | 25.45 | 10,988,292.00 | |
| DELTA ELECTRONICS INC | 217,903 | 275.00 | 59,923,325.00 | |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD | 92,850 | 62.00 | 5,756,700.00 | |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY | 1,368,248 | 103.50 | 141,613,668.00 | |
| INVENTEC CO LTD | 280,511 | 25.15 | 7,054,851.65 | |
| LARGAN PRECISION CO LTD | 11,040 | 2,100.00 | 23,184,000.00 | |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 225,452 | 63.60 | 14,338,747.20 | |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO | 60,000 | 158.00 | 9,480,000.00 | |
| NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD | 21,000 | 519.00 | 10,899,000.00 | |
| PEGATRON CORP | 200,474 | 71.00 | 14,233,654.00 | |
| QUANTA COMPUTER INC | 286,270 | 93.40 | 26,737,618.00 | |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP | 128,100 | 68.00 | 8,710,800.00 | |
| UNIMICRON TECHNOLOGY CORP | 141,000 | 215.50 | 30,385,500.00 | |
| WISTRON CORP | 242,695 | 30.95 | 7,511,410.25 | |
| WIWYNN CORP | 8,000 | 1,085.00 | 8,680,000.00 | |
| WPG HOLDINGS LTD | 143,692 | 54.40 | 7,816,844.80 | |
| YAGEO CORPORATION | 38,764 | 487.50 | 18,897,450.00 | |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING | 59,922 | 101.00 | 6,052,122.00 | |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 410,315 | 117.00 | 48,006,855.00 | |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD | 157,000 | 64.90 | 10,189,300.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | TAIWAN MOBILE CO LTD | 192,200 | 101.00 | 19,412,200.00 | |
| | ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT | 359,315 | 105.00 | 37,728,075.00 | |
| | ASMEDIA TECHNOLOGY INC | 3,000 | 1,580.00 | 4,740,000.00 | |
| | EMEMORY TECHNOLOGY INC | 6,000 | 1,755.00 | 10,530,000.00 | |
| | GLOBALWAFERS CO LTD | 24,000 | 795.00 | 19,080,000.00 | |
| | MEDIATEK INC | 165,804 | 1,100.00 | 182,384,400.00 | |
| | NANYA TECHNOLOGY CORP | 115,000 | 75.20 | 8,648,000.00 | |
| | NOVATEK MICROELECTRONICS LTD | 58,045 | 506.00 | 29,370,770.00 | |
| | PARADE TECHNOLOGIES LTD | 8,000 | 1,990.00 | 15,920,000.00 | |
| | REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | 50,944 | 541.00 | 27,560,704.00 | |
| | SILERGY CORP | 9,000 | 3,820.00 | 34,380,000.00 | |
| | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 2,677,389 | 654.00 | 1,751,012,406.00 | |
| | UNITED MICROELECTRONICS CORP | 1,316,000 | 62.80 | 82,644,800.00 | |
| | VANGUARD INTERNATIONAL SEMI | 89,000 | 138.50 | 12,326,500.00 | |
| | WIN SEMICONDUCTORS CORP | 32,000 | 333.00 | 10,656,000.00 | |
| | WINBOND ELECTRONICS CORP | 349,000 | 30.45 | 10,627,050.00 | |
| 新台湾ドル 小計 | | 35,789,489 | | 3,854,258,271.45<br>(15,938,514,229) | |
| インドルピー | BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 96,221 | 394.35 | 37,944,751.35 | |
| | COAL INDIA LTD | 180,326 | 163.90 | 29,555,431.40 | |
| | HINDUSTAN PETROLEUM CORP | 59,425 | 324.35 | 19,274,498.75 | |
| | INDIAN OIL CORP LTD | 193,765 | 125.10 | 24,240,001.50 | |
| | OIL & NATURAL GAS CORP LTD | 252,709 | 170.25 | 43,023,707.25 | |
| | PETRONET LNG LTD | 83,779 | 218.20 | 18,280,577.80 | |
| | RELIANCE INDUSTRIES LTD | 309,735 | 2,521.60 | 781,027,776.00 | |
| | ACC LTD | 5,315 | 2,231.80 | 11,862,017.00 | |
| | AMBUJA CEMENTS LTD | 73,533 | 374.85 | 27,563,845.05 | |
| | ASIAN PAINTS LTD | 42,204 | 3,280.40 | 138,446,001.60 | |
| | BERGER PAINTS INDIA LTD | 29,449 | 748.45 | 22,041,104.05 | |
| | GRASIM INDUSTRIES LTD | 31,529 | 1,806.50 | 56,957,138.50 | |
| | HINDALCO INDUSTRIES LTD | 180,501 | 504.80 | 91,116,904.80 | |
| | JSW STEEL LTD | 99,332 | 674.65 | 67,014,333.80 | |
| | PI INDUSTRIES LTD | 8,147 | 2,692.80 | 21,938,241.60 | |
| | PIDILITE INDUSTRIES LTD | 18,199 | 2,673.40 | 48,653,206.60 | |
| | SHREE CEMENT LTD | 1,387 | 26,402.25 | 36,619,920.75 | |
| | SRF LTD | 14,609 | 2,556.90 | 37,353,752.10 | |
| | TATA STEEL LTD | 77,326 | 1,209.60 | 93,533,529.60 | |
| | ULTRATECH CEMENT LTD | 11,556 | 7,434.40 | 85,911,926.40 | |
| | UNITED PHOSPHORUS LTD | 54,204 | 813.25 | 44,081,403.00 | |
| | VEDANTA LTD | 147,245 | 324.60 | 47,795,727.00 | |
| | ADANI ENTERPRISES LTD | 26,979 | 1,849.30 | 49,892,264.70 | |
| | BHARAT ELECTRONICS LTD | 116,287 | 208.15 | 24,205,139.05 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| HAVELLS INDIA LTD | 23,476 | 1,308.75 | 30,724,215.00 | |
| LARSEN & TOUBRO LTD | 71,836 | 2,020.90 | 145,173,372.40 | |
| SIEMENS INDIA LTD | 5,926 | 2,380.35 | 14,105,954.10 | |
| INDIAN RAILWAY CATERING & TO | 22,993 | 875.95 | 20,140,718.35 | |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE | 64,743 | 744.20 | 48,181,740.60 | |
| CONTAINER CORP OF INDIA LTD | 26,455 | 671.20 | 17,756,596.00 | |
| INTERGLOBE AVIATION LTD | 8,360 | 2,079.50 | 17,384,620.00 | |
| BAJAJ AUTO LTD | 9,644 | 3,436.80 | 33,144,499.20 | |
| BALKRISHNA INDUSTRIES LTD | 8,831 | 2,504.25 | 22,115,031.75 | |
| BHARAT FORGE LTD | 30,322 | 758.35 | 22,994,688.70 | |
| EICHER MOTORS LTD | 14,685 | 2,718.70 | 39,924,109.50 | |
| HERO MOTOCORP LTD | 12,238 | 2,699.80 | 33,040,152.40 | |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD | 101,669 | 894.40 | 90,932,753.60 | |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD | 15,707 | 8,015.70 | 125,902,599.90 | |
| MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD | 124,426 | 184.50 | 22,956,597.00 | |
| MRF LTD | 133 | 76,529.85 | 10,178,470.05 | |
| TATA MOTORS LTD | 190,082 | 520.85 | 99,004,209.70 | |
| PAGE INDUSTRIES LTD | 601 | 43,390.40 | 26,077,630.40 | |
| TITAN INDUSTRIES LTD | 40,781 | 2,588.90 | 105,577,930.90 | |
| JUBILANT FOODWORKS LTD | 8,786 | 3,741.50 | 32,872,819.00 | |
| INFO EDGE INDIA LTD | 7,855 | 5,016.70 | 39,406,178.50 | |
| TRENT LTD | 19,255 | 1,167.55 | 22,481,175.25 | |
| ZOMATO LTD | 170,264 | 129.20 | 21,998,108.80 | |
| AVENUE SUPERMARTS LTD | 17,524 | 4,483.40 | 78,567,101.60 | |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD | 11,474 | 3,575.65 | 41,027,008.10 | |
| ITC LTD | 345,135 | 220.35 | 76,050,497.25 | |
| NESTLE INDIA LIMITED | 3,906 | 18,937.00 | 73,967,922.00 | |
| TATA CONSUMER PRODUCTS LTD | 61,013 | 717.65 | 43,785,979.45 | |
| UNITED SPIRITS LTD | 32,483 | 923.55 | 29,999,674.65 | |
| COLGATE-PALMOLIVE (INDIA) | 9,566 | 1,447.45 | 13,846,306.70 | |
| DABUR INDIA LTD | 58,111 | 568.55 | 33,039,009.05 | |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 38,464 | 937.55 | 36,061,923.20 | |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD | 89,298 | 2,309.90 | 206,269,450.20 | |
| MARICO LTD | 42,465 | 494.40 | 20,994,696.00 | |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE | 10,114 | 4,515.95 | 45,674,318.30 | |
| AUROBINDO PHARMA LTD | 35,415 | 670.50 | 23,745,757.50 | |
| BIOCON LTD | 58,256 | 367.35 | 21,400,341.60 | |
| CIPLA LTD | 49,816 | 895.65 | 44,617,700.40 | |
| DIVI'S LABORATORIES LTD | 14,782 | 4,481.50 | 66,245,533.00 | |
| DR. REDDY'S LABORATORIES | 12,644 | 4,684.95 | 59,236,507.80 | |
| LUPIN LTD | 26,552 | 959.45 | 25,475,316.40 | |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS | 97,015 | 838.50 | 81,347,077.50 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | TORRENT PHARMACEUTICALS LTD | 6,110 | 3,201.15 | 19,559,026.50 | |
| | AXIS BANK LTD | 247,821 | 729.60 | 180,810,201.60 | |
| | BANDHAN BANK LTD | 74,811 | 303.60 | 22,712,619.60 | |
| | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE | 187,327 | 2,620.25 | 490,843,571.75 | |
| | ICICI BANK LTD | 563,039 | 808.60 | 455,273,335.40 | |
| | KOTAK MAHINDRA BANK LTD | 62,523 | 1,905.65 | 119,146,954.95 | |
| | STATE BANK OF INDIA | 187,504 | 515.80 | 96,714,563.20 | |
| | YES BANK LTD | 1,020,164 | 13.80 | 14,078,263.20 | |
| | BAJAJ FINANCE LTD | 30,037 | 7,571.80 | 227,434,156.60 | |
| | BAJAJ FINSERV LTD | 3,888 | 18,077.30 | 70,284,542.40 | |
| | CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND | 38,543 | 612.10 | 23,592,170.30 | |
| | HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD | 4,095 | 2,394.20 | 9,804,249.00 | |
| | MUTHOOT FINANCE LTD | 12,423 | 1,475.10 | 18,325,167.30 | |
| | PIRAMAL ENTERPRISES LTD | 11,722 | 2,570.60 | 30,132,573.20 | |
| | SBI CARDS & PAYMENT SERVICES | 31,013 | 870.35 | 26,992,164.55 | |
| | SHRIRAM TRANSPORT FINANCE | 21,216 | 1,195.30 | 25,359,484.80 | |
| | HDFC LIFE INSURANCE CO LTD | 94,500 | 656.05 | 61,996,725.00 | |
| | ICICI LOMBARD GENERAL INSURA | 23,540 | 1,423.00 | 33,497,420.00 | |
| | ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA | 31,732 | 573.80 | 18,207,821.60 | |
| | SBI LIFE INSURANCE CO LTD | 53,770 | 1,248.10 | 67,110,337.00 | |
| | DLF LTD | 56,420 | 408.25 | 23,033,465.00 | |
| | GODREJ PROPERTIES LTD | 12,724 | 1,851.20 | 23,554,668.80 | |
| | HCL TECHNOLOGIES LTD | 123,161 | 1,199.20 | 147,694,671.20 | |
| | INFOSYS LTD | 370,852 | 1,867.05 | 692,399,226.60 | |
| | LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD | 5,756 | 6,697.05 | 38,548,219.80 | |
| | MINDTREE LTD | 6,247 | 4,226.20 | 26,401,071.40 | |
| | MPHASIS LTD | 7,796 | 3,088.25 | 24,075,997.00 | |
| | TATA CONSULTANCY SVCS LTD | 102,286 | 3,914.65 | 400,413,889.90 | |
| | TECH MAHINDRA LTD | 72,109 | 1,670.10 | 120,429,240.90 | |
| | WIPRO LTD | 144,908 | 621.15 | 90,009,604.20 | |
| | BHARTI AIRTEL LTD | 266,977 | 703.70 | 187,871,714.90 | |
| | INDUS TOWERS LTD | 90,578 | 270.70 | 24,519,464.60 | |
| | ADANI GREEN ENERGY LTD | 42,580 | 1,938.45 | 82,539,201.00 | |
| | ADANI TOTAL GAS LTD | 26,949 | 1,794.90 | 48,370,760.10 | |
| | ADANI TRANSMISSION LTD | 27,228 | 2,043.25 | 55,633,611.00 | |
| | GAIL INDIA LTD | 174,768 | 147.95 | 25,856,925.60 | |
| | INDRAPRASTHA GAS LTD | 26,724 | 438.60 | 11,721,146.40 | |
| | NTPC LTD | 513,123 | 134.80 | 69,168,980.40 | |
| | POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 327,337 | 204.65 | 66,989,517.05 | |
| | TATA POWER CO LTD | 145,582 | 248.50 | 36,177,127.00 | |
| インドルピー 小計 | | 9,356,746 | | 8,129,043,342.25<br>(12,600,017,180) | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| カタールリアル | QATAR FUEL QSC | 60,443 | 18.10 | 1,094,018.30 | |
| | QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT) | 296,777 | 3.47 | 1,031,893.62 | |
| | MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI | 443,925 | 2.45 | 1,089,835.87 | |
| | INDUSTRIES QATAR | 196,788 | 16.80 | 3,306,038.40 | |
| | COMMERCIAL BANK QSC | 203,990 | 7.43 | 1,516,257.67 | |
| | MASRAF AL RAYAN | 406,540 | 5.16 | 2,097,746.40 | |
| | QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC | 98,559 | 10.24 | 1,009,244.16 | |
| | QATAR ISLAMIC BANK | 114,230 | 20.10 | 2,296,023.00 | |
| | QATAR NATIONAL BANK | 484,445 | 21.80 | 10,560,901.00 | |
| | BARWA REAL ESTATE CO | 207,490 | 3.40 | 705,466.00 | |
| | OOREDOO QSC | 72,800 | 7.23 | 526,344.00 | |
| | QATAR ELECTRICITY & WATER CO | 62,421 | 17.17 | 1,071,768.57 | |
| カタールリアル 小計 | | 2,648,408 | | 26,305,536.99<br>(823,626,363) | |
| 南アフリカランド | EXXARO RESOURCES LTD | 22,520 | 180.15 | 4,056,978.00 | |
| | AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD | 14,670 | 245.11 | 3,595,763.70 | |
| | ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED | 6,119 | 1,805.57 | 11,048,282.83 | |
| | ANGLOGOLD ASHANTI LTD | 39,424 | 296.08 | 11,672,657.92 | |
| | GOLD FIELDS LTD | 97,102 | 157.00 | 15,245,014.00 | |
| | HARMONY GOLD MINING CO LTD | 56,301 | 59.69 | 3,360,606.69 | |
| | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 91,758 | 229.99 | 21,103,422.42 | |
| | KUMBA IRON ORE LTD | 5,372 | 543.21 | 2,918,124.12 | |
| | NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT | 33,950 | 208.76 | 7,087,402.00 | |
| | SASOL LTD | 57,207 | 315.81 | 18,066,542.67 | |
| | SIBANYE STILLWATER LTD | 313,727 | 58.65 | 18,400,088.55 | |
| | BIDVEST GROUP LTD | 27,702 | 192.98 | 5,345,931.96 | |
| | MULTICHOICE GROUP LTD | 40,529 | 118.24 | 4,792,148.96 | |
| | MR PRICE GROUP LTD | 28,510 | 211.96 | 6,042,979.60 | |
| | NASPERS LTD-N SHS | 23,206 | 2,521.59 | 58,516,017.54 | |
| | PEPKOR HOLDINGS LTD | 144,533 | 23.50 | 3,396,525.50 | |
| | WOOLWORTHS HOLDINGS LTD | 110,495 | 54.90 | 6,066,175.50 | |
| | BID CORP LTD | 35,017 | 332.57 | 11,645,603.69 | |
| | CLICKS GROUP LTD | 26,921 | 313.89 | 8,450,232.69 | |
| | SHOPRITE HOLDINGS LTD | 60,003 | 207.76 | 12,466,223.28 | |
| | SPAR GROUP LIMITED/THE | 23,274 | 174.71 | 4,066,200.54 | |
| | TIGER BRANDS LTD | 13,023 | 182.31 | 2,374,223.13 | |
| | ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 37,244 | 205.00 | 7,635,020.00 | |
| | ABSA GROUP LTD | 73,296 | 161.41 | 11,830,707.36 | |
| | CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | 8,544 | 2,019.00 | 17,250,336.00 | |
| | NEDBANK GROUP LTD | 44,497 | 183.00 | 8,142,951.00 | |
| | STANDARD BANK GROUP LTD | 150,257 | 143.91 | 21,623,484.87 | |
| | FIRSTRAND LTD | 560,323 | 64.77 | 36,292,120.71 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | REINET INVESTMENTS SCA | 17,187 | 304.41 | 5,231,894.67 | |
| | REMGRO LTD | 55,441 | 130.99 | 7,262,216.59 | |
| | DISCOVERY LIMITED | 48,488 | 143.37 | 6,951,724.56 | |
| | OLD MUTUAL LTD | 489,612 | 13.67 | 6,692,996.04 | |
| | RAND MERCHANT INVESTMENT HD | 101,268 | 45.59 | 4,616,808.12 | |
| | SANLAM LTD | 214,053 | 61.35 | 13,132,151.55 | |
| | NEPI ROCKCASTLE PLC | 60,556 | 106.11 | 6,425,597.16 | |
| | MTN GROUP LTD | 194,516 | 163.78 | 31,857,830.48 | |
| | VODACOM GROUP | 62,331 | 134.68 | 8,394,739.08 | |
| 南アフリカランド 小計 | | 3,388,976 | | 433,057,723.48<br>(3,234,941,194) | |
| アラブ首長国連邦ディルハム | ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO | 271,405 | 4.18 | 1,134,472.90 | |
| | ABU DHABI COMMERCIAL BANK | 327,038 | 8.73 | 2,855,041.74 | |
| | ABU DHABI ISLAMIC BANK | 185,781 | 6.85 | 1,272,599.85 | |
| | DUBAI ISLAMIC BANK | 335,455 | 5.45 | 1,828,229.75 | |
| | EMIRATES NBD PJSC | 265,296 | 12.80 | 3,395,788.80 | |
| | FIRST ABU DHABI BANK PJSC | 486,542 | 20.68 | 10,061,688.56 | |
| | ALDAR PROPERTIES PJSC | 367,539 | 4.13 | 1,517,936.07 | |
| | EMAAR PROPERTIES PJSC | 385,040 | 4.85 | 1,867,444.00 | |
| | EMIRATES TELECOM GROUP CO | 375,599 | 30.12 | 11,313,041.88 | |
| アラブ首長国連邦ディルハム 小計 | | 2,999,695 | | 35,246,243.55<br>(1,095,100,787) | |
| クウェートディナール | AGILITY | 142,931 | 0.99 | 141,787.55 | |
| | BOUBYAN BANK K.S.C | 130,019 | 0.82 | 107,265.67 | |
| | KUWAIT FINANCE HOUSE | 514,294 | 0.90 | 466,978.95 | |
| | NATIONAL BANK OF KUWAIT | 722,881 | 1.04 | 755,410.64 | |
| | MABANEE CO KPSC | 67,003 | 0.82 | 54,942.46 | |
| | MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | 215,000 | 0.59 | 128,140.00 | |
| クウェートディナール 小計 | | 1,792,128 | | 1,654,525.27<br>(626,667,991) | |
| 香港・オフショア人民元 | CHINA SHENHUA ENERGY CO-A | 20,000 | 23.51 | 470,200.00 | |
| | PETROCHINA CO LTD-A | 100,000 | 5.50 | 550,000.00 | |
| | SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A | 38,300 | 12.92 | 494,836.00 | |
| | SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A | 87,800 | 12.84 | 1,127,352.00 | |
| | YANTAI JEREH OILFIELD-A | 28,000 | 45.27 | 1,267,560.00 | |
| | YANZHOU COAL MINING CO-A | 61,200 | 23.86 | 1,460,232.00 | |
| | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A | 164,300 | 5.97 | 980,871.00 | |
| | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A | 29,440 | 42.94 | 1,264,153.60 | |
| | BAOSHAN IRON & STEEL CO-A | 38,700 | 7.70 | 297,990.00 | |
| | CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A | 20,600 | 46.48 | 957,488.00 | |
| | CHIFENG JILONG GOLD MINING-A | 78,847 | 15.07 | 1,188,224.29 | |
| | CHINA NORTHERN RARE EARTH -A | 20,800 | 41.28 | 858,624.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GANFENG LITHIUM CO LTD-A | 8,000 | 123.08 | 984,640.00 | |
| GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A | 12,413 | 95.23 | 1,182,089.99 | |
| HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A | 37,100 | 24.43 | 906,353.00 | |
| HUAXIN CEMENT CO LTD-A | 10,000 | 21.17 | 211,700.00 | |
| INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A | 461,000 | 2.57 | 1,184,770.00 | |
| INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A | 60,000 | 5.11 | 306,600.00 | |
| JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A | 22,300 | 18.32 | 408,536.00 | |
| KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A | 30,400 | 12.65 | 384,560.00 | |
| LB GROUP CO LTD-A | 15,300 | 26.99 | 412,947.00 | |
| NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A | 79,200 | 16.74 | 1,325,808.00 | |
| PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A | 220,100 | 3.93 | 864,993.00 | |
| RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A | 48,450 | 19.14 | 927,333.00 | |
| SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A | 28,320 | 42.79 | 1,211,812.80 | |
| SHANDONG GOLD MINING CO LT-A | 7,252 | 19.25 | 139,601.00 | |
| SHANDONG HUALU HENGSHENG-A | 17,940 | 31.38 | 562,957.20 | |
| SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A | 286,600 | 4.78 | 1,369,948.00 | |
| SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A | 5,600 | 144.80 | 810,880.00 | |
| SHANXI TAIGANG STAINLESS-A | 137,400 | 7.43 | 1,020,882.00 | |
| SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A | 49,300 | 17.47 | 861,271.00 | |
| SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A | 6,000 | 97.37 | 584,220.00 | |
| TONGKUN GROUP CO LTD-A | 9,800 | 22.20 | 217,560.00 | |
| TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A | 92,200 | 8.41 | 775,402.00 | |
| WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A | 17,500 | 96.47 | 1,688,225.00 | |
| WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A | 9,220 | 70.68 | 651,669.60 | |
| YINTAI GOLD CO LTD-A | 111,300 | 8.74 | 972,762.00 | |
| YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C | 10,400 | 265.65 | 2,762,760.00 | |
| ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A | 5,700 | 103.03 | 587,271.00 | |
| ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A | 23,600 | 12.85 | 303,260.00 | |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A | 105,600 | 9.89 | 1,044,384.00 | |
| AECC AVIATION POWER CO-A | 11,400 | 52.00 | 592,800.00 | |
| AVICOPTER PLC-A | 15,500 | 64.65 | 1,002,075.00 | |
| BEIJING NEW BUILDING MATER-A | 8,400 | 36.51 | 306,684.00 | |
| CHINA BAOAN GROUP-A | 64,000 | 14.35 | 918,400.00 | |
| CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A | 55,215 | 23.10 | 1,275,466.50 | |
| CHINA STATE CONSTRUCTION -A | 210,900 | 5.37 | 1,132,533.00 | |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A | 15,100 | 569.99 | 8,606,849.00 | |
| CRRC CORP LTD-A | 185,800 | 6.17 | 1,146,386.00 | |
| EVE ENERGY CO LTD-A | 7,573 | 98.98 | 749,575.54 | |
| FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A | 22,800 | 10.11 | 230,508.00 | |
| GOTION HIGH-TECH CO LTD-A | 5,800 | 43.81 | 254,098.00 | |
| GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A | 6,300 | 172.68 | 1,087,884.00 | |
| HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A | 13,600 | 38.04 | 517,344.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A | 18,800 | 67.50 | 1,269,000.00 | |
| JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A | 11,456 | 84.88 | 972,385.28 | |
| KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A | 48,100 | 19.77 | 950,937.00 | |
| METALLURGICAL CORP OF CHIN-A | 330,900 | 4.07 | 1,346,763.00 | |
| MING YANG SMART ENERGY GRO-A | 36,200 | 22.57 | 817,034.00 | |
| NARI TECHNOLOGY CO LTD-A | 58,320 | 40.32 | 2,351,462.40 | |
| POWER CONSTRUCTION CORP OF-A | 163,200 | 8.73 | 1,424,736.00 | |
| SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A | 41,900 | 24.35 | 1,020,265.00 | |
| SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A | 10,650 | 66.00 | 702,900.00 | |
| SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A | 17,900 | 11.11 | 198,869.00 | |
| SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A | 10,000 | 120.71 | 1,207,100.00 | |
| SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A | 1,600 | 522.80 | 836,480.00 | |
| TBEA CO LTD-A | 22,519 | 20.00 | 450,380.00 | |
| WEICHAI POWER CO LTD-A | 43,200 | 17.09 | 738,288.00 | |
| WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A | 3,800 | 139.50 | 530,100.00 | |
| XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A | 199,400 | 6.14 | 1,224,316.00 | |
| XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A | 20,111 | 14.99 | 301,463.89 | |
| YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A | 28,280 | 31.50 | 890,820.00 | |
| ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A | 31,600 | 49.11 | 1,551,876.00 | |
| ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A | 8,260 | 79.12 | 653,531.20 | |
| ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A | 47,190 | 24.40 | 1,151,436.00 | |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A | 80,100 | 7.66 | 613,566.00 | |
| BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A | 80,600 | 7.10 | 572,260.00 | |
| SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A | 11,000 | 56.09 | 616,990.00 | |
| AIR CHINA LTD-A | 25,900 | 9.63 | 249,417.00 | |
| BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A | 106,700 | 4.91 | 523,897.00 | |
| CHINA EASTERN AIRLINES CO-A | 40,000 | 5.34 | 213,600.00 | |
| S F HOLDING CO LTD-A | 20,300 | 65.70 | 1,333,710.00 | |
| SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A | 5,319 | 49.67 | 264,194.73 | |
| SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A | 44,400 | 5.88 | 261,072.00 | |
| YUNDA HOLDING CO LTD-A | 21,840 | 21.06 | 459,950.40 | |
| BYD CO LTD -A | 9,700 | 252.97 | 2,453,809.00 | |
| CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A | 33,348 | 13.87 | 462,536.76 | |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A | 18,500 | 47.87 | 885,595.00 | |
| HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A | 34,300 | 29.19 | 1,001,217.00 | |
| NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A | 29,300 | 21.06 | 617,058.00 | |
| SAIC MOTOR CORP LTD-A | 42,600 | 20.04 | 853,704.00 | |
| SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A | 39,254 | 32.40 | 1,271,829.60 | |
| BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A | 1,031 | 906.59 | 934,694.29 | |
| ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A | 2,800 | 139.55 | 390,740.00 | |
| HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A | 27,760 | 36.99 | 1,026,842.40 | |
| JASON FURNITURE HANGZHOU C-A | 6,102 | 75.12 | 458,382.24 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| NAVINFO CO LTD-A | 33,200 | 17.20 | 571,040.00 | |
| OPPEIN HOME GROUP INC-A | 7,700 | 143.64 | 1,106,028.00 | |
| QINGDAO HAIER CO LTD-A | 26,000 | 28.95 | 752,700.00 | |
| TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A | 102,000 | 6.13 | 625,260.00 | |
| ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A | 8,000 | 55.73 | 445,840.00 | |
| SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A | 26,200 | 56.08 | 1,469,296.00 | |
| SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A | 79,300 | 8.17 | 647,881.00 | |
| SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A | 33,480 | 15.27 | 511,239.60 | |
| BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A | 53,600 | 11.54 | 618,544.00 | |
| FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A | 139,400 | 7.76 | 1,081,744.00 | |
| G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A | 2,900 | 398.13 | 1,154,577.00 | |
| MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A | 16,300 | 45.13 | 735,619.00 | |
| PERFECT WORLD CO LTD-A | 22,800 | 17.16 | 391,248.00 | |
| WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A | 24,500 | 28.07 | 687,715.00 | |
| ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A | 61,500 | 8.21 | 504,915.00 | |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A | 12,200 | 188.62 | 2,301,164.00 | |
| SUNING.COM CO LTD-A | 45,800 | 4.13 | 189,154.00 | |
| DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A | 15,480 | 41.98 | 649,850.40 | |
| LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A | 8,600 | 47.80 | 411,080.00 | |
| YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A | 10,140 | 55.99 | 567,738.60 | |
| YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A | 40,500 | 4.24 | 171,720.00 | |
| ANGEL YEAST CO LTD-A | 10,700 | 53.85 | 576,195.00 | |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A | 1,600 | 203.40 | 325,440.00 | |
| ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A | 2,200 | 63.11 | 138,842.00 | |
| BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A | 59,500 | 9.36 | 556,920.00 | |
| BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A | 10,300 | 34.68 | 357,204.00 | |
| CHACHA FOOD CO LTD-A | 10,000 | 56.97 | 569,700.00 | |
| CHONGQING BREWERY CO-A | 7,900 | 127.50 | 1,007,250.00 | |
| CHONGQING FULING ZHACAI-A | 4,600 | 33.45 | 153,870.00 | |
| FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A | 18,408 | 103.97 | 1,913,879.76 | |
| FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A | 3,000 | 146.03 | 438,090.00 | |
| FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A | 27,400 | 22.72 | 622,528.00 | |
| GUANGDONG HAID GROUP CO-A | 17,000 | 69.94 | 1,188,980.00 | |
| HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A | 1,200 | 31.60 | 37,920.00 | |
| INNER MONGOLIA YILI INDUS-A | 34,302 | 39.31 | 1,348,411.62 | |
| JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A | 17,300 | 50.73 | 877,629.00 | |
| JIANGSU YANGHE BREWERY -A | 9,100 | 161.01 | 1,465,191.00 | |
| JIANGXI ZHENGBANG TECH -A | 27,700 | 9.56 | 264,812.00 | |
| JIUGUI LIQUOR CO LTD-A | 5,600 | 178.00 | 996,800.00 | |
| JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A | 11,500 | 34.11 | 392,265.00 | |
| JUEWEI FOOD CO LTD-A | 7,000 | 58.30 | 408,100.00 | |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A | 7,600 | 1,912.00 | 14,531,200.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A | 9,800 | 229.89 | 2,252,922.00 | |
| MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A | 33,558 | 54.53 | 1,829,917.74 | |
| NEW HOPE LIUHE CO LTD-A | 26,800 | 16.49 | 441,932.00 | |
| SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A | 9,380 | 277.75 | 2,605,295.00 | |
| TONGWEI CO LTD-A | 31,600 | 40.51 | 1,280,116.00 | |
| WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A | 38,160 | 19.25 | 734,580.00 | |
| WULIANGYE YIBIN CO LTD-A | 21,200 | 210.80 | 4,468,960.00 | |
| YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A | 10,100 | 61.91 | 625,291.00 | |
| YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A | 5,300 | 20.26 | 107,378.00 | |
| BY-HEALTH CO LTD-A | 29,700 | 26.18 | 777,546.00 | |
| AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A | 23,226 | 35.46 | 823,593.96 | |
| AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A | 6,500 | 58.15 | 377,975.00 | |
| CHINA NATIONAL MEDICINES-A | 33,700 | 30.30 | 1,021,110.00 | |
| GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A | 2,838 | 87.21 | 247,501.98 | |
| HUADONG MEDICINE CO LTD-A | 9,720 | 38.39 | 373,150.80 | |
| INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A | 7,875 | 63.73 | 501,873.75 | |
| JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A | 12,350 | 56.12 | 693,082.00 | |
| JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A | 18,000 | 32.90 | 592,200.00 | |
| JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A | 10,400 | 14.26 | 148,304.00 | |
| LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A | 14,800 | 23.40 | 346,320.00 | |
| MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A | 24,840 | 7.69 | 191,019.60 | |
| OVCTEK CHINA INC-A | 7,209 | 48.25 | 347,834.25 | |
| SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A | 8,400 | 335.22 | 2,815,848.00 | |
| TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A | 2,000 | 165.20 | 330,400.00 | |
| WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A | 37,830 | 15.43 | 583,716.90 | |
| ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A | 200 | 358.00 | 71,600.00 | |
| BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A | 23,400 | 30.71 | 718,614.00 | |
| BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A | 5,167 | 226.00 | 1,167,742.00 | |
| BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A | 16,100 | 74.75 | 1,203,475.00 | |
| BGI GENOMICS CO LTD-A | 5,500 | 92.21 | 507,155.00 | |
| CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A | 2,200 | 227.60 | 500,720.00 | |
| CHINA RESOURCES SANJIU MED-A | 10,200 | 36.10 | 368,220.00 | |
| CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A | 9,900 | 106.38 | 1,053,162.00 | |
| DONG-E-E-JIAOCO LTD-A | 22,193 | 40.67 | 902,589.31 | |
| GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A | 16,000 | 32.34 | 517,440.00 | |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A | 8,000 | 118.90 | 951,200.00 | |
| HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A | 18,850 | 28.15 | 530,627.50 | |
| IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A | 2,080 | 467.60 | 972,608.00 | |
| JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A | 38,102 | 45.73 | 1,742,404.46 | |
| JOINN LABORATORIES CHINA C-A | 7,940 | 98.52 | 782,248.80 | |
| NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A | 21,294 | 37.30 | 794,266.20 | |
| SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A | 64,100 | 7.22 | 462,802.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A | 6,800 | 88.25 | 600,100.00 | |
| SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A | 7,000 | 25.33 | 177,310.00 | |
| SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A | 59,640 | 25.29 | 1,508,295.60 | |
| SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A | 11,232 | 19.80 | 222,393.60 | |
| WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A | 17,000 | 53.30 | 906,100.00 | |
| WUXI APPTEC CO LTD-A | 16,464 | 112.00 | 1,843,968.00 | |
| YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A | 7,100 | 98.75 | 701,125.00 | |
| ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A | 3,900 | 391.00 | 1,524,900.00 | |
| ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A | 9,020 | 22.41 | 202,138.20 | |
| ZHEJIANG NHU CO LTD-A | 29,040 | 30.80 | 894,432.00 | |
| ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A | 9,700 | 52.10 | 505,370.00 | |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A | 353,600 | 2.98 | 1,053,728.00 | |
| BANK OF BEIJING CO LTD -A | 58,000 | 4.58 | 265,640.00 | |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-A | 98,900 | 4.80 | 474,720.00 | |
| BANK OF JIANGSU CO LTD-A | 75,140 | 6.72 | 504,940.80 | |
| BANK OF NANJING CO LTD -A | 50,500 | 9.89 | 499,445.00 | |
| BANK OF NINGBO CO LTD -A | 26,400 | 39.46 | 1,041,744.00 | |
| BANK OF SHANGHAI CO LTD-A | 45,500 | 7.26 | 330,330.00 | |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-A | 124,900 | 6.05 | 755,645.00 | |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A | 128,900 | 3.44 | 443,416.00 | |
| CHINA MERCHANTS BANK-A | 104,900 | 49.70 | 5,213,530.00 | |
| CHINA MINSHENG BANKING-A | 273,600 | 3.96 | 1,083,456.00 | |
| CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A | 308,600 | 3.54 | 1,092,444.00 | |
| HUAXIA BANK CO LTD-A | 119,400 | 5.76 | 687,744.00 | |
| IND & COMM BK OF CHINA-A | 261,200 | 4.70 | 1,227,640.00 | |
| INDUSTRIAL BANK CO LTD -A | 95,200 | 21.51 | 2,047,752.00 | |
| PING AN BANK CO LTD-A | 119,400 | 16.50 | 1,970,100.00 | |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A | 141,500 | 5.65 | 799,475.00 | |
| SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A | 138,300 | 8.64 | 1,194,912.00 | |
| AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A | 122,500 | 3.94 | 482,650.00 | |
| BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A | 79,400 | 12.92 | 1,025,848.00 | |
| CAITONG SECURITIES CO LTD-A | 44,100 | 10.37 | 457,317.00 | |
| CHANGJIANG SECURITIES CO L-A | 19,900 | 7.28 | 144,872.00 | |
| CHINA GREAT WALL SECURITIE-A | 46,700 | 12.13 | 566,471.00 | |
| CHINA MERCHANTS SECURITIES-A | 28,660 | 16.96 | 486,073.60 | |
| CITIC SECURITIES CO-A | 43,200 | 25.70 | 1,110,240.00 | |
| CSC FINANCIAL CO LTD-A | 24,100 | 28.01 | 675,041.00 | |
| EAST MONEY INFORMATION CO-A | 41,880 | 33.15 | 1,388,322.00 | |
| EVERBRIGHT SECURITIE CO -A | 3,600 | 14.46 | 52,056.00 | |
| FIRST CAPITAL SECURITIES C-A | 60,200 | 7.02 | 422,604.00 | |
| FOUNDER SECURITIES CO LTD-A | 82,800 | 7.80 | 645,840.00 | |
| GF SECURITIES CO LTD-A | 60,600 | 22.27 | 1,349,562.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A | 127,170 | 8.65 | 1,100,020.50 | |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A | 72,300 | 17.85 | 1,290,555.00 | |
| GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A | 152,050 | 7.50 | 1,140,375.00 | |
| HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A | 5,400 | 131.06 | 707,724.00 | |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-A | 31,500 | 17.51 | 551,565.00 | |
| INDUSTRIAL SECURITIES CO-A | 87,900 | 9.23 | 811,317.00 | |
| NANJING SECURITIES CO LTD-A | 42,700 | 9.68 | 413,336.00 | |
| ORIENT SECURITIES CO LTD-A | 31,700 | 13.42 | 425,414.00 | |
| SDIC CAPITAL CO LTD-A | 69,616 | 8.01 | 557,624.16 | |
| SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A | 207,200 | 5.04 | 1,044,288.00 | |
| SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A | 114,000 | 5.06 | 576,840.00 | |
| TIANFENG SECURITIES CO LTD-A | 94,600 | 3.94 | 372,724.00 | |
| ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A | 43,700 | 12.81 | 559,797.00 | |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A | 18,200 | 27.66 | 503,412.00 | |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-A | 66,800 | 51.45 | 3,436,860.00 | |
| CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A | 54,700 | 13.86 | 758,142.00 | |
| CHINA VANKE CO LTD -A | 53,700 | 21.90 | 1,176,030.00 | |
| GEMDALE CORP-A | 45,500 | 13.66 | 621,530.00 | |
| GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A | 123,480 | 4.54 | 560,599.20 | |
| POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A | 81,800 | 16.09 | 1,316,162.00 | |
| SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A | 12,800 | 33.40 | 427,520.00 | |
| SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A | 8,500 | 14.80 | 125,800.00 | |
| 360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A | 26,900 | 12.62 | 339,478.00 | |
| BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A | 4,823 | 272.51 | 1,314,315.73 | |
| BEIJING SHIJI INFORMATION -A | 18,900 | 27.90 | 527,310.00 | |
| BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A | 28,800 | 16.07 | 462,816.00 | |
| CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A | 78,400 | 16.00 | 1,254,400.00 | |
| DHC SOFTWARE CO LTD -A | 55,700 | 8.18 | 455,626.00 | |
| HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A | 12,740 | 59.92 | 763,380.80 | |
| IFLYTEK CO LTD - A | 10,800 | 48.45 | 523,260.00 | |
| SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A | 3,000 | 181.10 | 543,300.00 | |
| SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A | 6,110 | 63.33 | 386,946.30 | |
| THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A | 5,500 | 149.66 | 823,130.00 | |
| YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A | 13,170 | 38.88 | 512,049.60 | |
| ADDSINO CO LTD -A | 5,800 | 16.24 | 94,192.00 | |
| AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A | 37,900 | 38.87 | 1,473,173.00 | |
| BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A | 114,600 | 4.96 | 568,416.00 | |
| CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A | 28,000 | 40.96 | 1,146,880.00 | |
| CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A | 34,800 | 15.16 | 527,568.00 | |
| FIBERHOME TELECOM TECH CO-A | 20,800 | 18.51 | 385,008.00 | |
| FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A | 45,100 | 11.64 | 524,964.00 | |
| GOERTEK INC -A | 26,900 | 49.80 | 1,339,620.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A | 50,000 | 6.89 | 344,500.00 | |
| GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A | 7,000 | 77.11 | 539,770.00 | |
| INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A | 19,712 | 36.42 | 717,911.04 | |
| LENS TECHNOLOGY CO LTD-A | 16,800 | 19.79 | 332,472.00 | |
| LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A | 46,450 | 47.46 | 2,204,517.00 | |
| MAXSCEND MICROELECTRONICS -A | 1,080 | 277.50 | 299,700.00 | |
| NINESTAR CORP-A | 18,543 | 52.50 | 973,507.50 | |
| OFILM GROUP CO LTD-A | 31,300 | 9.19 | 287,647.00 | |
| SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A | 24,300 | 22.26 | 540,918.00 | |
| SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A | 4,760 | 115.30 | 548,828.00 | |
| SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A | 23,500 | 14.80 | 347,800.00 | |
| SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A | 13,400 | 23.80 | 318,920.00 | |
| SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A | 6,435 | 141.95 | 913,448.25 | |
| SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A | 28,500 | 24.12 | 687,420.00 | |
| TIANMA MICROELECTRONICS-A | 47,000 | 12.95 | 608,650.00 | |
| UNISPLENDOUR CORP LTD-A | 18,340 | 24.56 | 450,430.40 | |
| UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A | 2,800 | 15.01 | 42,028.00 | |
| WESTONE INFORMATION INDUST-A | 20,100 | 48.60 | 976,860.00 | |
| WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A | 4,200 | 117.80 | 494,760.00 | |
| WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A | 29,512 | 23.86 | 704,156.32 | |
| WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A | 2,760 | 73.00 | 201,480.00 | |
| XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A | 4,700 | 201.62 | 947,614.00 | |
| YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A | 11,250 | 85.66 | 963,675.00 | |
| ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A | 30,300 | 20.74 | 628,422.00 | |
| ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A | 8,700 | 39.33 | 342,171.00 | |
| ZTE CORP-A | 12,600 | 33.65 | 423,990.00 | |
| CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A | 173,800 | 7.22 | 1,254,836.00 | |
| CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A | 134,000 | 22.95 | 3,075,300.00 | |
| ENN NATURAL GAS CO LTD-A | 55,600 | 18.48 | 1,027,488.00 | |
| SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A | 67,600 | 10.29 | 695,604.00 | |
| ADVANCED MICRO-FABRICATION-A | 7,097 | 116.86 | 829,355.42 | |
| GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A | 82,500 | 3.43 | 282,975.00 | |
| GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A | 6,272 | 157.90 | 990,348.80 | |
| HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A | 10,800 | 115.30 | 1,245,240.00 | |
| HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A | 7,500 | 51.33 | 384,975.00 | |
| INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A | 7,500 | 112.08 | 840,600.00 | |
| JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A | 17,450 | 88.30 | 1,540,835.00 | |
| JCET GROUP CO LTD-A | 29,800 | 28.78 | 857,644.00 | |
| LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A | 33,600 | 78.51 | 2,637,936.00 | |
| NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A | 3,100 | 306.49 | 950,119.00 | |
| SG MICRO CORP-A | 2,100 | 295.45 | 620,445.00 | |
| SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A | 2,600 | 99.48 | 258,648.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A | 29,500 | 40.78 | 1,203,010.00 | |
| | TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A | 32,750 | 12.31 | 403,152.50 | |
| | TONGFU MICROELECTRONIC CO-A | 22,466 | 18.89 | 424,382.74 | |
| | UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A | 4,900 | 227.35 | 1,114,015.00 | |
| | WILL SEMICONDUCTOR LTD-A | 5,400 | 292.00 | 1,576,800.00 | |
| | ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A | 17,022 | 60.99 | 1,038,171.78 | |
| **香港・オフショア人民元 小計** | | 13,562,566 | | 281,105,496.78<br>(5,060,208,158) | |
| **サウジアラビアリアル** | RABIGH REFINING AND PETROCHE | 23,559 | 24.60 | 579,551.40 | |
| | SAUDI ARABIAN OIL CO | 238,091 | 36.70 | 8,737,939.70 | |
| | ADVANCED PETROCHEMICALS CO | 9,804 | 71.90 | 704,907.60 | |
| | NATIONAL INDUSTRIALIZATION C | 31,928 | 22.50 | 718,380.00 | |
| | NATIONAL PETROCHEMICAL CO | 13,666 | 44.05 | 601,987.30 | |
| | SABIC AGRI-NUTRIENTS CO | 24,254 | 192.40 | 4,666,469.60 | |
| | SAHARA INTERNATIONAL PETROCH | 32,283 | 45.35 | 1,464,034.05 | |
| | SAUDI ARABIAN MINING CO | 44,984 | 92.20 | 4,147,524.80 | |
| | SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP | 97,353 | 126.60 | 12,324,889.80 | |
| | SAUDI CEMENT | 7,489 | 55.90 | 418,635.10 | |
| | SAUDI IND INVESTMENT GROUP | 21,059 | 34.30 | 722,323.70 | |
| | SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO | 103,431 | 18.90 | 1,954,845.90 | |
| | YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL | 26,556 | 71.90 | 1,909,376.40 | |
| | JARIR MARKETING CO | 7,199 | 200.80 | 1,445,559.20 | |
| | ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS | 3,725 | 110.40 | 411,240.00 | |
| | ALMARAI CO | 30,130 | 50.00 | 1,506,500.00 | |
| | SAVOLA | 25,336 | 34.45 | 872,825.20 | |
| | DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL | 6,923 | 166.00 | 1,149,218.00 | |
| | MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO | 4,029 | 189.40 | 763,092.60 | |
| | AL RAJHI BANK | 130,773 | 150.40 | 19,668,259.20 | |
| | ALINMA BANK | 109,956 | 27.65 | 3,040,283.40 | |
| | ARAB NATIONAL BANK | 86,031 | 26.80 | 2,305,630.80 | |
| | BANK AL-JAZIRA | 35,813 | 22.38 | 801,494.94 | |
| | BANK ALBILAD | 45,859 | 53.10 | 2,435,112.90 | |
| | BANQUE SAUDI FRANSI | 67,536 | 49.25 | 3,326,148.00 | |
| | RIYAD BANK | 138,943 | 32.45 | 4,508,700.35 | |
| | SAUDI BRITISH BANK | 94,400 | 41.55 | 3,922,320.00 | |
| | THE SAUDI NATIONAL BANK | 236,442 | 74.10 | 17,520,352.20 | |
| | BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE | 6,063 | 133.60 | 810,016.80 | |
| | CO FOR COOPERATIVE INSURANCE | 6,613 | 79.00 | 522,427.00 | |
| | DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV | 47,092 | 10.34 | 486,931.28 | |
| | EMAAR ECONOMIC CITY | 46,187 | 12.66 | 584,727.42 | |
| | ETIHAD ETISALAT CO | 34,414 | 32.45 | 1,116,734.30 | |
| | MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | 26,891 | 12.60 | 338,826.60 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | SAUDI TELECOM CO | 66,310 | 121.00 | 8,023,510.00 | |
| | SAUDI ELECTRICITY CO | 92,221 | 25.40 | 2,342,413.40 | |
| サウジアラビアリアル 小計 | | 2,023,343 | | 116,853,188.94<br>(3,566,359,326) | |
| 合　計 | | 278,921,675 | | 98,138,356,943<br>(98,138,356,943) | |

(2)株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 投資信託受益証券 | メキシコペソ | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | 58,400 | 6,441,520.00 | |
| | メキシコペソ 小計 | | 58,400 | 6,441,520.00<br>(35,914,050) | |
| | ブラジルレアル | BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT | 131,500 | 2,616,850.00 | |
| | | BANCO INTER SA-UNITS | 31,500 | 708,750.00 | |
| | | BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT | 45,900 | 1,446,768.00 | |
| | | ENERGISA SA-UNITS | 16,500 | 681,615.00 | |
| | | KLABIN SA-UNIT | 64,600 | 1,659,574.00 | |
| | ブラジルレアル 小計 | | 290,000 | 7,113,557.00<br>(149,273,014) | |
| 投資信託受益証券合計 | | | 348,400 | 185,187,064<br>(185,187,064) | |
| 投資証券 | メキシコペソ | FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | 308,400 | 6,689,196.00 | |
| | メキシコペソ 小計 | | 308,400 | 6,689,196.00<br>(37,294,943) | |
| | 南アフリカランド | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | 478,733 | 6,884,180.54 | |
| | 南アフリカランド 小計 | | 478,733 | 6,884,180.54<br>(51,424,828) | |
| 投資証券合計 | | | 787,133 | 88,719,771<br>(88,719,771) | |
| 合計 | | | | 273,906,835<br>(273,906,835) | |

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入株式<br>時価比率 | 組入投資信託<br>受益証券<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|---|---|
| アメリカドル | 株式　63銘柄 | 100.0% | — | — | 6.7% |
| メキシコペソ | 株式　22銘柄 | 96.3% | — | — | 1.9% |
| | 投資信託受益証券　1銘柄 | — | 1.8% | — | 0.0% |
| | 投資証券　1銘柄 | — | — | 1.9% | 0.0% |
| ブラジルレアル | 株式　45銘柄 | 96.4% | — | — | 4.1% |
| | 投資信託受益証券　5銘柄 | — | 3.6% | — | 0.2% |
| チリペソ | 株式　11銘柄 | 100.0% | — | — | 0.4% |
| コロンビアペソ | 株式　5銘柄 | 100.0% | — | — | 0.2% |
| ユーロ | 株式　6銘柄 | 100.0% | — | — | 0.2% |
| イギリスポンド | 株式　1銘柄 | 100.0% | — | — | 0.1% |
| トルコリラ | 株式　11銘柄 | 100.0% | — | — | 0.3% |
| チェココルナ | 株式　3銘柄 | 100.0% | — | — | 0.2% |
| ハンガリーフォリント | 株式　3銘柄 | 100.0% | — | — | 0.3% |
| ポーランドズロチ | 株式　15銘柄 | 100.0% | — | — | 0.8% |
| 香港ドル | 株式　209銘柄 | 100.0% | — | — | 23.6% |
| マレーシアリンギット | 株式　35銘柄 | 100.0% | — | — | 1.3% |
| タイバーツ | 株式　42銘柄 | 100.0% | — | — | 1.7% |
| フィリピンペソ | 株式　19銘柄 | 100.0% | — | — | 0.7% |
| インドネシアルピア | 株式　22銘柄 | 100.0% | — | — | 1.5% |
| 韓国ウォン | 株式　110銘柄 | 100.0% | — | — | 12.2% |
| 新台湾ドル | 株式　86銘柄 | 100.0% | — | — | 16.2% |
| インドルピー | 株式　106銘柄 | 100.0% | — | — | 12.8% |
| カタールリアル | 株式　12銘柄 | 100.0% | — | — | 0.8% |
| 南アフリカランド | 株式　37銘柄 | 98.4% | — | — | 3.3% |
| | 投資証券　1銘柄 | — | — | 1.6% | 0.1% |
| アラブ首長国連邦ディルハム | 株式　9銘柄 | 100.0% | — | — | 1.1% |
| クウェートディナール | 株式　6銘柄 | 100.0% | — | — | 0.6% |
| 香港・オフショア人民元 | 株式　312銘柄 | 100.0% | — | — | 5.1% |
| サウジアラビアリアル | 株式　36銘柄 | 100.0% | — | — | 3.6% |

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

**注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。**

**【中間財務諸表】**

**(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。**

**(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期中間計算期間(2022年1月21日から2022年7月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。**

## 【世界経済インデックスファンド（株式シフト型）】

### （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 第9期<br>（2022年 1月20日現在） | 第10期中間計算期間<br>（2022年 7月20日現在） |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 75,933,591 | 70,718,514 |
| 親投資信託受益証券 | 5,293,469,090 | 5,467,226,705 |
| 未収入金 | 20,200,000 | 180,000 |
| 流動資産合計 | 5,389,602,681 | 5,538,125,219 |
| 資産合計 | 5,389,602,681 | 5,538,125,219 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 10,374,945 | 822,408 |
| 未払受託者報酬 | 1,486,043 | 1,464,972 |
| 未払委託者報酬 | 14,860,417 | 14,649,618 |
| 未払利息 | 113 | 36 |
| その他未払費用 | 148,542 | 146,436 |
| 流動負債合計 | 26,870,060 | 17,083,470 |
| 負債合計 | 26,870,060 | 17,083,470 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 2,807,071,125 | 2,841,948,395 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 2,555,661,496 | 2,679,093,354 |
| （分配準備積立金） | 1,546,996,315 | 1,484,944,350 |
| 元本等合計 | 5,362,732,621 | 5,521,041,749 |
| 純資産合計 | 5,362,732,621 | 5,521,041,749 |
| 負債純資産合計 | 5,389,602,681 | 5,538,125,219 |

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第9期中間計算期間<br>自　2021年 1月21日<br>至　2021年 7月20日 | 第10期中間計算期間<br>自　2022年 1月21日<br>至　2022年 7月20日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 16 | 221 |
| 有価証券売買等損益 | 411,752,016 | 108,877,615 |
| 営業収益合計 | 411,752,032 | 108,877,836 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 8,533 | 11,746 |
| 受託者報酬 | 1,355,148 | 1,464,972 |
| 委託者報酬 | 13,551,412 | 14,649,618 |
| その他費用 | 135,454 | 146,436 |
| 営業費用合計 | 15,050,547 | 16,272,772 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 396,701,485 | 92,605,064 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 396,701,485 | 92,605,064 |
| 中間純利益又は中間純損失（△） | 396,701,485 | 92,605,064 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△） | 16,845,148 | △219,377 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 1,930,729,301 | 2,555,661,496 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 143,229,688 | 136,052,051 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 143,229,688 | 136,052,051 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 145,610,260 | 105,444,634 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 145,610,260 | 105,444,634 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 2,308,205,066 | 2,679,093,354 |

**（３）【中間注記表】**

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

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

**（中間貸借対照表に関する注記）**

| | 第9期<br>(2022年 1月20日現在) | 第10期中間計算期間<br>(2022年 7月20日現在) |
|---|---|---|
| １．計算期間の末日における受益権の総数 | 2,807,071,125口 | 2,841,948,395口 |
| ２．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.9104円<br>(1万口当たり純資産額) (19,104円) | 1口当たり純資産額 1.9427円<br>(1万口当たり純資産額) (19,427円) |

**（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）**

該当事項はありません。

**（金融商品に関する注記）**
**金融商品の時価等に関する事項**

| | 第10期中間計算期間<br>(2022年 7月20日現在) |
|---|---|
| １.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間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<br>売買目的有価証券<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| ３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

**（重要な後発事象に関する注記）**

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

**（その他の注記）**
**元本の移動**

| 区分 | 第9期<br>自 2021年 1月21日<br>至 2022年 1月20日 | 第10期中間計算期間<br>自 2022年 1月21日<br>至 2022年 7月20日 |
|---|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | | |
| 期首元本額 | 2,815,369,100円 | 2,807,071,125円 |
| 期中追加設定元本額 | 363,887,048円 | 150,966,166円 |
| 期中一部解約元本額 | 372,185,023円 | 116,088,896円 |

**（デリバティブ取引に関する注記）**

該当事項はありません。

**（参考）**

**当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。**
**なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。**

**国内債券インデックス　マザーファンド**

**貸借対照表**

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 431,532,586 |
| 国債証券 | 522,819,863,500 |
| 地方債証券 | 33,311,579,965 |
| 特殊債券 | 36,232,769,631 |
| 社債券 | 28,862,026,120 |
| 未収入金 | 99,940,000 |
| 未収利息 | 1,008,634,642 |
| 前払費用 | 24,758,823 |
| 流動資産合計 | 622,791,105,267 |
| 資産合計 | 622,791,105,267 |

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 101,416,000 |
| 未払解約金 | 187,953,872 |
| 未払利息 | 225 |
| 流動負債合計 | 289,370,097 |
| 負債合計 | 289,370,097 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 454,682,126,452 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 167,819,608,718 |
| 元本等合計 | 622,501,735,170 |
| 純資産合計 | 622,501,735,170 |
| 負債純資産合計 | 622,791,105,267 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券<br>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | 先物取引<br>債券先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 |
| 3.収益及び費用の計上基準 | 派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| | 2022年 7月20日現在 | |
|---|---|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | | 454,682,126,452口 |
| 2. 担保資産 | 先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 | |
| | 有価証券 | 100,197,000円 |
| 3. | 1口当たり純資産額 | 1.3691円 |

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | (1万口当たり純資産額) (13,691円) |

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

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

（重要な後発事象に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（その他の注記）
元本の移動

| 区分 | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2022年 1月21日 |
| 期首元本額 | 462,000,831,762円 |
| 期中追加設定元本額 | 23,348,015,429円 |
| 期中一部解約元本額 | 30,666,720,739円 |
| 期末元本額 | 454,682,126,452円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |

| 区分 | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| エマージング株式オープン | 2,227,240円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 4,076,048,028円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 15,681,254円 |
| ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン | 20,875,919,618円 |
| 世界経済インデックスファンド | 3,868,491,258円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 25,841,326,430円 |
| ＤＣマイセレクション５０ | 29,586,976,306円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 8,662,149,762円 |
| ＤＣ日本債券インデックス・オープン | 435,447,922円 |
| ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ | 92,160,833,664円 |
| ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ | 66,503,930,043円 |
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 13,120,615,746円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 14,588,698,976円 |
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 3,324,585,554円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 793,999,542円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 2,219,092,924円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 827,202,385円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 3,437,442,306円 |
| 国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,414,396円 |
| マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 29,862,458円 |
| マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 9,937,325円 |
| 国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 972,063円 |
| バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 85,764,566円 |
| バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 125,568,007円 |
| バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 33,715,879円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 27,106,745円 |
| バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 2,861,025,767円 |
| バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 759,865,941円 |
| バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 3,157,837,170円 |
| 世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用） | 81,850,569円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 55,511,752円 |
| バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 983,388,427円 |
| バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,127,412,922円 |
| バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,414,863,624円 |
| 国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 138,892,386円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ１ | 6,042,755,457円 |
| 日本債券ファンド・シリーズ１ | 16,484,933,731円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 20,452,828,218円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 25,571,521,445円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 166,917,212円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 1,411,656,400円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 72,502,867円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 36,517,503円 |

| 区分 | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 61,908,078円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 38,169,864円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 75,689,213円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 119,706,647円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 11,071,613円 |
| グローバル経済コア | 232,657,329円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 31,405,959円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 18,577,417円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 30,151,204円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 15,847,787円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 3,923,870円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 2,943,381円 |
| Ｍｙ　ＳＭＴ　国内債券インデックス（ノーロード） | 362,728円 |
| １０資産分散投資ファンド | 89,612円 |
| ＦＯＦｓ用　国内債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用） | 82,174,230,637円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 87,164,741円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 13,574,237円 |
| ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用） | 289,360,347円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 2,502,243,465 |
| 株式 | 504,755,769,300 |
| 派生商品評価勘定 | 106,004,650 |
| 未収配当金 | 738,571,562 |
| 差入委託証拠金 | 191,009,600 |
| 流動資産合計 | 508,293,598,577 |
| 資産合計 | 508,293,598,577 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 前受金 | 106,039,300 |
| 未払解約金 | 159,397,085 |
| 未払利息 | 1,308 |
| 流動負債合計 | 265,437,693 |
| 負債合計 | 265,437,693 |

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 263,936,695,300 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 244,091,465,584 |
| 元本等合計 | 508,028,160,884 |
| 純資産合計 | 508,028,160,884 |
| 負債純資産合計 | 508,293,598,577 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | 先物取引<br>株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。<br><br>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。 |
| 3.収益及び費用の計上基準 | (1)受取配当金<br>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。<br><br>(2)派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| | | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|---|
| 1. | 計算期間の末日における受益権の総数 | 263,936,695,300口 |
| 2. | 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.9248円<br>(1万口当たり純資産額) (19,248円) |

**（金融商品に関する注記）**

**金融商品の時価等に関する事項**

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

**（重要な後発事象に関する注記）**

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

**（その他の注記）**

**元本の移動**

| 区分 | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2022年 1月21日 |
| 期首元本額 | 254,903,427,075円 |
| 期中追加設定元本額 | 20,867,077,251円 |
| 期中一部解約元本額 | 11,833,809,026円 |
| 期末元本額 | 263,936,695,300円 |

| 区分 | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 期末元本額の内訳 | |
| グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型） | 399,678,170円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 4,016,483,145円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 14,370,549円 |
| ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン | 11,934,237,783円 |
| 世界経済インデックスファンド | 3,991,611,942円 |
| 日本株式インデックス・オープン | 3,294,859,638円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 6,236,891,758円 |
| ＤＣマイセレクション５０ | 19,050,522,943円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 19,015,012,802円 |
| ＤＣ日本株式インデックス・オープン | 6,206,395,860円 |
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 3,188,326,855円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 9,321,690,570円 |
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 7,148,291,592円 |
| ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ | 8,439,413,124円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 196,642,281円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 709,304,898円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 519,221,931円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 3,677,778,864円 |
| 日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 1,733,341,184円 |
| 国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 3,324,278円 |
| マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 19,871,367円 |
| マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 21,109,086円 |
| 日本株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用） | 173,754,879円 |
| 国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 2,336,253円 |
| バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 28,878,794円 |
| バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 111,278,049円 |
| バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 25,662,277円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 70,731,569円 |
| バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 887,924,499円 |
| バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 434,239,816円 |
| バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 2,794,293,665円 |
| 世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用） | 49,811,689円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 18,428,736円 |
| バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 473,709,824円 |
| バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 273,106,377円 |
| バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 345,396,126円 |
| 国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 35,108,426円 |
| ＦＯＦｓ用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用） | 585,550,161円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ１ | 3,598,505,045円 |
| 日本株式ファンド・シリーズ２ | 1,898,838,018円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 2,035,970,286円 |

| 区分 | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 4,319,372,568円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 1,440,100,504円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 6,097,040,794円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 493,146,031円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 432,565,948円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 1,817,511,992円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 221,567,208円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 10,918,367円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 58,360,571円 |
| 国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用） | 30,779,638,056円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 558,843,487円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 48,382,563円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 183,958,647円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 32,945,799円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 8,876,814円 |
| グローバル経済コア | 220,805,008円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 28,456,476円 |
| ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード） | 103,951,897円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 24,260,795円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 696,080,004円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 215,096,633円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 18,442,759円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 14,927,913円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 5,722,412円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 7,143,056円 |
| １０資産分散投資ファンド | 32,436円 |
| ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用） | 44,760,039,446円 |
| ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用） | 914,562,447円 |
| 世界株式ファンド（適格機関投資家専用） | 312,040,104円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 52,355,883円 |
| ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用） | 237,067,266円 |
| ＳＭＴＡＭ日本株式インデックスファンドＶＬ－Ｐ（適格機関投資家専用） | 46,641,032,354円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 14,745,442円 |
| ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用） | 184,798,511円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 7月20日現在）

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

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 3,010,760,700 | － | 3,116,800,000 | 106,039,300 |
| 合計 | | 3,010,760,700 | － | 3,116,800,000 | 106,039,300 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 外国債券インデックス　マザーファンド

### 貸借対照表

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 62,961,401 |
| コール・ローン | 1,884,174,935 |
| 国債証券 | 314,488,563,245 |
| 派生商品評価勘定 | 29,085,214 |
| 未収入金 | 6,701,876 |
| 未収利息 | 1,875,794,968 |
| 前払費用 | 102,945,989 |
| 差入委託証拠金 | 692,605,876 |
| 流動資産合計 | 319,142,833,504 |
| 資産合計 | 319,142,833,504 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 5,400,011 |
| 前受金 | 3,912,468 |
| 未払解約金 | 231,879,835 |
| 未払利息 | 985 |
| 流動負債合計 | 241,193,299 |
| 負債合計 | 241,193,299 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 99,457,179,750 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 219,444,460,455 |
| 元本等合計 | 318,901,640,205 |
| 純資産合計 | 318,901,640,205 |
| 負債純資産合計 | 319,142,833,504 |

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券 |

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| | 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br>債券先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。<br><br>(2)為替予約取引<br>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。<br><br>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。 |
| 3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。<br>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。 |
| 4.収益及び費用の計上基準 | (1)派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。<br><br>(2)為替予約取引による為替差損益<br>約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| | | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|---|
| 1. | 計算期間の末日における受益権の総数 | 99,457,179,750口 |
| 2. | 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 3.2064円<br>(1万口当たり純資産額) (32,064円) |

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

（重要な後発事象に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（その他の注記）
元本の移動

| 区分 | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2022年 1月21日 |
| 期首元本額 | 99,838,150,047円 |
| 期中追加設定元本額 | 9,963,446,193円 |
| 期中一部解約元本額 | 10,344,416,490円 |
| 期末元本額 | 99,457,179,750円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| 外国債券オープン（毎月決算型） | 1,302,866,897円 |
| グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型） | 563,717,789円 |
| 財産四分法ファンド（毎月決算型） | 371,830,524円 |

| 区分 | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 2,190,510,047円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 8,298,424円 |
| ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン | 8,279,918,069円 |
| 世界経済インデックスファンド | 14,208,531,380円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 1,951,233,119円 |
| ＤＣマイセレクション５０ | 1,685,967,477円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 1,149,356,424円 |
| ＤＣ外国債券インデックス・オープン | 2,294,604,158円 |
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 961,540,094円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 758,288,170円 |
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 428,923,223円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 30,350,595円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 92,988,088円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 47,732,908円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 12,961,798,439円 |
| 外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 595,853,983円 |
| マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,717,871円 |
| マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,321,326円 |
| 外国債券インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用） | 22,525,073円 |
| バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 42,847,031円 |
| バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 69,623,997円 |
| バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 73,263,752円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 67,320,205円 |
| バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,250,802,147円 |
| バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 428,346,271円 |
| バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,710,405,416円 |
| 世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用） | 74,135,745円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 38,388,616円 |
| バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 427,612,878円 |
| バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 166,097,923円 |
| バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 207,943,853円 |
| ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用） | 736,001,746円 |
| グローバル債券ファンド・シリーズ１（適格機関投資家専用） | 2,238,885,375円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ１ | 744,139,958円 |
| 外国債券ファンド・シリーズ１ | 700,996,695円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 511,218,449円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 1,348,562,464円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 259,544,875円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 556,972,964円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 563,315,358円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 4,134,594,241円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 568,890,046円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 251,517,268円 |

| 区分 | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 108,584,513円 |
| ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり） | 1,295,555,300円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 198,359,332円 |
| 外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用） | 15,227,959,145円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 260,440,932円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 326,917,386円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 522,217,844円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 5,256,887円 |
| グローバル経済コア | 853,177,292円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 17,033,634円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 1,719,160円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 172,558,497円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 31,240,217円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 18,897,164円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 18,964,586円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 8,119,391円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 11,162,980円 |
| Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル債券インデックス（ノーロード） | 159,667円 |
| １０資産分散投資ファンド | 7,886円 |
| ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用） | 277,873,880円 |
| ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用） | 11,024,565,250円 |
| 外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用） | 331,641,687円 |
| 外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用） | 292,740,413円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 351,478,461円 |
| ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用） | 867,710,279円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 82,997,097円 |
| ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用） | 68,539,519円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2022年 7月20日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 債券先物取引<br>買建 | 1,628,166,486 | － | 1,632,078,954 | 3,912,468 |
| 合計 | | 1,628,166,486 | － | 1,632,078,954 | 3,912,468 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

### 通貨関連

（2022年 7月20日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 1,290,397,369 | － | 1,310,170,104 | 19,772,735 |
| | アメリカドル | 741,759,362 | － | 747,557,836 | 5,798,474 |
| | カナダドル | 70,336,080 | － | 71,819,310 | 1,483,230 |
| | ユーロ | 377,455,032 | － | 387,984,000 | 10,528,968 |
| | イギリスポンド | 100,846,895 | － | 102,808,958 | 1,962,063 |
| 合計 | | 1,290,397,369 | － | 1,310,170,104 | 19,772,735 |

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

### 外国株式インデックス　マザーファンド

### 貸借対照表

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 17,685,060,118 |
| コール・ローン | 617,450,597 |
| 株式 | 511,163,818,241 |
| 投資信託受益証券 | 218,677,900 |
| 投資証券 | 12,563,784,725 |
| 派生商品評価勘定 | 686,237,803 |
| 未収入金 | 1,805,627 |
| 未収配当金 | 390,736,482 |
| 差入委託証拠金 | 2,580,312,179 |
| 流動資産合計 | 545,907,883,672 |
| 資産合計 | 545,907,883,672 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 33,344,657 |
| 前受金 | 652,486,506 |
| 未払解約金 | 146,243,390 |
| 未払利息 | 322 |

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 流動負債合計 | 832,074,875 |
| 負債合計 | 832,074,875 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 127,056,616,240 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 418,019,192,557 |
| 元本等合計 | 545,075,808,797 |
| 純資産合計 | 545,075,808,797 |
| 負債純資産合計 | 545,907,883,672 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | (1)株式<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。<br><br>(2)投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。<br><br>(3)投資証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br>株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。<br><br>(2)為替予約取引 |

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| | 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。<br><br>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。 |
| 3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。<br>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。 |
| 4.収益及び費用の計上基準 | (1)受取配当金<br>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。<br>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。<br><br>(2)派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。<br><br>(3)為替予約取引による為替差損益<br>約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| | | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|---|
| 1. | 計算期間の末日における受益権の総数 | 127,056,616,240口 |
| 2. | 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額　4.2900円<br>(1万口当たり純資産額)　(42,900円) |

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| ２.時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| ３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

（重要な後発事象に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（その他の注記）
元本の移動

| 区分 | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2022年 1月21日 |
| 期首元本額 | 125,379,065,422円 |
| 期中追加設定元本額 | 9,913,041,678円 |
| 期中一部解約元本額 | 8,235,490,860円 |
| 期末元本額 | 127,056,616,240円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 1,898,826,563円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 6,452,610円 |
| ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン | 32,563,909,106円 |
| 世界経済インデックスファンド | 10,822,252,845円 |
| 外国株式インデックス・オープン | 885,292,585円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 802,488,164円 |

| 区分 | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| ＤＣマイセレクション５０ | 3,644,426,671円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 4,416,890,279円 |
| ＤＣ外国株式インデックス・オープン | 11,937,059,205円 |
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 406,860,555円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 1,865,167,448円 |
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 1,573,870,116円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 45,851,409円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 165,019,731円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 120,739,347円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 9,885,895,590円 |
| 外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 1,472,187,774円 |
| マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 3,968,223円 |
| マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 4,723,159円 |
| 外国株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用） | 27,827,354円 |
| バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 14,332,390円 |
| バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 51,512,025円 |
| バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 11,591,757円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 31,949,096円 |
| バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 274,294,634円 |
| バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 174,469,903円 |
| バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,270,768,057円 |
| 世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用） | 112,280,552円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 24,546,389円 |
| バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 160,959,886円 |
| バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 55,258,947円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ１ | 1,070,221,107円 |
| ＦＯＦｓ用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用） | 1,116,002,449円 |
| 外国株式ファンド・シリーズ１ | 1,136,228,878円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 581,693,447円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 1,362,981,916円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 1,498,580,570円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 8,324,445,284円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 1,320,282,878円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 1,110,768,652円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 574,095,237円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 597,553,764円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 29,561,112円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 157,895,386円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 376,694,058円 |
| 外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用） | 16,343,591,891円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 197,158,067円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 759,326,563円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 139,768,665円 |

| 区分 | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 3,930,003円 |
| ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード） | 177,174,690円 |
| グローバル経済コア | 650,331,488円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 13,646,166円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 5,598,332円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 205,869,265円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 79,342,578円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 50,463,937円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 40,868,377円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 15,543,613円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 19,709,670円 |
| １０資産分散投資ファンド | 18,092円 |
| ＦＯＦｓ用　外国株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用） | 267,375,226円 |
| 外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用） | 186,307,029円 |
| 外株インデックス・ファンド２（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用） | 873,335,254円 |
| 世界株式ファンド（適格機関投資家専用） | 1,278,668,568円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 210,538,263円 |
| ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 112,679,041円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 61,942,263円 |
| ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用） | 63,331,548円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用） | 232,787,423円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用） | 241,405,184円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用） | 240,174,152円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用） | 225,480,922円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用） | 221,972,924円 |
| ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド２０２１－１１（適格機関投資家専用） | 149,599,938円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 7月20日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 21,525,994,221 | － | 22,178,480,727 | 652,486,506 |
| 合計 | | 21,525,994,221 | － | 22,178,480,727 | 652,486,506 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

**通貨関連**

（2022年 7月20日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 1,535,750,920 | － | 1,536,157,560 | 406,640 |
| | アメリカドル | 1,291,890,500 | － | 1,291,735,810 | △154,690 |
| | ユーロ | 160,859,420 | － | 161,424,000 | 564,580 |
| | イギリスポンド | 83,001,000 | － | 82,997,750 | △3,250 |
| 合計 | | 1,535,750,920 | － | 1,536,157,560 | 406,640 |

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

**新興国債券インデックス　マザーファンド**

**貸借対照表**

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 585,096,375 |
| コール・ローン | 1,148,284,358 |
| 国債証券 | 80,000,045,598 |
| 未収利息 | 1,082,076,532 |
| 前払費用 | 130,852,171 |
| 流動資産合計 | 82,946,355,034 |
| 資産合計 | 82,946,355,034 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 62,907,741 |
| 未払利息 | 600 |
| 流動負債合計 | 62,908,341 |
| 負債合計 | 62,908,341 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 47,134,253,100 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 35,749,193,593 |

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 元本等合計 | 82,883,446,693 |
| 純資産合計 | 82,883,446,693 |
| 負債純資産合計 | 82,946,355,034 |

## 注記表

### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券<br>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 |
| 3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。<br>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。 |
| 4.収益及び費用の計上基準 | 為替予約取引による為替差損益<br>約定日基準で計上しております。 |

### （貸借対照表に関する注記）

| | | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|---|
| 1. | 計算期間の末日における受益権の総数 | 47,134,253,100口 |
| 2. | 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額　1.7585円<br>(1万口当たり純資産額)　(17,585円) |

### （金融商品に関する注記）
### 金融商品の時価等に関する事項

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

（重要な後発事象に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（その他の注記）
元本の移動

| 区分 | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2022年 1月21日 |
| 期首元本額 | 47,259,879,384円 |
| 期中追加設定元本額 | 4,244,606,962円 |
| 期中一部解約元本額 | 4,370,233,246円 |
| 期末元本額 | 47,134,253,100円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| ＳＭＴ　新興国債券インデックス・オープン | 5,303,823,916円 |
| 世界経済インデックスファンド | 12,542,904,133円 |
| ＤＣ新興国債券インデックス・オープン | 5,147,290,816円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 11,084,434,132円 |
| 新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用） | 4,010,983円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 104,373,835円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 273,391,462円 |
| 新興国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 55,174,447円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 227,137,108円 |

| 区分 | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 487,361,674円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 469,761,244円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 3,536,750,394円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 111,862,553円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 208,183,265円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 93,647,609円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 169,802,462円 |
| 外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用） | 2,949,546,746円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 341,004,334円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 427,108,333円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 682,302,434円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 9,385,734円 |
| グローバル経済コア | 745,014,468円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 33,693,326円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 5,548,851円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 30,457,380円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 22,896,022円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 8,278,268円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 10,009,010円 |
| Ｍｙ　ＳＭＴ　新興国債券インデックス（ノーロード） | 284,870円 |
| １０資産分散投資ファンド | 13,984円 |
| ＦＯＦｓ用　新興国債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用） | 58,139,049円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 471,406,968円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 108,626,368円 |
| ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用） | 13,827,185円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用） | 282,637,302円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用） | 286,165,422円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用） | 284,706,302円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用） | 273,775,150円 |
| ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用） | 269,515,561円 |

**（デリバティブ取引に関する注記）**

該当事項はありません。

**新興国株式インデックス　マザーファンド**

**貸借対照表**

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 3,608,145,736 |
| コール・ローン | 109,297,231 |
| 株式 | 105,971,421,332 |
| 投資信託受益証券 | 223,708,273 |
| 投資証券 | 104,407,847 |
| 派生商品評価勘定 | 5,024,840 |
| 未収入金 | 15,014,149 |
| 未収配当金 | 788,411,389 |
| 前払金 | 87,116,186 |
| 差入委託証拠金 | 580,264,393 |
| 流動資産合計 | 111,492,811,376 |
| 資産合計 | 111,492,811,376 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 92,193,738 |
| 未払金 | 40,915 |
| 未払解約金 | 13,914,700 |
| 未払利息 | 57 |
| 流動負債合計 | 106,149,410 |
| 負債合計 | 106,149,410 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 31,231,584,765 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 80,155,077,201 |
| 元本等合計 | 111,386,661,966 |
| 純資産合計 | 111,386,661,966 |
| 負債純資産合計 | 111,492,811,376 |

**注記表**

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 1 .有価証券の評価基準及び評価方法 | (1)株式<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。<br><br>(2)投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。<br><br>(3)投資証券 |

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| | 移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br>株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。<br><br>(2)為替予約取引<br>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。<br><br>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。 |
| 3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。<br>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。 |
| 4.収益及び費用の計上基準 | (1)受取配当金<br>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。<br>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。<br><br>(2)派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。<br><br>(3)為替予約取引による為替差損益<br>約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 1．　計算期間の末日における受益権の総数 | 31,231,584,765口 |

| | 2022年 7月20日現在 | |
|---|---|---|
| 2．　計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 | 3.5665円 |
| | (1万口当たり純資産額) | (35,665円) |

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

| | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

（重要な後発事象に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（その他の注記）
元本の移動

| 区分 | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2022年 1月21日 |
| 期首元本額 | 28,827,989,077円 |

| 区分 | 2022年 7月20日現在 |
|---|---|
| 期中追加設定元本額 | 2,766,119,661円 |
| 期中一部解約元本額 | 362,523,973円 |
| 期末元本額 | 31,231,584,765円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| ＳＭＴ　新興国株式インデックス・オープン | 7,956,791,153円 |
| 世界経済インデックスファンド | 6,033,569,361円 |
| ＤＣ新興国株式インデックス・オープン | 5,484,176,700円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 5,460,370,556円 |
| 新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 160,865,924円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 234,719,161円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 1,319,362,044円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 758,166,995円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 621,058,375円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 337,986,705円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 16,429,097円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 84,088,748円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 163,939,561円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 650,037,769円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 111,150,980円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 4,589,008円 |
| グローバル経済コア | 357,361,012円 |
| ｉ－ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード） | 48,671,256円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 28,983,856円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 23,564,048円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 8,950,743円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 11,279,476円 |
| １０資産分散投資ファンド | 4,133円 |
| 世界株式ファンド（適格機関投資家専用） | 1,106,400,994円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 188,437,182円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 52,356,859円 |
| ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用） | 8,273,069円 |

**（デリバティブ取引に関する注記）**

**株式関連**

**（2022年 7月20日現在）**

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 5,168,959,044 | － | 5,081,842,858 | △87,116,186 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 合計 | 5,168,959,044 | － | 5,081,842,858 | △87,116,186 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

（2022年 7月20日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 121,206,000 | － | 121,153,288 | △52,712 |
| | アメリカドル | 33,156,000 | － | 33,156,288 | 288 |
| | 香港ドル | 88,050,000 | － | 87,997,000 | △53,000 |
| 合計 | | 121,206,000 | － | 121,153,288 | △52,712 |

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 2【ファンドの現況】

### 【世界経済インデックスファンド（株式シフト型）】

### 【純資産額計算書】

（2022年 8月31日現在）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 5,571,700,230円 |
| Ⅱ　負債総額 | 55,635,638円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 5,516,064,592円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 2,813,827,198口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.9603円 |
| （1万口当たり純資産額） | （19,603円） |

（参考）

国内債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 8月31日現在）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 647,385,490,238円 |
| Ⅱ　負債総額 | 18,723,836,439円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 628,661,653,799円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 457,020,854,714口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.3756円 |
| （1万口当たり純資産額） | （13,756円） |

国内株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 8月31日現在）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 514,123,653,971円 |
| Ⅱ　負債総額 | 1,077,034,729円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 513,046,619,242円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 264,196,295,704口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.9419円 |
| （1万口当たり純資産額） | （19,419円） |

## 外国債券インデックス　マザーファンド

### 純資産額計算書

（2022年 8月31日現在）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 319,794,985,621円 |
| Ⅱ　負債総額 | 172,045,000円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 319,622,940,621円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 101,323,877,978口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 3.1545円 |
| （1万口当たり純資産額） | （31,545円） |

## 外国株式インデックス　マザーファンド

### 純資産額計算書

（2022年 8月31日現在）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 555,402,658,296円 |
| Ⅱ　負債総額 | 474,877,096円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 554,927,781,200円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 127,922,822,579口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 4.3380円 |
| （1万口当たり純資産額） | （43,380円） |

## 新興国債券インデックス　マザーファンド

### 純資産額計算書

（2022年 8月31日現在）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 86,858,363,930円 |
| Ⅱ　負債総額 | 27,972,246円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 86,830,391,684円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 47,984,575,558口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.8095円 |
| （1万口当たり純資産額） | （18,095円） |

## 新興国株式インデックス　マザーファンド

### 純資産額計算書

（2022年 8月31日現在）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 115,893,415,683円 |
| Ⅱ　負債総額 | 727,995,593円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 115,165,420,090円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 31,715,109,774口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 3.6312円 |
| （1万口当たり純資産額） | （36,312円） |

## 第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

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

②受益権の譲渡

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

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

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

③受益権の譲渡の対抗要件

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

④受益権の再分割

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

⑤償還金

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

**則として取得申込者とします。）に支払います。**

**⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて**

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

# 第三部【委託会社等の情報】

## 第１【委託会社等の概況】

### １【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2022年 8月31日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

会社に取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。
取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。
また、監査等委員以外の取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席し、その議決権の３分の２以上をもって行います。
取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。
監査等委員である取締役の任期は、選任後２年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。
取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長１名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。
取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。
取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。
取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

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

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

［DO（実行）］

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

［CHECK（検証・評価）］

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

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

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

委託会社の機構は2022年10月20日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年8月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

| | 本数（本） | 純資産総額（百万円） |
|---|---|---|
| 追加型株式投資信託 | 539 | 14,041,250 |
| 追加型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 単位型株式投資信託 | 70 | 221,703 |
| 単位型公社債投資信託 | 51 | 216,636 |
| 合計 | 660 | 14,479,589 |

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

**（1）【貸借対照表】**

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

## （2）【損益計算書】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

| | 前事業年度<br>（自　2020年4月1日<br>至　2021年3月31日） | 当事業年度<br>（自　2021年4月1日<br>至　2022年3月31日） |
|---|---|---|

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

## （3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

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

当事業年度（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

| | 評価・換算差額等 | | | 純資産合計 |
|---|---|---|---|---|
| | その他有価証券評価差額金 | 繰延ヘッジ損益 | 評価・換算差額等合計 | |

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

## 注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

２．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

３．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

４．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

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

５．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

６．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

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

（2）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用　　：発生事業年度に損益処理

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

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

７．収益及び費用の計上基準

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

（1）投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応

じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

（2）投資一任業務

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

（3）投資助言業務

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

（4）成功報酬

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

８．ヘッジ会計の会計処理

（1）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

（2）ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

（3）ヘッジ方針

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

（4）ヘッジ有効性評価の方法

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

９．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

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

（会計方針の変更）

１．「収益認識に関する会計基準」等の適用

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号　2020年3月31日）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

２．「時価の算定に関する会計基準」等の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号　2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号　2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

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

**（未適用の会計基準等）**

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

**(1) 概要**

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

**(2) 適用予定日**

**2023年3月期の期首より適用予定であります。**

**(3) 当該会計基準等の適用による影響**

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

**（追加情報）**

**退職給付債務及び費用の算定方法の変更**

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

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

**（貸借対照表関係）**

**※1有形固定資産の減価償却累計額**

| | 前事業年度<br>（2021年3月31日） | | 当事業年度<br>（2022年3月31日） | |
|---|---|---|---|---|
| 建　　物 | 106 | 百万円 | 146 | 百万円 |
| 器具備品 | 391 | 〃 | 535 | 〃 |
| そ の 他 | 4 | 〃 | ― | 〃 |
| 計 | 503 | 〃 | 681 | 〃 |

**（株主資本等変動計算書関係）**

**前事業年度（自 2020年4月1日　至 2021年3月31日）**

**１．発行済株式の種類及び総数に関する事項**

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

**２．自己株式の種類及び株式数に関する事項**

**該当事項はありません。**

**３．剰余金の配当に関する事項**

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

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

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

当事業年度（自 2021年4月1日　至 2022年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

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

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

2022年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額(百万円) | 配当金の原資 | 1株当たり配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2022年6月23日<br>定時株主総会 | 普通株式 | 2,641 | 利益剰余金 | 880,447 | 2022年3月31日 | 2022年6月24日 |

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。

これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針８．ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

２.金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31 号 2019年7月4日。以下、「時価算定適用指針」という。）第26 項に従い経過措置を適用した投資信託、市場価格のない株式等及び、時価算定適用指針第27項に従い経過措置を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）*2、*3及び（注2）参照）。

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

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

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

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

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

（１）時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2021年3月31日）

| | 貸借対照表計上額（百万円）（*1） |
|---|---|
| 金銭の信託 | 10,857 |
| 投資有価証券 | |
| その他有価証券 | 9,950 |
| デリバティブ取引（*2） | |
| ヘッジ会計が適用されていないもの | (357) |
| ヘッジ会計が適用されているもの | (73) |
| デリバティブ取引計 | (431) |

(*1) 負債に計上されているものについては、（　　）で示しております。
(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2022年3月31日）

| 区　分 | 貸借対照表計上額（百万円）(*1、*2) | | | |
|---|---|---|---|---|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| 金銭の信託(*3) | － | 196 | － | 196 |
| デリバティブ取引(*4) | | | | |
| ヘッジ会計が適用されていないもの | (1,333) | (80) | － | (1,413) |
| ヘッジ会計が適用されているもの | － | (71) | － | (71) |
| デリバティブ取引計 | (1,333) | (151) | － | (1,485) |

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
(*2) 投資有価証券のうち、投資信託（貸借対照表計上額6,474百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額133百万円）は上記に含めておりません。
(*3) 金銭の信託の信託財産のうち、投資信託（貸借対照表計上額13,876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額840百万円）は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,913百万円であります。
(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

（２）時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位:百万円）

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

（注3） 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2021年3月31日）　　（単位:百万円）

| | 1年以内 | 1年超5年以内 | 5年超10年以内 | 10年超 |
|---|---|---|---|---|
| 現金及び預金 | 21,589 | － | － | － |
| 未収委託者報酬 | 8,471 | － | － | － |
| 未収運用受託報酬 | 6,151 | － | － | － |
| 投資有価証券<br>投資信託 | － | 10 | 5,751 | 0 |

当事業年度（2022年3月31日）　　（単位:百万円）

| | 1年以内 | 1年超5年以内 | 5年超10年以内 | 10年超 |
|---|---|---|---|---|
| 現金及び預金 | 21,675 | － | － | － |
| 未収委託者報酬 | 9,067 | － | － | － |
| 未収運用受託報酬 | 6,252 | － | － | － |
| 投資有価証券 | | | | |
| 投資信託 | － | 108 | 1,712 | 0 |

（有価証券関係）

１．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位:百万円）

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

２．その他有価証券

前事業年度（2021年3月31日）　　（単位:百万円）

| 区分 | 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|---|---|---|---|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | | | |
| その他 | 9,940 | 8,798 | 1,142 |
| 小計 | 9,940 | 8,798 | 1,142 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | | | |
| その他 | 9 | 10 | △1 |
| 小計 | 9 | 10 | △1 |
| 合計 | 9,950 | 8,809 | 1,141 |

当事業年度（2022年3月31日）　　（単位：百万円）

| 区分 | 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|---|---|---|---|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | | | |
| その他 | 4,888 | 3,403 | 1,485 |
| 小計 | 4,888 | 3,403 | 1,485 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | | | |
| その他 | 1,585 | 1,711 | △126 |
| 小計 | 1,585 | 1,711 | △126 |
| 合計 | 6,474 | 5,115 | 1,358 |

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

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位:百万円）

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

**３．事業年度中に売却したその他有価証券**

前事業年度（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）　（単位:百万円）

| 区分 | 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|---|---|---|---|
| その他 | 109 | 1 | 0 |

当事業年度（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日）　（単位:百万円）

| 区分 | 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|---|---|---|---|
| その他 | 7 | 0 | 0 |

**（デリバティブ取引関係）**

前事業年度（2021年3月31日）

**１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引**

**（1）通貨関連**

| 種類 | | 契約額等<br>(百万円) | 契約額等の<br>うち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) | 評価損益<br>(百万円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | | | | |
| | 米ドル | 2,889 | ― | △41 | △41 |
| | 英ポンド | 128 | ― | △0 | △0 |
| | カナダドル | 21 | ― | △0 | △0 |
| | スイスフラン | 51 | ― | 0 | 0 |
| | 香港ドル | 128 | ― | △1 | △1 |
| | ユーロ | 246 | ― | 0 | 0 |
| | 買建 | | | | |
| | 米ドル | 99 | ― | 1 | 1 |
| | 香港ドル | 2 | ― | 0 | 0 |
| 合計 | | 3,567 | ― | △41 | △41 |

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

**（2）株式関連**

| 種類 | | 契約額等<br>(百万円) | 契約額等の<br>うち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) | 評価損益<br>(百万円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>売建 | 13,711 | ― | △315 | △315 |
| 合計 | | 13,711 | ― | △315 | △315 |

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

**２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引**

**（1）通貨関連**

| ヘッジ会計の方法 | 種類 | 主なヘッジ対象 | 契約額等（百万円） | 契約額等のうち1年超（百万円） | 時価（百万円） |
|---|---|---|---|---|---|
| 原則的処理方法 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | | | | |
| | 米ドル | 投資有価証券関係会社株式 | 3,993 | － | △57 |
| | 英ポンド | | 3,108 | － | △15 |
| | カナダドル | | 3 | － | △0 |
| | スイスフラン | | 57 | － | 0 |
| | 香港ドル | | 110 | － | △1 |
| | ユーロ | | 108 | － | 0 |
| | 人民元 | | 6 | － | △0 |
| | 買建 | | | | |
| | 米ドル | | 38 | － | 0 |
| | 香港ドル | | 3 | － | 0 |
| | 人民元 | | 1 | － | 0 |
| 合計 | | | 7,431 | － | △73 |

当事業年度（2022年3月31日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

| 種類 | | 契約額等（百万円） | 契約額等のうち1年超（百万円） | 時価（百万円） | 評価損益（百万円） |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | | | | |
| | 米ドル | 5,498 | － | △54 | △54 |
| | 英ポンド | 277 | － | △1 | △1 |
| | カナダドル | 111 | － | △1 | △1 |
| | スイスフラン | 139 | － | △2 | △2 |
| | 香港ドル | 190 | － | △1 | △1 |
| | ユーロ | 676 | － | △18 | △18 |
| | 買建 | | | | |
| | ユーロ | 21 | － | 0 | 0 |
| 合計 | | 6,915 | － | △80 | △80 |

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

（2）株式関連

| 種類 | | 契約額等（百万円） | 契約額等のうち1年超（百万円） | 時価（百万円） | 評価損益（百万円） |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 売建 | 17,197 | － | △1,333 | △1,333 |
| 合計 | | 17,197 | － | △1,333 | △1,333 |

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

| ヘッジ会計の方法 | 種類 | 主なヘッジ対象 | 契約額等（百万円） | 契約額等のうち1年超（百万円） | 時価（百万円） |
|---|---|---|---|---|---|

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 原則的処理方法 | 為替予約取引<br>売建<br>米ドル | 投資有価証券<br>関係会社株式 | 4,422 | － | △43 |
| | 英ポンド | | 3,297 | － | △21 |
| | スイスフラン | | 79 | － | △1 |
| | 香港ドル | | 119 | － | △1 |
| | ユーロ | | 125 | － | △3 |
| | 人民元 | | 13 | － | △0 |
| 合計 | | | 8,057 | － | △71 |

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。当社が有する退職一時金制度は従来簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しておりましたが、当事業年度より原則法と簡便法の併用により、これら計算を行っております。

2．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（単位：百万円）

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

（単位：百万円）

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

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

(5) 年金資産に関する事項
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

3．確定拠出制度
当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度92百万円、当事業年度100百万円であります。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（収益認識関係）

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

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

3．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

**（セグメント情報等）**

**［セグメント情報］**

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

**［関連情報］**

**１．製品及びサービスごとの情報**

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

**２．地域ごとの情報**

**（1）営業収益**

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

**（2）有形固定資産**

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

**３．主要な顧客ごとの情報**

**前事業年度（自 2020年4月1日　至 2021年3月31日）**

| 顧客の名称 | 営業収益 |
|---|---|
| 三井住友信託銀行株式会社 | 9,649百万円 |
| 次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*) | 6,372百万円 |

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

**当事業年度（自 2021年4月1日　至 2022年3月31日）**

| 顧客の名称 | 営業収益 |
|---|---|
| 三井住友信託銀行株式会社 | 10,395百万円 |
| 次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*) | 6,395百万円 |

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

**［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］**

**該当事項はありません。**

**［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］**

**該当事項はありません。**

**［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］**

**該当事項はありません。**

**（関連当事者情報）**

**１．関連当事者との取引**

**財務諸表提出会社と関連当事者の取引**

**（ア）財務諸表提出会社の親会社**

**重要性が乏しいため、記載を省略しております。**

**（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等**

**重要性が乏しいため、記載を省略しております。**

**（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等**

**前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）**

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金（百万円） | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有（被所有）割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（百万円） | 科目 | 期末残高（百万円） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 親会社の子会社 | 三井住友信託銀行㈱ | 東京都千代田区 | 342,037 | 信託業務及び銀行業務 | ― | 営業上の取引役員の兼任 | 運用受託報酬 | 9,365 | 未収運用受託報酬 | 5,402 |
| | | | | | | | 投信販売代行手数料等 | 9,124 | 未払手数料 | 1,888 |

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

**２．取引条件及び取引条件の決定方針等**

**① 運用受託報酬**

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

**② 投信販売代行手数料等**

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

**当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）**

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金（百万円） | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有（被所有）割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（百万円） | 科目 | 期末残高（百万円） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 親会社の子会社 | 三井住友信託銀行㈱ | 東京都千代田区 | 342,037 | 信託業務及び銀行業務 | ― | 営業上の取引役員の兼任 | 運用受託報酬 | 10,090 | 未収運用受託報酬 | 5,421 |
| | | | | | | | 投信販売代行手数料等 | 9,701 | 未払手数料 | 1,995 |

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

**２．取引条件及び取引条件の決定方針等**

**① 運用受託報酬**

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

**② 投信販売代行手数料等**

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

**（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等**

**該当事項はありません。**

**２．親会社又は重要な関連会社に関する注記**

**(1) 親会社情報**

**前事業年度（2021年3月31日）**

**三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）**

**当事業年度（2022年3月31日）**

**三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）**

**（１株当たり情報）**

| | 前事業年度<br>（自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日） | 当事業年度<br>（自 2021年4月1日<br>至 2022年3月31日） |
|---|---|---|

| | | |
|---|---|---|
| 1株当たり純資産額 | 20,274,967円09銭 | 21,406,512円22銭 |
| 1株当たり当期純利益金額 | 2,331,221円85銭 | 2,162,405円20銭 |

（注）１．潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
２．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 前事業年度<br>（自　2020年4月1日<br>至　2021年3月31日） | 当事業年度<br>（自　2021年4月1日<br>至　2022年3月31日） |
|---|---|---|
| 当期純利益 | 6,993百万円 | 6,487百万円 |
| 普通株主に帰属しない金額 | － | － |
| 普通株式に係る当期純利益 | 6,993百万円 | 6,487百万円 |
| 普通株式の期中平均株式数 | 3,000株 | 3,000株 |

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

## ４【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

**5【その他】**

**(1)定款の変更**

**委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。**

**(2)訴訟事件その他の重要事項**

**2022年10月20日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。**

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

**(1)受託会社**

**①名称　　：三井住友信託銀行株式会社**

**②資本金の額：342,037百万円（2022年3月末日現在）**

**③事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。**

**(2)販売会社**

| 名称 | 資本金の額（百万円）<br>（2022年3月末日現在） | 事業の内容 |
|---|---|---|
| 株式会社ＳＢＩ証券 | 48,323 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| マネックス証券株式会社 | 12,200 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 楽天証券株式会社 | 17,495 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| ソニー銀行株式会社 | 38,500 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| 立花証券株式会社 | 6,695 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| ａｕカブコム証券株式会社 | 7,196 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 丸八証券株式会社 | 3,751 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| GMOクリック証券株式会社 | 4,346 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 岡三証券株式会社 | 5,000 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 松井証券株式会社 | 11,945 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |

### 2【関係業務の概要】

**(1)受託会社**

**当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。**

**(2)販売会社**

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

## 3【資本関係】

**(1)受託会社**

**該当事項はありません。**

**(2)販売会社**

**該当事項はありません。**

**(参考)再信託受託会社**

**①名称　　：株式会社日本カストディ銀行**
**②設立年月日　：2000年6月20日**
**③資本金の額　：51,000百万円（2022年3月末日現在）**
**④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。**
**⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。**

## 第3【その他】

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

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

**(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。**

**①ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。**
**②本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。**
**③交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。**
**④ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。**
**⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。**

**(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。**

**(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。**

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

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

**(7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。**

**(8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。**

**(9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。**

**(10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。**

# 独立監査人の監査報告書

2022年６月２日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

| | |
|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士　三　上　和　彦 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士　藤　澤　　孝 |

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

　当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
　その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。
　当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任
　監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による

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

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

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

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

**利害関係**

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

**以　上**

---

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

**２．ＸＢＲＬ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3月18日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　松崎雅則　　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界経済インデックスファンド（株式シフト型）の2021年1月21日から2022年1月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界経済インデックスファンド（株式シフト型）の2022年1月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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

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

以　上

---

（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2022年9月30日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　松崎雅則　　印

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界経済インデックスファンド（株式シフト型）の2022年1月21日から2022年7月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、世界経済インデックスファンド（株式シフト型）の2022年7月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年1月21日から2022年7月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

**する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。**

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

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

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

**利害関係**

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

**以　上**

---

**（注）１．上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。**
**２．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。**