【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年10月11日提出
【計算期間】	第10期(自 2021年7月13日至 2022年7月11日)
【ファンド名】	分散投資コア戦略ファンドＡ 分散投資コア戦略ファンドＳ
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田　賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長　民野　誠
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

当ファンドは、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

＜信託金限度額＞

各ファンドにつき上限 1兆円

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 （収益の源泉）	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	ＭＭＦ	インデックス型
追加型	海外	債券	ＭＲＦ	特殊型
	内外	不動産投信	ＥＴＦ	
		その他資産 （　　）		
		資産複合		

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象 地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型

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

（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. 長期分散投資により、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指します。

●投資対象ファンドを通じて、国内外の株式・債券といった様々な資産に分散投資し、これらをうまく組み合わせることで中長期的に安定した収益の獲得を目指します。
●今後も先進国の安定成長と新興国の高い経済成長が見込まれることから、投資対象の多様化により、世界経済の成長果実をじっくりと享受することを目指します。

2. 短期的な下振れリスクの抑制を目指します。

●保有資産の価値を守り、収益を安定させるために、市場の下落局面でも損失の抑制や収益の獲得を目指します。
●市場の下振れリスクに伴う保有資産の価値の減少を抑制するために、投資対象ファンドを通じてヘッジファンド※1等に投資し、オルタナティブ運用※2を行います。

※1 実質的に金利、為替、株式、債券、商品等に対して裁定取引やデリバティブ取引等の様々な手法を活用してリスクを回避しながら利益を追求するファンドを指します。
※2 株式や債券等の伝統的資産とは異なる資産への投資を言います。具体的な投資対象は、リート、バンクローン、コモディティ、ヘッジファンド等があり、一般に株式や債券等との価格連動性（相関性）が低く、分散投資効果があるとされています。なお、オルタナティブ運用では、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指した運用を行うこともあります。

3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

●各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の値動きの関係（相関関係）、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。また、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合の定期的な見直しを行うほか、市場環境等の変化に応じた調整を行います。
●投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

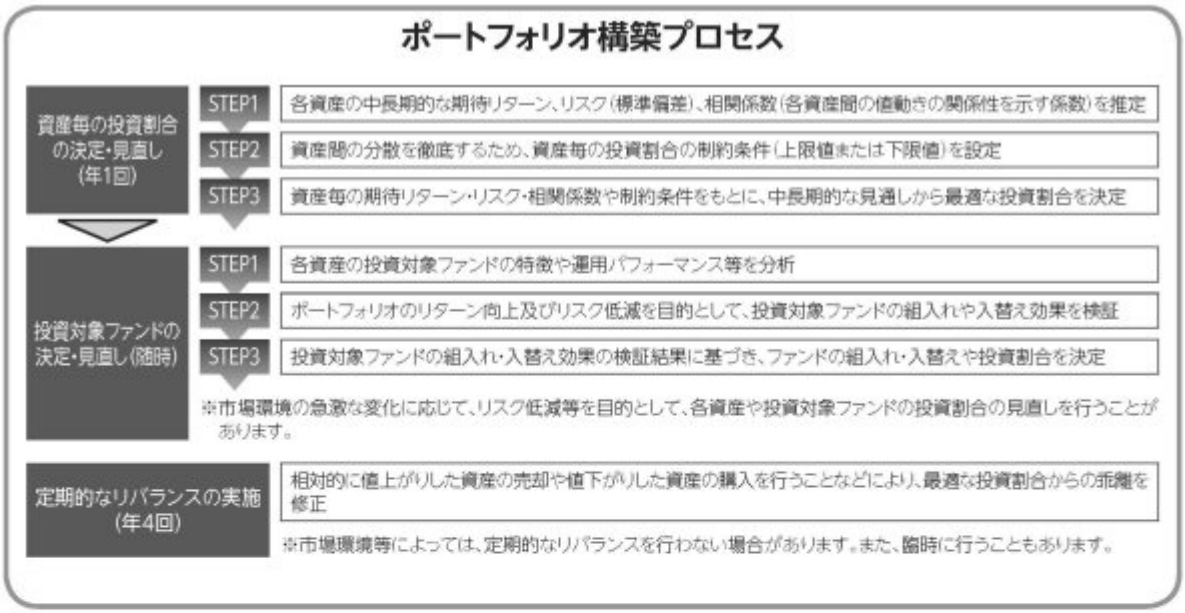
ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、投資対象とする資産及びファンドを限定していません。また、それらへの投資割合も予め定めているものでもありません。従って、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資割合を変更する運用を行います。

4. 運用目的・リスク許容度に応じて2つのファンドから選択できます。

	「株式」「リート」「コモディティ」への投資割合の合計※3	運用の特徴
分散投資コア戦略ファンドA 愛称:コアラップA	原則50%未満	安定性を重視
分散投資コア戦略ファンドS 愛称:コアラップS	原則75%未満	安定性と収益性のバランスを重視

※3 純資産総額に対する投資対象ファンドへの投資割合の合計です。なお、当該投資割合には、ヘッジファンドに投資する投資対象ファンドが含まれていないため、ヘッジファンドへの投資割合が高くなる可能性があります。
ヘッジファンドには特有のリスクがありますので、後掲「3　投資リスク　(1)ファンドのリスク　⑩ヘッジファンドの運用手法に係るリスク」を十分にお読みください。

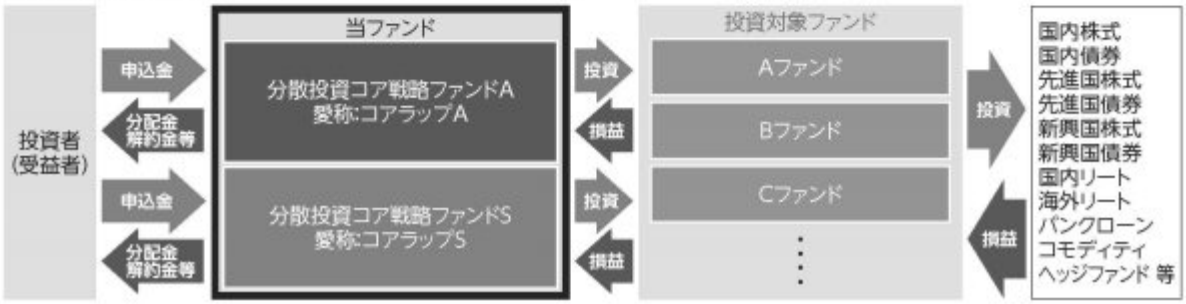
●市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



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

？ ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

分配方針

●年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。
●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。
●分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
●収益分配金は、自動的にファンドの受益権に再投資されます。
※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

〈ご参考情報〉

パンクローン

銀行などの金融機関が、事業拡大などのために資金調達を希望する企業などに対して行う融資(ローン)を指します。一般的に、パンクローンは投資適格未満の格付を有する企業への変動金利のローンです。

コモディティ

金や原油、穀物などの「商品」のことです。商品への投資に際しては、商品インデックスに連動する仕組み債券に投資するファンドなどがあります。

ヘッジファンド

ヘッジとは元々"回避する"という意味で、投資対象資産の価格変動に伴うリスクを回避する投資行動のことをいいます。裁定取引やデリバティブ取引(先物取引、オプション取引等)等を活用して実質的に金利・債券・株式・リート・コモディティ等に投資を行います。市場環境に関わらず収益(絶対収益)を追求するファンド※などがあります。
※特定の市場の動向に関わらず収益を追求することを目標として運用を行うファンドのことで、絶対に収益が得られるという意味ではありません。

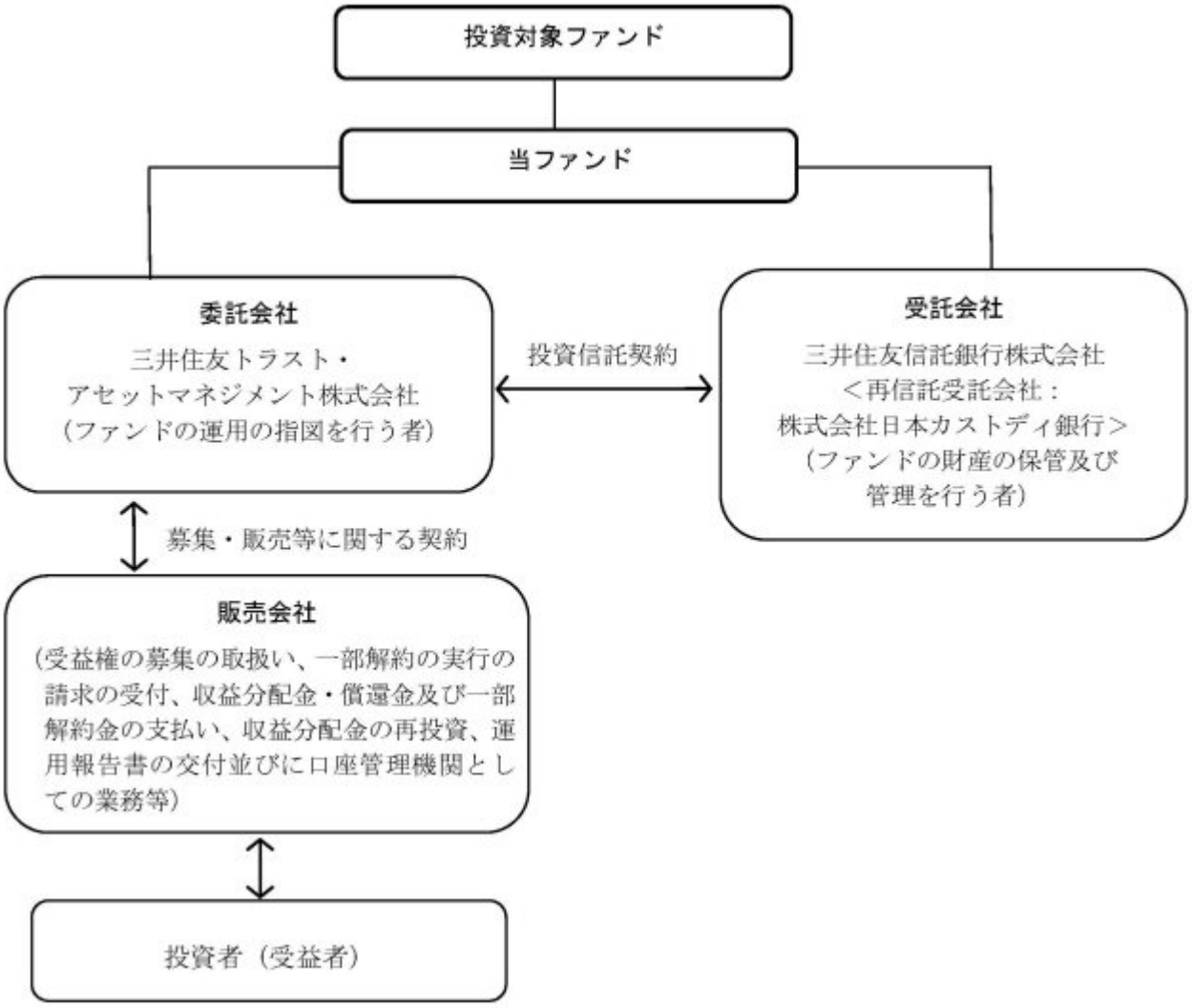
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（２）【ファンドの沿革】

2013年3月29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 7月29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、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

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

②投資対象

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

③投資態度

イ．主として、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、国内不動産投資信託証券（以下「国内リート」といいます。）、海外不動産投資信託証券（以下「海外リート」といいます。）、貸付債権（以下「バンクローン」といいます。）、コモディティ[*1]、ヘッジファンド[*2]及びその他の様々な資産を実質的な投資対象とする投資対象ファンドに分散投資します。

＊1：コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的にコモディティリンク債券やコモディティ関連デリバティブ等を活用するファンドを指します。

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

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

※投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

ハ．国内株式、先進国株式、新興国株式、国内リート、海外リート、コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、以下の割合とします。

分散投資コア戦略ファンドA	分散投資コア戦略ファンドS
50%未満	75%未満

なお、市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。

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

ホ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

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

ト．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。

（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. 金銭債権
3. 約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

②有価証券の指図範囲

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

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

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

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

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。

④当ファンドが、当ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性のある投資対象ファンドの概要は、下記「（参考）投資対象ファンドの概要」に記載されている通りです。

（参考）投資対象ファンドの概要

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

以下の内容は、2022年 7月29日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。
なお、投資対象ファンドの運用会社より確認した情報をもとにしており、記載している定義は、当該ファンドに限定されます。

1.国内株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（※）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している株式
投資態度	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、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 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ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 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、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

主な投資制限	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新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236 条第1 項第3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の５%以下とします。 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およびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 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、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

①同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。

②ＪＰＸは、同指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は同指数に係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

③ＪＰＸは、同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
④ＪＰＸは、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではありません。
⑥ＪＰＸは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負いません。
⑦ＪＰＸは、当社又は本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではありません。
⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

2.日本株式最小分散インデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場している株式
投資態度	①主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投資し、MSCI日本株最小分散インデックス（配当込み）（※）に連動する投資成果を目指します。 ②株式への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③株式以外の資産への投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。 ④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 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、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	MSCI 日本株最小分散インデックス（配当込み）
決算日	年1回：1月22日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。

信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年4月15日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「MSCI 日本株最小分散インデックス（配当込み）」とは、MSCI Inc.が開発した日本の株式市場に上場する日本株を対象とした指数です。計量モデルを活用することで、指数値の変動幅を一定の制約条件下で最小化することを目指します。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

3.国内債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の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。
主要投資対象	わが国の公社債
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。

主な投資制限	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（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 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。
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「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。

4.外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、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、円ヘッジ・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。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債

投資態度	①FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・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公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行います。 ④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、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。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 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、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）
決算日	年1回：12月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年1月15日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・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。「円ヘッジ・円ベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。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。

5.外国株式インデックス マザーファンド

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

主な投資制限	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、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236 条第1項第3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 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。
ベンチマーク	MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

6.外国株式最小分散インデックスマザーファンド

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

主要投資対象	わが国を除く世界の主要国の株式
投資態度	①主としてわが国を除く世界の主要国の株式に投資し、MSCIコクサイ最小分散インデックス（JPY）（円換算ベース）（※）に連動する投資成果を目指します。 ②株式への投資割合は、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資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 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、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	MSCIコクサイ最小分散インデックス（JPY）（円換算ベース）
決算日	年1回：5月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年7月25日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「MSCIコクサイ最小分散インデックス（JPY）」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に上場する銘柄を対象とした指数です。計量モデルを活用することで、対円の為替変動を含めた指数値の変動幅を、一定の制約条件下で最小化することを目指します。「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ものです。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。

7.外国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の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。

主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債
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。
主な投資制限	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（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 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。
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「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。

8.新興国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、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。
主要投資対象	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。）
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者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。

主な投資制限	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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 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。
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月12日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「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。

9.新興国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、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。
主要投資対象	新興国の債券

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者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。
主な投資制限	①株式への投資は行いません。 ②同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 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。
ベンチマーク	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）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月11日

信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「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。

10.J-REITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）（※）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券
投資態度	①わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。 ③投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 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。

主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数(配当込み)における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 ③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。 ④外貨建資産への投資は行いません。 ⑤投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。 ⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	東証REIT指数（配当込み）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「東証REIT指数（配当込み）」とは、株式会社ＪＰＸ総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。

①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ＪＰ

Ｘが有しています。
②ＪＰＸは、同指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は同指数に係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。
③ＪＰＸは、同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
④ＪＰＸは、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではありません。
⑥ＪＰＸは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負いません。
⑦ＪＰＸは、当社又は本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではありません。
⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

11.グローバルREITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）（※）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券
投資態度	①日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。 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。

主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 ③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。 ④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ⑤一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor’s(R)及びS&P(R)は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor’s Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones(R)はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者又はいかなる一般人に対して、株式全般又は具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追随するS&P先進国REIT指数の能力に関して、明示又は黙示を問わず、いかなる表明又は保証もしません。S&P先進国REIT指数に関して、S&P Dow Jones Indicesと当社との間にある唯一の

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

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

12.グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価格が概ね連動する米ドル建て債券（以下「米ドル建て債券」といいます。）に投資を行い、世界の様々な商品（コモディティ）市況を捉えることを目的に、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）（※）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	米ドル建て債券

投資態度	①ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。 ②米ドル建て債券への投資は高位とすることを基本とします。 ③外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ④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、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並びに委託者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（スワップ取引）、並びに金利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。
主な投資制限	①株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236 条第1項第3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、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。 ⑤同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥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。 ⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 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およびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。

信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年7月1日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index[SM]）及び「ブルームバーグ（Bloomberg[(R)]）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、当社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index[SM]）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー及びその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグ及びUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューし又は推奨するものではありません。ブルームバーグ及びUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index[SM]）に関連するいかなるデータ又は情報の適時性、正確性又は完全性も保証するものではありません。

13.ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 ＜別に定める金現物に投資する上場投資信託証券＞（2022年7月29日現在） iShares Gold Trust SPDR Gold Shares
投資態度	①主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。 ②投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託者の判断により見直しを行うことがあります。 ③投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	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（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 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、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	ＬＢＭＡ金価格（円ヘッジベース）（※）（2022年7月29日現在） ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年10月11日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

14.ＨＦリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）

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

主要投資対象	日本国債及び国内外の上場投資信託証券を主要投資対象とし、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引、為替予約取引を主要取引対象とします。
投資態度	①主として日本国債及び国内外の上場投資信託証券に投資し、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引、為替予約取引を組み合わせることで、HFRI総合指数（円ヘッジ・円ベース）（※）の騰落率と概ね同程度の投資成果を目指します。 ②ポートフォリオの構築にあたっては、計量手法に基づいてHFRI総合指数（円ヘッジ・円ベース)の値動きを分析し、日本国債及び上場投資信託証券や上場投資証券の投資割合、株価指数先物取引、債券先物取引、為替予約取引の取引量等を決定します。 ③組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行います。なお、当該為替ヘッジとは別に、為替予約取引を活用することで収益の獲得を目指します。 ④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。 ⑤為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。 ⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：7月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年10月20日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※HFRI総合指数（円ヘッジ・円ベース）（HFRI Weighted Composite Index JPY）は、HFRI Fund Weighted Composite Index の日本円ヘッジバージョンであり、Hedge Fund Research, Inc.（以下「HFR」）が月次為替予約のコストを適用して算出します。

HFRI Fund Weighted Composite Indexは、HFRのデータベースに登録されたヘッジファンドを対象とするグローバルな等加重インデックスです。データベースへの登録条件は、①運用会社がHFRからの質問項目に回答すること、②5,000万米ドル以上の運用資産残高を有するか、12か月間以上の運用実績と1,000万米ドル以上の運用資産残高を有すること、③毎月、手数料控除後の米ドルベースのパフォーマンスと運用資産残高をHFRに対して報告することとなっています。なお、ファンド・オブ・ヘッジファンズは対象としていません。

「HFRI Weighted Composite Index JPY」及び「HFRI」は、Hedge Fund Research, Inc.（以下「HFR」）の商標です。その使用については、ライセンス契約に基づいてHFRから三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に許諾されています。HFRは、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社、その関連会社、又はそれらの金融商品とは一切関係ありません。HFRは、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社のいかなる金融商品の組成にも関与しておらず、それらの金融商品への投資を支持、承認、推奨するものではありません。また、それらの当該金融商品に関連するいかなる種類又は性質の損害に対しても責任を負いません。

15.ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本の円建短期公社債等を主要投資対象とし、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を主要取引対象とします。
投資態度	①主として日本の円建短期公社債等に投資するとともに、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。 ②債券先物取引及び為替予約取引等は、原則として定量的手法に基づいた複数の運用戦略を組み合わせることで行います。 ③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、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。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。 ⑤為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。 ⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年3月25日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

16.FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

投資態度	①マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます）に投資し、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR － Diversified Alpha」（以下「PTRディバーシファイド・アルファ・ファンド」※といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。 ※PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドは、世界の株式、債券、為替等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルク籍投資信託証券です。 ②円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。 ③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 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、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 ①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。 ②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜　0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2016年1月20日
信託期間	原則として、2016年1月20日から2025年10月10日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	ＭＡＮ　ＡＨＬ　ダイバーシファイド　リンク　マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてUBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（ＳＰＣ）の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます。）に投資し、AHL Partners LLPが運用する外国投資信託証券「Man AHL Diversified (Cayman) Ltd」（以下「MAN AHLファンド」※といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。 ※MAN AHLファンドは、主として世界各国の株式、債券、金利、商品、為替等の先物取引等に投資を行い、定量分析モデルを用いて市場動向を予測し、上昇局面だけでなく下落局面でも収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。なお、MAN AHLファンドは、組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。 ②円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。 ③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 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、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 ①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。 ②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜　0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2016年1月20日
信託期間	原則として、2016年1月20日から2025年10月10日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

18.マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針	この投資信託は、わが国を含む世界の株式及び債券を主要投資対象とし、有価証券先物取引、有価証券指数先物取引（以下総称して「有価証券先物取引等」ということがあります。）、オプション取引、スワップ取引（トータル・リターン・スワップ取引を含みます。）、金利先渡取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引、クレジットデリバティブ取引（以下、「デリバティブ取引」といいます。）及び為替予約取引を主要取引対象とし、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国を含む世界の株式及び債券を主要投資対象とし、有価証券先物取引、有価証券指数先物取引（以下総称して「有価証券先物取引等」ということがあります。）、オプション取引、スワップ取引（トータル・リターン・スワップ取引を含みます。）、金利先渡取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引、クレジットデリバティブ取引（以下、「デリバティブ取引」といいます。）及び為替予約取引を主要取引対象とします。
投資態度	①主としてわが国を含む世界の株式及び債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、主要投資対象及び主要取引対象への投資は、投資信託証券を通じて行うことがあります。 ②ポートフォリオの構築は、複数の運用戦略を組み合わせることで行い、信用取引による株式の売付や債券の空売りを用いる運用戦略を含みます。 ③実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジを行うことがあります。 ④信用取引による株式の売付の建玉の実質時価総額は、投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。 ⑤債券（転換社債券、他社株転換可能債券、新株引受権付社債券及び新株予約権付社債券を除きます。）の空売りに係る債券の実質時価総額は、投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。 ⑥有価証券先物取引等は、以下の範囲で行うことを基本とします。 株価指数先物取引に係る実質投資額（買建玉の実質時価総額と売建玉の実質時価総額の差額の絶対値をいいます。以下同じ。）は、原則として投資信託財産の純資産総額の200%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。 債券先物取引に係る実質投資額は原則として投資信託財産の純資産総額の500%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。 ⑦為替予約取引は、以下の範囲で行うことを基本とします。 為替予約取引の買い予約の実質合計額と売り予約の実質合計額のいずれか大きい方の額は原則として投資信託財産の純資産総額の200%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。 また、為替予約取引の買い予約の実質合計額と売り予約の実質合計額との差額の絶対値の額は原則として投資信託財産の純資産総額の100%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。 ⑧資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への実質投資割合には制限を設けません。 ②新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。 ⑤同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、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。 ⑥同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑦外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ⑧デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。 ⑨為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。 ⑩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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑪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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月7日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 ①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。 ②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.88%（税抜　0.8%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2013年4月2日
信託期間	2013年4月2日から2026年3月26日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

19.ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドＳ（適格機関投資家専用）

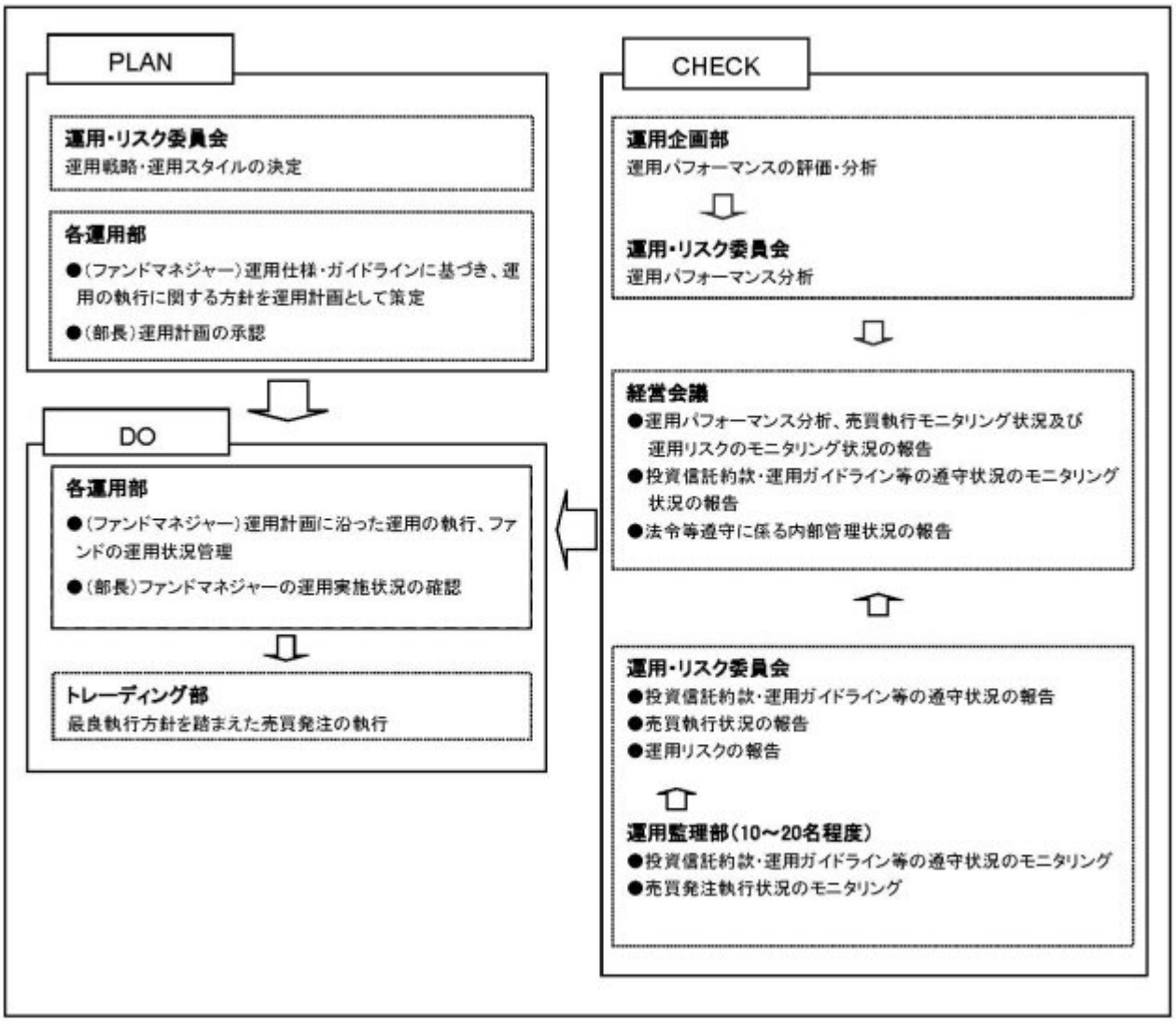
運用会社	フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社

運用の基本方針	この投資信託は、主に「ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に日本の公社債に投資を行うとともに、為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング・ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。
主要投資対象	「ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 主に日本の公社債を主要投資対象とし、為替予約取引等を積極的に活用します。
投資態度	①ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。 ②ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。 ③資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主に、日本の公社債に投資するとともに、主要先進国通貨を中心とした為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング・ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。 ②モデルによる定量分析とポートフォリオマネージャーによる定性分析を組み合わせた独自のアプローチにより、ポートフォリオを構築します。 ③リスク管理を運用プロセスに組み込み、ポジション・リスクの分散化を図ります。 ④資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ⑤運用の指図に関する権限を投資顧問会社であるウエスタン・アセット・マネジメント株式会社及びウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド（在英国）に委託します。
主な投資制限	①株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以内とします。 ②新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以内とします。 ③同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以内とします。 ④投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以内とします。 ⑤外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑥為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。 ⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10％、合計で20％以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：11月16日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.418%（税抜　0.38%） このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の0.05%を上限）をファンドから支弁します。 投資顧問会社の報酬は、委託者が収受する委託者報酬から支弁されます。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年4月12日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

（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回の毎決算時（決算日は毎年7月10日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

・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。
・分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（5）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

イ．投資信託証券への投資割合
投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ．株式への投資
株式への直接投資は行いません。

ハ．同一銘柄の投資信託証券への投資割合
同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ニ．外貨建資産への投資割合
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

ホ．デリバティブの利用
デリバティブの直接利用は行いません。

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

ト．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

チ．外国為替予約取引の指図

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

リ．資金の借入れ

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

＜その他の投資制限＞

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

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

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

債券、バンクローン等の価格は、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。なお、債券、バンクローン等が変動金利である場合、こうした金利変動による価格の変動は固定金利の場合と比べて小さくなる傾向があります。また、発行者・債務者等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。加えて、物価連動債券の価格は、物価変動及び将来の物価変動に対する市場予想の変化によっても変動します。債券、バンクローン等の価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

③リートの価格変動リスク

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

④商品（コモディティ）の価格変動リスク

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

⑤為替変動リスク

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

⑥信用リスク

有価証券等の発行体等が財政難、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、有価証券等の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。相対的に格付が低い発行体等の有価証券等に投資する際には、信用度に関するマーケットの考え方の変化の影響をより大きく受ける可能性があり、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るリスクがより高いものになると想定されます。

⑦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。

⑧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。

⑨資産等の選定・配分に係るリスク

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

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

⑩ヘッジファンドの運用手法に係るリスク
投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的に現物有価証券、デリバティブや為替予約取引等の買建てや売建てによりポートフォリオを組成することがあり、買い建てている対象が下落した場合もしくは売り建てている対象が上昇した場合に損失が発生し、ファンドの基準価額が影響を受け、投資元本を割り込むことがあります。また、投資対象ファンドの純資産総額を上回る買建て、売建てを行う場合があるため、投資対象ファンドの基準価額は現物有価証券に投資する場合と比べ大きく変動することがあり、投資元本を割り込むことがあります。
ヘッジファンドのパフォーマンスは、通常、運用者の運用能力に大きく依存することになるため、市場の動向に関わらず、損失が発生する可能性があります。

⑪仕組み債券に係るリスク
投資対象ファンドにおいては、特定の対象（指数やファンド等）の値動きに概ね連動する投資成果を目指す仕組み債券を活用する場合がありますが、投資対象ファンドが、特定の対象と連動することを保証するものではありません。
また、仕組み債券の価格は取引に関わる関係法人の財務状況等及びそれらに関する外部評価等、市場や経済環境の悪化や混乱、また概ね連動を目指すファンドの流動性の制約等により変動し、あるいは債券取引が一部不可能となる等、概ね連動を目指す対象と大きく乖離することがあります。加えて、通常、仕組み債券の取引に関わるブローカーは限定的であり（1社の場合もあります）、取引にあたっては高いコストがかかる場合があります。
なお、仕組み債券の発行体は少数であることが多いため、信用リスクが顕在化した場合には、投資対象ファンドは多数の発行体に分散投資を行う投資信託と比較して、大きな影響を被る可能性があります。また、発行体の財務状況や信用力の他、市場や経済環境の変動等により、仕組み債券が発行されない場合には、投資対象ファンドが償還となる可能性があります。

⑫ブローカーの信用リスク
投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的にデリバティブや為替予約取引等を行う場合があります。ブローカーの債務不履行等によって、ブローカーで保管されている証拠金の一部又は相当の額が失われる可能性や契約が履行されない可能性があり、ファンドが大きな影響を被る可能性があります。

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞
①同じ投資対象ファンドに投資する他のファンドによる追加設定や一部解約等があり、投資対象ファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。
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。

⑤確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

(2)リスクの管理体制

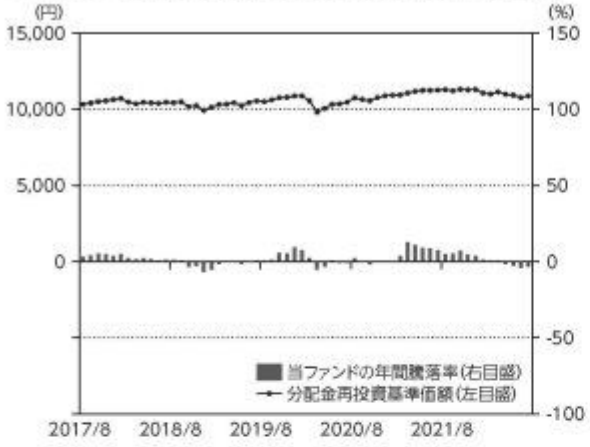
委託会社におけるリスク管理体制

・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。

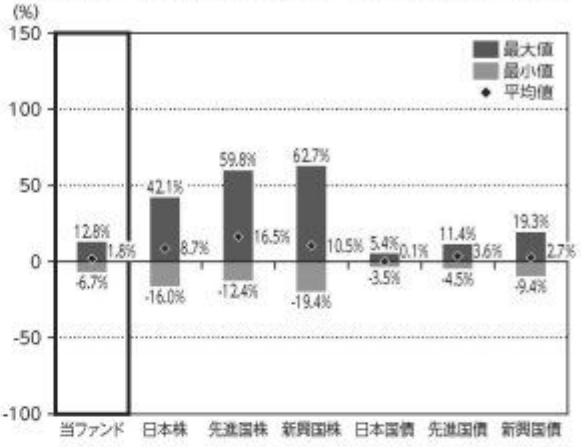
〔参考情報〕

分散投資コア戦略ファンドA

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

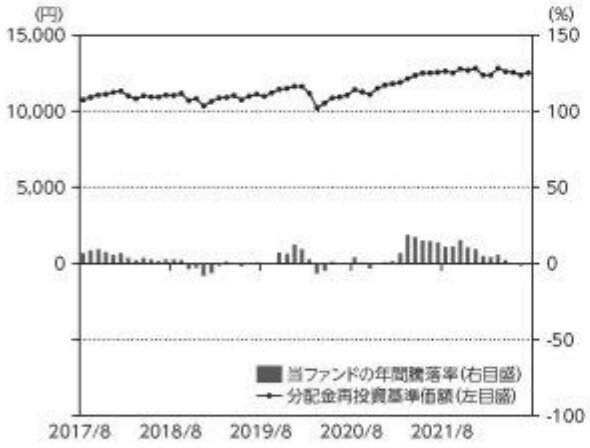


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

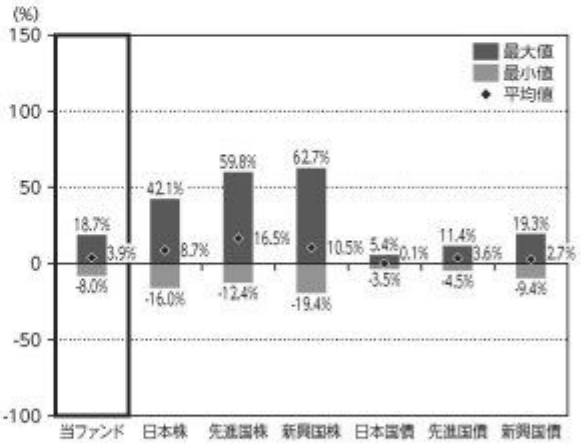


分散投資コア戦略ファンドS

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



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



＊当ファンドの年間騰落率は、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。

＊2017年8月～2022年7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。

※各資産クラスの詳細については、後掲「各資産クラスの指数について」をご覧ください。

〔参考情報〕

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広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 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCI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 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 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、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 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】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

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

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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0.935%（税抜　0.85%）（※）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　0.495%　（税抜　0.45%）	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　0.385%　（税抜　0.35%）	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

※「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。

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。

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

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

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

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
日本株式最小分散インデックスマザーファンド	ありません。
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	ありません。
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバルREITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド	ありません。
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
ＨＦリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）	ありません。
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.066%　　（税抜　0.06%）
FOFs用ＭＡＮ　ＡＨＬ　ダイバーシファイド　リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.066%　　（税抜　0.06%）
マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.88%　　（税抜　0.8%）

ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率　0.418%　　（税抜　0.38%）

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

◎実質的な信託報酬率：年率0.935%～1.42646%程度（税抜　0.85%～1.3145%程度）

（投資対象とする投資信託証券：年率0.0%～0.49146%程度（税抜0.0%～0.4645%程度））

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

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

⑥これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

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

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（ご参考）

《　仕組み債券の費用にかかる記載　》

・FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。
・円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
・円建債券の連動対象となるPTRディバーシファイド・アルファ・ファンドにおいては、運用報酬（PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドの純資産総額に対して年率1.0%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。
これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・FOFs用ＭＡＮ　ＡＨＬ　ダイバーシファイド　リンクファンド（適格機関投資家専用）
実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。
・円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.24%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
・円建債券の連動対象となるMAN AHLファンドにおいては、固定報酬（運用報酬として1.35%（MAN AHLファンドの純資産総額に対する年率。以下同じ。）、加えてサービスマネジャー費用として0.25%、ブローカレッジ費用として1.00%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。
これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

（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。
確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。
受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。
※上記は、2022年 7月29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7月29日現在の状況について記載してあります。

【分散投資コア戦略ファンドＡ】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	日本	12,447,002,249	14.69
親投資信託受益証券	日本	71,099,387,310	83.91
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,181,521,274	1.39
合計(純資産総額)		84,727,910,833	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	国内債券インデックス　マザーファンド	20,452,828,218	1.3679	27,977,423,719	1.3787	28,198,314,264	33.28
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（為替ヘッジあり）	19,931,709,696	0.9043	18,025,635,928	0.9268	18,472,708,546	21.80
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	1,498,580,570	4.1909	6,280,401,310	4.3087	6,456,934,101	7.62
日本	投資信託受益証券	ＦＯＦｓ用　ピクテ　マルチストラテジー　リンクファンド（適格機関投資家専用）	4,868,650,307	1.0348	5,038,079,337	1.0228	4,979,655,533	5.88
日本	投資信託受益証券	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	4,392,104,162	0.9767	4,289,768,135	0.9799	4,303,822,868	5.08
日本	親投資信託受益証券	ＨＦリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）	3,927,125,252	0.8995	3,532,449,164	0.9049	3,553,655,640	4.19
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	2,846,783,765	1.2001	3,416,638,976	1.2077	3,438,060,752	4.06
日本	投資信託受益証券	ＦＯＦｓ用ＭＡＮ　ＡＨＬ　ダイバーシファイド　リンクファンド（適格機関投資家専用）	2,519,531,577	1.2715	3,203,584,400	1.2556	3,163,523,848	3.73
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	1,440,100,504	1.8933	2,726,542,284	1.9189	2,763,408,857	3.26
日本	親投資信託受益証券	外国株式最小分散インデックスマザーファンド	1,154,504,393	1.6930	1,954,575,937	1.6962	1,958,270,351	2.31
日本	親投資信託受益証券	グローバルＲＥＩＴインデックスマザーファンド	663,634,730	2.5181	1,671,098,613	2.6508	1,759,162,942	2.08
日本	親投資信託受益証券	Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	795,726,284	2.1412	1,703,809,119	2.2096	1,758,236,797	2.08
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	234,719,161	3.5883	842,242,765	3.5420	831,375,268	0.98
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス　マザーファンド	259,544,875	3.1459	816,502,222	3.1929	828,700,831	0.98
日本	親投資信託受益証券	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	564,917,885	1.1999	677,844,970	1.2077	682,251,329	0.81
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	227,137,108	1.7545	398,512,055	1.7536	398,307,632	0.47

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	14.69
親投資信託受益証券	83.91
合計	98.61

(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 (2013年 7月10日)	258,830,299	258,830,299	9,811	9,811
第2期計算期間末 (2014年 7月10日)	16,628,969,770	16,628,969,770	10,208	10,208
第3期計算期間末 (2015年 7月10日)	23,204,975,199	23,204,975,199	10,550	10,550
第4期計算期間末 (2016年 7月11日)	40,992,277,841	40,992,277,841	9,890	9,890
第5期計算期間末 (2017年 7月10日)	47,152,867,522	47,152,867,522	10,297	10,297
第6期計算期間末 (2018年 7月10日)	56,957,731,265	56,957,731,265	10,442	10,442
第7期計算期間末 (2019年 7月10日)	64,206,017,914	64,206,017,914	10,533	10,533
第8期計算期間末 (2020年 7月10日)	69,610,450,591	69,610,450,591	10,401	10,401
第9期計算期間末 (2021年 7月12日)	80,414,109,882	80,414,109,882	11,262	11,262
第10期計算期間末 (2022年 7月11日)	83,363,228,383	83,363,228,383	10,759	10,759
2021年 7月末日	80,760,783,711	—	11,262	—
8月末日	81,309,193,796	—	11,285	—
9月末日	80,837,129,898	—	11,210	—
10月末日	82,067,637,612	—	11,309	—
11月末日	81,538,113,444	—	11,271	—
12月末日	82,136,503,137	—	11,306	—
2022年 1月末日	81,217,462,974	—	11,055	—
2月末日	80,577,463,338	—	11,002	—
3月末日	82,298,081,573	—	11,138	—
4月末日	80,861,467,282	—	10,986	—
5月末日	81,211,470,560	—	10,927	—
6月末日	82,795,487,554	—	10,766	—
7月末日	84,727,910,833	—	10,882	—

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 3月29日～2013年 7月10日	0
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	0
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	0

第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	0
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	0
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	0
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第1期計算期間	2013年 3月29日～2013年 7月10日	△1.9
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	4.0
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	3.4
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	△6.3
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	4.1
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	1.4
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0.9
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	△1.3
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	8.3
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	△4.5

(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 3月29日～2013年 7月10日	263,825,167	—	263,825,167
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	16,300,810,769	274,885,382	16,289,750,554
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	6,829,705,615	1,125,034,771	21,994,421,398
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	21,115,619,373	1,662,548,782	41,447,491,989
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	6,712,164,459	2,368,251,334	45,791,405,114
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	11,384,212,208	2,627,192,900	54,548,424,422
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	9,304,566,486	2,896,398,134	60,956,592,774
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	10,458,038,852	4,487,544,486	66,927,087,140
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	8,942,057,064	4,467,543,464	71,401,600,740
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	10,745,359,555	4,666,858,341	77,480,101,954

(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。

【分散投資コア戦略ファンドＳ】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	27,881,229,334	15.44
親投資信託受益証券	日本	150,527,832,828	83.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	2,215,946,989	1.23
合計(純資産総額)		180,625,009,151	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	8,324,445,284	4.1909	34,886,917,740	4.3087	35,867,537,395	19.86
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	25,571,521,445	1.3679	34,979,284,184	1.3787	35,255,456,616	19.52
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（為替ヘッジあり）	25,296,023,847	0.9044	22,878,323,778	0.9268	23,444,354,901	12.98
日本	投資信託受益証券	ＦＯＦｓ用MAN　AHL　ダイバーシファイド　リンクファンド（適格機関投資家専用）	10,777,008,374	1.2715	13,702,966,147	1.2556	13,531,611,714	7.49
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	10,387,799,394	1.2003	12,468,529,880	1.2077	12,545,345,328	6.95
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	6,097,040,794	1.8933	11,543,527,335	1.9189	11,699,611,579	6.48
日本	親投資信託受益証券	外国株式最小分散インデックスマザーファンド	6,061,848,131	1.6930	10,262,708,885	1.6962	10,282,106,799	5.69
日本	投資信託受益証券	ＦＯＦｓ用　ピクテ　マルチストラテジー　リンクファンド（適格機関投資家専用）	8,692,912,311	1.0348	8,995,425,659	1.0228	8,891,110,711	4.92
日本	投資信託受益証券	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	5,570,473,425	0.9767	5,440,681,394	0.9799	5,458,506,909	3.02
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	1,319,362,044	3.5883	4,734,266,822	3.5420	4,673,180,359	2.59
日本	親投資信託受益証券	Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	1,687,481,776	2.1412	3,613,235,978	2.2096	3,728,659,732	2.06
日本	親投資信託受益証券	ＨＦリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）	4,120,114,511	0.8995	3,706,043,002	0.9049	3,728,291,621	2.06
日本	親投資信託受益証券	グローバルＲＥＩＴインデックスマザーファンド	1,393,496,043	2.5181	3,508,962,385	2.6508	3,693,879,310	2.05
日本	親投資信託受益証券	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	2,464,529,918	1.1999	2,957,189,448	1.2077	2,976,412,781	1.65
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	556,972,964	3.1459	1,752,181,247	3.1929	1,778,358,976	0.98
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	487,361,674	1.7545	855,076,057	1.7536	854,637,431	0.47

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	15.44
親投資信託受益証券	83.34
合計	98.77

(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 (2013年 7月10日)	54,287,050	54,287,050	9,915	9,915
第2期計算期間末 (2014年 7月10日)	9,560,643,872	9,560,643,872	10,451	10,451
第3期計算期間末 (2015年 7月10日)	23,718,308,897	23,718,308,897	11,013	11,013
第4期計算期間末 (2016年 7月11日)	40,713,425,166	40,713,425,166	9,845	9,845
第5期計算期間末 (2017年 7月10日)	57,661,475,690	57,661,475,690	10,759	10,759
第6期計算期間末 (2018年 7月10日)	75,431,956,580	75,431,956,580	11,008	11,008
第7期計算期間末 (2019年 7月10日)	89,663,756,248	89,663,756,248	11,109	11,109
第8期計算期間末 (2020年 7月10日)	143,157,363,596	143,157,363,596	10,980	10,980
第9期計算期間末 (2021年 7月12日)	171,466,226,114	171,466,226,114	12,554	12,554
第10期計算期間末 (2022年 7月11日)	177,910,582,335	177,910,582,335	12,378	12,378
2021年 7月末日	172,254,659,336	—	12,552	—
8月末日	173,806,239,389	—	12,625	—
9月末日	172,176,011,968	—	12,507	—
10月末日	176,992,124,139	—	12,771	—
11月末日	175,175,030,693	—	12,682	—
12月末日	177,548,376,018	—	12,808	—
2022年 1月末日	172,787,807,627	—	12,366	—

2月末日	172,111,235,783	—	12,363	—
3月末日	179,947,548,637	—	12,818	—
4月末日	176,272,987,474	—	12,599	—
5月末日	177,105,396,808	—	12,544	—
6月末日	175,910,883,604	—	12,373	—
7月末日	180,625,009,151	—	12,520	—

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 3月29日～2013年 7月10日	0
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	0
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	0
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	0
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	0
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	0
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第1期計算期間	2013年 3月29日～2013年 7月10日	△0.9
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	5.4
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	5.4
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	△10.6
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	9.3
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	2.3
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0.9
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	△1.2
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	14.3
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	△1.4

(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 3月29日～2013年 7月10日	54,750,331	―	54,750,331
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	9,258,266,615	164,756,557	9,148,260,389
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	13,807,316,695	1,419,809,778	21,535,767,306
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	22,822,224,799	3,002,745,419	41,355,246,686
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	15,776,145,748	3,537,868,655	53,593,523,779
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	19,014,211,372	4,083,197,323	68,524,537,828
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	17,123,071,331	4,937,538,036	80,710,071,123
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	60,254,110,229	10,583,069,703	130,381,111,649
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	17,432,745,205	11,230,399,627	136,583,457,227
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	17,903,179,345	10,752,318,272	143,734,318,300

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

（参考）

国内株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	504,253,220,400	99.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	2,398,757,203	0.47
合計(純資産総額)		506,651,977,603	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	2,635,000,000	0.52

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

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	9,261,800	2,126.05	19,691,055,361	2,137.00	19,792,466,600	3.91
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,272,700	11,969.65	15,233,782,583	11,695.00	14,884,226,500	2.94
日本	株式	キーエンス	電気機器	184,100	51,483.31	9,478,077,621	52,430.00	9,652,363,000	1.91
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	11,729,000	738.19	8,658,267,795	745.40	8,742,796,600	1.73
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,234,600	3,983.60	8,901,769,194	3,807.00	8,507,122,200	1.68
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,390,800	4,685.71	6,516,885,588	4,953.00	6,888,632,400	1.36
日本	株式	任天堂	その他製品	114,700	58,342.17	6,691,847,148	59,710.00	6,848,737,000	1.35
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,195,500	5,357.56	6,404,969,141	5,605.00	6,700,777,500	1.32
日本	株式	日立製作所	電気機器	977,100	6,770.42	6,615,384,092	6,704.00	6,550,478,400	1.29
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,596,900	3,746.52	5,982,822,743	3,925.00	6,267,832,500	1.24
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,453,400	4,540.98	6,599,869,905	4,292.00	6,237,992,800	1.23
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	128,900	59,158.98	7,625,593,312	46,010.00	5,930,689,000	1.17
日本	株式	信越化学工業	化学	315,400	18,207.72	5,742,716,252	16,960.00	5,349,184,000	1.06
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,300,400	3,982.22	5,178,489,629	4,107.00	5,340,742,800	1.05
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	392,200	13,944.41	5,468,999,162	13,270.00	5,204,494,000	1.03
日本	株式	第一三共	医薬品	1,473,700	3,463.30	5,103,879,650	3,523.00	5,191,845,100	1.02
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,312,000	4,487.61	5,887,745,372	3,948.00	5,179,776,000	1.02
日本	株式	ダイキン工業	機械	221,900	20,670.60	4,586,806,431	23,250.00	5,159,175,000	1.02
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,485,400	3,186.62	4,733,412,842	3,388.00	5,032,535,200	0.99
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	3,019,700	1,492.45	4,506,769,320	1,538.50	4,645,808,450	0.92
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,199,600	3,721.71	4,464,568,991	3,866.00	4,637,653,600	0.92
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	557,600	7,376.21	4,112,975,541	7,764.00	4,329,206,400	0.85
日本	株式	村田製作所	電気機器	554,400	8,234.51	4,565,212,917	7,747.00	4,294,936,800	0.85
日本	株式	三井物産	卸売業	1,450,300	3,182.94	4,616,228,028	2,925.50	4,242,852,650	0.84
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	206,500	19,684.62	4,064,874,883	20,150.00	4,160,975,000	0.82
日本	株式	日本電産	電気機器	451,500	8,641.71	3,901,734,953	9,198.00	4,152,897,000	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	178,300	21,337.10	3,804,405,029	22,825.00	4,069,697,500	0.80
日本	株式	ＳＭＣ	機械	59,500	66,229.82	3,940,674,571	65,410.00	3,891,895,000	0.77
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,402,500	1,531.34	3,679,061,965	1,583.50	3,804,358,750	0.75
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	671,000	5,409.44	3,629,739,637	5,429.00	3,642,859,000	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	0.30

		建設業	2.20
		食料品	3.36
		繊維製品	0.45
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.19
		医薬品	5.32
		石油・石炭製品	0.53
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.70
		鉄鋼	0.77
		非鉄金属	0.70
		金属製品	0.61
		機械	5.29
		電気機器	17.60
		輸送用機器	7.82
		精密機器	2.77
		その他製品	2.49
		電気・ガス業	1.29
		陸運業	3.02
		海運業	0.68
		空運業	0.41
		倉庫・運輸関連業	0.16
		情報・通信業	9.19
		卸売業	5.39
		小売業	4.35
		銀行業	5.29
		証券、商品先物取引業	0.73
		保険業	2.21
		その他金融業	1.17
		不動産業	2.00
		サービス業	5.54
		小計	99.53
合計			99.53

(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	136	円	2,561,671,950	2,635,000,000	0.52

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

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

日本株式最小分散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	3,583,196,560	97.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	75,348,621	2.06
合計(純資産総額)		3,658,545,181	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	58,125,000	1.59

(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	中部電力	電気・ガス業	39,000	1,236.81	48,235,590	1,420.00	55,380,000	1.51
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	14,300	3,686.49	52,716,807	3,866.00	55,283,800	1.51
日本	株式	ゆうちょ銀行	銀行業	51,800	1,111.62	57,581,916	1,063.00	55,063,400	1.51
日本	株式	小野薬品工業	医薬品	14,600	2,867.32	41,862,890	3,738.00	54,574,800	1.49
日本	株式	関西電力	電気・ガス業	40,300	1,162.82	46,861,979	1,350.00	54,405,000	1.49
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	25,400	2,275.38	57,794,800	2,137.00	54,279,800	1.48

日本	株式	武田薬品工業	医薬品	13,800	3,350.20	46,232,760	3,925.00	54,165,000	1.48
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	25,900	1,927.00	49,909,300	2,087.50	54,066,250	1.48
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	10,400	5,099.41	53,033,864	5,198.00	54,059,200	1.48
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	13,100	4,161.67	54,517,877	4,107.00	53,801,700	1.47
日本	株式	大塚ホールディングス	医薬品	11,300	4,207.84	47,548,696	4,754.00	53,720,200	1.47
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	6,900	6,792.04	46,865,100	7,764.00	53,571,600	1.46
日本	株式	明治ホールディングス	食料品	7,700	6,770.77	52,134,980	6,950.00	53,515,000	1.46
日本	株式	セコム	サービス業	6,000	8,023.83	48,142,980	8,890.00	53,340,000	1.46
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	34,500	1,446.56	49,906,399	1,538.50	53,078,250	1.45
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	22,100	2,345.32	51,831,572	2,387.50	52,763,750	1.44
日本	株式	日立金属	鉄鋼	25,300	2,078.11	52,576,379	2,046.00	51,763,800	1.41
日本	株式	日本郵政	サービス業	53,800	974.06	52,404,549	956.30	51,448,940	1.41
日本	株式	三菱地所	不動産業	26,000	1,861.01	48,386,262	1,976.00	51,376,000	1.40
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	13,100	3,280.43	42,973,633	3,807.00	49,871,700	1.36
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	66,900	687.44	45,990,219	745.40	49,867,260	1.36
日本	株式	キヤノン	電気機器	15,800	2,807.34	44,355,972	3,141.00	49,627,800	1.36
日本	株式	日本マクドナルドホールディングス	小売業	9,900	5,052.26	50,017,374	5,000.00	49,500,000	1.35
日本	株式	大阪瓦斯	電気・ガス業	20,400	2,022.28	41,254,693	2,391.00	48,776,400	1.33
日本	株式	オービック	情報・通信業	2,300	18,286.08	42,058,000	21,160.00	48,668,000	1.33
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	11,300	3,595.01	40,623,613	4,292.00	48,499,600	1.33
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	2,400	19,000.37	45,600,888	20,150.00	48,360,000	1.32
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	30,500	1,584.00	48,312,049	1,583.50	48,296,750	1.32
日本	株式	村田製作所	電気機器	6,200	8,564.95	53,102,699	7,747.00	48,031,400	1.31
日本	株式	任天堂	その他製品	800	54,826.25	43,861,000	59,710.00	47,768,000	1.31

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	建設業	2.57
		食料品	7.14
		化学	4.82
		医薬品	9.32
		石油・石炭製品	1.72
		ゴム製品	1.48
		鉄鋼	1.41
		機械	2.01
		電気機器	10.77

		輸送用機器	2.21
		精密機器	2.99
		その他製品	2.15
		電気・ガス業	5.50
		陸運業	5.51
		情報・通信業	11.71
		卸売業	4.38
		小売業	6.43
		銀行業	5.66
		保険業	2.84
		その他金融業	0.28
		不動産業	1.40
		サービス業	5.63
		小計	97.94
合計			97.94

(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	3	円	58,411,650	58,125,000	1.59

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

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

国内債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	528,267,355,050	84.03
地方債証券	日本	33,315,687,527	5.30
特殊債券	日本	36,785,552,628	5.85
社債券	日本	27,578,814,520	4.39
	フランス	896,365,000	0.14
	スペイン	398,840,000	0.06

小計		28,874,019,520	4.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,409,239,615	0.22
合計(純資産総額)		628,651,854,340	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第１５０回利付国債（５年）	7,880,000,000	100.06	7,885,118,400	100.28	7,902,458,000	0.005	2026/12/20	1.26
日本	国債証券	第１４１回利付国債（５年）	7,750,000,000	100.36	7,778,597,500	100.42	7,783,170,000	0.100	2024/9/20	1.24
日本	国債証券	第１４８回利付国債（５年）	6,950,000,000	100.12	6,958,409,500	100.33	6,973,004,500	0.005	2026/6/20	1.11
日本	国債証券	第３６５回利付国債（１０年）	6,990,000,000	98.86	6,910,675,600	99.62	6,964,067,100	0.100	2031/12/20	1.11
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	6,890,000,000	100.28	6,909,292,000	100.31	6,911,979,100	0.100	2023/12/20	1.10
日本	国債証券	第１３７回利付国債（５年）	6,690,000,000	100.24	6,706,056,000	100.28	6,708,999,600	0.100	2023/9/20	1.07
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	6,630,000,000	100.34	6,653,006,100	100.61	6,671,039,700	0.100	2028/3/20	1.06
日本	国債証券	第１４４回利付国債（５年）	6,210,000,000	100.45	6,237,945,000	100.56	6,245,024,400	0.100	2025/6/20	0.99
日本	国債証券	第３６６回利付国債（１０年）	6,170,000,000	99.71	6,152,703,200	100.76	6,216,953,700	0.200	2032/3/20	0.99
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	100.70	5,941,595,000	0.100	2026/9/20	0.95
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	5,750,000,000	100.48	5,777,600,000	100.69	5,790,020,000	0.100	2027/3/20	0.92
日本	国債証券	第１４５回利付国債（５年）	5,670,000,000	100.48	5,697,216,000	100.61	5,704,757,100	0.100	2025/9/20	0.91
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	100.34	5,609,173,700	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	100.54	5,444,349,300	0.100	2028/12/20	0.87
日本	国債証券	第３４１回利付国債（１０年）	5,340,000,000	101.21	5,404,614,000	101.32	5,410,701,600	0.300	2025/12/20	0.86
日本	国債証券	第３６３回利付国債（１０年）	5,270,000,000	99.11	5,223,097,000	99.73	5,256,087,200	0.100	2031/6/20	0.84
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	100.61	5,030,950,000	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	100.58	4,969,047,200	0.100	2028/6/20	0.79
日本	国債証券	第１４９回利付国債（５年）	4,920,000,000	100.10	4,924,920,000	100.31	4,935,301,200	0.005	2026/9/20	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	101.55	4,905,203,100	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	100.00	4,890,000,000	0.100	2030/9/20	0.78
日本	国債証券	第３３２回利付国債（１０年）	4,800,000,000	101.05	4,850,832,000	101.01	4,848,624,000	0.600	2023/12/20	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	100.51	4,824,672,000	0.100	2025/3/20	0.77
日本	国債証券	第３３９回利付国債（１０年）	4,750,000,000	101.37	4,815,360,000	101.43	4,817,972,500	0.400	2025/6/20	0.77
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	4,790,000,000	100.06	4,793,209,300	100.52	4,815,339,100	0.100	2029/3/20	0.77
日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	4,760,000,000	100.49	4,783,514,400	100.67	4,792,082,400	0.100	2026/3/20	0.76
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	4,740,000,000	100.42	4,759,998,000	100.61	4,769,245,800	0.100	2027/9/20	0.76
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	4,660,000,000	100.33	4,675,797,400	100.37	4,677,568,200	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	101.30	4,619,553,600	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	100.58	4,536,248,200	0.100	2028/9/20	0.72

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.03
地方債証券	5.30
特殊債券	5.85
社債券	4.59
合計	99.78

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	33,185,784,247	48.65
	フランス	5,778,231,736	8.47
	イタリア	5,090,291,619	7.46
	ドイツ	4,321,135,209	6.33
	スペイン	3,454,261,424	5.06

	イギリス	3,323,830,754	4.87
	中国	1,481,247,823	2.17
	カナダ	1,373,494,900	2.01
	ベルギー	1,301,556,903	1.91
	オランダ	1,139,628,750	1.67
	オーストラリア	1,030,659,174	1.51
	オーストリア	845,693,831	1.24
	メキシコ	501,024,917	0.73
	アイルランド	439,595,032	0.64
	フィンランド	354,083,892	0.52
	マレーシア	331,614,628	0.49
	シンガポール	287,486,217	0.42
	ポーランド	270,048,150	0.40
	イスラエル	260,922,596	0.38
	デンマーク	246,350,397	0.36
	スウェーデン	172,311,123	0.25
	ノルウェー	137,227,840	0.20
	小計	65,326,481,162	95.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	2,892,231,114	4.24
合計(純資産総額)		68,218,712,276	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	535,289,291	0.78
	買建	ドイツ	476,426,317	0.70

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	—	64,321,612,939	△94.29

(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 1.25% 08/15/31	4,450,000	13,188.62	586,893,816	11,944.53	531,531,772	1.250	2031/8/15	0.78
アメリカ	国債証券	T 0.5% 11/30/23	4,000,000	13,309.29	532,371,781	13,036.92	521,477,035	0.500	2023/11/30	0.76
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	3,630,000	14,701.57	533,667,335	13,760.19	499,494,959	3.125	2028/11/15	0.73
アメリカ	国債証券	T 0.125% 10/15/23	3,640,000	13,255.47	482,499,330	13,019.04	473,893,349	0.125	2023/10/15	0.69
アメリカ	国債証券	T 1.125% 10/31/26	3,700,000	13,160.60	486,942,504	12,587.61	465,741,662	1.125	2026/10/31	0.68
アメリカ	国債証券	T 0.125% 09/15/23	3,500,000	13,273.06	464,557,283	13,046.12	456,614,473	0.125	2023/9/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 0.5% 02/28/26	3,650,000	12,956.05	472,896,150	12,413.04	453,075,965	0.500	2026/2/28	0.66
アメリカ	国債証券	T 0.625% 10/15/24	3,500,000	13,213.99	462,489,672	12,817.92	448,627,260	0.625	2024/10/15	0.66
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/23	3,300,000	13,315.08	439,397,731	13,048.75	430,608,977	0.250	2023/9/30	0.63
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	3,240,000	13,959.47	452,287,076	13,281.16	430,309,892	2.250	2024/11/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	3,410,000	13,487.37	459,919,454	12,384.12	422,298,492	1.625	2031/5/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 0.375% 10/31/23	3,120,000	13,327.98	415,833,241	13,044.55	406,989,970	0.375	2023/10/31	0.60
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/28	3,160,000	13,186.89	416,705,991	12,497.17	394,910,616	1.500	2028/11/30	0.58
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	3,000,000	13,243.05	397,291,645	12,829.48	384,884,695	0.750	2024/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	3,100,000	13,310.61	412,629,077	12,327.33	382,147,273	1.250	2028/9/30	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	3,160,000	13,030.99	411,779,286	12,036.02	380,338,454	1.375	2031/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	3,190,000	12,930.54	412,484,339	11,912.98	380,024,222	1.125	2031/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.375% 10/31/28	3,000,000	13,158.19	394,745,800	12,407.25	372,217,683	1.375	2028/10/31	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	2,650,000	13,890.40	368,095,756	13,324.28	353,093,597	2.375	2024/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/51	2,800,000	14,599.80	408,794,417	11,664.79	326,614,339	2.375	2051/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.875% 09/30/26	2,500,000	13,223.32	330,583,230	12,469.82	311,745,718	0.875	2026/9/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	2,630,000	12,821.60	337,208,146	11,702.65	307,779,876	0.875	2030/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	2,250,000	14,040.45	315,910,215	13,425.77	302,079,825	2.750	2024/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/15/23	2,210,000	13,997.59	309,346,950	13,434.70	296,907,069	2.750	2023/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	2,180,000	13,558.51	295,575,561	13,557.22	295,547,507	2.875	2028/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/28	2,320,000	13,089.47	303,675,853	12,406.20	287,823,945	1.250	2028/3/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	2,200,000	13,543.27	297,952,134	13,048.23	287,061,083	1.500	2024/11/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.25% 05/31/28	2,300,000	13,340.06	306,821,411	12,377.81	284,689,633	1.250	2028/5/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	2,200,000	13,547.15	298,037,309	12,933.07	284,527,681	1.625	2026/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	2,200,000	12,949.59	284,891,056	12,840.26	282,485,919	0.250	2024/5/15	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.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	95.76
合計	95.76

(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	13	アメリカドル	1,462,589.79	196,879,212	1,478,343.75	198,999,852	0.29
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	10	アメリカドル	1,188,090.52	159,928,865	1,209,843.8	162,857,074	0.24
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	9	アメリカドル	1,248,119.4	168,009,352	1,288,406.25	173,432,365	0.25
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	5	ユーロ	546,286.25	74,977,787	551,150	75,645,337	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	8	ユーロ	1,000,878	137,370,506	1,025,280	140,719,680	0.21
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	12	ユーロ	1,814,407	249,027,361	1,894,800	260,061,300	0.38

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	244,961,000.00	33,241,178,436	32,957,616,349	△48.31
	カナダドル	売建	12,701,000.00	1,338,424,831	1,333,932,684	△1.96
	メキシコペソ	売建	75,445,000.00	505,819,924	499,762,769	△0.73
	ユーロ	売建	160,959,000.00	22,911,869,226	22,090,528,227	△32.38
	イギリスポンド	売建	19,970,000.00	3,296,919,587	3,271,111,960	△4.80
	スウェーデンクローナ	売建	12,871,000.00	170,884,750	169,867,596	△0.25
	ノルウェークローネ	売建	9,869,000.00	136,181,858	136,641,239	△0.20
	デンマーククローネ	売建	12,812,000.00	245,278,841	236,253,280	△0.35
	ポーランドズロチ	売建	9,151,000.00	275,833,625	263,369,439	△0.39
	オーストラリアドル	売建	10,580,000.00	989,459,664	996,254,061	△1.46
	シンガポールドル	売建	2,928,000.00	285,810,583	285,510,158	△0.42
	マレーシアリンギット	売建	10,803,000.00	332,746,443	326,485,025	△0.48
	イスラエルシェケル	売建	6,611,000.00	256,956,099	260,658,508	△0.38
	オフショア人民元	売建	74,940,000.00	1,517,711,415	1,493,621,644	△2.19

(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	364,701,897,361	66.21
	イギリス	22,792,223,506	4.14
	カナダ	19,910,768,131	3.61
	スイス	17,436,369,090	3.17
	フランス	15,542,319,507	2.82
	ドイツ	11,294,989,220	2.05
	オーストラリア	11,090,734,427	2.01
	オランダ	9,430,061,869	1.71
	アイルランド	9,324,307,216	1.69
	スウェーデン	5,029,459,466	0.91
	デンマーク	4,288,507,774	0.78
	スペイン	3,595,844,886	0.65
	香港	3,434,766,260	0.62
	イタリア	2,387,387,841	0.43
	フィンランド	1,789,774,905	0.32
	シンガポール	1,709,595,311	0.31
	ジャージー	1,598,392,047	0.29
	ノルウェー	1,265,968,996	0.23
	ベルギー	1,196,852,640	0.22
	イスラエル	1,171,231,358	0.21
	ケイマン	1,167,119,250	0.21
	バミューダ	737,122,080	0.13
	キュラソー	540,903,829	0.10
	ニュージーランド	394,777,621	0.07
	ルクセンブルク	357,976,322	0.06
	ポルトガル	285,478,170	0.05
	オーストリア	264,548,835	0.05
	マン島	95,880,663	0.02
	リベリア	85,450,242	0.02
	パナマ	76,071,907	0.01
	小計	512,996,780,730	93.13
投資信託受益証券	オーストラリア	149,776,187	0.03
	香港	65,565,564	0.01

	小計	215,341,751	0.04
投資証券	アメリカ	11,288,331,843	2.05
	オーストラリア	700,763,276	0.13
	イギリス	279,467,072	0.05
	シンガポール	241,494,463	0.04
	フランス	211,818,515	0.04
	香港	190,503,486	0.03
	カナダ	57,616,141	0.01
	ベルギー	55,902,962	0.01
	小計	13,025,897,758	2.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	24,590,237,139	4.46
合計(純資産総額)		550,828,257,378	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	18,698,183,773	3.39
	買建	カナダ	1,405,270,567	0.26
	買建	ドイツ	4,086,300,525	0.74
	買建	イギリス	514,074,700	0.09
	買建	オーストラリア	703,683,420	0.13

(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	―	1,284,197,810	0.23

(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	1,298,829	20,141.88	26,160,861,776	21,180.88	27,510,345,735	4.99
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	567,129	36,778.20	20,857,984,575	37,207.55	21,101,480,681	3.83
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	728,980	15,513.30	11,308,889,772	16,460.11	11,999,091,571	2.18
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	69,919	102,246.23	7,148,954,758	113,435.84	7,931,320,986	1.44
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	478,740	15,122.46	7,239,726,838	15,375.15	7,360,701,322	1.34
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	452,200	15,185.61	6,866,936,107	15,424.95	6,975,166,867	1.27
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	74,889	68,237.63	5,110,248,162	72,889.96	5,458,656,881	0.99
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	209,270	24,372.67	5,100,470,537	23,449.06	4,907,185,205	0.89
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	199,119	25,318.72	5,041,439,176	24,208.26	4,820,325,001	0.88
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	336,966	13,132.27	4,425,130,478	12,470.27	4,202,057,136	0.76
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	102,772	42,952.21	4,414,285,506	39,561.87	4,065,853,429	0.74
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	183,787	26,266.44	4,827,431,917	21,634.51	3,976,143,380	0.72
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	190,793	20,018.39	3,819,368,732	19,930.35	3,802,572,527	0.69
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	132,437	28,654.53	3,794,920,792	28,449.82	3,767,809,275	0.68
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	224,341	16,447.31	3,689,806,584	16,505.19	3,702,790,830	0.67
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	235,026	17,672.38	4,153,470,484	15,454.57	3,632,226,732	0.66
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	83,117	41,507.41	3,449,971,885	40,333.19	3,352,374,111	0.61
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	69,486	48,160.98	3,346,514,445	47,443.29	3,296,644,762	0.60
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	155,015	23,984.83	3,718,009,838	20,243.99	3,138,123,334	0.57
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	447,595	7,254.07	3,246,889,189	6,827.41	3,055,918,697	0.55
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	64,434	43,519.88	2,804,160,293	44,528.98	2,869,180,813	0.52
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	140,788	20,183.77	2,841,633,704	20,157.84	2,837,983,034	0.52
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	327,837	8,702.29	2,852,933,064	8,623.11	2,826,976,677	0.51
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	110,121	23,109.96	2,544,892,623	23,535.21	2,591,721,125	0.47
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	576,261	4,983.26	2,871,659,659	4,485.20	2,584,648,834	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	56,019	46,513.66	2,605,648,857	45,741.94	2,562,418,157	0.47
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	35,297	63,354.27	2,236,215,837	72,175.18	2,547,567,674	0.46
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	31,139	77,033.96	2,398,760,700	80,448.32	2,505,080,249	0.45
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	201,204	12,526.63	2,520,408,098	12,106.82	2,435,941,295	0.44
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	32,248	74,293.42	2,395,814,369	74,856.14	2,413,961,125	0.44

(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	4.86
		素材	3.91
		資本財	5.71
		商業・専門サービス	1.17
		運輸	1.90
		自動車・自動車部品	2.21
		耐久消費財・アパレル	1.58
		消費者サービス	1.69
		メディア・娯楽	5.43
		小売	4.64
		食品・生活必需品小売り	1.50
		食品・飲料・タバコ	4.15
		家庭用品・パーソナル用品	1.74
		ヘルスケア機器・サービス	4.68
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.68
		銀行	5.40
		各種金融	4.46
		保険	2.90
		不動産	0.40
		ソフトウェア・サービス	10.73
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.42
		電気通信サービス	1.46
		公益事業	3.10
		半導体・半導体製造装置	4.43

		小計	93.13
投資信託受益証券	—	—	0.04
投資証券	—	—	2.36
合計			95.54

(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	682	アメリカドル	130,467,016.5	17,562,165,091	138,906,350	18,698,183,773	3.39
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	57	カナダドル	13,324,728.5	1,400,162,471	13,373,340	1,405,270,567	0.26
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	103	スイスフラン	11,141,511	1,571,732,956	11,438,150	1,613,579,820	0.29
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	494	ユーロ	17,244,038	2,366,744,215	18,016,180	2,472,720,705	0.45
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	44	オーストラリアドル	7,240,883	682,091,179	7,470,100	703,683,420	0.13
	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	43	イギリスポンド	3,076,446.25	504,106,482	3,137,280	514,074,700	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。

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	6,975,000.00	940,273,500	938,644,275	0.17
	ユーロ	買建	900,000.00	123,511,500	123,521,490	0.02
	スイスフラン	買建	500,000.00	70,532,000	70,535,000	0.01
	デンマーククローネ	買建	3,000,000.00	55,941,000	55,320,000	0.01
	オーストラリアドル	買建	475,000.00	44,735,025	44,732,745	0.01
	香港ドル	買建	3,000,000.00	52,080,000	51,444,300	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。

外国株式最小分散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	11,940,164,449	62.69
	スイス	1,542,680,615	8.10
	カナダ	1,302,841,080	6.84
	ドイツ	424,638,211	2.23
	アイルランド	364,152,051	1.91
	デンマーク	323,670,091	1.70
	香港	321,508,596	1.69
	フランス	292,676,663	1.54
	オーストラリア	289,599,229	1.52
	シンガポール	239,083,267	1.26
	オランダ	219,417,428	1.15
	フィンランド	140,279,264	0.74
	スペイン	133,189,271	0.70
	イスラエル	121,483,688	0.64
	ベルギー	97,262,247	0.51
	イギリス	94,950,340	0.50
	ノルウェー	57,472,481	0.30
	ニュージーランド	57,136,632	0.30
	スウェーデン	56,442,746	0.30
	イタリア	55,161,574	0.29
	ケイマン	54,200,208	0.28
	ポルトガル	36,896,094	0.19
	ルクセンブルク	24,822,898	0.13
	バミューダ	18,727,751	0.10
	小計	18,208,456,874	95.60
投資信託受益証券	香港	57,641,836	0.30
投資証券	アメリカ	471,233,355	2.47
	香港	43,799,042	0.23
	小計	515,032,397	2.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	265,923,195	1.40
合計(純資産総額)		19,047,054,302	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	109,666,767	0.58
	買建	カナダ	24,653,869	0.13

(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(%)
アメリカ	株式	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8,018	31,636.04	253,657,787	37,801.18	303,089,863	1.59
アメリカ	株式	WASTE MANAGEMENT INC	商業・専門サービス	13,151	21,435.29	281,895,583	22,152.76	291,331,048	1.53
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	17,021	16,982.00	289,050,734	16,505.19	280,934,839	1.47
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	11,772	23,870.39	281,002,247	23,449.06	276,042,358	1.45
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	6,729	42,127.54	283,476,255	39,561.87	266,211,884	1.40
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	5,698	48,810.22	278,120,634	45,741.94	260,637,617	1.37
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	10,987	23,112.53	253,937,444	23,535.21	258,581,379	1.36
アメリカ	株式	PAYCHEX INC	ソフトウェア・サービス	14,814	16,189.54	239,831,915	17,266.42	255,784,815	1.34
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	21,669	11,832.95	256,408,228	11,732.79	254,237,868	1.33
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	40,956	6,544.73	268,046,298	6,131.48	251,121,120	1.32
アメリカ	株式	CONSOLIDATED EDISON INC	公益事業	18,308	12,704.49	232,593,836	13,256.39	242,698,039	1.27
ドイツ	株式	DEUTSCHE TELEKOM	電気通信サービス	93,561	2,352.46	220,098,978	2,524.30	236,176,219	1.24
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	—	5,027	42,225.81	212,269,151	45,377.03	228,110,335	1.20
アメリカ	株式	DOLLAR GENERAL CORP	小売	6,877	31,144.71	214,182,210	32,999.64	226,938,535	1.19
カナダ	株式	WASTE CONNECTIONS INC	商業・専門サービス	12,207	16,546.26	201,980,210	17,627.17	215,174,980	1.13
アメリカ	株式	REPUBLIC SERVICES INC	商業・専門サービス	11,550	17,627.17	203,593,923	18,476.56	213,404,367	1.12
アメリカ	株式	XCEL ENERGY INC	公益事業	21,770	9,914.02	215,828,357	9,720.18	211,608,495	1.11

アメリカ	株式	HERSHEY FOODS CORPORATION	食品・飲料・タバコ	6,881	30,044.95	206,739,315	30,188.98	207,730,404	1.09
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	16,582	11,797.22	195,621,509	12,106.82	200,755,346	1.05
アメリカ	株式	WEC ENERGY GROUP INC	公益事業	14,413	13,722.14	197,777,253	13,864.83	199,833,795	1.05
アメリカ	株式	SOUTHERN CO	公益事業	19,431	9,992.10	194,156,501	10,208.82	198,367,628	1.04
アメリカ	株式	MOTOROLA SOLUTIONS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6,157	27,201.98	167,482,645	31,811.03	195,860,544	1.03
アメリカ	株式	T-MOBILE US INC	電気通信サービス	10,157	16,386.07	166,433,367	19,074.23	193,737,025	1.02
アメリカ	株式	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8,973	17,795.44	159,678,501	21,448.75	192,459,700	1.01
アメリカ	株式	KEURIG DR PEPPER INC	食品・飲料・タバコ	37,107	4,676.35	173,525,372	5,182.48	192,306,471	1.01
アメリカ	株式	NEWMONT CORPORATION	素材	30,962	9,273.28	287,119,385	6,166.48	190,926,681	1.00
アメリカ	株式	DUKE ENERGY CORP	公益事業	12,996	14,945.74	194,234,944	14,665.75	190,596,210	1.00
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	30,700	6,260.71	192,203,831	6,140.90	188,525,882	0.99
カナダ	株式	FRANCO-NEVADA CORP	素材	10,869	19,305.29	209,829,280	17,049.23	185,308,081	0.97
アメリカ	株式	MARSH & MCLENNAN COS	保険	8,496	21,140.50	179,609,692	21,775.85	185,007,704	0.97

(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	0.55
		素材	5.63
		資本財	0.62
		商業・専門サービス	4.28
		運輸	1.96
		自動車・自動車部品	0.10
		耐久消費財・アパレル	0.17
		消費者サービス	1.33
		メディア・娯楽	2.24
		小売	3.85
		食品・生活必需品小売り	2.48
		食品・飲料・タバコ	7.87
		家庭用品・パーソナル用品	2.45
		ヘルスケア機器・サービス	2.25
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	16.43
		銀行	1.50
		各種金融	3.00

		保険	4.25
		不動産	0.29
		ソフトウェア・サービス	12.68
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.90
		電気通信サービス	9.12
		公益事業	8.02
		半導体・半導体製造装置	0.64
		小計	95.60
投資信託受益証券	—	—	0.30
投資証券	—	—	2.70
合計			98.60

(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	4	アメリカドル	780,408	105,050,721	814,700	109,666,767	0.58
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	1	カナダドル	243,338.5	25,570,009	234,620	24,653,869	0.13

(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	158,947,908,438	49.94
	フランス	27,684,408,425	8.70
	イタリア	24,397,855,224	7.67
	ドイツ	20,688,449,952	6.50
	スペイン	16,556,949,372	5.20
	イギリス	15,927,568,632	5.00
	中国	7,095,834,400	2.23
	カナダ	6,584,934,547	2.07

	ベルギー	6,213,924,417	1.95
	オランダ	5,454,022,644	1.71
	オーストラリア	4,933,059,561	1.55
	オーストリア	4,080,427,892	1.28
	メキシコ	2,422,396,132	0.76
	アイルランド	2,122,353,420	0.67
	フィンランド	1,704,559,741	0.54
	マレーシア	1,594,967,923	0.50
	シンガポール	1,398,555,341	0.44
	ポーランド	1,301,371,571	0.41
	イスラエル	1,259,566,204	0.40
	デンマーク	1,187,486,499	0.37
	スウェーデン	837,454,305	0.26
	ノルウェー	669,392,661	0.21
	小計	313,063,447,301	98.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	5,189,114,314	1.63
合計(純資産総額)		318,252,561,615	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	1,387,105,588	0.44
	買建	ドイツ	1,257,102,945	0.40

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	2,395,798,711	0.75

(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	11,839.53	2,489,855,106	12,036.02	2,531,176,482	1.375	2031/11/15	0.80
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	19,380,000	11,803.82	2,287,582,118	11,944.53	2,314,850,731	1.250	2031/8/15	0.73
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	11,799.40	1,775,810,876	11,912.98	1,792,904,243	1.125	2031/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	14,500,000	12,265.81	1,778,542,517	12,327.33	1,787,463,053	1.250	2028/9/30	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	13,340,000	13,333.75	1,778,722,456	13,386.33	1,785,736,900	2.625	2029/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	12,961.47	1,684,991,200	12,891.79	1,675,933,930	0.250	2024/3/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/51	15,150,000	10,797.19	1,635,774,945	10,695.18	1,620,320,550	2.000	2051/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/23	12,000,000	13,121.84	1,574,621,512	13,048.75	1,565,850,825	0.250	2023/9/30	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	13,184.77	1,541,300,022	13,239.10	1,547,651,245	2.375	2027/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	11,830,000	12,393.05	1,466,098,868	12,423.03	1,469,644,540	0.750	2026/8/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.5% 04/30/27	11,940,000	11,860.28	1,416,118,569	12,128.04	1,448,088,629	0.500	2027/4/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.25% 11/15/23	11,000,000	13,078.72	1,438,660,146	13,010.37	1,431,140,923	0.250	2023/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	10,860,000	12,876.28	1,398,364,856	12,829.48	1,393,282,595	0.750	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	12,000,000	11,444.54	1,373,345,064	11,536.49	1,384,379,719	0.625	2030/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	12,278.95	1,369,103,586	12,384.12	1,380,829,380	1.625	2031/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	12,499.27	1,374,920,215	12,510.31	1,376,134,856	0.750	2026/3/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,382.95	1,360,263,496	11,488.12	1,372,830,601	0.625	2030/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	13,352.15	1,355,243,748	13,281.16	1,348,038,706	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	13,036.13	1,332,293,220	13,047.70	1,333,475,481	2.000	2026/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,590.13	1,292,299,650	11,702.65	1,304,846,242	0.875	2030/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.75% 08/15/41	12,330,000	10,670.53	1,315,676,929	10,542.69	1,299,914,581	1.750	2041/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	12,992.23	1,299,223,117	12,923.34	1,292,334,868	0.125	2024/1/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	12,899.68	1,289,968,680	12,840.26	1,284,026,914	0.250	2024/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	10,210,000	12,184.83	1,244,071,558	12,247.93	1,250,513,909	1.125	2028/8/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	11,968.72	1,196,872,202	12,032.87	1,203,287,203	0.625	2027/12/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	13,166.01	1,178,358,328	13,171.27	1,178,828,931	2.250	2027/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,500,000	12,307.35	1,169,198,279	12,366.76	1,174,842,957	1.250	2028/6/30	0.37
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	13,724.96	1,152,896,796	13,760.19	1,155,856,104	3.125	2028/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	12,875.76	1,160,106,158	12,824.23	1,155,463,264	0.375	2024/7/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	12,867.87	1,158,108,722	12,815.02	1,153,352,679	0.250	2024/6/15	0.36

(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	98.37
合計	98.37

(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	34	アメリカドル	3,819,642.1	514,162,023	3,866,437.5	520,461,152	0.16
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	26	アメリカドル	3,090,088.51	415,956,814	3,145,593.88	423,428,392	0.13
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	23	アメリカドル	3,214,251.9	432,670,448	3,292,593.75	443,216,044	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	14	ユーロ	1,531,999.4	210,266,918	1,543,220	211,806,945	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	20	ユーロ	2,508,732	344,323,467	2,563,200	351,799,200	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	32	ユーロ	4,858,247.2	666,794,428	5,052,800	693,496,800	0.22

(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	10,010,000.00	1,369,029,738	1,345,799,455	0.42
	カナダドル	買建	1,080,000.00	113,903,750	113,344,272	0.04
	ユーロ	買建	5,680,000.00	786,325,384	779,486,280	0.24
	イギリスポンド	買建	960,000.00	156,879,150	157,168,704	0.05

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

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

新興国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	ケイマン	19,654,264,842	17.68
	台湾	14,988,147,715	13.48
	インド	14,492,372,386	13.03
	中国	13,319,166,110	11.98

	韓国	12,527,556,857	11.27
	ブラジル	5,183,196,776	4.66
	サウジアラビア	4,715,428,211	4.24
	南アフリカ	3,629,008,709	3.26
	メキシコ	2,127,607,490	1.91
	インドネシア	1,983,207,709	1.78
	タイ	1,948,974,269	1.75
	マレーシア	1,520,574,898	1.37
	アラブ首長国連邦	1,399,621,001	1.26
	香港	1,309,605,587	1.18
	カタール	1,174,670,060	1.06
	クウェート	903,290,004	0.81
	フィリピン	817,733,531	0.74
	バミューダ	644,714,876	0.58
	チリ	578,486,212	0.52
	ポーランド	577,154,443	0.52
	アメリカ	394,484,135	0.35
	トルコ	290,817,647	0.26
	ギリシャ	268,069,686	0.24
	ハンガリー	190,600,377	0.17
	コロンビア	162,492,959	0.15
	チェコ	158,319,520	0.14
	ルクセンブルク	67,687,861	0.06
	マン島	46,189,604	0.04
	エジプト	45,862,408	0.04
	シンガポール	27,408,615	0.02
	ペルー	12,739,315	0.01
	ロシア	164	0.00
	小計	105,159,453,977	94.58
投資信託受益証券	ブラジル	185,791,405	0.17
	メキシコ	47,828,945	0.04
	小計	233,620,350	0.21
投資証券	メキシコ	53,921,295	0.05
	南アフリカ	53,296,866	0.05
	小計	107,218,161	0.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	5,680,174,163	5.11

合計(純資産総額)	111,180,466,651	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	5,698,719,734	5.13

(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	—	100,333,112	0.09

(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	2,730.86	8,068,046,792	2,251.29	6,651,197,048	5.98
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	748,300	7,520.11	5,627,305,769	5,501.72	4,116,937,076	3.70
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	7,306.66	4,193,763,335	6,431.40	3,691,397,809	3.32
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	1,830,888	2,599.81	4,759,962,682	1,700.42	3,113,283,150	2.80
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	495,300	4,472.51	2,215,237,465	3,224.20	1,596,946,260	1.44

インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	367,287	4,293.35	1,576,894,128	4,177.06	1,534,183,509	1.38
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	396,083	2,949.82	1,168,374,617	2,579.57	1,021,727,785	0.92
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	小売	237,411	4,957.08	1,176,867,562	4,201.74	997,541,669	0.90
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	11,210,620	90.32	1,012,654,615	85.92	963,233,286	0.87
ブラジル	株式	VALE SA	素材	477,787	1,766.47	843,997,439	1,834.27	876,390,929	0.79
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	618,625	1,326.73	820,754,121	1,384.82	856,684,273	0.77
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	214,032	4,864.55	1,041,169,638	3,973.83	850,527,853	0.76
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	237,965	3,307.67	787,109,959	3,216.64	765,447,738	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	484.21	731,288,325	487.55	736,329,870	0.66
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	65,667	11,377.14	747,102,675	10,327.65	678,186,449	0.61
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	265,761	2,401.29	638,171,683	2,516.59	668,811,475	0.60
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	784,500	962.36	754,972,406	820.62	643,782,274	0.58
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	246,830	2,699.07	666,213,859	2,589.64	639,203,309	0.57
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	267,900	2,505.17	671,136,932	2,376.99	636,795,621	0.57
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	106,835	5,964.89	637,259,237	5,542.85	592,170,380	0.53
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	6,858.39	661,293,655	5,922.29	571,034,088	0.51
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	1,708.42	722,663,433	1,319.69	558,229,927	0.50
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	27,673	19,928.51	551,481,808	20,040.93	554,592,697	0.50
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	179,804	4,333.45	779,172,095	3,064.63	551,033,667	0.50
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	102,000	5,197.37	530,132,700	4,959.78	505,897,560	0.46
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,699,515	73.04	489,346,277	71.00	475,672,265	0.43
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	9,806,200	47.87	469,462,203	48.02	470,893,724	0.42
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	544,440	691.25	376,348,170	837.86	456,166,757	0.41
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	6,769,300	70.03	474,093,082	66.88	452,764,631	0.41
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	3,513,640	123.65	434,478,318	128.43	451,269,751	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	4.71
		素材	7.83
		資本財	3.46
		商業・専門サービス	0.08
		運輸	2.07
		自動車・自動車部品	3.64
		耐久消費財・アパレル	1.62
		消費者サービス	1.04
		メディア・娯楽	6.61
		小売	7.24
		食品・生活必需品小売り	1.19
		食品・飲料・タバコ	3.77
		家庭用品・パーソナル用品	0.85
		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	2.93
		銀行	15.34
		各種金融	2.32
		保険	2.32
		不動産	1.79
		ソフトウェア・サービス	2.42
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.71
		電気通信サービス	3.05
		公益事業	2.98
		半導体・半導体製造装置	8.67
		小計	94.58
投資信託受益証券	—	—	0.21
投資証券	—	—	0.10
合計			94.89

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	844	アメリカドル	42,349,476	5,700,662,964	42,335,040	5,698,719,734	5.13

(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	340,000.00	45,753,800	45,754,242	0.04
	南アフリカランド	買建	6,700,000.00	54,524,600	54,578,870	0.05

(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	8,479,631,887	10.19
	メキシコ	8,372,141,770	10.06
	マレーシア	8,362,244,884	10.05
	インドネシア	8,268,169,263	9.94
	中国	8,240,000,967	9.90
	タイ	8,201,203,858	9.86
	南アフリカ	8,131,023,010	9.77
	ポーランド	5,518,706,132	6.63
	チェコ	4,104,953,058	4.93
	コロンビア	3,282,937,579	3.95
	ルーマニア	2,590,008,207	3.11
	ハンガリー	2,245,658,358	2.70
	ペルー	1,880,369,243	2.26
	チリ	1,721,527,631	2.07
	ドミニカ共和国	129,265,073	0.16
	ウルグアイ	116,915,426	0.14
	フィリピン	69,276,514	0.08
	小計	79,714,032,860	95.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	3,489,263,071	4.19
合計(純資産総額)		83,203,295,931	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	2,074.47	2,871,072,744	2,168.77	3,001,578,705	0.000	2024/1/1	3.61
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000	3.52	2,299,325,856	2.80	1,834,097,678	9.850	2027/6/28	2.20
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	169,400,000	899.17	1,523,210,546	860.73	1,458,089,833	10.500	2026/12/21	1.75
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	55,000,000	2,148.01	1,181,407,492	2,302.90	1,266,595,198	0.000	2023/7/1	1.52
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	198,300,000	628.50	1,246,321,878	602.24	1,194,250,822	5.750	2026/3/5	1.44
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	140,700,000	752.57	1,058,877,816	714.86	1,005,809,356	8.000	2030/1/31	1.21
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	41,200,000	2,450.69	1,009,685,777	2,357.07	971,116,281	10.000	2027/1/1	1.17
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	143,200,000	684.90	980,776,825	640.50	917,208,172	8.750	2048/2/28	1.10
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	129,000,000	724.42	934,514,324	690.41	890,640,639	8.250	2032/3/31	1.07
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	140,600,000	676.12	950,633,576	627.71	882,563,343	7.750	2031/5/29	1.06
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	128,400,000	679.86	872,947,200	648.39	832,538,321	8.000	2024/9/5	1.00
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000	3,135.35	815,192,493	3,056.61	794,720,699	3.955	2025/9/15	0.96
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000	2,480.48	788,793,457	2,447.96	778,454,421	10.000	2025/1/1	0.94
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	37,100,000,000	2.82	1,046,432,466	2.06	766,018,482	7.250	2034/10/18	0.92
マレーシア	国債証券	MGS 3.733% 06/15/28	25,500,000	3,087.45	787,300,128	3,002.67	765,682,102	3.733	2028/6/15	0.92
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	110,000,000	727.72	800,495,024	691.63	760,796,795	8.875	2035/2/28	0.91
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	115,100,000	712.98	820,650,924	658.15	757,532,157	8.500	2029/5/31	0.91
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 01/31/44	116,000,000	675.36	783,421,809	645.12	748,350,278	8.750	2044/1/31	0.90
タイ	国債証券	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000	410.25	738,461,326	406.22	731,198,322	3.775	2032/6/25	0.88
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	114,000,000	673.96	768,316,219	632.76	721,357,676	7.500	2027/6/3	0.87
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	31,700,000	2,366.34	750,131,485	2,272.83	720,487,376	10.000	2029/1/1	0.87
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	38,900,000	1,821.48	708,557,653	1,826.82	710,634,267	0.000	2025/7/1	0.85
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	104,250,000	717.17	747,658,164	675.59	704,307,158	10.000	2024/12/5	0.85
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	175,500,000	424.03	744,174,501	399.74	701,550,264	3.650	2031/6/20	0.84
タイ	国債証券	THAIGB 1.45% 12/17/24	184,000,000	373.50	687,255,179	363.31	668,506,941	1.450	2024/12/17	0.80
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	97,700,000	699.61	683,521,217	654.54	639,488,316	8.500	2037/1/31	0.77
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000	712.12	700,020,894	647.05	636,053,666	8.500	2038/11/18	0.76
マレーシア	国債証券	MGS 3.899% 11/16/27	20,800,000	3,106.13	646,075,833	3,045.21	633,405,479	3.899	2027/11/16	0.76
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/24	30,850,000	1,955.07	603,140,657	2,049.70	632,335,042	0.000	2024/7/1	0.76
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000	2,803.56	731,729,998	2,374.73	619,806,852	2.750	2029/10/25	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	95.81
合計	95.81

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	日本	116,128,541,000	96.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	4,175,493,077	3.47
合計(純資産総額)		120,304,034,077	100.00

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	買建	日本	4,156,680,000	3.46

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	12,061	704,751.03	8,500,002,210	706,000	8,515,066,000	7.08
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	10,339	672,935.95	6,957,484,793	643,000	6,647,977,000	5.53
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	16,941	368,592.11	6,244,319,003	346,000	5,861,586,000	4.87
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	52,166	101,130.01	5,275,548,185	108,400	5,654,794,400	4.70
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	31,840	183,081.69	5,829,321,112	175,100	5,575,184,000	4.63
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	33,434	165,623.23	5,537,447,197	166,700	5,573,447,800	4.63
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	15,585	324,500.27	5,057,336,765	320,500	4,994,992,500	4.15
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	20,600	180,415.38	3,716,556,942	191,100	3,936,660,000	3.27
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	10,337	358,622.66	3,707,082,439	367,000	3,793,679,000	3.15
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	23,275	141,745.99	3,299,138,093	145,000	3,374,875,000	2.81
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	7,071	409,667.14	2,896,756,373	406,500	2,874,361,500	2.39
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	15,450	203,075.5	3,137,516,598	185,100	2,859,795,000	2.38
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	31,420	84,362.78	2,650,678,811	83,400	2,620,428,000	2.18
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,570	634,379.19	2,264,733,724	696,000	2,484,720,000	2.07
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	33,341	65,980.34	2,199,850,604	69,000	2,300,529,000	1.91
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,458	447,534.42	2,442,642,904	417,500	2,278,715,000	1.89
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,971	328,020.36	2,286,629,973	320,000	2,230,720,000	1.85
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	12,657	188,616.28	2,387,316,381	175,600	2,222,569,200	1.85
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,038	705,671.08	2,143,828,741	715,000	2,172,170,000	1.81
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,084	582,095.74	2,377,279,011	523,000	2,135,932,000	1.78
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,836	509,752.45	1,955,410,432	543,000	2,082,948,000	1.73
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	45,506	42,837.98	1,949,385,143	41,850	1,904,426,100	1.58
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	12,158	154,184.89	1,874,579,932	153,000	1,860,174,000	1.55
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,445	153,800.18	1,760,243,065	156,100	1,786,564,500	1.49
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	13,988	113,029.97	1,581,063,222	125,800	1,759,690,400	1.46
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,415	213,680.25	1,584,439,084	223,700	1,658,735,500	1.38
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,810	323,530.07	1,556,179,661	336,500	1,618,565,000	1.35
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,673	169,743.78	1,641,931,675	166,700	1,612,489,100	1.34
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	3,190	471,546.1	1,504,232,081	477,500	1,523,225,000	1.27
日本	投資証券	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	9,939	151,891.12	1,509,645,904	152,500	1,515,697,500	1.26

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。
(注3)銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	96.53
合計	96.53

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証ＲＥＩＴ指数先物	買建	2,068	円	4,085,127,200	4,156,680,000	3.46

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

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

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	アメリカ	83,196,181,818	77.05
	オーストラリア	6,811,228,781	6.31
	イギリス	5,406,101,771	5.01
	シンガポール	3,888,218,160	3.60
	カナダ	1,951,419,500	1.81
	フランス	1,670,382,875	1.55
	香港	1,501,636,932	1.39
	ベルギー	1,184,597,287	1.10
	スペイン	400,225,910	0.37
	ニュージーランド	368,198,888	0.34
	ガーンジー	277,168,568	0.26
	韓国	221,623,471	0.21
	オランダ	187,660,512	0.17
	イスラエル	124,695,787	0.12
	ドイツ	55,129,208	0.05
	アイルランド	39,198,600	0.04
	イタリア	32,926,158	0.03
	小計	107,316,594,226	99.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	665,486,070	0.62
合計(純資産総額)		107,982,080,296	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	111,697,477	0.10

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	409,708	19,782.09	8,104,884,473	17,822.36	7,301,965,110	6.76
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	50,404	105,316.17	5,308,356,288	95,749.43	4,826,154,728	4.47
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	84,333	44,078.35	3,717,259,923	45,377.03	3,826,781,155	3.54
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	333,314	9,236.21	3,078,559,158	9,899.21	3,299,548,415	3.06
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	251,600	11,460.30	2,883,413,899	11,573.76	2,911,959,979	2.70
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	157,787	20,733.03	3,271,403,559	18,432.14	2,908,353,226	2.69
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	182,024	21,608.97	3,933,351,676	14,465.19	2,633,011,854	2.44
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	533,970	3,954.56	2,111,618,226	4,549.81	2,429,466,317	2.25
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	77,562	31,908.01	2,474,849,130	28,569.62	2,215,917,363	2.05
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	188,464	11,414.57	2,151,235,906	10,465.92	1,972,450,560	1.83
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	73,972	26,396.89	1,952,630,814	25,325.52	1,873,379,765	1.73
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	81,853	27,148.36	2,222,174,756	21,968.35	1,798,175,516	1.67
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	211,831	7,609.54	1,611,937,704	8,406.39	1,780,734,953	1.65
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	336,279	5,407.16	1,818,315,779	5,198.63	1,748,192,855	1.62
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	936,078	2,185.74	2,046,025,903	1,864.21	1,745,053,457	1.62
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	220,294	7,116.26	1,567,671,359	7,177.40	1,581,139,301	1.46
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	63,631	27,055.17	1,721,548,089	24,766.89	1,575,942,226	1.46
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	67,035	25,466.00	1,707,113,978	21,992.58	1,474,272,721	1.37
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	36,035	45,190.67	1,628,445,859	38,336.92	1,381,471,201	1.28
香港	投資証券	LINK REIT	1,172,300	1,184.12	1,388,146,919	1,117.32	1,309,837,167	1.21
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	106,438	10,402.70	1,107,242,877	11,418.96	1,215,411,935	1.13
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	663,336	2,131.98	1,414,220,593	1,737.73	1,152,702,383	1.07
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	58,822	21,607.85	1,271,017,128	19,024.43	1,119,055,098	1.04
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	297,947	4,487.15	1,336,934,642	3,700.42	1,102,531,689	1.02
アメリカ	投資証券	UDR INC	165,334	7,350.14	1,215,228,540	6,496.27	1,074,055,726	0.99
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	160,524	6,405.40	1,028,220,682	6,461.28	1,037,190,511	0.96
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	341,607	3,125.15	1,067,574,883	2,942.57	1,005,204,081	0.93
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	78,819	15,630.94	1,232,015,412	12,125.66	955,733,089	0.89

アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	395,306	2,454.37	970,230,698	2,410.86	953,029,439	0.88
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	95,594	11,246.07	1,075,057,209	9,823.83	939,099,951	0.87

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	99.38
合計	99.38

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	買建	830,000.00	112,267,700	111,697,477	0.10

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	アメリカ	32,841,936,226	98.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	450,905,283	1.35
合計(純資産総額)		33,292,841,509	100.00

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	―	32,152,696,940	△96.58

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	7,315,695	4,452.94	32,576,393,136	4,489.24	32,841,936,226	98.65

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	98.65
合計	98.65

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	238,961,300.00	32,568,574,056	32,152,696,940	△96.58

(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。

ＨＦリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）

国債証券	日本	6,302,066,400	48.85
投資信託受益証券	アメリカ	1,720,744,075	13.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	4,877,593,876	37.81
合計(純資産総額)		12,900,404,351	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	3,310,964,479	25.67
	買建	ドイツ	1,297,333,057	10.06
	売建	アメリカ	27,416,691	△0.21
	売建	イギリス	824,910,566	△6.39
債券先物取引	売建	アメリカ	2,784,855,964	△21.59

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	―	3,699,991,164	△28.68

(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(%)
日本	国債証券	第１０３１回国庫短期証券	6,300,000,000	100.03	6,302,299,500	100.03	6,302,066,400	―	2022/10/20	48.85
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GSCI COMMODITY DYNAM	130,510	5,304.98	692,352,953	5,341.32	697,096,300	―	―	5.40
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR GOLD SHARES ETF	27,900	21,424.52	597,744,320	22,027.58	614,569,493	―	―	4.76
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES JP MORGAN USD EMERGI	34,660	11,137.63	386,030,304	11,802.60	409,078,282	―	―	3.17

(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	48.85
投資信託受益証券	13.34
合計	62.19

(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（%）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	売建	1	アメリカドル	191,687.5	25,803,053	203,675	27,416,691	△0.21
	アメリカ	シカゴ商業取引所	RUSSELL EMIN	買建	200	アメリカドル	17,388,000	2,340,598,680	18,728,000	2,520,976,080	19.54
	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	117	アメリカドル	5,695,560	766,679,331	5,868,720	789,988,399	6.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	45	スイスフラン	4,951,350	698,486,944	4,997,250	704,962,057	5.46
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DAX INDEX FU	買建	13	ユーロ	4,199,975	576,446,569	4,316,000	592,371,000	4.59
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	売建	69	イギリスポンド	4,947,300	810,664,578	5,034,240	824,910,566	△6.39
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	売建	171	アメリカドル	20,258,156.25	2,726,950,413	20,688,328.98	2,784,855,964	△21.59

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	売建	20,114,000.00	2,776,244,907	2,704,820,093	△20.97
	カナダドル	売建	23,000.00	2,444,536	2,414,346	△0.02
	ユーロ	売建	2,132,000.00	298,709,616	292,588,218	△2.27
	イギリスポンド	売建	2,540,000.00	418,622,226	415,906,204	△3.22

	スイスフラン	売建	2,007,000.00	283,633,856	283,127,490	△2.19
	スウェーデンクローナ	売建	86,000.00	1,140,557	1,134,813	△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。

≪参考情報≫

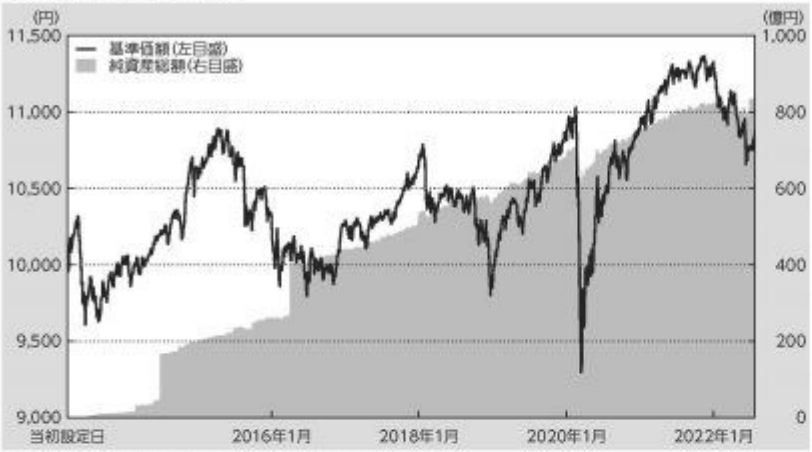
交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2013年3月29日
作成基準日：2022年7月29日

分散投資コア戦略ファンドA

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	10,882円
純資産総額	847.28億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2018年７月	0円
2019年７月	0円
2020年７月	0円
2021年７月	0円
2022年７月	0円
設定来分配金合計額	0円

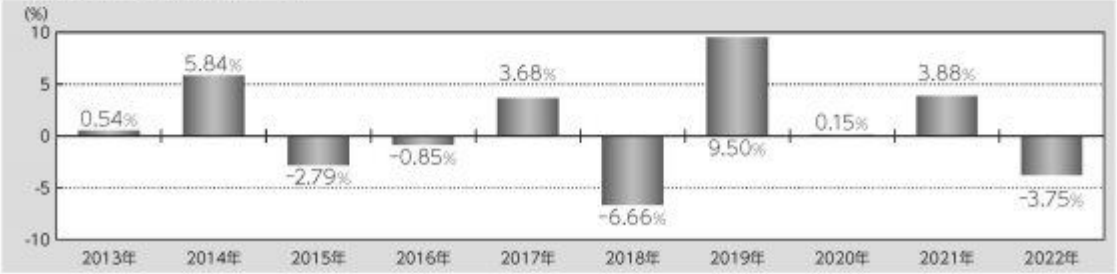
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
国内債券インデックス マザーファンド	33.3%
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	21.8%
外国株式インデックス マザーファンド	7.6%
FOFs 用ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	5.9%
マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	5.1%
HFリターン・ターゲット・マザーファンド(為替ヘッジあり)	4.2%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	4.1%
FOFs 用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	3.7%
国内株式インデックス マザーファンド	3.3%
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	2.3%

※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。

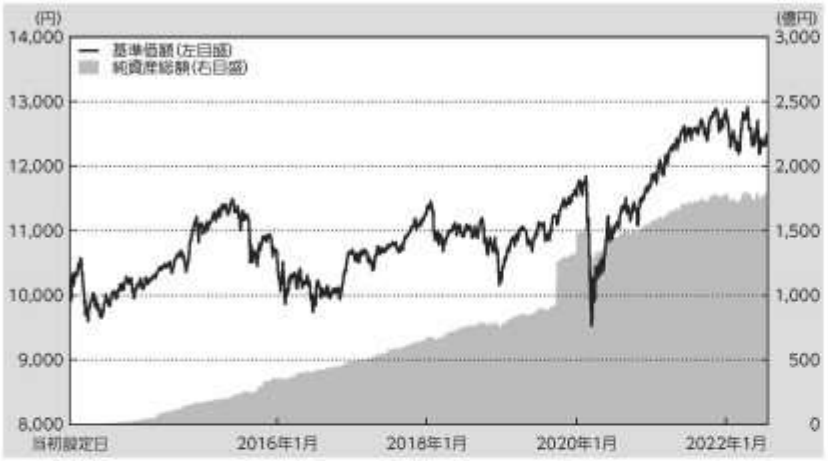
記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

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。

当初設定日：2013年3月29日
作成基準日：2022年7月29日

分散投資コア戦略ファンドS

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	12,520円
純資産総額	1,806.25億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年7月	0円
2019年7月	0円
2020年7月	0円
2021年7月	0円
2022年7月	0円
設定来分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	19.9%
国内債券インデックス マザーファンド	19.5%
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	13.0%
FOFs 用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	7.5%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	6.9%
国内株式インデックス マザーファンド	6.5%
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	5.7%
FOFs 用ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	4.9%
マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	3.0%
新興国株式インデックス マザーファンド	2.6%

※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＞

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。
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＞
当ファンドは、「分配金再投資コース」（※）専用ファンドです。
※「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＞
1円以上1円単位とします。

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

＜申込手数料＞
ありません。

＜申込代金の支払い＞
販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞
収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。
ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行休業日
ロンドンの銀行休業日

＜申込受付の中止等＞
収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

＜その他＞

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

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

＜一部解約の受付＞

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

＜一部解約単位＞

1口以上1口単位とします。

＜解約価額＞

一部解約の実行の請求受付日の翌々営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

＜一部解約代金の支払い＞

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

益者に支払われます。
なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに拠ることとなります。

＜受付不可日＞
一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行休業日
ロンドンの銀行休業日

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口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．内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

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

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

ハ．外国投資信託証券の評価方法

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

ニ．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。

ホ．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

（ハ）公社債等（仕組債を含みます。）

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

a.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c.価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

（ニ）株価指数先物取引

原則として、金融商品取引所等が発表する計算日の清算値段（外国で取引されているものについては、計算日に知り得る直近の日の主たる金融商品取引所等が発表する清算値段又は最終相場）で評価します。

（ホ）債券先物取引

原則として、金融商品取引所等が発表する計算日の清算値段（外国で取引されているものについては、計算日に知り得る直近の日の主たる金融商品取引所等が発表する清算値段又は最終相場）で評価します。

ヘ．外貨建資産等の円換算

外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値

によって計算し、為替予約の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2013年 3月29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7月11日から翌年7月10日までとします。
ただし、第1計算期間は2013年3月29日から2013年7月10日までとします。
なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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10億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、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎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。

(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【財務諸表】

【分散投資コア戦略ファンドA】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2021年7月13日から2022年7月11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）【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 （2021年 7月12日現在）	第10期 （2022年 7月11日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,114,065,007	1,475,945,530
投資信託受益証券	14,319,904,876	12,531,431,872
親投資信託受益証券	65,461,331,316	69,783,677,062
流動資産合計	80,895,301,199	83,791,054,464
資産合計	80,895,301,199	83,791,054,464
負債の部		
流動負債		
未払解約金	52,193,497	53,084,744
未払受託者報酬	21,401,889	21,987,576
未払委託者報酬	406,635,814	351,801,239
未払利息	1,700	451
その他未払費用	958,417	952,071
流動負債合計	481,191,317	427,826,081
負債合計	481,191,317	427,826,081
純資産の部		
元本等		
元本	71,401,600,740	77,480,101,954
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,012,509,142	5,883,126,429
（分配準備積立金）	6,329,338,397	5,976,709,617
元本等合計	80,414,109,882	83,363,228,383
純資産合計	80,414,109,882	83,363,228,383
負債純資産合計	80,895,301,199	83,791,054,464

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自　2020年 7月11日 至　2021年 7月12日	第10期 自　2021年 7月13日 至　2022年 7月11日
営業収益		
受取配当金	43,757,441	44,687,624
受取利息	2,939	13,277
有価証券売買等損益	6,705,618,587	△2,959,454,268
営業収益合計	6,749,378,967	△2,914,753,367
営業費用		
支払利息	504,002	660,260
受託者報酬	41,527,168	44,547,618
委託者報酬	789,016,051	746,352,353
その他費用	1,908,149	1,926,148
営業費用合計	832,955,370	793,486,379
営業利益又は営業損失（△）	5,916,423,597	△3,708,239,746
経常利益又は経常損失（△）	5,916,423,597	△3,708,239,746
当期純利益又は当期純損失（△）	5,916,423,597	△3,708,239,746
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（△）	232,572,390	△73,996,715
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,683,363,451	9,012,509,142
剰余金増加額又は欠損金減少額	834,856,459	1,092,293,410
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	834,856,459	1,092,293,410
剰余金減少額又は欠損金増加額	189,561,975	587,433,092
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	189,561,975	587,433,092
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,012,509,142	5,883,126,429

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.収益及び費用の計上基準	受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。
３.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第10期計算期間は2021年 7月13日から2022年 7月11日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第9期 (2021年 7月12日現在)	第10期 (2022年 7月11日現在)
１. 計算期間の末日における受益権の総数	71,401,600,740口	77,480,101,954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 1.1262円 (1万口当たり純資産額) (11,262円)	1口当たり純資産額 1.0759円 (1万口当たり純資産額) (10,759円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日	第10期 自 2021年 7月13日 至 2022年 7月11日
分配金の計算過程	分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	681,382,091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	4,082,181,964円
収益調整金額	C	2,709,230,297円

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	38,905,568円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	3,876,389,288円

第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日			第10期 自 2021年 7月13日 至 2022年 7月11日		
分配準備積立金額	D	1,565,774,342円	分配準備積立金額	D	5,937,804,049円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,038,568,694円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,853,098,905円
当ファンドの期末残存口数	F	71,401,600,740口	当ファンドの期末残存口数	F	77,480,101,954口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,265円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,271円
1万口当たり分配金額	H	－円	1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第10期 自 2021年 7月13日 至 2022年 7月11日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第10期 (2022年 7月11日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第10期 (2022年 7月11日現在)
	短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日	第10期 自 2021年 7月13日 至 2022年 7月11日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	66,927,087,140円	71,401,600,740円
期中追加設定元本額	8,942,057,064円	10,745,359,555円
期中一部解約元本額	4,467,543,464円	4,666,858,341円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第9期 (2021年 7月12日現在)	第10期 (2022年 7月11日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	771,204,715	△71,528,941
親投資信託受益証券	4,336,500,166	△2,555,925,789
合計	5,107,704,881	△2,627,454,730

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	4,392,104,162	4,289,768,135	
	ＦＯＦｓ用　ピクテ　マルチストラテジー　リンクファンド（適格機関投資家専用）	4,868,650,307	5,038,079,337	
	ＦＯＦｓ用ＭＡＮ　ＡＨＬ　ダイバーシファイド　リンクファンド（適格機関投資家専用）	2,519,531,577	3,203,584,400	
投資信託受益証券合計		11,780,286,046	12,531,431,872	
親投資信託受益証券	Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	795,726,284	1,703,809,119	
	グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	663,634,730	1,671,098,613	
	新興国株式インデックス　マザーファンド	234,719,161	842,242,765	
	国内株式インデックス　マザーファンド	1,440,100,504	2,726,542,284	
	外国株式インデックス　マザーファンド	1,498,580,570	6,280,401,310	
	国内債券インデックス　マザーファンド	20,452,828,218	27,977,423,719	
	外国債券インデックス　マザーファンド	259,544,875	816,502,222	
	新興国債券インデックス　マザーファンド	227,137,108	398,512,055	
	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	2,712,735,507	3,256,638,976	
	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	564,917,885	677,844,970	
	ＨＦリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）	3,927,125,252	3,532,449,164	
	外国株式最小分散インデックスマザーファンド	1,154,504,393	1,954,575,937	
	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	19,844,781,520	17,945,635,928	
親投資信託受益証券合計		53,776,336,007	69,783,677,062	
合計			82,315,108,934	

(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。

【分散投資コア戦略ファンドＳ】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2021年7月13日から2022年7月11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）【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 （2021年 7月12日現在）	第10期 （2022年 7月11日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,648,918,734	2,827,903,189
投資信託受益証券	26,035,961,567	28,139,073,200
親投資信託受益証券	143,931,416,850	147,616,246,741
未収入金	-	350,000,000
流動資産合計	172,616,297,151	178,933,223,130
資産合計	172,616,297,151	178,933,223,130
負債の部		
流動負債		
未払解約金	244,208,892	212,826,500
未払受託者報酬	45,233,071	47,565,031
未払委託者報酬	859,428,294	761,040,550
未払利息	4,042	864
その他未払費用	1,196,738	1,207,850
流動負債合計	1,150,071,037	1,022,640,795
負債合計	1,150,071,037	1,022,640,795
純資産の部		
元本等		
元本	136,583,457,227	143,734,318,300
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	34,882,768,887	34,176,264,035
（分配準備積立金）	20,563,834,888	19,403,362,850
元本等合計	171,466,226,114	177,910,582,335
純資産合計	171,466,226,114	177,910,582,335
負債純資産合計	172,616,297,151	178,933,223,130

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自　2020年 7月11日 至　2021年 7月12日	第10期 自　2021年 7月13日 至　2022年 7月11日
営業収益		
受取配当金	52,860,248	58,666,172
受取利息	7,356	20,907
有価証券売買等損益	22,645,644,567	△881,945,628
営業収益合計	22,698,512,171	△823,258,549
営業費用		
支払利息	1,122,753	1,340,748
受託者報酬	86,764,433	95,940,216
委託者報酬	1,648,524,134	1,606,736,754
その他費用	2,360,527	2,440,078
営業費用合計	1,738,771,847	1,706,457,796
営業利益又は営業損失（△）	20,959,740,324	△2,529,716,345
経常利益又は経常損失（△）	20,959,740,324	△2,529,716,345
当期純利益又は当期純損失（△）	20,959,740,324	△2,529,716,345
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（△）	944,909,202	△1,366,445
期首剰余金又は期首欠損金（△）	12,776,251,947	34,882,768,887
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,231,342,205	4,570,297,066
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,231,342,205	4,570,297,066
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,139,656,387	2,748,452,018
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,139,656,387	2,748,452,018
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	34,882,768,887	34,176,264,035

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.収益及び費用の計上基準	受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。
３.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第10期計算期間は2021年 7月13日から2022年 7月11日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第9期 (2021年 7月12日現在)	第10期 (2022年 7月11日現在)
１. 計算期間の末日における受益権の総数	136,583,457,227口	143,734,318,300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 1.2554円 (1万口当たり純資産額) (12,554円)	1口当たり純資産額 1.2378円 (1万口当たり純資産額) (12,378円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日	第10期 自 2021年 7月13日 至 2022年 7月11日
分配金の計算過程	分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,781,811,259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	15,383,662,849円
収益調整金額	C	14,318,933,999円

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	368,395,273円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	14,772,901,185円

第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日			第10期 自 2021年 7月13日 至 2022年 7月11日		
分配準備積立金額	D	3,398,360,780円	分配準備積立金額	D	19,034,967,577円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	34,882,768,887円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	34,176,264,035円
当ファンドの期末残存口数	F	136,583,457,227口	当ファンドの期末残存口数	F	143,734,318,300口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,553円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,377円
1万口当たり分配金額	H	－円	1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第10期 自 2021年 7月13日 至 2022年 7月11日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第10期 (2022年 7月11日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第10期 (2022年 7月11日現在)
	短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日	第10期 自 2021年 7月13日 至 2022年 7月11日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	130,381,111,649円	136,583,457,227円
期中追加設定元本額	17,432,745,205円	17,903,179,345円
期中一部解約元本額	11,230,399,627円	10,752,318,272円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第9期 (2021年 7月12日現在)	第10期 (2022年 7月11日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	1,761,857,531	687,110,674
親投資信託受益証券	17,124,998,757	△646,424,433
合計	18,886,856,288	40,686,241

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	5,570,473,425	5,440,681,394	
	ＦＯＦｓ用　ピクテ　マルチストラテジー　リンクファンド（適格機関投資家専用）	8,692,912,311	8,995,425,659	
	ＦＯＦｓ用ＭＡＮ　ＡＨＬ　ダイバーシファイド　リンクファンド（適格機関投資家専用）	10,777,008,374	13,702,966,147	
投資信託受益証券合計		25,040,394,110	28,139,073,200	
親投資信託受益証券	Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	1,687,481,776	3,613,235,978	
	グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	1,393,496,043	3,508,962,385	
	新興国株式インデックス　マザーファンド	1,319,362,044	4,734,266,822	
	国内株式インデックス　マザーファンド	6,097,040,794	11,543,527,335	
	外国株式インデックス　マザーファンド	8,324,445,284	34,886,917,740	
	国内債券インデックス　マザーファンド	25,571,521,445	34,979,284,184	
	外国債券インデックス　マザーファンド	556,972,964	1,752,181,247	
	新興国債券インデックス　マザーファンド	487,361,674	855,076,057	
	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	10,094,568,830	12,118,529,880	
	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	2,464,529,918	2,957,189,448	
	ＨＦリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）	4,120,114,511	3,706,043,002	
	外国株式最小分散インデックスマザーファンド	6,061,848,131	10,262,708,885	
	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	25,100,435,451	22,698,323,778	
親投資信託受益証券合計		93,279,178,865	147,616,246,741	
合計			175,755,319,941	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,991,025,485
株式	496,512,658,660
派生商品評価勘定	41,391,850
未収入金	146,155,300
未収配当金	738,641,138
差入委託証拠金	130,320,000
流動資産合計	499,560,192,433
資産合計	499,560,192,433
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	121,650
前受金	41,303,200
未払解約金	144,034,951
未払利息	608
流動負債合計	185,460,409
負債合計	185,460,409
純資産の部	
元本等	
元本	263,755,440,320
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	235,619,291,704
元本等合計	499,374,732,024
純資産合計	499,374,732,024
負債純資産合計	499,560,192,433

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11日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	2022年 7月11日現在
	移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	263,755,440,320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　1.8933円 (1万口当たり純資産額)　(18,933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 7月11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 7月11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。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月11日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	251,095,419,520円
期中追加設定元本額	36,066,794,774円
期中一部解約元本額	23,406,773,974円
期末元本額	263,755,440,320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）	400,221,389円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	4,007,775,587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	11,961,751,699円
世界経済インデックスファンド	3,968,855,016円
日本株式インデックス・オープン	3,296,225,287円
ＤＣマイセレクション２５	6,244,201,141円
ＤＣマイセレクション５０	19,065,779,456円
ＤＣマイセレクション７５	19,022,256,983円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	6,208,111,264円
ＤＣマイセレクションＳ２５	3,190,241,485円
ＤＣマイセレクションＳ５０	9,327,956,294円
ＤＣマイセレクションＳ７５	7,141,183,428円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	8,450,630,101円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	196,748,599円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	709,996,032円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	519,639,649円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,677,551,196円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,727,257,533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）	18,158,121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）	173,782,661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）	29,585,940円

区分	2022年 7月11日現在
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）	891,920,563円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	434,614,119円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,798,847,146円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	50,709,593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）	474,957,123円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	273,810,169円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	347,592,571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）	585,589,769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	1,898,971,617円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,035,970,286円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,319,372,568円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,440,100,504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）	493,236,576円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	432,747,507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）	221,406,255円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,298,534円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	58,355,592円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	30,593,626,151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	48,296,197円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	182,985,648円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	32,689,129円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	8,889,766円
グローバル経済コア	219,862,164円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	28,345,430円
ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	106,531,452円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	24,249,989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）	211,083,787円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	18,351,027円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	14,839,165円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	5,677,543円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	7,096,855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）	44,810,496,769円

区分	2022年 7月11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）	920,469,451円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	309,822,187円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	52,217,377円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	144,428,377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）	46,643,343,632円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	14,533,345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）	179,832,545円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△1,829,041,016
合計	△1,829,041,016

(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 7月11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	2,665,216,800	－	2,706,520,000	41,303,200
合計		2,665,216,800	－	2,706,520,000	41,303,200

(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	8,900	3,535.00	31,461,500	
日本水産	254,300	583.00	148,256,900	
マルハニチロ	36,300	2,524.00	91,621,200	
雪国まいたけ	20,000	955.00	19,100,000	
カネコ種苗	7,700	1,594.00	12,273,800	
サカタのタネ	29,700	4,410.00	130,977,000	
ホクト	20,900	1,952.00	40,796,800	
ホクリヨウ	3,700	617.00	2,282,900	
住石ホールディングス	47,900	187.00	8,957,300	
日鉄鉱業	5,200	5,250.00	27,300,000	
三井松島ホールディングス	11,500	2,913.00	33,499,500	
ＩＮＰＥＸ	955,200	1,404.00	1,341,100,800	
石油資源開発	32,200	3,135.00	100,947,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	10,600	1,539.00	16,313,400	
ショーボンドホールディングス	32,000	6,010.00	192,320,000	
ミライト・ワン	88,200	1,643.00	144,912,600	
タマホーム	16,600	2,401.00	39,856,600	
サンヨーホームズ	3,200	723.00	2,313,600	
日本アクア	10,900	589.00	6,420,100	
ファーストコーポレーション	6,700	734.00	4,917,800	
ベステラ	5,500	1,142.00	6,281,000	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	45,700	184.00	8,408,800	
キャンディル	4,000	535.00	2,140,000	
ダイセキ環境ソリューション	5,300	836.00	4,430,800	
第一カッター興業	6,000	1,289.00	7,734,000	
安藤・間	124,700	870.00	108,489,000	
東急建設	73,500	633.00	46,525,500	
コムシスホールディングス	88,300	2,609.00	230,374,700	
ビーアールホールディングス	34,400	338.00	11,627,200	
高松コンストラクショングループ	17,400	2,072.00	36,052,800	
東建コーポレーション	7,600	8,300.00	63,080,000	
ソネック	2,800	1,006.00	2,816,800	
ヤマウラ	11,900	964.00	11,471,600	
オリエンタル白石	92,100	243.00	22,380,300	
大成建設	176,000	4,290.00	755,040,000	
大林組	587,400	973.00	571,540,200	
清水建設	543,200	763.00	414,461,600	
飛島建設	16,900	1,044.00	17,643,600	
長谷工コーポレーション	169,500	1,605.00	272,047,500	
松井建設	21,100	638.00	13,461,800	
錢高組	2,400	3,185.00	7,644,000	
鹿島建設	430,400	1,508.00	649,043,200	

不動テトラ	13,400	1,622.00	21,734,800	
大末建設	6,600	1,533.00	10,117,800	
鉄建建設	12,800	1,831.00	23,436,800	
西松建設	38,300	4,045.00	154,923,500	
三井住友建設	142,600	460.00	65,596,000	
大豊建設	9,200	4,280.00	39,376,000	
佐田建設	13,600	449.00	6,106,400	
ナカノフドー建設	15,100	305.00	4,605,500	
奥村組	31,500	2,980.00	93,870,000	
東鉄工業	24,900	2,378.00	59,212,200	
イチケン	4,600	1,816.00	8,353,600	
富士ピー・エス	8,200	454.00	3,722,800	
淺沼組	7,100	5,390.00	38,269,000	
戸田建設	242,500	725.00	175,812,500	
熊谷組	31,300	2,771.00	86,732,300	
北野建設	3,900	2,128.00	8,299,200	
植木組	5,200	1,338.00	6,957,600	
矢作建設工業	25,100	798.00	20,029,800	
ピーエス三菱	20,800	618.00	12,854,400	
日本ハウスホールディングス	42,600	405.00	17,253,000	
大東建託	64,700	12,170.00	787,399,000	
新日本建設	26,900	736.00	19,798,400	
東亜道路工業	3,300	5,710.00	18,843,000	
日本道路	5,500	6,630.00	36,465,000	
東亜建設工業	14,100	2,484.00	35,024,400	
日本国土開発	49,200	527.00	25,928,400	
若築建設	9,700	2,305.00	22,358,500	
東洋建設	70,900	874.00	61,966,600	
五洋建設	232,800	703.00	163,658,400	
世紀東急工業	30,400	822.00	24,988,800	
福田組	6,800	4,820.00	32,776,000	
住友林業	138,600	2,032.00	281,635,200	
日本基礎技術	15,500	613.00	9,501,500	
巴コーポレーション	23,000	450.00	10,350,000	
大和ハウス工業	500,600	3,256.00	1,629,953,600	
ライト工業	34,800	1,879.00	65,389,200	
積水ハウス	600,300	2,379.00	1,428,113,700	
日特建設	13,100	824.00	10,794,400	
北陸電気工事	11,300	768.00	8,678,400	
ユアテック	36,200	740.00	26,788,000	
日本リーテック	12,000	952.00	11,424,000	
四電工	6,100	1,758.00	10,723,800	

中電工	25,500	2,148.00	54,774,000	
関電工	102,800	855.00	87,894,000	
きんでん	128,500	1,605.00	206,242,500	
東京エネシス	18,700	1,033.00	19,317,100	
トーエネック	6,400	3,645.00	23,328,000	
住友電設	15,600	2,616.00	40,809,600	
日本電設工業	27,000	1,792.00	48,384,000	
エクシオグループ	87,800	2,124.00	186,487,200	
新日本空調	13,700	1,857.00	25,440,900	
九電工	39,900	2,741.00	109,365,900	
三機工業	41,100	1,582.00	65,020,200	
日揮ホールディングス	178,600	1,717.00	306,656,200	
中外炉工業	5,900	1,643.00	9,693,700	
ヤマト	15,200	773.00	11,749,600	
太平電業	11,500	2,904.00	33,396,000	
高砂熱学工業	48,400	1,653.00	80,005,200	
三晃金属工業	2,500	2,668.00	6,670,000	
朝日工業社	7,700	1,869.00	14,391,300	
明星工業	31,800	706.00	22,450,800	
大氣社	26,400	3,165.00	83,556,000	
ダイダン	11,900	2,139.00	25,454,100	
日比谷総合設備	17,200	1,933.00	33,247,600	
フィル・カンパニー	3,300	1,290.00	4,257,000	
テスホールディングス	17,600	1,188.00	20,908,800	
インフロニア・ホールディングス	220,200	953.00	209,850,600	
東洋エンジニアリング	26,600	649.00	17,263,400	
レイズネクスト	27,100	1,184.00	32,086,400	
ニップン	49,400	1,662.00	82,102,800	
日清製粉グループ本社	190,600	1,644.00	313,346,400	
日東富士製粉	2,900	4,670.00	13,543,000	
昭和産業	16,000	2,611.00	41,776,000	
鳥越製粉	14,700	667.00	9,804,900	
中部飼料	20,900	1,094.00	22,864,600	
フィード・ワン	24,100	697.00	16,797,700	
東洋精糖	3,400	936.00	3,182,400	
日本甜菜製糖	10,600	1,717.00	18,200,200	
DM三井製糖ホールディングス	16,400	1,935.00	31,734,000	
塩水港精糖	24,100	208.00	5,012,800	
日新製糖	9,600	1,776.00	17,049,600	
森永製菓	40,700	4,405.00	179,283,500	
中村屋	4,100	3,215.00	13,181,500	
江崎グリコ	47,200	4,090.00	193,048,000	

名糖産業	7,300	1,689.00	12,329,700	
井村屋グループ	9,800	2,300.00	22,540,000	
不二家	11,300	2,443.00	27,605,900	
山崎製パン	124,100	1,738.00	215,685,800	
第一屋製パン	3,900	494.00	1,926,600	
モロゾフ	6,000	3,680.00	22,080,000	
亀田製菓	10,500	4,775.00	50,137,500	
寿スピリッツ	17,500	6,370.00	111,475,000	
カルビー	92,300	2,838.00	261,947,400	
森永乳業	34,300	5,140.00	176,302,000	
六甲バター	13,400	1,425.00	19,095,000	
ヤクルト本社	128,500	8,110.00	1,042,135,000	
明治ホールディングス	111,500	7,060.00	787,190,000	
雪印メグミルク	44,300	1,907.00	84,480,100	
プリマハム	25,300	2,333.00	59,024,900	
日本ハム	70,900	4,285.00	303,806,500	
林兼産業	6,100	486.00	2,964,600	
丸大食品	18,300	1,590.00	29,097,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	18,200	3,185.00	57,967,000	
柿安本店	7,000	2,434.00	17,038,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	130,300	699.00	91,079,700	
サッポロホールディングス	59,200	2,975.00	176,120,000	
アサヒグループホールディングス	412,700	4,584.00	1,891,816,800	
キリンホールディングス	744,100	2,224.50	1,655,250,450	
宝ホールディングス	112,500	1,032.00	116,100,000	
オエノンホールディングス	53,400	313.00	16,714,200	
養命酒製造	5,400	1,805.00	9,747,000	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	129,200	1,552.00	200,518,400	
サントリー食品インターナショナル	135,400	5,290.00	716,266,000	
ダイドーグループホールディングス	10,400	5,140.00	53,456,000	
伊藤園	61,500	6,330.00	389,295,000	
キーコーヒー	18,500	2,123.00	39,275,500	
ユニカフェ	6,100	920.00	5,612,000	
ジャパンフーズ	2,900	1,145.00	3,320,500	
日清オイリオグループ	23,200	3,255.00	75,516,000	
不二製油グループ本社	43,900	2,314.00	101,584,600	
かどや製油	1,800	3,595.00	6,471,000	
Ｊ－オイルミルズ	18,900	1,640.00	30,996,000	
キッコーマン	121,400	7,760.00	942,064,000	
味の素	403,500	3,490.00	1,408,215,000	
ブルドックソース	7,200	1,919.00	13,816,800	
キユーピー	88,600	2,319.00	205,463,400	

ハウス食品グループ本社	63,100	2,992.00	188,795,200	
カゴメ	76,800	3,430.00	263,424,000	
焼津水産化学工業	8,200	945.00	7,749,000	
アリアケジャパン	18,500	5,540.00	102,490,000	
ピエトロ	2,600	1,833.00	4,765,800	
エバラ食品工業	4,400	3,065.00	13,486,000	
やまみ	1,700	1,670.00	2,839,000	
ニチレイ	75,500	2,417.00	182,483,500	
東洋水産	90,300	5,430.00	490,329,000	
イートアンドホールディングス	7,600	2,340.00	17,784,000	
大冷	2,300	1,914.00	4,402,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,400	485.00	5,044,000	
日清食品ホールディングス	65,300	9,790.00	639,287,000	
永谷園ホールディングス	9,000	2,040.00	18,360,000	
一正蒲鉾	7,900	804.00	6,351,600	
フジッコ	18,800	2,011.00	37,806,800	
ロック・フィールド	20,100	1,482.00	29,788,200	
日本たばこ産業	1,085,400	2,380.00	2,583,252,000	
ケンコーマヨネーズ	10,300	1,496.00	15,408,800	
わらべや日洋ホールディングス	12,100	2,236.00	27,055,600	
なとり	11,300	2,068.00	23,368,400	
イフジ産業	3,500	963.00	3,370,500	
ピックルスコーポレーション	9,700	1,130.00	10,961,000	
ファーマフーズ	25,500	1,418.00	36,159,000	
ユーグレナ	104,500	926.00	96,767,000	
紀文食品	15,700	1,003.00	15,747,100	
ミヨシ油脂	7,100	1,041.00	7,391,100	
理研ビタミン	14,200	1,734.00	24,622,800	
片倉工業	17,900	2,126.00	38,055,400	
グンゼ	11,600	3,800.00	44,080,000	
東洋紡	78,600	1,024.00	80,486,400	
ユニチカ	56,500	236.00	13,334,000	
富士紡ホールディングス	8,200	3,320.00	27,224,000	
倉敷紡績	14,000	2,052.00	28,728,000	
シキボウ	10,400	903.00	9,391,200	
日本毛織	49,300	999.00	49,250,700	
トーア紡コーポレーション	7,300	370.00	2,701,000	
帝国繊維	20,900	1,692.00	35,362,800	
帝人	173,900	1,432.00	249,024,800	
東レ	1,226,700	709.30	870,098,310	
住江織物	3,400	1,702.00	5,786,800	
日本フエルト	12,400	411.00	5,096,400	

イチカワ	2,700	1,391.00	3,755,700	
日東製網	2,100	1,308.00	2,746,800	
アツギ	14,500	496.00	7,192,000	
ダイニック	6,400	622.00	3,980,800	
セーレン	36,700	2,052.00	75,308,400	
ソトー	7,500	844.00	6,330,000	
東海染工	2,500	1,134.00	2,835,000	
小松マテーレ	29,900	1,111.00	33,218,900	
ワコールホールディングス	40,500	2,119.00	85,819,500	
ホギメディカル	24,600	3,300.00	81,180,000	
ＴＳＩホールディングス	60,700	344.00	20,880,800	
マツオカコーポレーション	5,900	942.00	5,557,800	
ワールド	26,000	1,298.00	33,748,000	
三陽商会	8,700	864.00	7,516,800	
ナイガイ	7,500	280.00	2,100,000	
オンワードホールディングス	109,700	252.00	27,644,400	
ルックホールディングス	6,400	1,641.00	10,502,400	
ゴールドウイン	32,700	8,000.00	261,600,000	
デサント	33,800	3,180.00	107,484,000	
キング	9,700	510.00	4,947,000	
ヤマトインターナショナル	15,500	283.00	4,386,500	
特種東海製紙	10,300	3,115.00	32,084,500	
王子ホールディングス	762,300	571.00	435,273,300	
日本製紙	80,100	985.00	78,898,500	
三菱製紙	25,200	298.00	7,509,600	
北越コーポレーション	117,800	729.00	85,876,200	
中越パルプ工業	7,500	929.00	6,967,500	
巴川製紙所	5,900	622.00	3,669,800	
大王製紙	84,700	1,456.00	123,323,200	
阿波製紙	4,500	301.00	1,354,500	
レンゴー	152,800	746.00	113,988,800	
トーモク	9,700	1,540.00	14,938,000	
ザ・パック	12,500	2,407.00	30,087,500	
北の達人コーポレーション	70,700	215.00	15,200,500	
クラレ	266,700	1,081.00	288,302,700	
旭化成	1,222,100	1,069.00	1,306,424,900	
共和レザー	10,700	573.00	6,131,100	
昭和電工	173,700	2,253.00	391,346,100	
住友化学	1,347,700	527.00	710,237,900	
住友精化	7,900	2,908.00	22,973,200	
日産化学	88,900	6,570.00	584,073,000	
ラサ工業	7,000	1,844.00	12,908,000	

クレハ	14,300	10,350.00	148,005,000	
多木化学	6,500	4,645.00	30,192,500	
テイカ	11,300	1,242.00	14,034,600	
石原産業	35,400	1,044.00	36,957,600	
片倉コープアグリ	4,500	1,283.00	5,773,500	
日本曹達	21,700	4,270.00	92,659,000	
東ソー	244,300	1,727.00	421,906,100	
トクヤマ	58,700	1,774.00	104,133,800	
セントラル硝子	29,600	3,145.00	93,092,000	
東亞合成	94,100	1,061.00	99,840,100	
大阪ソーダ	15,100	3,300.00	49,830,000	
関東電化工業	36,000	887.00	31,932,000	
デンカ	66,500	3,355.00	223,107,500	
信越化学工業	313,100	16,175.00	5,064,392,500	
日本カーバイド工業	7,100	1,370.00	9,727,000	
堺化学工業	12,800	1,894.00	24,243,200	
第一稀元素化学工業	16,800	1,227.00	20,613,600	
エア・ウォーター	158,300	1,722.00	272,592,600	
日本酸素ホールディングス	162,700	2,221.00	361,356,700	
日本化学工業	5,600	1,952.00	10,931,200	
東邦アセチレン	3,900	1,114.00	4,344,600	
日本パーカライジング	83,000	954.00	79,182,000	
高圧ガス工業	27,800	688.00	19,126,400	
チタン工業	2,300	1,632.00	3,753,600	
四国化成工業	22,800	1,261.00	28,750,800	
戸田工業	4,200	2,309.00	9,697,800	
ステラ　ケミファ	9,900	2,463.00	24,383,700	
保土谷化学工業	5,300	3,330.00	17,649,000	
日本触媒	28,100	5,310.00	149,211,000	
大日精化工業	14,000	1,822.00	25,508,000	
カネカ	42,600	3,410.00	145,266,000	
三菱瓦斯化学	155,500	1,975.00	307,112,500	
三井化学	153,800	2,875.00	442,175,000	
ＪＳＲ	184,100	3,555.00	654,475,500	
東京応化工業	29,300	6,790.00	198,947,000	
大阪有機化学工業	14,000	2,443.00	34,202,000	
三菱ケミカルグループ	1,226,200	752.10	922,225,020	
ＫＨネオケム	30,200	2,473.00	74,684,600	
ダイセル	265,600	848.00	225,228,800	
住友ベークライト	27,900	4,165.00	116,203,500	
積水化学工業	377,300	1,910.00	720,643,000	
日本ゼオン	148,500	1,367.00	202,999,500	

アイカ工業	46,600	3,005.00	140,033,000	
ＵＢＥ	93,100	2,042.00	190,110,200	
積水樹脂	27,100	1,765.00	47,831,500	
タキロンシーアイ	42,700	551.00	23,527,700	
旭有機材	11,200	1,981.00	22,187,200	
ニチバン	10,400	1,639.00	17,045,600	
リケンテクノス	40,100	445.00	17,844,500	
大倉工業	8,600	1,727.00	14,852,200	
積水化成品工業	23,500	418.00	9,823,000	
群栄化学工業	3,900	2,615.00	10,198,500	
タイガースポリマー	9,400	428.00	4,023,200	
ミライアル	6,300	1,811.00	11,409,300	
ダイキアクシス	7,700	706.00	5,436,200	
ダイキョーニシカワ	41,600	538.00	22,380,800	
竹本容器	7,100	793.00	5,630,300	
森六ホールディングス	9,600	1,839.00	17,654,400	
恵和	5,400	3,400.00	18,360,000	
日本化薬	138,800	1,115.00	154,762,000	
カーリットホールディングス	16,600	683.00	11,337,800	
日本精化	12,700	1,977.00	25,107,900	
扶桑化学工業	15,600	3,520.00	54,912,000	
トリケミカル研究所	20,400	2,141.00	43,676,400	
ＡＤＥＫＡ	78,000	2,317.00	180,726,000	
日油	57,100	5,180.00	295,778,000	
新日本理化	28,000	267.00	7,476,000	
ハリマ化成グループ	13,100	760.00	9,956,000	
花王	416,400	5,760.00	2,398,464,000	
第一工業製薬	6,700	2,366.00	15,852,200	
石原ケミカル	9,200	1,301.00	11,969,200	
日華化学	6,700	827.00	5,540,900	
ニイタカ	3,700	2,157.00	7,980,900	
三洋化成工業	11,800	4,775.00	56,345,000	
有機合成薬品工業	13,800	268.00	3,698,400	
大日本塗料	22,300	719.00	16,033,700	
日本ペイントホールディングス	742,200	1,114.00	826,810,800	
関西ペイント	170,700	1,878.00	320,574,600	
神東塗料	15,500	149.00	2,309,500	
中国塗料	42,700	901.00	38,472,700	
日本特殊塗料	11,800	987.00	11,646,600	
藤倉化成	24,600	483.00	11,881,800	
太陽ホールディングス	29,100	2,817.00	81,974,700	
ＤＩＣ	71,500	2,448.00	175,032,000	

サカタインクス	33,900	969.00	32,849,100	
東洋インキＳＣホールディングス	36,500	1,927.00	70,335,500	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	15,900	845.00	13,435,500	
富士フイルムホールディングス	354,500	7,580.00	2,687,110,000	
資生堂	375,700	5,616.00	2,109,931,200	
ライオン	201,500	1,532.00	308,698,000	
高砂香料工業	11,400	2,547.00	29,035,800	
マンダム	39,300	1,695.00	66,613,500	
ミルボン	24,900	5,150.00	128,235,000	
ファンケル	81,600	2,560.00	208,896,000	
コーセー	37,900	12,600.00	477,540,000	
コタ	14,100	1,601.00	22,574,100	
シーボン	2,600	1,705.00	4,433,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	86,100	1,656.00	142,581,600	
ノエビアホールディングス	15,000	5,980.00	89,700,000	
アジュバンホールディングス	4,500	996.00	4,482,000	
新日本製薬	9,600	1,611.00	15,465,600	
エステー	13,000	1,570.00	20,410,000	
アグロ　カネショウ	6,700	1,270.00	8,509,000	
コニシ	30,600	1,597.00	48,868,200	
長谷川香料	34,800	3,010.00	104,748,000	
星光ＰＭＣ	11,400	534.00	6,087,600	
小林製薬	56,500	9,050.00	511,325,000	
荒川化学工業	14,200	995.00	14,129,000	
メック	13,800	2,276.00	31,408,800	
日本高純度化学	4,700	2,304.00	10,828,800	
タカラバイオ	52,800	1,985.00	104,808,000	
ＪＣＵ	20,700	3,525.00	72,967,500	
新田ゼラチン	11,500	610.00	7,015,000	
ＯＡＴアグリオ	8,300	1,534.00	12,732,200	
デクセリアルズ	52,500	3,535.00	185,587,500	
アース製薬	16,600	5,500.00	91,300,000	
北興化学工業	16,900	955.00	16,139,500	
大成ラミック	5,300	2,740.00	14,522,000	
クミアイ化学工業	75,100	1,075.00	80,732,500	
日本農薬	35,900	674.00	24,196,600	
アキレス	12,900	1,375.00	17,737,500	
有沢製作所	27,400	1,013.00	27,756,200	
日東電工	121,900	8,720.00	1,062,968,000	
レック	23,900	687.00	16,419,300	
三光合成	23,100	339.00	7,830,900	
きもと	30,900	226.00	6,983,400	

藤森工業	15,700	3,550.00	55,735,000	
前澤化成工業	11,800	1,309.00	15,446,200	
未来工業	7,200	1,518.00	10,929,600	
ウェーブロックホールディングス	7,700	639.00	4,920,300	
ＪＳＰ	11,800	1,454.00	17,157,200	
エフピコ	37,100	2,869.00	106,439,900	
天馬	15,900	2,311.00	36,744,900	
信越ポリマー	36,200	1,216.00	44,019,200	
東リ	46,000	206.00	9,476,000	
ニフコ	67,300	3,285.00	221,080,500	
バルカー	16,400	2,600.00	42,640,000	
ユニ・チャーム	388,800	4,878.00	1,896,566,400	
ショーエイコーポレーション	5,400	586.00	3,164,400	
協和キリン	202,900	3,165.00	642,178,500	
武田薬品工業	1,585,300	3,973.00	6,298,396,900	
アステラス製薬	1,724,500	2,164.00	3,731,818,000	
住友ファーマ	124,600	1,122.00	139,801,200	
塩野義製薬	234,100	7,215.00	1,689,031,500	
わかもと製薬	19,600	264.00	5,174,400	
日本新薬	44,000	8,460.00	372,240,000	
中外製薬	630,900	3,737.00	2,357,673,300	
科研製薬	28,800	3,995.00	115,056,000	
エーザイ	222,900	6,181.00	1,377,744,900	
ロート製薬	96,100	4,020.00	386,322,000	
小野薬品工業	388,800	3,835.00	1,491,048,000	
久光製薬	42,700	3,465.00	147,955,500	
持田製薬	22,600	3,400.00	76,840,000	
参天製薬	351,300	1,104.00	387,835,200	
扶桑薬品工業	6,500	2,169.00	14,098,500	
日本ケミファ	2,100	1,880.00	3,948,000	
ツムラ	57,700	3,220.00	185,794,000	
日医工	57,200	369.00	21,106,800	
キッセイ薬品工業	29,200	2,766.00	80,767,200	
生化学工業	35,600	883.00	31,434,800	
栄研化学	30,000	1,877.00	56,310,000	
日水製薬	7,400	1,713.00	12,676,200	
鳥居薬品	10,800	3,405.00	36,774,000	
ＪＣＲファーマ	56,800	2,516.00	142,908,800	
東和薬品	29,000	2,685.00	77,865,000	
富士製薬工業	10,900	1,003.00	10,932,700	
ゼリア新薬工業	29,900	2,227.00	66,587,300	
第一三共	1,463,100	3,596.00	5,261,307,600	

キョーリン製薬ホールディングス	36,400	1,851.00	67,376,400	
大幸薬品	30,400	597.00	18,148,800	
ダイト	12,500	2,868.00	35,850,000	
大塚ホールディングス	384,300	4,984.00	1,915,351,200	
大正製薬ホールディングス	37,300	5,540.00	206,642,000	
ペプチドリーム	105,800	1,556.00	164,624,800	
あすか製薬ホールディングス	19,100	1,062.00	20,284,200	
サワイグループホールディングス	38,700	4,330.00	167,571,000	
日本コークス工業	170,400	119.00	20,277,600	
ニチレキ	21,800	1,336.00	29,124,800	
ユシロ化学工業	9,600	915.00	8,784,000	
ビーピー・カストロール	7,200	1,124.00	8,092,800	
富士石油	44,100	313.00	13,803,300	
ＭＯＲＥＳＣＯ	6,700	1,221.00	8,180,700	
出光興産	205,200	3,235.00	663,822,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	3,034,300	506.00	1,535,355,800	
コスモエネルギーホールディングス	79,600	3,515.00	279,794,000	
横浜ゴム	95,600	1,937.00	185,177,200	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	96,500	1,766.00	170,419,000	
ブリヂストン	536,300	5,038.00	2,701,879,400	
住友ゴム工業	164,700	1,232.00	202,910,400	
藤倉コンポジット	16,200	844.00	13,672,800	
オカモト	9,300	3,890.00	36,177,000	
フコク	8,800	960.00	8,448,000	
ニッタ	19,000	2,788.00	52,972,000	
住友理工	39,100	595.00	23,264,500	
三ツ星ベルト	24,500	2,866.00	70,217,000	
バンドー化学	32,500	962.00	31,265,000	
日東紡績	25,100	2,299.00	57,704,900	
ＡＧＣ	170,900	4,780.00	816,902,000	
日本板硝子	91,200	394.00	35,932,800	
石塚硝子	3,200	1,639.00	5,244,800	
日本山村硝子	7,200	710.00	5,112,000	
日本電気硝子	74,800	2,650.00	198,220,000	
オハラ	8,100	1,195.00	9,679,500	
住友大阪セメント	30,100	3,585.00	107,908,500	
太平洋セメント	114,700	2,007.00	230,202,900	
日本ヒューム	16,800	665.00	11,172,000	
日本コンクリート工業	36,700	271.00	9,945,700	
三谷セキサン	8,200	4,265.00	34,973,000	
アジアパイルホールディングス	28,900	479.00	13,843,100	
東海カーボン	155,100	1,044.00	161,924,400	

日本カーボン	10,400	4,060.00	42,224,000	
東洋炭素	11,900	2,933.00	34,902,700	
ノリタケカンパニーリミテド	10,300	4,200.00	43,260,000	
ＴＯＴＯ	121,900	4,585.00	558,911,500	
日本碍子	198,700	1,850.00	367,595,000	
日本特殊陶業	140,700	2,459.00	345,981,300	
ＭＡＲＵＷＡ	7,000	15,320.00	107,240,000	
品川リフラクトリーズ	4,800	3,590.00	17,232,000	
黒崎播磨	3,500	4,410.00	15,435,000	
ヨータイ	12,900	1,502.00	19,375,800	
東京窯業	20,500	276.00	5,658,000	
ニッカトー	8,700	455.00	3,958,500	
フジミインコーポレーテッド	16,200	5,510.00	89,262,000	
クニミネ工業	6,500	935.00	6,077,500	
エーアンドエーマテリアル	3,400	858.00	2,917,200	
ニチアス	42,500	2,310.00	98,175,000	
ニチハ	25,800	2,671.00	68,911,800	
日本製鉄	833,200	1,952.50	1,626,823,000	
神戸製鋼所	347,600	620.00	215,512,000	
中山製鋼所	27,800	430.00	11,954,000	
合同製鐵	9,700	1,383.00	13,415,100	
ＪＦＥホールディングス	461,800	1,481.00	683,925,800	
東京製鐵	58,300	1,469.00	85,642,700	
共英製鋼	19,700	1,408.00	27,737,600	
大和工業	32,600	4,435.00	144,581,000	
東京鐵鋼	8,300	1,267.00	10,516,100	
大阪製鐵	10,600	1,511.00	16,016,600	
淀川製鋼所	21,800	2,370.00	51,666,000	
丸一鋼管	57,900	2,898.00	167,794,200	
モリ工業	4,900	2,450.00	12,005,000	
大同特殊鋼	27,200	3,630.00	98,736,000	
日本高周波鋼業	7,600	322.00	2,447,200	
日本冶金工業	13,600	2,196.00	29,865,600	
山陽特殊製鋼	17,100	1,894.00	32,387,400	
愛知製鋼	11,200	2,097.00	23,486,400	
日立金属	214,900	2,059.00	442,479,100	
日本金属	5,000	1,145.00	5,725,000	
大平洋金属	12,300	2,361.00	29,040,300	
新日本電工	110,600	352.00	38,931,200	
栗本鐵工所	8,200	1,696.00	13,907,200	
虹技	2,600	978.00	2,542,800	
三菱製鋼	12,900	950.00	12,255,000	

日亜鋼業	23,000	259.00	5,957,000	
日本精線	3,100	4,430.00	13,733,000	
エンビプロ・ホールディングス	13,300	778.00	10,347,400	
シンニッタン	24,400	224.00	5,465,600	
新家工業	4,200	1,460.00	6,132,000	
大紀アルミニウム工業所	24,700	1,201.00	29,664,700	
日本軽金属ホールディングス	50,500	1,528.00	77,164,000	
三井金属鉱業	53,900	3,090.00	166,551,000	
東邦亜鉛	10,300	2,179.00	22,443,700	
三菱マテリアル	115,300	1,945.00	224,258,500	
住友金属鉱山	218,600	4,065.00	888,609,000	
ＤＯＷＡホールディングス	46,600	4,560.00	212,496,000	
古河機械金属	30,500	1,218.00	37,149,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	23,100	3,050.00	70,455,000	
東邦チタニウム	35,700	2,325.00	83,002,500	
ＵＡＣＪ	27,300	2,089.00	57,029,700	
ＣＫサンエツ	3,800	4,270.00	16,226,000	
古河電気工業	57,600	2,284.00	131,558,400	
住友電気工業	696,100	1,486.00	1,034,404,600	
フジクラ	222,500	743.00	165,317,500	
昭和電線ホールディングス	17,400	1,582.00	27,526,800	
東京特殊電線	2,600	2,309.00	6,003,400	
タツタ電線	35,400	462.00	16,354,800	
カナレ電気	3,000	1,544.00	4,632,000	
平河ヒューテック	11,100	1,088.00	12,076,800	
リョービ	20,500	1,049.00	21,504,500	
アーレスティ	21,500	376.00	8,084,000	
アサヒホールディングス	79,900	2,091.00	167,070,900	
稲葉製作所	10,100	1,381.00	13,948,100	
宮地エンジニアリンググループ	5,600	3,340.00	18,704,000	
トーカロ	51,400	1,259.00	64,712,600	
アルファＣｏ	7,000	1,007.00	7,049,000	
ＳＵＭＣＯ	328,900	1,762.00	579,521,800	
川田テクノロジーズ	3,700	3,660.00	13,542,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	6,500	6,030.00	39,195,000	
ジェイテックコーポレーション	2,600	2,144.00	5,574,400	
信和	12,400	783.00	9,709,200	
東洋製罐グループホールディングス	101,600	1,419.00	144,170,400	
ホッカンホールディングス	9,300	1,263.00	11,745,900	
コロナ	9,600	847.00	8,131,200	
横河ブリッジホールディングス	28,500	1,956.00	55,746,000	
駒井ハルテック	3,100	1,707.00	5,291,700	

高田機工	1,700	2,428.00	4,127,600	
三和ホールディングス	188,100	1,335.00	251,113,500	
文化シヤッター	58,800	1,017.00	59,799,600	
三協立山	23,700	551.00	13,058,700	
アルインコ	13,200	866.00	11,431,200	
東洋シヤッター	4,400	571.00	2,512,400	
ＬＩＸＩＬ	313,900	2,710.00	850,669,000	
日本フイルコン	12,500	495.00	6,187,500	
ノーリツ	31,800	1,489.00	47,350,200	
長府製作所	20,300	1,803.00	36,600,900	
リンナイ	34,500	9,800.00	338,100,000	
ダイニチ工業	9,500	659.00	6,260,500	
日東精工	22,500	495.00	11,137,500	
三洋工業	2,400	1,788.00	4,291,200	
岡部	30,900	620.00	19,158,000	
ジーテクト	22,000	1,300.00	28,600,000	
東プレ	30,400	1,046.00	31,798,400	
高周波熱錬	30,700	672.00	20,630,400	
東京製綱	12,200	941.00	11,480,200	
サンコール	17,100	616.00	10,533,600	
モリテック　スチール	15,500	281.00	4,355,500	
パイオラックス	26,200	1,984.00	51,980,800	
エイチワン	17,800	612.00	10,893,600	
日本発條	168,100	879.00	147,759,900	
中央発條	9,600	706.00	6,777,600	
アドバネクス	2,600	1,167.00	3,034,200	
立川ブラインド工業	7,800	1,080.00	8,424,000	
三益半導体工業	15,600	2,056.00	32,073,600	
日本ドライケミカル	4,600	1,648.00	7,580,800	
日本製鋼所	51,300	3,125.00	160,312,500	
三浦工業	78,600	3,150.00	247,590,000	
タクマ	57,400	1,322.00	75,882,800	
ツガミ	41,000	1,144.00	46,904,000	
オークマ	19,100	5,170.00	98,747,000	
芝浦機械	22,600	2,710.00	61,246,000	
アマダ	315,100	1,018.00	320,771,800	
アイダエンジニアリング	43,800	927.00	40,602,600	
滝澤鉄工所	5,900	1,198.00	7,068,200	
ＦＵＪＩ	79,700	2,034.00	162,109,800	
牧野フライス製作所	20,300	4,340.00	88,102,000	
オーエスジー	87,100	1,639.00	142,756,900	
ダイジェット工業	2,400	908.00	2,179,200	

旭ダイヤモンド工業	49,300	624.00	30,763,200	
DMG森精機	110,600	1,682.00	186,029,200	
ソディック	43,600	821.00	35,795,600	
ディスコ	29,400	30,650.00	901,110,000	
日東工器	9,600	1,559.00	14,966,400	
日進工具	15,800	1,287.00	20,334,600	
パンチ工業	17,100	451.00	7,712,100	
冨士ダイス	10,200	657.00	6,701,400	
豊和工業	10,600	914.00	9,688,400	
ニデックオーケーケー	7,500	1,180.00	8,850,000	
東洋機械金属	13,200	569.00	7,510,800	
津田駒工業	3,400	502.00	1,706,800	
エンシュウ	4,700	917.00	4,309,900	
島精機製作所	29,300	2,170.00	63,581,000	
オプトラン	25,100	1,885.00	47,313,500	
ＮＣホールディングス	5,600	2,137.00	11,967,200	
イワキポンプ	12,800	976.00	12,492,800	
フリュー	17,800	1,132.00	20,149,600	
ヤマシンフィルタ	31,700	329.00	10,429,300	
日阪製作所	20,600	847.00	17,448,200	
やまびこ	33,200	1,168.00	38,777,600	
野村マイクロ・サイエンス	6,400	3,480.00	22,272,000	
平田機工	8,800	4,445.00	39,116,000	
ペガサスミシン製造	20,400	601.00	12,260,400	
マルマエ	8,200	1,916.00	15,711,200	
タツモ	10,300	1,246.00	12,833,800	
ナブテスコ	106,200	3,265.00	346,743,000	
三井海洋開発	21,300	1,164.00	24,793,200	
レオン自動機	21,400	1,316.00	28,162,400	
ＳＭＣ	59,100	62,400.00	3,687,840,000	
ホソカワミクロン	13,000	2,742.00	35,646,000	
ユニオンツール	7,500	3,245.00	24,337,500	
オイレス工業	25,900	1,585.00	41,051,500	
日精エー・エス・ビー機械	7,700	3,560.00	27,412,000	
サトーホールディングス	26,300	1,935.00	50,890,500	
技研製作所	17,700	3,165.00	56,020,500	
日本エアーテック	9,300	1,027.00	9,551,100	
カワタ	6,000	976.00	5,856,000	
日精樹脂工業	12,900	914.00	11,790,600	
オカダアイヨン	6,400	1,485.00	9,504,000	
ワイエイシイホールディングス	7,900	1,496.00	11,818,400	
小松製作所	914,200	2,963.00	2,708,774,600	

住友重機械工業	107,900	2,951.00	318,412,900	
日立建機	80,900	2,877.00	232,749,300	
日工	25,500	639.00	16,294,500	
巴工業	7,300	2,365.00	17,264,500	
井関農機	16,100	1,204.00	19,384,400	
ＴＯＷＡ	17,300	1,731.00	29,946,300	
丸山製作所	3,400	1,563.00	5,314,200	
北川鉄工所	8,100	1,433.00	11,607,300	
ローツェ	10,000	8,630.00	86,300,000	
タカキタ	6,400	512.00	3,276,800	
クボタ	977,200	2,140.00	2,091,208,000	
荏原実業	9,400	2,292.00	21,544,800	
三菱化工機	6,100	2,070.00	12,627,000	
月島機械	31,800	888.00	28,238,400	
帝国電機製作所	12,900	1,675.00	21,607,500	
新東工業	38,000	705.00	26,790,000	
澁谷工業	16,000	2,444.00	39,104,000	
アイチ　コーポレーション	29,100	844.00	24,560,400	
小森コーポレーション	46,700	817.00	38,153,900	
鶴見製作所	14,400	1,945.00	28,008,000	
住友精密工業	3,000	2,832.00	8,496,000	
日本ギア工業	7,600	302.00	2,295,200	
酒井重工業	3,400	2,906.00	9,880,400	
荏原製作所	80,700	5,100.00	411,570,000	
石井鐵工所	2,500	2,942.00	7,355,000	
西島製作所	16,600	1,314.00	21,812,400	
北越工業	17,100	900.00	15,390,000	
ダイキン工業	220,300	22,095.00	4,867,528,500	
オルガノ	5,800	8,650.00	50,170,000	
トーヨーカネツ	7,100	2,706.00	19,212,600	
栗田工業	101,900	5,040.00	513,576,000	
椿本チエイン	26,500	3,085.00	81,752,500	
大同工業	8,600	816.00	7,017,600	
木村化工機	15,900	746.00	11,861,400	
アネスト岩田	31,500	911.00	28,696,500	
ダイフク	95,200	8,240.00	784,448,000	
サムコ	5,600	2,725.00	15,260,000	
加藤製作所	9,900	806.00	7,979,400	
油研工業	3,300	1,774.00	5,854,200	
タダノ	97,700	954.00	93,205,800	
フジテック	62,000	3,030.00	187,860,000	
ＣＫＤ	51,100	1,753.00	89,578,300	

キトー	15,900	2,629.00	41,801,100	
平和	56,300	2,061.00	116,034,300	
理想科学工業	17,000	2,312.00	39,304,000	
ＳＡＮＫＹＯ	41,600	4,205.00	174,928,000	
日本金銭機械	20,600	685.00	14,111,000	
マースグループホールディングス	12,900	1,636.00	21,104,400	
フクシマガリレイ	12,500	3,585.00	44,812,500	
オーイズミ	7,300	407.00	2,971,100	
ダイコク電機	9,400	1,261.00	11,853,400	
竹内製作所	30,700	2,344.00	71,960,800	
アマノ	52,900	2,478.00	131,086,200	
ＪＵＫＩ	28,100	716.00	20,119,600	
ジャノメ	17,300	720.00	12,456,000	
マックス	23,900	1,657.00	39,602,300	
グローリー	47,900	2,150.00	102,985,000	
新晃工業	18,800	1,683.00	31,640,400	
大和冷機工業	29,300	1,117.00	32,728,100	
セガサミーホールディングス	181,300	2,256.00	409,012,800	
日本ピストンリング	7,400	1,273.00	9,420,200	
リケン	7,400	2,371.00	17,545,400	
ＴＰＲ	22,100	1,224.00	27,050,400	
ツバキ・ナカシマ	44,400	910.00	40,404,000	
ホシザキ	118,000	4,030.00	475,540,000	
大豊工業	16,600	675.00	11,205,000	
日本精工	345,400	734.00	253,523,600	
ＮＴＮ	366,800	256.00	93,900,800	
ジェイテクト	172,100	1,020.00	175,542,000	
不二越	14,100	3,635.00	51,253,500	
日本トムソン	46,300	520.00	24,076,000	
ＴＨＫ	113,900	2,695.00	306,960,500	
ユーシン精機	15,800	712.00	11,249,600	
前澤給装工業	13,100	923.00	12,091,300	
イーグル工業	21,900	1,001.00	21,921,900	
前澤工業	12,300	616.00	7,576,800	
日本ピラー工業	17,300	2,631.00	45,516,300	
キッツ	56,800	674.00	38,283,200	
マキタ	228,000	3,440.00	784,320,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	74,200	340.00	25,228,000	
日立造船	160,300	834.00	133,690,200	
三菱重工業	295,800	5,053.00	1,494,677,400	
ＩＨＩ	126,000	3,605.00	454,230,000	
スター精密	27,300	1,641.00	44,799,300	

日清紡ホールディングス	116,400	1,053.00	122,569,200	
イビデン	97,500	3,885.00	378,787,500	
コニカミノルタ	413,300	460.00	190,118,000	
ブラザー工業	230,700	2,413.00	556,679,100	
ミネベアミツミ	321,700	2,330.00	749,561,000	
日立製作所	970,100	6,565.00	6,368,706,500	
東芝	352,600	5,470.00	1,928,722,000	
三菱電機	1,882,400	1,469.00	2,765,245,600	
富士電機	112,200	5,500.00	617,100,000	
東洋電機製造	6,700	900.00	6,030,000	
安川電機	200,400	4,290.00	859,716,000	
シンフォニアテクノロジー	20,500	1,382.00	28,331,000	
明電舎	28,500	2,052.00	58,482,000	
オリジン	4,600	1,198.00	5,510,800	
山洋電気	7,700	5,250.00	40,425,000	
デンヨー	14,300	1,643.00	23,494,900	
ＰＨＣホールディングス	32,700	1,446.00	47,284,200	
東芝テック	21,700	4,450.00	96,565,000	
芝浦メカトロニクス	3,800	9,280.00	35,264,000	
マブチモーター	46,700	3,685.00	172,089,500	
日本電産	448,300	9,112.00	4,084,909,600	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,800	446.00	5,262,800	
トレックス・セミコンダクター	9,500	2,454.00	23,313,000	
東光高岳	12,400	1,793.00	22,233,200	
ダイヘン	18,700	4,010.00	74,987,000	
ヤーマン	34,100	1,698.00	57,901,800	
ＪＶＣケンウッド	175,900	180.00	31,662,000	
ミマキエンジニアリング	22,000	557.00	12,254,000	
Ｉ－ＰＥＸ	11,000	1,343.00	14,773,000	
日新電機	47,300	1,471.00	69,578,300	
大崎電気工業	33,900	506.00	17,153,400	
オムロン	167,900	7,027.00	1,179,833,300	
日東工業	25,300	2,351.00	59,480,300	
ＩＤＥＣ	25,000	2,805.00	70,125,000	
正興電機製作所	7,500	1,130.00	8,475,000	
不二電機工業	5,500	1,156.00	6,358,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	61,500	2,208.00	135,792,000	
サクサホールディングス	4,700	1,243.00	5,842,100	
メルコホールディングス	6,200	3,580.00	22,196,000	
テクノメディカ	5,800	1,585.00	9,193,000	
日本電気	239,200	5,500.00	1,315,600,000	
富士通	181,500	18,145.00	3,293,317,500	

沖電気工業	76,500	755.00	57,757,500	
岩崎通信機	8,200	805.00	6,601,000	
電気興業	9,700	2,507.00	24,317,900	
サンケン電気	17,300	4,695.00	81,223,500	
ナカヨ	3,300	1,130.00	3,729,000	
アイホン	9,100	1,822.00	16,580,200	
ルネサスエレクトロニクス	1,099,800	1,235.00	1,358,253,000	
セイコーエプソン	225,200	1,978.00	445,445,600	
ワコム	156,900	851.00	133,521,900	
アルバック	40,200	4,730.00	190,146,000	
アクセル	10,400	797.00	8,288,800	
ＥＩＺＯ	13,800	3,835.00	52,923,000	
日本信号	42,800	996.00	42,628,800	
京三製作所	39,400	445.00	17,533,000	
能美防災	24,000	1,873.00	44,952,000	
ホーチキ	14,200	1,306.00	18,545,200	
星和電機	12,400	462.00	5,728,800	
エレコム	47,500	1,624.00	77,140,000	
パナソニック　ホールディングス	2,151,300	1,140.00	2,452,482,000	
シャープ	191,600	1,072.00	205,395,200	
アンリツ	129,900	1,534.00	199,266,600	
富士通ゼネラル	54,800	2,765.00	151,522,000	
ソニーグループ	1,263,500	11,380.00	14,378,630,000	
ＴＤＫ	292,600	4,085.00	1,195,271,000	
帝国通信工業	10,400	1,419.00	14,757,600	
タムラ製作所	72,600	582.00	42,253,200	
アルプスアルパイン	166,200	1,316.00	218,719,200	
池上通信機	5,900	600.00	3,540,000	
日本電波工業	22,100	1,101.00	24,332,100	
鈴木	12,600	787.00	9,916,200	
メイコー	22,400	3,110.00	69,664,000	
日本トリム	4,600	2,505.00	11,523,000	
ローランド　ディー．ジー．	12,500	3,150.00	39,375,000	
フォスター電機	18,800	764.00	14,363,200	
ＳＭＫ	4,700	2,147.00	10,090,900	
ヨコオ	14,400	1,999.00	28,785,600	
ホシデン	46,200	1,255.00	57,981,000	
ヒロセ電機	28,000	18,690.00	523,320,000	
日本航空電子工業	40,500	2,086.00	84,483,000	
ＴＯＡ	21,600	782.00	16,891,200	
マクセル	38,300	1,347.00	51,590,100	
古野電気	26,000	1,067.00	27,742,000	

ユニデンホールディングス	4,400	4,100.00	18,040,000	
スミダコーポレーション	21,500	799.00	17,178,500	
アイコム	6,500	2,540.00	16,510,000	
リオン	7,800	2,447.00	19,086,600	
本多通信工業	19,600	531.00	10,407,600	
横河電機	185,000	2,244.00	415,140,000	
新電元工業	7,100	3,435.00	24,388,500	
アズビル	117,000	3,775.00	441,675,000	
東亜ディーケーケー	12,400	907.00	11,246,800	
日本光電工業	78,400	3,025.00	237,160,000	
チノー	6,400	1,688.00	10,803,200	
共和電業	19,300	317.00	6,118,100	
日本電子材料	9,500	1,626.00	15,447,000	
堀場製作所	34,600	6,100.00	211,060,000	
アドバンテスト	149,900	7,260.00	1,088,274,000	
小野測器	12,500	424.00	5,300,000	
エスペック	16,100	1,826.00	29,398,600	
キーエンス	182,800	50,260.00	9,187,528,000	
日置電機	10,000	6,570.00	65,700,000	
シスメックス	144,600	9,063.00	1,310,509,800	
日本マイクロニクス	31,700	1,238.00	39,244,600	
メガチップス	18,500	3,085.00	57,072,500	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	8,600	3,030.00	26,058,000	
澤藤電機	3,900	1,454.00	5,670,600	
原田工業	11,800	896.00	10,572,800	
コーセル	24,900	843.00	20,990,700	
イリソ電子工業	17,600	3,250.00	57,200,000	
オプテックスグループ	34,100	2,074.00	70,723,400	
千代田インテグレ	8,700	2,015.00	17,530,500	
レーザーテック	82,800	16,885.00	1,398,078,000	
スタンレー電気	130,800	2,338.00	305,810,400	
岩崎電気	7,200	2,631.00	18,943,200	
ウシオ電機	96,600	1,709.00	165,089,400	
岡谷電機産業	22,200	252.00	5,594,400	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	23,800	321.00	7,639,800	
エノモト	7,000	1,465.00	10,255,000	
日本セラミック	19,800	2,044.00	40,471,200	
遠藤照明	11,900	775.00	9,222,500	
古河電池	16,100	1,225.00	19,722,500	
双信電機	13,800	506.00	6,982,800	
山一電機	14,400	1,646.00	23,702,400	
図研	13,800	3,255.00	44,919,000	

日本電子	39,100	5,430.00	212,313,000	
カシオ計算機	124,800	1,264.00	157,747,200	
ファナック	177,000	21,915.00	3,878,955,000	
日本シイエムケイ	40,400	436.00	17,614,400	
エンプラス	5,600	3,100.00	17,360,000	
大真空	27,200	887.00	24,126,400	
ローム	84,100	9,430.00	793,063,000	
浜松ホトニクス	134,700	5,710.00	769,137,000	
三井ハイテック	17,500	8,390.00	146,825,000	
新光電気工業	59,800	3,425.00	204,815,000	
京セラ	284,000	7,060.00	2,005,040,000	
太陽誘電	90,100	4,560.00	410,856,000	
村田製作所	550,400	7,638.00	4,203,955,200	
双葉電子工業	37,600	690.00	25,944,000	
北陸電気工業	9,400	1,109.00	10,424,600	
ニチコン	55,300	1,214.00	67,134,200	
日本ケミコン	20,300	1,690.00	34,307,000	
ＫＯＡ	29,100	1,606.00	46,734,600	
市光工業	30,100	375.00	11,287,500	
小糸製作所	101,100	4,530.00	457,983,000	
ミツバ	31,400	413.00	12,968,200	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	31,800	8,950.00	284,610,000	
キヤノン電子	19,800	1,556.00	30,808,800	
キヤノン	1,002,300	3,173.00	3,180,297,900	
リコー	479,900	1,067.00	512,053,300	
象印マホービン	51,500	1,515.00	78,022,500	
ＭＵＴＯＨホールディングス	3,500	2,025.00	7,087,500	
東京エレクトロン	128,000	42,950.00	5,497,600,000	
トヨタ紡織	70,500	2,042.00	143,961,000	
芦森工業	3,800	1,025.00	3,895,000	
ユニプレス	33,100	850.00	28,135,000	
豊田自動織機	142,800	8,210.00	1,172,388,000	
モリタホールディングス	32,300	1,346.00	43,475,800	
三櫻工業	27,900	694.00	19,362,600	
デンソー	394,700	7,410.00	2,924,727,000	
東海理化電機製作所	53,100	1,486.00	78,906,600	
川崎重工業	136,700	2,510.00	343,117,000	
名村造船所	51,900	433.00	22,472,700	
日本車輌製造	6,400	2,097.00	13,420,800	
三菱ロジスネクスト	26,700	880.00	23,496,000	
近畿車輛	3,000	1,108.00	3,324,000	
日産自動車	2,378,800	517.40	1,230,791,120	

いすゞ自動車	584,200	1,478.00	863,447,600	
トヨタ自動車	9,195,000	2,152.00	19,787,640,000	
日野自動車	251,900	713.00	179,604,700	
三菱自動車工業	746,600	436.00	325,517,600	
エフテック	12,900	506.00	6,527,400	
レシップホールディングス	8,000	531.00	4,248,000	
ＧＭＢ	3,600	703.00	2,530,800	
ファルテック	3,500	603.00	2,110,500	
武蔵精密工業	45,000	1,398.00	62,910,000	
日産車体	29,500	594.00	17,523,000	
新明和工業	52,600	1,070.00	56,282,000	
極東開発工業	32,100	1,436.00	46,095,600	
トピー工業	15,100	1,322.00	19,962,200	
ティラド	5,500	2,577.00	14,173,500	
曙ブレーキ工業	110,700	159.00	17,601,300	
タチエス	33,100	1,100.00	36,410,000	
ＮＯＫ	75,900	1,162.00	88,195,800	
フタバ産業	44,900	388.00	17,421,200	
ＫＹＢ	17,700	3,080.00	54,516,000	
大同メタル工業	38,700	534.00	20,665,800	
プレス工業	90,400	403.00	36,431,200	
ミクニ	23,500	362.00	8,507,000	
太平洋工業	38,400	1,081.00	41,510,400	
河西工業	24,700	269.00	6,644,300	
アイシン	147,600	4,225.00	623,610,000	
マツダ	593,500	1,042.00	618,427,000	
今仙電機製作所	13,200	601.00	7,933,200	
本田技研工業	1,474,600	3,313.00	4,885,349,800	
スズキ	399,800	4,290.00	1,715,142,000	
ＳＵＢＡＲＵ	529,800	2,304.50	1,220,924,100	
安永	8,100	724.00	5,864,400	
ヤマハ発動機	263,200	2,547.00	670,370,400	
ＴＢＫ	20,300	339.00	6,881,700	
エクセディ	30,400	1,745.00	53,048,000	
豊田合成	57,000	2,159.00	123,063,000	
愛三工業	31,600	715.00	22,594,000	
盟和産業	2,900	1,003.00	2,908,700	
日本プラスト	14,600	461.00	6,730,600	
ヨロズ	15,700	901.00	14,145,700	
エフ・シー・シー	33,000	1,362.00	44,946,000	
シマノ	74,200	23,380.00	1,734,796,000	
テイ・エス　テック	85,200	1,460.00	124,392,000	

ジャムコ	11,800	1,130.00	13,334,000	
テルモ	570,800	4,258.00	2,430,466,400	
クリエートメディック	6,100	989.00	6,032,900	
日機装	51,200	817.00	41,830,400	
日本エム・ディ・エム	11,600	1,608.00	18,652,800	
島津製作所	241,000	4,475.00	1,078,475,000	
ＪＭＳ	15,600	553.00	8,626,800	
長野計器	13,400	1,126.00	15,088,400	
ブイ・テクノロジー	8,800	2,874.00	25,291,200	
東京計器	12,900	1,308.00	16,873,200	
愛知時計電機	7,300	1,421.00	10,373,300	
インターアクション	10,100	1,822.00	18,402,200	
オーバル	18,100	350.00	6,335,000	
東京精密	31,500	4,440.00	139,860,000	
マニー	73,700	1,600.00	117,920,000	
ニコン	284,300	1,448.00	411,666,400	
トプコン	94,900	1,812.00	171,958,800	
オリンパス	976,400	2,745.50	2,680,706,200	
理研計器	13,300	3,850.00	51,205,000	
タムロン	14,100	2,594.00	36,575,400	
ＨＯＹＡ	389,400	12,695.00	4,943,433,000	
シード	9,500	517.00	4,911,500	
ノーリツ鋼機	18,100	2,322.00	42,028,200	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	22,700	900.00	20,430,000	
朝日インテック	221,100	2,357.00	521,132,700	
シチズン時計	196,900	547.00	107,704,300	
リズム	6,300	1,710.00	10,773,000	
大研医器	16,000	482.00	7,712,000	
メニコン	62,200	3,215.00	199,973,000	
シンシア	2,200	419.00	921,800	
松風	6,700	1,711.00	11,463,700	
セイコーホールディングス	28,500	2,881.00	82,108,500	
ニプロ	139,600	1,117.00	155,933,200	
中本パックス	5,600	1,606.00	8,993,600	
スノーピーク	26,300	2,660.00	69,958,000	
パラマウントベッドホールディングス	38,700	2,347.00	90,828,900	
トランザクション	12,900	1,158.00	14,938,200	
粧美堂	5,000	398.00	1,990,000	
ニホンフラッシュ	15,700	946.00	14,852,200	
前田工繊	18,200	2,956.00	53,799,200	
永大産業	22,000	264.00	5,808,000	
アートネイチャー	17,200	751.00	12,917,200	

バンダイナムコホールディングス	166,800	10,040.00	1,674,672,000	
アイフィスジャパン	5,100	628.00	3,202,800	
共立印刷	27,600	147.00	4,057,200	
ＳＨＯＥＩ	17,700	5,380.00	95,226,000	
フランスベッドホールディングス	25,900	915.00	23,698,500	
パイロットコーポレーション	28,800	4,905.00	141,264,000	
萩原工業	12,100	1,129.00	13,660,900	
フジシールインターナショナル	41,400	1,481.00	61,313,400	
タカラトミー	83,300	1,439.00	119,868,700	
広済堂ホールディングス	12,500	1,064.00	13,300,000	
エステールホールディングス	4,300	631.00	2,713,300	
タカノ	6,900	830.00	5,727,000	
プロネクサス	15,600	1,108.00	17,284,800	
ホクシン	14,200	146.00	2,073,200	
ウッドワン	6,200	1,168.00	7,241,600	
大建工業	10,200	1,907.00	19,451,400	
凸版印刷	262,800	2,218.00	582,890,400	
大日本印刷	218,500	2,852.00	623,162,000	
共同印刷	5,200	2,625.00	13,650,000	
ＮＩＳＳＨＡ	35,000	1,512.00	52,920,000	
光村印刷	1,600	1,243.00	1,988,800	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	11,500	1,846.00	21,229,000	
アシックス	154,600	2,528.00	390,828,800	
ツツミ	5,000	2,052.00	10,260,000	
ローランド	14,100	4,055.00	57,175,500	
小松ウオール工業	6,100	2,002.00	12,212,200	
ヤマハ	117,300	5,630.00	660,399,000	
河合楽器製作所	5,100	2,686.00	13,698,600	
クリナップ	18,800	601.00	11,298,800	
ピジョン	121,900	1,970.00	240,143,000	
兼松サステック	1,300	1,617.00	2,102,100	
キングジム	14,800	910.00	13,468,000	
リンテック	38,400	2,331.00	89,510,400	
イトーキ	37,200	379.00	14,098,800	
任天堂	113,900	59,100.00	6,731,490,000	
三菱鉛筆	27,200	1,464.00	39,820,800	
タカラスタンダード	32,400	1,312.00	42,508,800	
コクヨ	88,700	1,768.00	156,821,600	
ナカバヤシ	16,200	503.00	8,148,600	
グローブライド	15,000	2,151.00	32,265,000	
オカムラ	56,700	1,250.00	70,875,000	
美津濃	16,600	2,409.00	39,989,400	

東京電力ホールディングス	1,509,500	619.00	934,380,500	
中部電力	569,600	1,398.00	796,300,800	
関西電力	705,400	1,375.00	969,925,000	
中国電力	290,900	902.00	262,391,800	
北陸電力	171,200	549.00	93,988,800	
東北電力	440,900	746.00	328,911,400	
四国電力	167,600	800.00	134,080,000	
九州電力	386,000	886.00	341,996,000	
北海道電力	175,300	518.00	90,805,400	
沖縄電力	42,800	1,319.00	56,453,200	
電源開発	149,000	2,279.00	339,571,000	
エフオン	12,200	579.00	7,063,800	
イーレックス	26,000	2,396.00	62,296,000	
レノバ	39,600	2,622.00	103,831,200	
東京瓦斯	359,000	2,525.00	906,475,000	
大阪瓦斯	339,200	2,411.00	817,811,200	
東邦瓦斯	79,100	2,995.00	236,904,500	
北海道瓦斯	10,000	1,601.00	16,010,000	
広島ガス	35,300	324.00	11,437,200	
西部ガスホールディングス	19,200	1,866.00	35,827,200	
静岡ガス	47,700	931.00	44,408,700	
メタウォーター	20,900	2,038.00	42,594,200	
ＳＢＳホールディングス	14,900	2,859.00	42,599,100	
東武鉄道	183,900	3,060.00	562,734,000	
相鉄ホールディングス	59,900	2,332.00	139,686,800	
東急	469,600	1,588.00	745,724,800	
京浜急行電鉄	224,500	1,438.00	322,831,000	
小田急電鉄	253,800	1,845.00	468,261,000	
京王電鉄	88,600	4,945.00	438,127,000	
京成電鉄	118,800	3,515.00	417,582,000	
富士急行	20,600	3,960.00	81,576,000	
新京成電鉄	4,700	2,867.00	13,474,900	
東日本旅客鉄道	307,700	6,693.00	2,059,436,100	
西日本旅客鉄道	213,900	4,791.00	1,024,794,900	
東海旅客鉄道	141,900	15,175.00	2,153,332,500	
西武ホールディングス	243,100	1,322.00	321,378,200	
鴻池運輸	28,500	1,287.00	36,679,500	
西日本鉄道	48,500	2,857.00	138,564,500	
ハマキョウレックス	13,100	3,055.00	40,020,500	
サカイ引越センター	9,300	4,725.00	43,942,500	
近鉄グループホールディングス	179,100	4,175.00	747,742,500	
阪急阪神ホールディングス	222,900	3,690.00	822,501,000	

南海電気鉄道	79,900	2,554.00	204,064,600	
京阪ホールディングス	74,400	3,250.00	241,800,000	
神戸電鉄	4,500	3,255.00	14,647,500	
名古屋鉄道	184,800	2,076.00	383,644,800	
山陽電気鉄道	13,600	2,147.00	29,199,200	
アルプス物流	13,300	1,159.00	15,414,700	
ヤマトホールディングス	267,700	2,274.00	608,749,800	
山九	46,400	4,030.00	186,992,000	
丸運	9,100	233.00	2,120,300	
丸全昭和運輸	12,900	3,170.00	40,893,000	
センコーグループホールディングス	88,500	907.00	80,269,500	
トナミホールディングス	3,700	3,670.00	13,579,000	
ニッコンホールディングス	57,600	2,234.00	128,678,400	
日本石油輸送	2,100	2,440.00	5,124,000	
福山通運	24,400	3,140.00	76,616,000	
セイノーホールディングス	104,000	1,117.00	116,168,000	
エスライン	5,200	849.00	4,414,800	
神奈川中央交通	4,700	3,450.00	16,215,000	
日立物流	36,900	8,550.00	315,495,000	
丸和運輸機関	32,300	1,417.00	45,769,100	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	16,100	1,125.00	18,112,500	
九州旅客鉄道	128,100	2,741.00	351,122,100	
ＳＧホールディングス	320,800	2,511.00	805,528,800	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	56,700	7,550.00	428,085,000	
日本郵船	160,100	9,300.00	1,488,930,000	
商船三井	295,700	3,100.00	916,670,000	
川崎汽船	58,800	7,860.00	462,168,000	
ＮＳユナイテッド海運	10,000	3,735.00	37,350,000	
飯野海運	80,200	686.00	55,017,200	
共栄タンカー	7,300	956.00	6,978,800	
乾汽船	11,400	1,773.00	20,212,200	
日本航空	410,600	2,283.00	937,399,800	
ＡＮＡホールディングス	454,900	2,461.50	1,119,736,350	
パスコ	3,600	1,335.00	4,806,000	
トランコム	5,300	7,450.00	39,485,000	
日新	14,000	1,615.00	22,610,000	
三菱倉庫	46,200	3,360.00	155,232,000	
三井倉庫ホールディングス	18,700	2,995.00	56,006,500	
住友倉庫	56,100	2,044.00	114,668,400	
澁澤倉庫	9,500	2,164.00	20,558,000	
東陽倉庫	27,100	291.00	7,886,100	
日本トランスシティ	33,600	497.00	16,699,200	

ケイヒン	3,300	1,348.00	4,448,400	
中央倉庫	9,800	985.00	9,653,000	
川西倉庫	3,500	1,055.00	3,692,500	
安田倉庫	12,800	935.00	11,968,000	
ファイズホールディングス	4,100	731.00	2,997,100	
東洋埠頭	5,300	1,315.00	6,969,500	
上組	90,700	2,710.00	245,797,000	
サンリツ	4,900	701.00	3,434,900	
キムラユニティー	9,900	781.00	7,731,900	
キユーソー流通システム	9,500	1,157.00	10,991,500	
東海運	10,900	283.00	3,084,700	
エーアイテイー	12,000	1,542.00	18,504,000	
内外トランスライン	7,400	1,848.00	13,675,200	
日本コンセプト	6,100	1,434.00	8,747,400	
ＮＥＣネッツエスアイ	65,600	1,934.00	126,870,400	
クロスキャット	10,900	999.00	10,889,100	
システナ	282,900	451.00	127,587,900	
デジタルアーツ	10,700	6,230.00	66,661,000	
日鉄ソリューションズ	34,400	3,810.00	131,064,000	
キューブシステム	10,200	1,003.00	10,230,600	
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	3,000	1,055.00	3,165,000	
コア	8,500	1,479.00	12,571,500	
手間いらず	2,900	5,240.00	15,196,000	
ラクーンホールディングス	16,900	1,632.00	27,580,800	
ソリトンシステムズ	10,100	1,268.00	12,806,800	
ソフトクリエイトホールディングス	8,700	4,125.00	35,887,500	
ＴＩＳ	173,100	3,645.00	630,949,500	
ＪＮＳホールディングス	9,100	413.00	3,758,300	
グリー	90,300	833.00	75,219,900	
GMOペパボ	2,200	2,000.00	4,400,000	
コーエーテクモホールディングス	63,200	4,705.00	297,356,000	
三菱総合研究所	8,300	4,195.00	34,818,500	
電算	2,300	2,192.00	5,041,600	
ＡＧＳ	8,100	764.00	6,188,400	
ファインデックス	17,000	672.00	11,424,000	
ブレインパッド	17,000	1,117.00	18,989,000	
ＫＬａｂ	33,900	491.00	16,644,900	
ポールトゥウィンホールディングス	28,900	947.00	27,368,300	
ネクソン	451,600	2,921.00	1,319,123,600	
アイスタイル	52,000	248.00	12,896,000	
エムアップホールディングス	23,000	1,362.00	31,326,000	
エイチーム	12,700	708.00	8,991,600	

エニグモ	21,800	522.00	11,379,600	
テクノスジャパン	15,800	485.00	7,663,000	
コロプラ	65,500	662.00	43,361,000	
ブロードリーフ	98,600	461.00	45,454,600	
クロス・マーケティンググループ	7,800	729.00	5,686,200	
デジタルハーツホールディングス	9,100	1,811.00	16,480,100	
システム情報	15,100	978.00	14,767,800	
メディアドゥ	6,900	2,052.00	14,158,800	
じげん	56,600	340.00	19,244,000	
ブイキューブ	20,300	1,202.00	24,400,600	
エンカレッジ・テクノロジ	4,800	507.00	2,433,600	
サイバーリンクス	6,800	1,157.00	7,867,600	
フィックスターズ	19,200	981.00	18,835,200	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	8,200	1,939.00	15,899,800	
オプティム	14,100	805.00	11,350,500	
セレス	7,600	1,234.00	9,378,400	
ＳＨＩＦＴ	12,300	17,240.00	212,052,000	
ティーガイア	17,700	1,640.00	29,028,000	
セック	3,000	2,510.00	7,530,000	
テクマトリックス	33,600	1,823.00	61,252,800	
プロシップ	6,700	1,596.00	10,693,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	51,500	2,477.00	127,565,500	
GMOペイメントゲートウェイ	38,400	10,690.00	410,496,000	
ザッパラス	7,400	357.00	2,641,800	
システムリサーチ	5,900	2,091.00	12,336,900	
インターネットイニシアティブ	52,800	5,120.00	270,336,000	
さくらインターネット	21,600	560.00	12,096,000	
ヴィンクス	5,700	1,305.00	7,438,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,400	5,390.00	23,716,000	
ＳＲＡホールディングス	9,600	2,900.00	27,840,000	
システムインテグレータ	6,700	477.00	3,195,900	
朝日ネット	18,400	592.00	10,892,800	
ｅＢＡＳＥ	24,000	549.00	13,176,000	
アバント	21,400	1,449.00	31,008,600	
アドソル日進	7,200	1,618.00	11,649,600	
ＯＤＫソリューションズ	4,500	584.00	2,628,000	
フリービット	10,500	835.00	8,767,500	
コムチュア	22,300	2,798.00	62,395,400	
サイバーコム	3,200	1,339.00	4,284,800	
アステリア	14,500	954.00	13,833,000	
アイル	9,600	1,572.00	15,091,200	
マークラインズ	10,000	2,200.00	22,000,000	

メディカル・データ・ビジョン	25,300	1,129.00	28,563,700	
ｇｕｍｉ	27,800	691.00	19,209,800	
ショーケース	4,800	432.00	2,073,600	
モバイルファクトリー	4,700	1,097.00	5,155,900	
テラスカイ	7,400	1,524.00	11,277,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,900	1,424.00	12,673,600	
ＰＣＩホールディングス	8,000	927.00	7,416,000	
パイプドＨＤ	3,700	2,798.00	10,352,600	
アイビーシー	3,400	428.00	1,455,200	
ネオジャパン	5,800	1,136.00	6,588,800	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	4,300	2,121.00	9,120,300	
ラクス	90,900	1,826.00	165,983,400	
ランドコンピュータ	4,700	876.00	4,117,200	
ダブルスタンダード	6,100	2,018.00	12,309,800	
オープンドア	11,900	1,662.00	19,777,800	
マイネット	7,100	505.00	3,585,500	
アカツキ	8,900	2,671.00	23,771,900	
ベネフィットジャパン	1,600	1,988.00	3,180,800	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	5,300	2,608.00	13,822,400	
カナミックネットワーク	24,500	588.00	14,406,000	
ノムラシステムコーポレーション	22,100	123.00	2,718,300	
チェンジ	41,200	2,164.00	89,156,800	
シンクロ・フード	10,700	379.00	4,055,300	
オークネット	10,600	2,137.00	22,652,200	
キャピタル・アセット・プランニング	3,900	639.00	2,492,100	
セグエグループ	5,500	537.00	2,953,500	
エイトレッド	2,900	2,027.00	5,878,300	
マクロミル	38,300	948.00	36,308,400	
ビーグリー	4,800	1,297.00	6,225,600	
オロ	6,200	1,711.00	10,608,200	
ユーザーローカル	6,200	1,589.00	9,851,800	
テモナ	4,200	359.00	1,507,800	
ニーズウェル	6,100	632.00	3,855,200	
マネーフォワード	40,400	3,665.00	148,066,000	
サインポスト	6,400	880.00	5,632,000	
電算システムホールディングス	8,200	2,387.00	19,573,400	
ソルクシーズ	17,400	376.00	6,542,400	
フェイス	5,600	591.00	3,309,600	
プロトコーポレーション	21,200	1,063.00	22,535,600	
ハイマックス	5,400	1,398.00	7,549,200	
野村総合研究所	344,200	3,825.00	1,316,565,000	
サイバネットシステム	14,300	850.00	12,155,000	

ＣＥホールディングス	10,100	459.00	4,635,900	
日本システム技術	3,600	2,464.00	8,870,400	
インテージホールディングス	23,000	1,356.00	31,188,000	
東邦システムサイエンス	5,400	918.00	4,957,200	
ソースネクスト	86,300	223.00	19,244,900	
インフォコム	21,700	2,127.00	46,155,900	
シンプレクス・ホールディングス	31,400	1,804.00	56,645,600	
ＨＥＲＯＺ	5,900	832.00	4,908,800	
ラクスル	23,700	1,931.00	45,764,700	
ＩＰＳ	5,500	2,286.00	12,573,000	
ＦＩＧ	22,200	322.00	7,148,400	
システムサポート	7,300	1,266.00	9,241,800	
イーソル	12,500	618.00	7,725,000	
アルテリア・ネットワークス	19,000	1,269.00	24,111,000	
東海ソフト	3,300	931.00	3,072,300	
ウイングアーク１ｓｔ	15,200	1,636.00	24,867,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,600	1,588.00	7,304,800	
サーバーワークス	3,500	2,242.00	7,847,000	
東名	1,600	1,101.00	1,761,600	
ヴィッツ	2,000	1,073.00	2,146,000	
トビラシステムズ	4,200	961.00	4,036,200	
Ｓａｎｓａｎ	62,800	1,009.00	63,365,200	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	3,900	664.00	2,589,600	
ギフティ	16,400	1,205.00	19,762,000	
ベース	3,400	5,500.00	18,700,000	
ＪＭＤＣ	24,800	6,360.00	157,728,000	
フォーカスシステムズ	12,500	910.00	11,375,000	
クレスコ	14,500	1,944.00	28,188,000	
フジ・メディア・ホールディングス	176,200	1,188.00	209,325,600	
オービック	62,400	21,110.00	1,317,264,000	
ジャストシステム	28,200	3,995.00	112,659,000	
ＴＤＣソフト	15,900	1,116.00	17,744,400	
Ｚホールディングス	2,854,600	437.30	1,248,316,580	
トレンドマイクロ	97,000	7,330.00	711,010,000	
ＩＤホールディングス	12,700	849.00	10,782,300	
日本オラクル	32,200	8,130.00	261,786,000	
アルファシステムズ	5,300	4,600.00	24,380,000	
フューチャー	41,900	1,596.00	66,872,400	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	10,400	1,386.00	14,414,400	
ＳＢテクノロジー	8,600	2,319.00	19,943,400	
トーセ	5,100	754.00	3,845,400	
オービックビジネスコンサルタント	18,900	4,855.00	91,759,500	

伊藤忠テクノソリューションズ	90,200	3,515.00	317,053,000	
アイティフォー	24,200	797.00	19,287,400	
東計電算	2,400	5,950.00	14,280,000	
エックスネット	3,300	1,013.00	3,342,900	
大塚商会	107,100	4,140.00	443,394,000	
サイボウズ	26,700	1,085.00	28,969,500	
電通国際情報サービス	24,500	4,285.00	104,982,500	
ＡＣＣＥＳＳ	22,600	774.00	17,492,400	
デジタルガレージ	32,800	3,910.00	128,248,000	
ＥＭシステムズ	32,900	1,025.00	33,722,500	
ウェザーニューズ	6,000	7,600.00	45,600,000	
ＣＩＪ	15,600	735.00	11,466,000	
ビジネスエンジニアリング	4,600	2,394.00	11,012,400	
日本エンタープライズ	20,700	154.00	3,187,800	
WOWOW	8,300	1,507.00	12,508,100	
スカラ	16,900	736.00	12,438,400	
インテリジェント　ウェイブ	10,200	814.00	8,302,800	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	14,300	827.00	11,826,100	
ネットワンシステムズ	73,100	3,210.00	234,651,000	
システムソフト	60,500	106.00	6,413,000	
アルゴグラフィックス	15,500	3,270.00	50,685,000	
マーベラス	31,500	689.00	21,703,500	
エイベックス	34,300	1,455.00	49,906,500	
ＢＩＰＲＯＧＹ	61,900	2,773.00	171,648,700	
兼松エレクトロニクス	10,800	4,110.00	44,388,000	
都築電気	9,000	1,317.00	11,853,000	
ＴＢＳホールディングス	96,800	1,727.00	167,173,600	
日本テレビホールディングス	165,400	1,262.00	208,734,800	
朝日放送グループホールディングス	16,100	658.00	10,593,800	
テレビ朝日ホールディングス	47,700	1,517.00	72,360,900	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	168,000	546.00	91,728,000	
テレビ東京ホールディングス	12,300	1,978.00	24,329,400	
日本ＢＳ放送	6,900	1,065.00	7,348,500	
ビジョン	31,700	1,097.00	34,774,900	
スマートバリュー	4,900	476.00	2,332,400	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	15,200	2,193.00	33,333,600	
ワイヤレスゲート	8,800	288.00	2,534,400	
コネクシオ	14,200	1,350.00	19,170,000	
クロップス	3,800	914.00	3,473,200	
日本電信電話	2,218,500	3,914.00	8,683,209,000	
ＫＤＤＩ	1,443,000	4,433.00	6,396,819,000	
ソフトバンク	2,997,900	1,553.00	4,655,738,700	

光通信	22,800	14,270.00	325,356,000	
エムティーアイ	15,800	501.00	7,915,800	
GMOインターネット	69,400	2,608.00	180,995,200	
ファイバーゲート	9,300	923.00	8,583,900	
アイドママーケティングコミュニケーション	5,000	296.00	1,480,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	106,600	3,175.00	338,455,000	
学研ホールディングス	28,200	941.00	26,536,200	
ゼンリン	32,500	946.00	30,745,000	
昭文社ホールディングス	8,600	363.00	3,121,800	
インプレスホールディングス	16,400	214.00	3,509,600	
アイネット	9,300	1,266.00	11,773,800	
松竹	11,400	12,390.00	141,246,000	
東宝	116,800	5,050.00	589,840,000	
東映	5,600	18,990.00	106,344,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	527,100	1,936.00	1,020,465,600	
ピー・シー・エー	11,800	1,243.00	14,667,400	
ビジネスブレイン太田昭和	6,700	1,477.00	9,895,900	
ＤＴＳ	36,900	3,350.00	123,615,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	92,100	6,210.00	571,941,000	
シーイーシー	21,400	1,226.00	26,236,400	
カプコン	186,700	3,605.00	673,053,500	
アイ・エス・ビー	9,500	1,015.00	9,642,500	
ジャステック	11,600	1,184.00	13,734,400	
ＳＣＳＫ	137,100	2,404.00	329,588,400	
日本システムウエア	7,600	2,397.00	18,217,200	
アイネス	17,100	1,636.00	27,975,600	
ＴＫＣ	30,200	3,430.00	103,586,000	
富士ソフト	19,000	8,180.00	155,420,000	
ＮＳＤ	62,100	2,551.00	158,417,100	
コナミグループ	71,900	7,440.00	534,936,000	
福井コンピュータホールディングス	9,100	3,565.00	32,441,500	
ＪＢＣＣホールディングス	13,500	1,631.00	22,018,500	
ミロク情報サービス	17,600	1,322.00	23,267,200	
ソフトバンクグループ	1,186,900	5,446.00	6,463,857,400	
高千穂交易	7,000	1,968.00	13,776,000	
オルバヘルスケアホールディングス	3,300	1,655.00	5,461,500	
伊藤忠食品	4,000	5,020.00	20,080,000	
エレマテック	15,900	1,247.00	19,827,300	
あらた	14,700	4,105.00	60,343,500	
トーメンデバイス	3,000	5,660.00	16,980,000	
東京エレクトロン　デバイス	5,900	5,310.00	31,329,000	
フィールズ	17,400	863.00	15,016,200	

双日	203,800	1,938.00	394,964,400	
アルフレッサ　ホールディングス	206,100	1,876.00	386,643,600	
横浜冷凍	48,300	909.00	43,904,700	
ラサ商事	9,100	975.00	8,872,500	
アルコニックス	25,300	1,308.00	33,092,400	
神戸物産	137,100	3,480.00	477,108,000	
ハイパー	5,000	447.00	2,235,000	
あい　ホールディングス	28,400	1,620.00	46,008,000	
ディーブイエックス	6,800	1,066.00	7,248,800	
ダイワボウホールディングス	84,500	1,838.00	155,311,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	47,400	2,614.00	123,903,600	
ラクト・ジャパン	6,800	2,454.00	16,687,200	
グリムス	8,900	1,516.00	13,492,400	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	31,700	709.00	22,475,300	
八洲電機	14,400	1,001.00	14,414,400	
メディアスホールディングス	11,400	980.00	11,172,000	
レスターホールディングス	18,800	1,925.00	36,190,000	
ジューテックホールディングス	3,900	1,051.00	4,098,900	
大光	8,500	709.00	6,026,500	
ＯＣＨＩホールディングス	4,500	1,230.00	5,535,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	96,300	887.00	85,418,100	
黒谷	5,500	596.00	3,278,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	3,500	717.00	2,509,500	
三洋貿易	18,200	1,001.00	18,218,200	
ビューティガレージ	3,200	2,631.00	8,419,200	
ウイン・パートナーズ	14,400	1,030.00	14,832,000	
ミタチ産業	5,000	862.00	4,310,000	
シップヘルスケアホールディングス	57,300	2,585.00	148,120,500	
明治電機工業	6,000	1,099.00	6,594,000	
デリカフーズホールディングス	7,800	512.00	3,993,600	
スターティアホールディングス	4,600	742.00	3,413,200	
コメダホールディングス	43,400	2,292.00	99,472,800	
ピーバンドットコム	2,900	515.00	1,493,500	
アセンテック	6,900	629.00	4,340,100	
富士興産	5,000	1,072.00	5,360,000	
協栄産業	2,000	1,320.00	2,640,000	
フルサト・マルカホールディングス	17,600	2,692.00	47,379,200	
ヤマエグループホールディングス	11,200	1,400.00	15,680,000	
小野建	17,800	1,410.00	25,098,000	
南陽	3,800	1,782.00	6,771,600	
佐鳥電機	12,400	1,084.00	13,441,600	
エコートレーディング	4,200	574.00	2,410,800	

伯東	11,600	2,541.00	29,475,600	
コンドーテック	14,900	1,013.00	15,093,700	
中山福	10,600	316.00	3,349,600	
ナガイレーベン	24,000	2,000.00	48,000,000	
三菱食品	19,100	3,715.00	70,956,500	
松田産業	14,500	2,073.00	30,058,500	
第一興商	37,700	3,780.00	142,506,000	
メディパルホールディングス	183,800	1,994.00	366,497,200	
ＳＰＫ	7,900	1,416.00	11,186,400	
萩原電気ホールディングス	6,800	1,993.00	13,552,400	
アズワン	28,500	6,140.00	174,990,000	
スズデン	6,200	1,955.00	12,121,000	
尾家産業	4,700	834.00	3,919,800	
シモジマ	12,200	989.00	12,065,800	
ドウシシャ	18,800	1,578.00	29,666,400	
小津産業	4,400	1,898.00	8,351,200	
高速	10,500	1,540.00	16,170,000	
たけびし	6,800	1,499.00	10,193,200	
リックス	4,100	2,049.00	8,400,900	
丸文	15,900	735.00	11,686,500	
ハピネット	15,100	1,588.00	23,978,800	
橋本総業ホールディングス	3,500	2,004.00	7,014,000	
日本ライフライン	58,900	941.00	55,424,900	
タカショー	15,500	741.00	11,485,500	
ＩＤＯＭ	60,300	773.00	46,611,900	
進和	11,800	2,203.00	25,995,400	
エスケイジャパン	4,900	461.00	2,258,900	
ダイトロン	7,700	1,815.00	13,975,500	
シークス	25,300	948.00	23,984,400	
田中商事	6,200	588.00	3,645,600	
オーハシテクニカ	9,800	1,373.00	13,455,400	
白銅	6,400	2,390.00	15,296,000	
ダイコー通産	2,400	1,115.00	2,676,000	
伊藤忠商事	1,191,000	3,865.00	4,603,215,000	
丸紅	1,720,900	1,205.00	2,073,684,500	
高島	2,800	2,635.00	7,378,000	
長瀬産業	90,900	1,922.00	174,709,800	
蝶理	11,100	1,972.00	21,889,200	
豊田通商	177,400	4,435.00	786,769,000	
三共生興	25,500	519.00	13,234,500	
兼松	68,800	1,371.00	94,324,800	
ツカモトコーポレーション	3,300	1,095.00	3,613,500	

三井物産	1,439,800	2,902.00	4,178,299,600	
日本紙パルプ商事	9,400	4,000.00	37,600,000	
カメイ	21,200	1,081.00	22,917,200	
東都水産	1,000	4,480.00	4,480,000	
ＯＵＧホールディングス	2,900	2,799.00	8,117,100	
スターゼン	13,500	2,070.00	27,945,000	
山善	71,700	1,003.00	71,915,100	
椿本興業	3,300	3,670.00	12,111,000	
住友商事	1,175,500	1,877.50	2,207,001,250	
内田洋行	7,800	5,150.00	40,170,000	
三菱商事	1,302,500	3,905.00	5,086,262,500	
第一実業	7,600	3,410.00	25,916,000	
キヤノンマーケティングジャパン	49,300	2,896.00	142,772,800	
西華産業	8,500	1,653.00	14,050,500	
佐藤商事	13,700	1,114.00	15,261,800	
菱洋エレクトロ	11,800	2,298.00	27,116,400	
東京産業	16,200	722.00	11,696,400	
ユアサ商事	16,000	3,550.00	56,800,000	
神鋼商事	4,500	3,825.00	17,212,500	
トルク	10,700	197.00	2,107,900	
阪和興業	34,500	2,837.00	97,876,500	
正栄食品工業	12,900	3,885.00	50,116,500	
カナデン	16,200	1,045.00	16,929,000	
菱電商事	15,800	1,632.00	25,785,600	
岩谷産業	44,000	5,340.00	234,960,000	
ナイス	6,100	1,709.00	10,424,900	
ニチモウ	2,400	2,367.00	5,680,800	
極東貿易	5,700	2,653.00	15,122,100	
アステナホールディングス	25,600	460.00	11,776,000	
三愛オブリ	44,500	1,041.00	46,324,500	
稲畑産業	39,800	2,317.00	92,216,600	
ＧＳＩクレオス	9,500	1,398.00	13,281,000	
明和産業	18,400	731.00	13,450,400	
クワザワホールディングス	7,200	445.00	3,204,000	
ワキタ	35,900	1,111.00	39,884,900	
東邦ホールディングス	53,900	2,122.00	114,375,800	
サンゲツ	48,200	1,600.00	77,120,000	
ミツウロコグループホールディングス	22,800	932.00	21,249,600	
シナネンホールディングス	6,500	3,555.00	23,107,500	
伊藤忠エネクス	44,000	1,055.00	46,420,000	
サンリオ	55,800	3,025.00	168,795,000	
サンワテクノス	10,100	1,311.00	13,241,100	

リョーサン	20,400	2,178.00	44,431,200	
新光商事	26,200	900.00	23,580,000	
トーホー	7,600	1,341.00	10,191,600	
三信電気	8,200	1,553.00	12,734,600	
東陽テクニカ	19,600	1,138.00	22,304,800	
モスフードサービス	26,100	3,245.00	84,694,500	
加賀電子	16,200	3,060.00	49,572,000	
ソーダニッカ	15,900	579.00	9,206,100	
立花エレテック	13,000	1,536.00	19,968,000	
フォーバル	7,000	862.00	6,034,000	
ＰＡＬＴＡＣ	27,900	4,390.00	122,481,000	
三谷産業	31,100	321.00	9,983,100	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	4,500	4,000.00	18,000,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,800	1,788.00	3,218,400	
コーア商事ホールディングス	12,500	712.00	8,900,000	
国際紙パルプ商事	36,800	483.00	17,774,400	
ヤマタネ	8,600	1,602.00	13,777,200	
丸紅建材リース	1,700	1,911.00	3,248,700	
日鉄物産	12,100	5,030.00	60,863,000	
泉州電業	4,900	5,060.00	24,794,000	
トラスコ中山	41,400	1,862.00	77,086,800	
オートバックスセブン	61,700	1,424.00	87,860,800	
モリト	14,500	782.00	11,339,000	
加藤産業	21,500	3,320.00	71,380,000	
北恵	5,100	830.00	4,233,000	
イノテック	12,000	1,324.00	15,888,000	
イエローハット	31,300	1,736.00	54,336,800	
ＪＫホールディングス	14,000	984.00	13,776,000	
日伝	13,500	1,945.00	26,257,500	
北沢産業	10,900	203.00	2,212,700	
杉本商事	9,300	2,093.00	19,464,900	
因幡電機産業	49,500	2,761.00	136,669,500	
東テク	5,900	3,150.00	18,585,000	
ミスミグループ本社	249,400	3,115.00	776,881,000	
アルテック	12,300	273.00	3,357,900	
タキヒヨー	5,400	933.00	5,038,200	
蔵王産業	3,800	1,846.00	7,014,800	
スズケン	71,200	3,915.00	278,748,000	
ジェコス	13,700	848.00	11,617,600	
グローセル	21,600	404.00	8,726,400	
ローソン	44,000	4,580.00	201,520,000	
サンエー	13,600	4,175.00	56,780,000	

カワチ薬品	15,600	2,169.00	33,836,400	
エービーシー・マート	31,100	5,830.00	181,313,000	
ハードオフコーポレーション	9,200	924.00	8,500,800	
アスクル	43,000	1,699.00	73,057,000	
ゲオホールディングス	24,200	1,305.00	31,581,000	
アダストリア	21,600	2,064.00	44,582,400	
くら寿司	20,900	3,320.00	69,388,000	
キャンドゥ	7,500	2,218.00	16,635,000	
アイケイ	7,000	442.00	3,094,000	
パルグループホールディングス	17,600	1,763.00	31,028,800	
エディオン	91,500	1,298.00	118,767,000	
サーラコーポレーション	40,900	705.00	28,834,500	
ワッツ	10,100	723.00	7,302,300	
ハローズ	9,200	3,050.00	28,060,000	
フジオフードグループ本社	14,700	1,347.00	19,800,900	
あみやき亭	4,800	2,981.00	14,308,800	
大黒天物産	6,400	4,645.00	29,728,000	
ハニーズホールディングス	16,000	1,256.00	20,096,000	
ファーマライズホールディングス	4,800	700.00	3,360,000	
アルペン	14,800	2,136.00	31,612,800	
ハブ	7,100	539.00	3,826,900	
クオールホールディングス	24,600	1,398.00	34,390,800	
ジンズホールディングス	10,600	4,420.00	46,852,000	
ビックカメラ	118,100	1,177.00	139,003,700	
ＤＣＭホールディングス	118,400	1,019.00	120,649,600	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	251,300	2,222.00	558,388,600	
東京一番フーズ	5,100	592.00	3,019,200	
きちりホールディングス	5,300	372.00	1,971,600	
アークランドサービスホールディングス	14,700	2,149.00	31,590,300	
Ｊ．フロント　リテイリング	220,600	1,076.00	237,365,600	
ドトール・日レスホールディングス	31,700	1,555.00	49,293,500	
マツキヨココカラ＆カンパニー	116,500	5,220.00	608,130,000	
ブロンコビリー	10,500	2,363.00	24,811,500	
ＺＯＺＯ	136,800	2,840.00	388,512,000	
トレジャー・ファクトリー	6,100	1,218.00	7,429,800	
物語コーポレーション	9,900	5,560.00	55,044,000	
三越伊勢丹ホールディングス	298,500	1,034.00	308,649,000	
Ｈａｍｅｅ	7,500	1,059.00	7,942,500	
マーケットエンタープライズ	2,300	1,158.00	2,663,400	
ウエルシアホールディングス	105,200	2,988.00	314,337,600	
クリエイトＳＤホールディングス	29,400	3,145.00	92,463,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	23,200	374.00	8,676,800	

ミサワ	4,600	607.00	2,792,200	
ティーライフ	2,900	1,397.00	4,051,300	
チムニー	6,100	1,234.00	7,527,400	
シュッピン	16,800	1,342.00	22,545,600	
オイシックス・ラ・大地	28,800	1,795.00	51,696,000	
ネクステージ	40,500	2,502.00	101,331,000	
ジョイフル本田	57,200	1,623.00	92,835,600	
鳥貴族ホールディングス	6,700	2,202.00	14,753,400	
ホットランド	15,100	1,325.00	20,007,500	
すかいらーくホールディングス	242,400	1,607.00	389,536,800	
ＳＦＰホールディングス	9,700	1,580.00	15,326,000	
綿半ホールディングス	14,000	1,394.00	19,516,000	
ヨシックスホールディングス	4,000	2,339.00	9,356,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	58,100	1,106.00	64,258,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	10,600	1,354.00	14,352,400	
ＢＥＥＮＯＳ	10,200	2,414.00	24,622,800	
あさひ	16,700	1,305.00	21,793,500	
日本調剤	12,300	1,350.00	16,605,000	
コスモス薬品	20,100	13,260.00	266,526,000	
トーエル	9,100	921.00	8,381,100	
セブン＆アイ・ホールディングス	666,200	5,482.00	3,652,108,400	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	133,300	918.00	122,369,400	
ツルハホールディングス	43,400	7,550.00	327,670,000	
サンマルクホールディングス	15,900	1,584.00	25,185,600	
フェリシモ	4,700	1,115.00	5,240,500	
トリドールホールディングス	49,600	2,592.00	128,563,200	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	19,400	330.00	6,402,000	
ウイルプラスホールディングス	4,200	864.00	3,628,800	
ＪＭホールディングス	15,300	1,670.00	25,551,000	
サツドラホールディングス	9,400	670.00	6,298,000	
アレンザホールディングス	13,600	1,045.00	14,212,000	
串カツ田中ホールディングス	5,500	1,877.00	10,323,500	
バロックジャパンリミテッド	14,300	820.00	11,726,000	
クスリのアオキホールディングス	17,800	5,550.00	98,790,000	
力の源ホールディングス	10,200	662.00	6,752,400	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	101,900	2,742.00	279,409,800	
メディカルシステムネットワーク	18,100	444.00	8,036,400	
はるやまホールディングス	10,100	447.00	4,514,700	
ノジマ	32,200	2,912.00	93,766,400	
カッパ・クリエイト	27,800	1,466.00	40,754,800	

ライトオン	14,800	745.00	11,026,000	
良品計画	228,900	1,269.00	290,474,100	
パリミキホールディングス	26,000	271.00	7,046,000	
アドヴァングループ	17,300	807.00	13,961,100	
アルビス	6,000	2,260.00	13,560,000	
コナカ	21,500	342.00	7,353,000	
ハウス　オブ　ローゼ	2,700	1,659.00	4,479,300	
Ｇ－７ホールディングス	22,300	1,474.00	32,870,200	
イオン北海道	26,400	1,091.00	28,802,400	
コジマ	34,700	667.00	23,144,900	
ヒマラヤ	6,600	987.00	6,514,200	
コーナン商事	28,300	3,685.00	104,285,500	
エコス	6,700	2,355.00	15,778,500	
ワタミ	24,100	912.00	21,979,200	
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	397,300	2,176.00	864,524,800	
西松屋チェーン	39,500	1,512.00	59,724,000	
ゼンショーホールディングス	97,100	3,380.00	328,198,000	
幸楽苑ホールディングス	11,600	1,284.00	14,894,400	
ハークスレイ	9,000	566.00	5,094,000	
サイゼリヤ	29,600	2,631.00	77,877,600	
ＶＴホールディングス	75,500	491.00	37,070,500	
魚力	5,700	2,484.00	14,158,800	
フジ・コーポレーション	10,800	1,286.00	13,888,800	
ユナイテッドアローズ	21,000	1,872.00	39,312,000	
ハイデイ日高	28,800	2,110.00	60,768,000	
ＹＵ－ＷＡ　Ｃｒｅａｔｉｏｎ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	13,400	209.00	2,800,600	
コロワイド	81,600	1,865.00	152,184,000	
ピーシーデポコーポレーション	24,300	313.00	7,605,900	
壱番屋	14,100	4,790.00	67,539,000	
ＰＬＡＮＴ	5,100	644.00	3,284,400	
スギホールディングス	39,700	6,160.00	244,552,000	
薬王堂ホールディングス	10,100	2,108.00	21,290,800	
スクロール	31,000	929.00	28,799,000	
ヨンドシーホールディングス	17,000	1,761.00	29,937,000	
木曽路	26,600	2,205.00	58,653,000	
ＳＲＳホールディングス	29,000	871.00	25,259,000	
千趣会	36,900	384.00	14,169,600	
リテールパートナーズ	26,600	1,185.00	31,521,000	
ケーヨー	37,000	910.00	33,670,000	
上新電機	19,500	1,971.00	38,434,500	
日本瓦斯	95,100	1,932.00	183,733,200	

ロイヤルホールディングス	30,700	2,154.00	66,127,800	
いなげや	19,900	1,305.00	25,969,500	
チヨダ	17,400	803.00	13,972,200	
ライフコーポレーション	15,600	2,686.00	41,901,600	
リンガーハット	22,900	2,410.00	55,189,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	25,400	630.00	16,002,000	
ＡＯＫＩホールディングス	39,000	681.00	26,559,000	
オークワ	28,600	877.00	25,082,200	
コメリ	30,800	2,650.00	81,620,000	
青山商事	38,300	861.00	32,976,300	
しまむら	23,100	12,420.00	286,902,000	
はせがわ	12,000	252.00	3,024,000	
高島屋	133,700	1,381.00	184,639,700	
松屋	33,600	856.00	28,761,600	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	86,500	1,001.00	86,586,500	
近鉄百貨店	5,900	2,382.00	14,053,800	
丸井グループ	143,800	2,309.00	332,034,200	
アクシアル　リテイリング	13,300	3,315.00	44,089,500	
イオン	655,300	2,665.00	1,746,374,500	
イズミ	31,500	3,080.00	97,020,000	
平和堂	29,700	1,995.00	59,251,500	
フジ	43,600	2,245.00	97,882,000	
ヤオコー	22,600	6,330.00	143,058,000	
ゼビオホールディングス	27,400	913.00	25,016,200	
ケーズホールディングス	169,400	1,401.00	237,329,400	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	9,400	639.00	6,006,600	
日産東京販売ホールディングス	30,600	272.00	8,323,200	
シルバーライフ	4,300	1,350.00	5,805,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	8,800	3,375.00	29,700,000	
ナルミヤ・インターナショナル	4,900	879.00	4,307,100	
ブックオフグループホールディングス	11,600	1,040.00	12,064,000	
ギフトホールディングス	3,300	2,191.00	7,230,300	
アインホールディングス	24,500	7,720.00	189,140,000	
元気寿司	5,700	2,550.00	14,535,000	
ヤマダホールディングス	703,600	496.00	348,985,600	
アークランドサカモト	31,300	1,594.00	49,892,200	
ニトリホールディングス	78,900	13,765.00	1,086,058,500	
グルメ杵屋	16,100	1,025.00	16,502,500	
愛眼	14,500	181.00	2,624,500	
ケーユーホールディングス	10,700	1,049.00	11,224,300	
吉野家ホールディングス	69,500	2,444.00	169,858,000	
松屋フーズホールディングス	9,600	4,070.00	39,072,000	

サガミホールディングス	28,800	1,142.00	32,889,600	
関西フードマーケット	16,300	1,232.00	20,081,600	
王将フードサービス	13,200	6,850.00	90,420,000	
プレナス	22,400	2,020.00	45,248,000	
ミニストップ	14,900	1,500.00	22,350,000	
アークス	35,400	2,124.00	75,189,600	
バローホールディングス	40,800	1,933.00	78,866,400	
ベルク	8,900	5,250.00	46,725,000	
大庄	10,900	1,187.00	12,938,300	
ファーストリテイリング	26,600	68,900.00	1,832,740,000	
サンドラッグ	74,900	3,140.00	235,186,000	
サックスバー　ホールディングス	19,300	632.00	12,197,600	
ヤマザワ	4,400	1,495.00	6,578,000	
やまや	4,100	2,566.00	10,520,600	
ベルーナ	43,100	775.00	33,402,500	
島根銀行	6,300	499.00	3,143,700	
じもとホールディングス	13,200	580.00	7,656,000	
めぶきフィナンシャルグループ	818,400	269.00	220,149,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	23,000	2,277.00	52,371,000	
九州フィナンシャルグループ	348,200	392.00	136,494,400	
ゆうちょ銀行	469,600	1,072.00	503,411,200	
富山第一銀行	44,300	426.00	18,871,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	984,700	462.00	454,931,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	104,400	757.00	79,030,800	
三十三フィナンシャルグループ	16,000	1,423.00	22,768,000	
第四北越フィナンシャルグループ	28,100	2,575.00	72,357,500	
ひろぎんホールディングス	254,300	629.00	159,954,700	
おきなわフィナンシャルグループ	16,800	2,177.00	36,573,600	
十六フィナンシャルグループ	23,200	2,403.00	55,749,600	
北國フィナンシャルホールディングス	16,400	4,705.00	77,162,000	
プロクレアホールディングス	20,200	2,034.00	41,086,800	
新生銀行	129,800	2,037.00	264,402,600	
あおぞら銀行	111,100	2,721.00	302,303,100	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	11,644,300	739.50	8,610,959,850	
りそなホールディングス	2,104,900	513.40	1,080,655,660	
三井住友トラスト・ホールディングス	329,000	4,279.00	1,407,791,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,291,000	4,128.00	5,329,248,000	
千葉銀行	561,800	752.00	422,473,600	
群馬銀行	320,000	386.00	123,520,000	
武蔵野銀行	25,400	1,796.00	45,618,400	
千葉興業銀行	42,900	256.00	10,982,400	
筑波銀行	77,500	194.00	15,035,000	

七十七銀行	52,800	1,773.00	93,614,400	
秋田銀行	11,900	1,674.00	19,920,600	
山形銀行	18,300	922.00	16,872,600	
岩手銀行	12,200	1,995.00	24,339,000	
東邦銀行	142,300	209.00	29,740,700	
東北銀行	8,900	976.00	8,686,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	143,600	2,428.00	348,660,800	
静岡銀行	409,900	820.00	336,118,000	
スルガ銀行	174,400	376.00	65,574,400	
八十二銀行	369,000	508.00	187,452,000	
山梨中央銀行	20,000	1,185.00	23,700,000	
大垣共立銀行	34,100	1,751.00	59,709,100	
福井銀行	15,900	1,388.00	22,069,200	
清水銀行	7,100	1,492.00	10,593,200	
富山銀行	3,100	1,859.00	5,762,900	
滋賀銀行	32,400	2,713.00	87,901,200	
南都銀行	26,900	2,035.00	54,741,500	
百五銀行	167,100	330.00	55,143,000	
京都銀行	61,700	5,770.00	356,009,000	
紀陽銀行	59,000	1,406.00	82,954,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	112,900	851.00	96,077,900	
山陰合同銀行	110,600	669.00	73,991,400	
中国銀行	140,000	987.00	138,180,000	
鳥取銀行	6,300	1,176.00	7,408,800	
伊予銀行	223,000	663.00	147,849,000	
百十四銀行	18,300	1,692.00	30,963,600	
四国銀行	26,200	854.00	22,374,800	
阿波銀行	26,400	2,054.00	54,225,600	
大分銀行	10,700	1,881.00	20,126,700	
宮崎銀行	10,800	2,089.00	22,561,200	
佐賀銀行	10,500	1,510.00	15,855,000	
琉球銀行	43,200	803.00	34,689,600	
セブン銀行	590,800	262.00	154,789,600	
みずほフィナンシャルグループ	2,385,200	1,582.50	3,774,579,000	
高知銀行	6,300	704.00	4,435,200	
山口フィナンシャルグループ	198,600	762.00	151,333,200	
長野銀行	6,100	1,321.00	8,058,100	
名古屋銀行	12,200	3,105.00	37,881,000	
北洋銀行	249,900	231.00	57,726,900	
愛知銀行	6,200	5,350.00	33,170,000	
中京銀行	6,100	1,731.00	10,559,100	
大光銀行	5,900	1,400.00	8,260,000	

愛媛銀行	25,900	908.00	23,517,200	
トマト銀行	6,000	1,010.00	6,060,000	
京葉銀行	83,000	470.00	39,010,000	
栃木銀行	89,200	264.00	23,548,800	
北日本銀行	5,800	1,675.00	9,715,000	
東和銀行	32,600	524.00	17,082,400	
福島銀行	21,000	218.00	4,578,000	
大東銀行	8,700	653.00	5,681,100	
トモニホールディングス	143,500	318.00	45,633,000	
フィデアホールディングス	18,200	1,319.00	24,005,800	
池田泉州ホールディングス	211,200	202.00	42,662,400	
ＦＰＧ	67,200	933.00	62,697,600	
ジャパンインベストメントアドバイザー	15,600	1,276.00	19,905,600	
マーキュリアホールディングス	11,200	612.00	6,854,400	
ＳＢＩホールディングス	245,800	2,714.00	667,101,200	
ジャフコ　グループ	69,000	1,726.00	119,094,000	
大和証券グループ本社	1,278,000	622.00	794,916,000	
野村ホールディングス	3,037,900	511.80	1,554,797,220	
岡三証券グループ	144,200	349.00	50,325,800	
丸三証券	59,600	495.00	29,502,000	
東洋証券	61,500	213.00	13,099,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	196,500	381.00	74,866,500	
光世証券	4,700	450.00	2,115,000	
水戸証券	49,700	264.00	13,120,800	
いちよし証券	33,300	646.00	21,511,800	
松井証券	97,700	813.00	79,430,100	
マネックスグループ	168,100	455.00	76,485,500	
極東証券	23,000	705.00	16,215,000	
岩井コスモホールディングス	19,000	1,279.00	24,301,000	
アイザワ証券グループ	27,200	725.00	19,720,000	
マネーパートナーズグループ	22,200	254.00	5,638,800	
スパークス・グループ	92,800	281.00	26,076,800	
かんぽ生命保険	200,200	2,198.00	440,039,600	
ＳＯＭＰＯホールディングス	283,100	6,069.00	1,718,133,900	
アニコム　ホールディングス	61,100	666.00	40,692,600	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	408,900	4,341.00	1,775,034,900	
第一生命ホールディングス	968,800	2,442.50	2,366,294,000	
東京海上ホールディングス	553,600	8,188.00	4,532,876,800	
Ｔ＆Ｄホールディングス	442,600	1,596.00	706,389,600	
アドバンスクリエイト	9,500	977.00	9,281,500	
全国保証	47,600	4,365.00	207,774,000	
あんしん保証	9,800	265.00	2,597,000	

イントラスト	9,300	571.00	5,310,300	
日本モーゲージサービス	11,600	988.00	11,460,800	
Ｃａｓａ	7,600	885.00	6,726,000	
アルヒ	29,900	1,023.00	30,587,700	
プレミアグループ	10,200	4,370.00	44,574,000	
ネットプロテクションズホールディングス	61,500	553.00	34,009,500	
クレディセゾン	116,500	1,581.00	184,186,500	
芙蓉総合リース	17,100	7,920.00	135,432,000	
みずほリース	24,700	3,240.00	80,028,000	
東京センチュリー	30,900	4,645.00	143,530,500	
日本証券金融	78,800	870.00	68,556,000	
アイフル	335,300	369.00	123,725,700	
リコーリース	17,800	3,615.00	64,347,000	
イオンフィナンシャルサービス	108,600	1,308.00	142,048,800	
アコム	394,000	328.00	129,232,000	
ジャックス	19,900	3,445.00	68,555,500	
オリエントコーポレーション	542,200	128.00	69,401,600	
オリックス	1,182,100	2,318.50	2,740,698,850	
三菱ＨＣキャピタル	643,800	629.00	404,950,200	
九州リースサービス	9,400	569.00	5,348,600	
日本取引所グループ	463,700	2,117.50	981,884,750	
イー・ギャランティ	29,800	2,247.00	66,960,600	
アサックス	11,200	613.00	6,865,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	8,300	2,067.00	17,156,100	
いちご	227,300	314.00	71,372,200	
日本駐車場開発	207,300	172.00	35,655,600	
スター・マイカ・ホールディングス	12,000	1,467.00	17,604,000	
ＳＲＥホールディングス	5,900	2,699.00	15,924,100	
ＡＤワークスグループ	35,500	150.00	5,325,000	
ヒューリック	434,500	1,073.00	466,218,500	
三栄建築設計	9,100	1,633.00	14,860,300	
野村不動産ホールディングス	103,500	3,245.00	335,857,500	
三重交通グループホールディングス	44,100	478.00	21,079,800	
サムティ	30,000	2,064.00	61,920,000	
ディア・ライフ	27,700	607.00	16,813,900	
地主	13,500	2,058.00	27,783,000	
プレサンスコーポレーション	22,900	1,535.00	35,151,500	
ハウスコム	5,500	891.00	4,900,500	
ＪＰＭＣ	11,400	1,024.00	11,673,600	
サンセイランディック	8,000	855.00	6,840,000	
フージャースホールディングス	25,400	800.00	20,320,000	
オープンハウスグループ	63,600	5,710.00	363,156,000	

東急不動産ホールディングス	543,400	706.00	383,640,400	
飯田グループホールディングス	166,800	2,143.00	357,452,400	
イーグランド	4,100	1,428.00	5,854,800	
ムゲンエステート	16,100	483.00	7,776,300	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	9,800	827.00	8,104,600	
シーアールイー	8,600	1,675.00	14,405,000	
ケイアイスター不動産	9,300	4,670.00	43,431,000	
グッドコムアセット	10,100	1,274.00	12,867,400	
ジェイ・エス・ビー	4,600	3,195.00	14,697,000	
ロードスターキャピタル	6,000	1,945.00	11,670,000	
テンポイノベーション	7,700	862.00	6,637,400	
フェイスネットワーク	3,900	1,383.00	5,393,700	
パーク２４	118,800	1,765.00	209,682,000	
パラカ	6,900	1,826.00	12,599,400	
三井不動産	776,900	2,902.00	2,254,563,800	
三菱地所	1,133,700	1,981.50	2,246,426,550	
平和不動産	32,100	3,985.00	127,918,500	
東京建物	171,200	1,963.00	336,065,600	
京阪神ビルディング	27,400	1,314.00	36,003,600	
住友不動産	358,300	3,567.00	1,278,056,100	
テーオーシー	32,400	782.00	25,336,800	
東京楽天地	3,300	3,980.00	13,134,000	
スターツコーポレーション	27,700	2,833.00	78,474,100	
フジ住宅	25,900	665.00	17,223,500	
空港施設	23,400	549.00	12,846,600	
明和地所	12,300	626.00	7,699,800	
ゴールドクレスト	16,800	1,743.00	29,282,400	
エスリード	8,900	1,693.00	15,067,700	
日神グループホールディングス	36,600	433.00	15,847,800	
日本エスコン	37,000	779.00	28,823,000	
タカラレーベン	83,300	357.00	29,738,100	
ＡＶＡＮＴＩＡ	11,600	808.00	9,372,800	
イオンモール	100,800	1,682.00	169,545,600	
毎日コムネット	9,700	630.00	6,111,000	
ファースト住建	9,100	1,118.00	10,173,800	
カチタス	49,800	3,210.00	159,858,000	
トーセイ	28,900	1,220.00	35,258,000	
穴吹興産	5,200	2,101.00	10,925,200	
サンフロンティア不動産	29,100	1,105.00	32,155,500	
ＦＪネクストホールディングス	21,300	1,075.00	22,897,500	
インテリックス	4,500	580.00	2,610,000	
ランドビジネス	6,700	228.00	1,527,600	

サンネクスタグループ	8,200	1,047.00	8,585,400	
グランディハウス	17,100	538.00	9,199,800	
日本空港ビルデング	64,500	5,120.00	330,240,000	
明豊ファシリティワークス	9,400	644.00	6,053,600	
日本工営	12,400	3,340.00	41,416,000	
ＬＩＦＵＬＬ	61,000	172.00	10,492,000	
ミクシィ	44,200	2,252.00	99,538,400	
ジェイエイシーリクルートメント	15,700	1,850.00	29,045,000	
日本M&Aセンターホールディングス	316,400	1,637.00	517,946,800	
メンバーズ	5,200	2,651.00	13,785,200	
中広	4,000	385.00	1,540,000	
ＵＴグループ	28,000	2,528.00	70,784,000	
アイティメディア	9,400	1,615.00	15,181,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	11,400	1,193.00	13,600,200	
夢真ビーネックスグループ	63,100	1,599.00	100,896,900	
コシダカホールディングス	52,000	714.00	37,128,000	
アルトナー	5,100	887.00	4,523,700	
パソナグループ	21,100	1,957.00	41,292,700	
ＣＤＳ	5,000	1,776.00	8,880,000	
リンクアンドモチベーション	42,500	501.00	21,292,500	
エス・エム・エス	65,600	2,892.00	189,715,200	
サニーサイドアップグループ	7,200	661.00	4,759,200	
パーソルホールディングス	192,800	2,700.00	520,560,000	
リニカル	11,300	799.00	9,028,700	
クックパッド	62,300	206.00	12,833,800	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	10,000	599.00	5,990,000	
学情	8,200	992.00	8,134,400	
スタジオアリス	8,800	2,378.00	20,926,400	
シミックホールディングス	9,700	1,498.00	14,530,600	
エプコ	4,600	711.00	3,270,600	
ＮＪＳ	4,400	1,951.00	8,584,400	
綜合警備保障	70,400	3,875.00	272,800,000	
カカクコム	141,600	2,339.00	331,202,400	
アイロムグループ	6,900	1,890.00	13,041,000	
セントケア・ホールディング	12,900	890.00	11,481,000	
サイネックス	3,800	594.00	2,257,200	
ルネサンス	13,800	941.00	12,985,800	
ディップ	34,000	3,750.00	127,500,000	
デジタルホールディングス	13,700	1,246.00	17,070,200	
新日本科学	23,600	2,073.00	48,922,800	
キャリアデザインセンター	4,300	1,176.00	5,056,800	
ベネフィット・ワン	70,300	1,965.00	138,139,500	

エムスリー	340,200	4,054.00	1,379,170,800	
ツカダ・グローバルホールディング	12,300	328.00	4,034,400	
アウトソーシング	110,700	1,115.00	123,430,500	
ウェルネット	17,800	463.00	8,241,400	
ワールドホールディングス	7,900	2,287.00	18,067,300	
ディー・エヌ・エー	73,600	1,880.00	138,368,000	
博報堂ＤＹホールディングス	244,200	1,280.00	312,576,000	
ぐるなび	29,000	373.00	10,817,000	
タカミヤ	24,300	376.00	9,136,800	
ジャパンベストレスキューシステム	10,900	760.00	8,284,000	
ファンコミュニケーションズ	44,300	390.00	17,277,000	
ライク	6,600	2,290.00	15,114,000	
ビジネス・ブレークスルー	8,000	424.00	3,392,000	
エスプール	54,700	990.00	54,153,000	
ＷＤＢホールディングス	8,900	2,497.00	22,223,300	
ティア	12,000	432.00	5,184,000	
ＣＤＧ	2,300	1,272.00	2,925,600	
アドウェイズ	29,500	678.00	20,001,000	
バリューコマース	15,200	3,155.00	47,956,000	
インフォマート	212,100	386.00	81,870,600	
ＪＰホールディングス	50,900	254.00	12,928,600	
エコナックホールディングス	36,900	92.00	3,394,800	
ＣＬホールディングス	4,500	924.00	4,158,000	
プレステージ・インターナショナル	72,800	698.00	50,814,400	
アミューズ	10,700	2,015.00	21,560,500	
ドリームインキュベータ	6,100	1,967.00	11,998,700	
クイック	12,200	1,452.00	17,714,400	
ＴＡＣ	12,100	215.00	2,601,500	
電通グループ	180,700	4,215.00	761,650,500	
イオンファンタジー	7,600	2,496.00	18,969,600	
シーティーエス	22,200	841.00	18,670,200	
ネクシィーズグループ	6,500	561.00	3,646,500	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	50,500	3,070.00	155,035,000	
アルプス技研	16,500	1,820.00	30,030,000	
ダイオーズ	4,100	1,086.00	4,452,600	
日本空調サービス	20,600	793.00	16,335,800	
オリエンタルランド	205,000	18,590.00	3,810,950,000	
ダスキン	41,600	2,937.00	122,179,200	
明光ネットワークジャパン	23,200	616.00	14,291,200	
ファルコホールディングス	8,700	1,924.00	16,738,800	
ラウンドワン	54,000	1,411.00	76,194,000	
リゾートトラスト	81,700	2,054.00	167,811,800	

ビー・エム・エル	24,600	3,655.00	89,913,000	
りらいあコミュニケーションズ	28,700	1,096.00	31,455,200	
リソー教育	89,100	324.00	28,868,400	
早稲田アカデミー	11,000	1,159.00	12,749,000	
ユー・エス・エス	215,900	2,457.00	530,466,300	
東京個別指導学院	17,600	616.00	10,841,600	
サイバーエージェント	411,900	1,358.00	559,360,200	
楽天グループ	895,100	647.00	579,129,700	
クリーク・アンド・リバー社	10,300	2,279.00	23,473,700	
モーニングスター	34,400	529.00	18,197,600	
テー・オー・ダブリュー	37,900	314.00	11,900,600	
山田コンサルティンググループ	10,300	1,167.00	12,020,100	
セントラルスポーツ	7,300	2,502.00	18,264,600	
フルキャストホールディングス	16,600	2,427.00	40,288,200	
エン・ジャパン	34,400	1,926.00	66,254,400	
リソルホールディングス	2,200	4,600.00	10,120,000	
テクノプロ・ホールディングス	115,500	3,095.00	357,472,500	
アトラグループ	4,300	191.00	821,300	
インターワークス	6,500	366.00	2,379,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	9,100	2,160.00	19,656,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	12,500	3,395.00	42,437,500	
ファーストロジック	3,400	779.00	2,648,600	
三機サービス	3,700	1,000.00	3,700,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	11,100	729.00	8,091,900	
デザインワン・ジャパン	7,700	180.00	1,386,000	
イー・ガーディアン	6,600	2,930.00	19,338,000	
リブセンス	12,900	179.00	2,309,100	
ジャパンマテリアル	59,400	1,845.00	109,593,000	
ベクトル	27,400	1,003.00	27,482,200	
ウチヤマホールディングス	10,700	295.00	3,156,500	
チャーム・ケア・コーポレーション	14,700	1,021.00	15,008,700	
キャリアリンク	7,300	1,975.00	14,417,500	
ＩＢＪ	16,200	755.00	12,231,000	
アサンテ	8,700	1,531.00	13,319,700	
バリューＨＲ	16,900	1,350.00	22,815,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	16,000	3,505.00	56,080,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,800	1,240.00	9,672,000	
ＥＲＩホールディングス	5,700	1,208.00	6,885,600	
アビスト	3,100	2,744.00	8,506,400	
シグマクシス・ホールディングス	23,500	1,184.00	27,824,000	
ウィルグループ	14,600	1,203.00	17,563,800	
エスクロー・エージェント・ジャパン	22,300	162.00	3,612,600	

メドピア	13,700	2,056.00	28,167,200	
レアジョブ	4,300	556.00	2,390,800	
リクルートホールディングス	1,380,700	4,330.00	5,978,431,000	
エラン	26,900	1,094.00	29,428,600	
土木管理総合試験所	10,000	328.00	3,280,000	
ネットマーケティング	10,100	562.00	5,676,200	
日本郵政	2,106,000	981.50	2,067,039,000	
ベルシステム２４ホールディングス	27,900	1,414.00	39,450,600	
鎌倉新書	22,600	564.00	12,746,400	
ＳＭＮ	4,800	586.00	2,812,800	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	3,400	702.00	2,386,800	
エアトリ	11,200	2,318.00	25,961,600	
アトラエ	13,700	1,712.00	23,454,400	
ストライク	8,600	3,615.00	31,089,000	
ソラスト	47,900	751.00	35,972,900	
セラク	6,400	1,285.00	8,224,000	
インソース	21,500	2,425.00	52,137,500	
ベイカレント・コンサルティング	13,600	38,150.00	518,840,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,800	2,534.00	9,629,200	
アイモバイル	9,800	1,381.00	13,533,800	
キャリアインデックス	7,300	538.00	3,927,400	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	8,200	906.00	7,429,200	
船場	4,400	673.00	2,961,200	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	61,400	1,580.00	97,012,000	
フルテック	3,000	1,300.00	3,900,000	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	6,500	527.00	3,425,500	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	3,300	646.00	2,131,800	
ウェルビー	13,200	703.00	9,279,600	
エル・ティー・エス	2,600	3,510.00	9,126,000	
ミダックホールディングス	8,800	2,837.00	24,965,600	
日総工産	15,700	583.00	9,153,100	
キュービーネットホールディングス	9,200	1,347.00	12,392,400	
ＲＰＡホールディングス	28,200	331.00	9,334,200	
スプリックス	6,900	993.00	6,851,700	
マネジメントソリューションズ	9,600	2,728.00	26,188,800	
プロレド・パートナーズ	5,000	488.00	2,440,000	
テノ．ホールディングス	2,900	674.00	1,954,600	
フロンティア・マネジメント	5,300	1,298.00	6,879,400	
ピアラ	3,600	703.00	2,530,800	
コプロ・ホールディングス	4,200	858.00	3,603,600	
ギークス	3,700	1,022.00	3,781,400	
カーブスホールディングス	53,400	685.00	36,579,000	

フォーラムエンジニアリング	12,100	924.00	11,180,400	
Ｆａｓｔ　Ｆｉｔｎｅｓｓ　Ｊａｐａｎ	3,800	1,388.00	5,274,400	
ダイレクトマーケティングミックス	19,800	1,835.00	36,333,000	
ポピンズ	4,700	1,888.00	8,873,600	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	15,800	2,305.00	36,419,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	10,500	447.00	4,693,500	
リログループ	105,600	2,062.00	217,747,200	
東祥	14,700	1,302.00	19,139,400	
ビーウィズ	5,400	1,408.00	7,603,200	
ＴＲＥホールディングス	36,400	1,667.00	60,678,800	
人・夢・技術グループ	7,800	2,471.00	19,273,800	
エイチ・アイ・エス	40,200	2,036.00	81,847,200	
ラックランド	5,900	2,946.00	17,381,400	
共立メンテナンス	34,500	4,760.00	164,220,000	
イチネンホールディングス	20,000	1,253.00	25,060,000	
建設技術研究所	9,900	2,671.00	26,442,900	
スペース	12,900	906.00	11,687,400	
燦ホールディングス	8,600	1,878.00	16,150,800	
スバル興業	1,200	8,660.00	10,392,000	
東京テアトル	7,000	1,227.00	8,589,000	
タナベ経営	7,900	666.00	5,261,400	
ナガワ	5,400	8,190.00	44,226,000	
東京都競馬	14,500	4,015.00	58,217,500	
カナモト	31,700	1,976.00	62,639,200	
西尾レントオール	16,100	2,835.00	45,643,500	
トランス・コスモス	24,500	3,565.00	87,342,500	
乃村工藝社	83,000	898.00	74,534,000	
藤田観光	8,400	2,714.00	22,797,600	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	12,000	1,443.00	17,316,000	
日本管財	20,800	2,621.00	54,516,800	
トーカイ	15,400	1,688.00	25,995,200	
セコム	190,000	8,752.00	1,662,880,000	
セントラル警備保障	9,400	2,681.00	25,201,400	
丹青社	36,800	814.00	29,955,200	
メイテック	68,800	2,345.00	161,336,000	
応用地質	18,600	1,707.00	31,750,200	
船井総研ホールディングス	36,300	2,296.00	83,344,800	
進学会ホールディングス	7,300	320.00	2,336,000	
オオバ	12,500	754.00	9,425,000	
いであ	4,900	1,737.00	8,511,300	
学究社	6,400	1,587.00	10,156,800	
ベネッセホールディングス	64,400	2,281.00	146,896,400	

イオンディライト	22,300	2,845.00	63,443,500	
ナック	9,500	987.00	9,376,500	
ダイセキ	35,200	3,805.00	133,936,000	
ステップ	7,300	1,726.00	12,599,800	
合　計	205,353,800		496,512,658,660	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	62,888,551
株式	3,561,555,110
未収配当金	7,867,681
前払金	1,230,000
差入委託証拠金	2,730,000
流動資産合計	3,636,271,342
資産合計	3,636,271,342
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,231,650
未払利息	19
流動負債合計	1,231,669
負債合計	1,231,669
純資産の部	
元本等	
元本	3,029,447,803
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	605,591,870
元本等合計	3,635,039,673
純資産合計	3,635,039,673
負債純資産合計	3,636,271,342

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11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	3,029,447,803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　1.1999円 (1万口当たり純資産額)　(11,999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 7月11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 7月11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。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月11日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	4,074,360,095円
期中追加設定元本額	52,442,969円
期中一部解約元本額	1,097,355,261円
期末元本額	3,029,447,803円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドＡ	564,917,885円
分散投資コア戦略ファンドＳ	2,464,529,918円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	134,490,356
合計	134,490,356

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株式最小分散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 7月11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	58,410,000	－	57,180,000	△1,230,000
合計		58,410,000	－	57,180,000	△1,230,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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)	
大成建設	4,500	4,290.00	19,305,000	
大林組	15,800	973.00	15,373,400	
鹿島建設	1,600	1,508.00	2,412,800	
大東建託	1,500	12,170.00	18,255,000	
積水ハウス	16,200	2,379.00	38,539,800	
ヤクルト本社	4,500	8,110.00	36,495,000	
明治ホールディングス	7,700	7,060.00	54,362,000	
キリンホールディングス	6,600	2,224.50	14,681,700	
サントリー食品インターナショナル	6,700	5,290.00	35,443,000	
味の素	7,000	3,490.00	24,430,000	
日清食品ホールディングス	4,600	9,790.00	45,034,000	
日本たばこ産業	22,100	2,380.00	52,598,000	
信越化学工業	1,100	16,175.00	17,792,500	
ＪＳＲ	2,700	3,555.00	9,598,500	
三菱ケミカルグループ	6,900	752.10	5,189,490	
花王	7,100	5,760.00	40,896,000	
富士フイルムホールディングス	6,000	7,580.00	45,480,000	
小林製薬	1,400	9,050.00	12,670,000	
日東電工	1,000	8,720.00	8,720,000	
ユニ・チャーム	7,300	4,878.00	35,609,400	
協和キリン	5,500	3,165.00	17,407,500	
武田薬品工業	13,800	3,973.00	54,827,400	
アステラス製薬	25,900	2,164.00	56,047,600	
塩野義製薬	4,500	7,215.00	32,467,500	
日本新薬	1,700	8,460.00	14,382,000	
中外製薬	11,100	3,737.00	41,480,700	
エーザイ	1,100	6,181.00	6,799,100	
小野薬品工業	14,600	3,835.00	55,991,000	
第一三共	4,100	3,596.00	14,743,600	
大塚ホールディングス	11,300	4,984.00	56,319,200	
出光興産	10,100	3,235.00	32,673,500	

ＥＮＥＯＳホールディングス	55,200	506.00	27,931,200	
ブリヂストン	10,400	5,038.00	52,395,200	
日立金属	25,300	2,059.00	52,092,700	
ＳＭＣ	300	62,400.00	18,720,000	
クボタ	5,700	2,140.00	12,198,000	
ダイキン工業	1,400	22,095.00	30,933,000	
ホシザキ	1,800	4,030.00	7,254,000	
マキタ	500	3,440.00	1,720,000	
日立製作所	1,500	6,565.00	9,847,500	
東芝	3,800	5,470.00	20,786,000	
三菱電機	21,300	1,469.00	31,289,700	
日本電産	1,100	9,112.00	10,023,200	
日本電気	3,200	5,500.00	17,600,000	
富士通	1,700	18,145.00	30,846,500	
ソニーグループ	3,000	11,380.00	34,140,000	
ヒロセ電機	1,700	18,690.00	31,773,000	
アズビル	3,600	3,775.00	13,590,000	
キーエンス	700	50,260.00	35,182,000	
シスメックス	300	9,063.00	2,718,900	
ファナック	300	21,915.00	6,574,500	
浜松ホトニクス	2,800	5,710.00	15,988,000	
京セラ	4,600	7,060.00	32,476,000	
村田製作所	6,200	7,638.00	47,355,600	
キヤノン	15,800	3,173.00	50,133,400	
トヨタ自動車	25,400	2,152.00	54,660,800	
シマノ	1,200	23,380.00	28,056,000	
テルモ	8,100	4,258.00	34,489,800	
島津製作所	1,300	4,475.00	5,817,500	
オリンパス	6,700	2,745.50	18,394,850	
ＨＯＹＡ	2,900	12,695.00	36,815,500	
朝日インテック	3,700	2,357.00	8,720,900	
バンダイナムコホールディングス	2,800	10,040.00	28,112,000	
大日本印刷	700	2,852.00	1,996,400	
任天堂	800	59,100.00	47,280,000	
中部電力	39,000	1,398.00	54,522,000	
関西電力	40,300	1,375.00	55,412,500	
東京瓦斯	16,300	2,525.00	41,157,500	
大阪瓦斯	20,400	2,411.00	49,184,400	
東武鉄道	2,900	3,060.00	8,874,000	
東急	8,200	1,588.00	13,021,600	
小田急電鉄	10,000	1,845.00	18,450,000	
京王電鉄	1,900	4,945.00	9,395,500	

京成電鉄	500	3,515.00	1,757,500	
東日本旅客鉄道	5,400	6,693.00	36,142,200	
東海旅客鉄道	2,100	15,175.00	31,867,500	
近鉄グループホールディングス	3,300	4,175.00	13,777,500	
阪急阪神ホールディングス	2,300	3,690.00	8,487,000	
ヤマトホールディングス	7,800	2,274.00	17,737,200	
ＳＧホールディングス	13,400	2,511.00	33,647,400	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	400	7,550.00	3,020,000	
ＴＩＳ	800	3,645.00	2,916,000	
コーエーテクモホールディングス	1,100	4,705.00	5,175,500	
ネクソン	1,900	2,921.00	5,549,900	
野村総合研究所	4,100	3,825.00	15,682,500	
オービック	2,300	21,110.00	48,553,000	
Ｚホールディングス	28,400	437.30	12,419,320	
トレンドマイクロ	4,000	7,330.00	29,320,000	
日本オラクル	2,000	8,130.00	16,260,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	5,700	3,515.00	20,035,500	
大塚商会	4,100	4,140.00	16,974,000	
日本電信電話	13,100	3,914.00	51,273,400	
ＫＤＤＩ	11,300	4,433.00	50,092,900	
ソフトバンク	34,500	1,553.00	53,578,500	
光通信	500	14,270.00	7,135,000	
東宝	8,600	5,050.00	43,430,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	13,100	1,936.00	25,361,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,100	6,210.00	6,831,000	
カプコン	4,000	3,605.00	14,420,000	
伊藤忠商事	14,300	3,865.00	55,269,500	
三井物産	10,500	2,902.00	30,471,000	
住友商事	12,800	1,877.50	24,032,000	
三菱商事	12,000	3,905.00	46,860,000	
ミスミグループ本社	900	3,115.00	2,803,500	
日本マクドナルドホールディングス	9,900	4,995.00	49,450,500	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	6,900	2,222.00	15,331,800	
ＺＯＺＯ	700	2,840.00	1,988,000	
ウエルシアホールディングス	4,800	2,988.00	14,342,400	
セブン&アイ・ホールディングス	8,500	5,482.00	46,597,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	15,100	2,176.00	32,857,600	
ニトリホールディングス	3,100	13,765.00	42,671,500	
ファーストリテイリング	400	68,900.00	27,560,000	
ゆうちょ銀行	51,800	1,072.00	55,529,600	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	66,900	739.50	49,472,550	

三井住友フィナンシャルグループ	13,100	4,128.00	54,076,800	
みずほフィナンシャルグループ	30,500	1,582.50	48,266,250	
ＳＯＭＰＯホールディングス	2,600	6,069.00	15,779,400	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	8,100	4,341.00	35,162,100	
東京海上ホールディングス	6,900	8,188.00	56,497,200	
日本取引所グループ	4,900	2,117.50	10,375,750	
三菱地所	26,000	1,981.50	51,519,000	
エムスリー	2,900	4,054.00	11,756,600	
オリエンタルランド	2,400	18,590.00	44,616,000	
ユー・エス・エス	14,400	2,457.00	35,380,800	
サイバーエージェント	1,600	1,358.00	2,172,800	
日本郵政	53,800	981.50	52,804,700	
セコム	6,000	8,752.00	52,512,000	
合　計	1,168,400		3,561,555,110	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	336,070,731
国債証券	522,318,913,200
地方債証券	33,298,297,889
特殊債券	36,217,099,393
社債券	28,956,118,900
未収利息	933,475,278
前払費用	25,620,988
流動資産合計	622,085,596,379
資産合計	622,085,596,379
負債の部	

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
流動負債	
未払解約金	190,482,498
未払利息	102
流動負債合計	190,482,600
負債合計	190,482,600
純資産の部	
元本等	
元本	454,636,713,292
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	167,258,400,487
元本等合計	621,895,113,779
純資産合計	621,895,113,779
負債純資産合計	622,085,596,379

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

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 7月11日現在	
1.	計算期間の末日における受益権の総数	454,636,713,292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 100,113,000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 1.3679円
		(1万口当たり純資産額) (13,679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 7月11日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月11日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	451,320,574,372円
期中追加設定元本額	59,301,427,781円
期中一部解約元本額	55,985,288,861円
期末元本額	454,636,713,292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）	4,065,936,613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	20,900,573,551円
世界経済インデックスファンド	3,843,566,927円
ＤＣマイセレクション２５	25,871,213,196円
ＤＣマイセレクション５０	29,610,850,661円
ＤＣマイセレクション７５	8,665,510,343円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	434,150,745円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	92,291,798,748円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	66,637,014,836円
ＤＣマイセレクションＳ２５	13,128,477,927円
ＤＣマイセレクションＳ５０	14,598,417,560円
ＤＣマイセレクションＳ７５	3,321,265,308円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	794,437,200円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	2,221,292,134円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	827,888,291円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,437,194,628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）	27,191,120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

区分	2022年 7月11日現在
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	87,749,823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）	2,874,166,442円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	760,523,606円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,163,066,095円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	83,334,596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）	986,028,554円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,130,391,238円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,424,024,185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	16,485,675,146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）	166,953,500円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,412,401,105円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	66,578,840円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	38,067,359円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	61,893,576円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	38,091,652円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	75,263,538円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	118,669,108円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	10,961,270円
グローバル経済コア	231,688,046円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	31,276,672円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	18,569,012円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	29,999,790円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	15,752,593円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	3,892,501円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	2,924,052円
Ｍｙ　ＳＭＴ　国内債券インデックス（ノーロード）	362,741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）	81,776,051,607円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	86,928,675円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	13,380,530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）	287,045,873円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△7,020,597,250
地方債証券	△213,012,191
特殊債券	△234,895,422
社債券	△277,268,480
合計	△7,745,773,343

(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４２７回利付国債（２年）	3,260,000,000	3,264,303,200	
	第４２８回利付国債（２年）	230,000,000	230,312,800	
	第４２９回利付国債（２年）	950,000,000	951,273,000	
	第４３０回利付国債（２年）	990,000,000	991,415,700	
	第４３４回利付国債（２年）	1,915,000,000	1,917,815,050	
	第４３５回利付国債（２年）	3,120,000,000	3,124,836,000	
	第４３６回利付国債（２年）	720,000,000	721,166,400	
	第４３８回利付国債（２年）	290,000,000	290,455,300	
	第１３７回利付国債（５年）	6,760,000,000	6,776,494,400	
	第１３８回利付国債（５年）	6,890,000,000	6,909,360,900	
	第１３９回利付国債（５年）	5,590,000,000	5,606,993,600	
	第１４０回利付国債（５年）	4,660,000,000	4,676,263,400	
	第１４１回利付国債（５年）	7,750,000,000	7,779,760,000	
	第１４２回利付国債（５年）	4,370,000,000	4,388,659,900	
	第１４３回利付国債（５年）	4,800,000,000	4,822,608,000	
	第１４４回利付国債（５年）	6,210,000,000	6,241,050,000	
	第１４５回利付国債（５年）	5,670,000,000	5,698,973,700	

第１４６回利付国債（５年）	4,120,000,000	4,141,300,400	
第１４７回利付国債（５年）	4,170,000,000	4,176,922,200	
第１４８回利付国債（５年）	6,950,000,000	6,958,201,000	
第１４９回利付国債（５年）	5,020,000,000	5,023,112,400	
第１５０回利付国債（５年）	7,880,000,000	7,880,000,000	
第１５１回利付国債（５年）	4,000,000,000	3,997,160,000	
第１回利付国債（４０年）	400,000,000	509,244,000	
第２回利付国債（４０年）	1,130,000,000	1,382,159,500	
第３回利付国債（４０年）	550,000,000	676,247,000	
第４回利付国債（４０年）	950,000,000	1,167,683,000	
第５回利付国債（４０年）	1,070,000,000	1,264,290,600	
第６回利付国債（４０年）	1,260,000,000	1,456,182,000	
第７回利付国債（４０年）	1,240,000,000	1,372,878,400	
第８回利付国債（４０年）	1,230,000,000	1,265,473,200	
第９回利付国債（４０年）	2,050,000,000	1,550,538,000	
第１０回利付国債（４０年）	2,100,000,000	1,863,519,000	
第１１回利付国債（４０年）	1,635,000,000	1,398,202,950	
第１２回利付国債（４０年）	1,290,000,000	985,882,500	
第１３回利付国債（４０年）	2,140,000,000	1,624,752,200	
第１４回利付国債（４０年）	2,130,000,000	1,729,773,000	
第１５回利付国債（４０年）	610,000,000	541,527,500	
第３３０回利付国債（１０年）	3,910,000,000	3,952,188,900	
第３３１回利付国債（１０年）	900,000,000	907,569,000	
第３３２回利付国債（１０年）	4,800,000,000	4,848,096,000	
第３３３回利付国債（１０年）	3,320,000,000	3,358,146,800	
第３３４回利付国債（１０年）	4,260,000,000	4,316,274,600	
第３３５回利付国債（１０年）	2,310,000,000	2,339,152,200	
第３３６回利付国債（１０年）	1,110,000,000	1,125,606,600	
第３３７回利付国債（１０年）	2,800,000,000	2,825,676,000	
第３３８回利付国債（１０年）	4,560,000,000	4,618,322,400	
第３３９回利付国債（１０年）	4,750,000,000	4,815,740,000	
第３４０回利付国債（１０年）	4,830,000,000	4,901,049,300	
第３４１回利付国債（１０年）	5,340,000,000	5,404,400,400	
第３４２回利付国債（１０年）	4,760,000,000	4,784,609,200	
第３４３回利付国債（１０年）	2,670,000,000	2,683,136,400	
第３４４回利付国債（１０年）	5,900,000,000	5,927,199,000	
第３４５回利付国債（１０年）	3,780,000,000	3,795,913,800	
第３４６回利付国債（１０年）	5,750,000,000	5,771,505,000	
第３４７回利付国債（１０年）	3,850,000,000	3,862,320,000	
第３４８回利付国債（１０年）	4,740,000,000	4,752,229,200	
第３４９回利付国債（１０年）	5,000,000,000	5,009,450,000	
第３５０回利付国債（１０年）	6,630,000,000	6,637,491,900	代用有価証券 100,000,000円

第３５１回利付国債（１０年）	4,940,000,000	4,941,432,600	
第３５２回利付国債（１０年）	4,510,000,000	4,507,203,800	
第３５３回利付国債（１０年）	5,415,000,000	5,408,068,800	
第３５４回利付国債（１０年）	4,790,000,000	4,780,467,900	
第３５５回利付国債（１０年）	3,710,000,000	3,698,499,000	
第３５６回利付国債（１０年）	3,880,000,000	3,862,074,400	
第３５７回利付国債（１０年）	2,770,000,000	2,751,690,300	
第３５８回利付国債（１０年）	3,560,000,000	3,533,015,200	
第３５９回利付国債（１０年）	3,360,000,000	3,332,414,400	
第３６０回利付国債（１０年）	4,890,000,000	4,846,674,600	
第３６１回利付国債（１０年）	4,180,000,000	4,138,409,000	
第３６２回利付国債（１０年）	3,790,000,000	3,748,006,800	
第３６３回利付国債（１０年）	5,370,000,000	5,306,472,900	
第３６４回利付国債（１０年）	3,710,000,000	3,666,555,900	
第３６５回利付国債（１０年）	6,990,000,000	6,912,411,000	
第３６６回利付国債（１０年）	6,240,000,000	6,237,004,800	
第１回利付国債（３０年）	110,000,000	130,693,200	
第２回利付国債（３０年）	160,000,000	186,598,400	
第３回利付国債（３０年）	120,000,000	139,594,800	
第４回利付国債（３０年）	110,000,000	134,416,700	
第５回利付国債（３０年）	50,000,000	58,624,000	
第６回利付国債（３０年）	350,000,000	420,157,500	
第７回利付国債（３０年）	180,000,000	215,800,200	
第８回利付国債（３０年）	350,000,000	403,581,500	
第９回利付国債（３０年）	240,000,000	266,997,600	
第１０回利付国債（３０年）	160,000,000	173,075,200	
第１１回利付国債（３０年）	260,000,000	297,923,600	
第１２回利付国債（３０年）	190,000,000	226,174,100	
第１３回利付国債（３０年）	400,000,000	472,344,000	
第１４回利付国債（３０年）	800,000,000	982,488,000	
第１５回利付国債（３０年）	340,000,000	422,324,200	
第１６回利付国債（３０年）	200,000,000	248,968,000	
第１７回利付国債（３０年）	1,150,000,000	1,420,894,000	
第１８回利付国債（３０年）	345,000,000	422,873,400	
第１９回利付国債（３０年）	530,000,000	650,288,800	
第２０回利付国債（３０年）	480,000,000	602,529,600	
第２１回利付国債（３０年）	500,000,000	615,675,000	
第２２回利付国債（３０年）	540,000,000	679,660,200	
第２３回利付国債（３０年）	430,000,000	542,066,600	
第２４回利付国債（３０年）	780,000,000	984,757,800	
第２５回利付国債（３０年）	600,000,000	741,960,000	
第２６回利付国債（３０年）	1,390,000,000	1,741,822,900	

第２７回利付国債（３０年）	1,920,000,000	2,438,073,600	
第２８回利付国債（３０年）	2,090,000,000	2,657,455,900	
第２９回利付国債（３０年）	1,670,000,000	2,101,210,700	
第３０回利付国債（３０年）	1,770,000,000	2,201,384,400	
第３１回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,351,119,000	
第３２回利付国債（３０年）	1,360,000,000	1,691,826,400	
第３３回利付国債（３０年）	1,820,000,000	2,172,006,200	
第３４回利付国債（３０年）	1,795,000,000	2,198,174,950	
第３５回利付国債（３０年）	2,300,000,000	2,738,679,000	
第３６回利付国債（３０年）	2,130,000,000	2,536,680,900	
第３７回利付国債（３０年）	2,255,000,000	2,644,821,850	
第３８回利付国債（３０年）	1,410,000,000	1,627,055,400	
第３９回利付国債（３０年）	1,480,000,000	1,734,648,800	
第４０回利付国債（３０年）	1,380,000,000	1,591,126,200	
第４１回利付国債（３０年）	1,150,000,000	1,303,628,500	
第４２回利付国債（３０年）	1,160,000,000	1,314,082,800	
第４３回利付国債（３０年）	1,340,000,000	1,516,947,000	
第４４回利付国債（３０年）	1,270,000,000	1,436,662,100	
第４５回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,570,521,600	
第４６回利付国債（３０年）	1,780,000,000	1,939,185,400	
第４７回利付国債（３０年）	1,560,000,000	1,729,806,000	
第４８回利付国債（３０年）	1,710,000,000	1,823,321,700	
第４９回利付国債（３０年）	1,700,000,000	1,810,211,000	
第５０回利付国債（３０年）	1,590,000,000	1,493,343,900	
第５１回利付国債（３０年）	1,710,000,000	1,422,463,500	
第５２回利付国債（３０年）	1,680,000,000	1,462,238,400	
第５３回利付国債（３０年）	1,320,000,000	1,172,529,600	
第５４回利付国債（３０年）	1,720,000,000	1,596,555,600	
第５５回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,333,267,200	
第５６回利付国債（３０年）	1,480,000,000	1,366,794,800	
第５７回利付国債（３０年）	1,410,000,000	1,298,793,300	
第５８回利付国債（３０年）	2,350,000,000	2,159,062,500	
第５９回利付国債（３０年）	1,410,000,000	1,260,554,100	
第６０回利付国債（３０年）	1,630,000,000	1,523,430,600	
第６１回利付国債（３０年）	1,460,000,000	1,293,983,400	
第６２回利付国債（３０年）	480,000,000	401,923,200	
第６３回利付国債（３０年）	1,630,000,000	1,322,777,600	
第６４回利付国債（３０年）	1,790,000,000	1,447,429,800	
第６５回利付国債（３０年）	1,505,000,000	1,219,922,900	
第６６回利付国債（３０年）	1,030,000,000	833,620,200	
第６７回利付国債（３０年）	1,865,000,000	1,582,825,500	
第６８回利付国債（３０年）	1,490,000,000	1,261,791,600	
第６９回利付国債（３０年）	1,340,000,000	1,165,786,600	

第７０回利付国債（３０年）	1,780,000,000	1,545,520,600	
第７１回利付国債（３０年）	1,430,000,000	1,239,152,200	
第７２回利付国債（３０年）	1,150,000,000	994,508,500	
第７３回利付国債（３０年）	1,870,000,000	1,615,623,900	
第７４回利付国債（３０年）	1,740,000,000	1,626,430,200	
第６４回利付国債（２０年）	320,000,000	327,654,400	
第６５回利付国債（２０年）	220,000,000	226,331,600	
第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	339,022,200	
第６７回利付国債（２０年）	130,000,000	134,349,800	
第６８回利付国債（２０年）	190,000,000	197,320,700	
第６９回利付国債（２０年）	390,000,000	404,367,600	
第７０回利付国債（２０年）	400,000,000	419,268,000	
第７１回利付国債（２０年）	200,000,000	208,858,000	
第７２回利付国債（２０年）	630,000,000	660,076,200	
第７３回利付国債（２０年）	360,000,000	378,266,400	
第７４回利付国債（２０年）	200,000,000	210,638,000	
第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	137,614,100	
第７６回利付国債（２０年）	270,000,000	284,358,600	
第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	306,205,200	
第７８回利付国債（２０年）	170,000,000	179,865,100	
第７９回利付国債（２０年）	270,000,000	286,461,900	
第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	234,062,400	
第８１回利付国債（２０年）	390,000,000	415,689,300	
第８２回利付国債（２０年）	600,000,000	641,442,000	
第８３回利付国債（２０年）	290,000,000	311,491,900	
第８４回利付国債（２０年）	470,000,000	503,210,200	
第８５回利付国債（２０年）	290,000,000	312,918,700	
第８６回利付国債（２０年）	510,000,000	554,069,100	
第８７回利付国債（２０年）	1,830,000,000	1,981,377,600	
第８８回利付国債（２０年）	420,000,000	458,505,600	
第８９回利付国債（２０年）	350,000,000	380,709,000	
第９０回利付国債（２０年）	630,000,000	688,382,100	
第９１回利付国債（２０年）	450,000,000	493,591,500	
第９２回利付国債（２０年）	880,000,000	961,857,600	
第９３回利付国債（２０年）	410,000,000	448,015,200	
第９４回利付国債（２０年）	610,000,000	669,420,100	
第９５回利付国債（２０年）	610,000,000	678,130,900	
第９６回利付国債（２０年）	1,590,000,000	1,751,893,800	
第９７回利付国債（２０年）	900,000,000	1,000,197,000	
第９８回利付国債（２０年）	440,000,000	486,706,000	
第９９回利付国債（２０年）	1,290,000,000	1,432,325,700	
第１００回利付国債（２０年）	480,000,000	537,763,200	

第１０１回利付国債（２０年）	715,000,000	809,144,050	
第１０２回利付国債（２０年）	1,260,000,000	1,431,952,200	
第１０３回利付国債（２０年）	400,000,000	452,224,000	
第１０４回利付国債（２０年）	160,000,000	179,000,000	
第１０５回利付国債（２０年）	1,180,000,000	1,324,809,600	
第１０６回利付国債（２０年）	380,000,000	428,970,600	
第１０７回利付国債（２０年）	760,000,000	856,451,600	
第１０８回利付国債（２０年）	870,000,000	969,284,400	
第１０９回利付国債（２０年）	520,000,000	581,214,400	
第１１０回利付国債（２０年）	1,100,000,000	1,244,078,000	
第１１１回利付国債（２０年）	970,000,000	1,107,710,900	
第１１２回利付国債（２０年）	790,000,000	896,721,100	
第１１３回利付国債（２０年）	2,020,000,000	2,299,426,600	
第１１４回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,658,483,400	
第１１５回利付国債（２０年）	700,000,000	803,824,000	
第１１６回利付国債（２０年）	1,490,000,000	1,716,912,100	
第１１７回利付国債（２０年）	1,080,000,000	1,236,297,600	
第１１８回利付国債（２０年）	660,000,000	753,139,200	
第１１９回利付国債（２０年）	530,000,000	596,504,400	
第１２０回利付国債（２０年）	1,570,000,000	1,742,464,500	
第１２１回利付国債（２０年）	1,500,000,000	1,705,515,000	
第１２２回利付国債（２０年）	940,000,000	1,061,213,000	
第１２３回利付国債（２０年）	1,870,000,000	2,164,020,100	
第１２４回利付国債（２０年）	610,000,000	700,853,400	
第１２５回利付国債（２０年）	1,770,000,000	2,069,625,600	
第１２６回利付国債（２０年）	730,000,000	841,127,900	
第１２７回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,166,574,000	
第１２８回利付国債（２０年）	970,000,000	1,112,871,300	
第１２９回利付国債（２０年）	740,000,000	842,504,800	
第１３０回利付国債（２０年）	1,285,000,000	1,468,575,100	
第１３１回利付国債（２０年）	1,000,000,000	1,133,850,000	
第１３２回利付国債（２０年）	1,160,000,000	1,316,948,000	
第１３３回利付国債（２０年）	1,230,000,000	1,407,784,200	
第１３４回利付国債（２０年）	830,000,000	953,935,600	
第１３５回利付国債（２０年）	1,030,000,000	1,174,035,200	
第１３６回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,639,022,000	
第１３７回利付国債（２０年）	1,060,000,000	1,209,067,800	
第１３８回利付国債（２０年）	620,000,000	695,162,600	
第１３９回利付国債（２０年）	830,000,000	938,671,900	
第１４０回利付国債（２０年）	2,420,000,000	2,763,228,600	
第１４１回利付国債（２０年）	1,600,000,000	1,829,552,000	
第１４２回利付国債（２０年）	980,000,000	1,130,537,800	
第１４３回利付国債（２０年）	1,920,000,000	2,177,337,600	

	第１４４回利付国債（２０年）	1,150,000,000	1,292,232,000	
	第１４５回利付国債（２０年）	2,675,000,000	3,065,175,500	
	第１４６回利付国債（２０年）	2,700,000,000	3,095,874,000	
	第１４７回利付国債（２０年）	2,310,000,000	2,624,737,500	
	第１４８回利付国債（２０年）	2,050,000,000	2,306,926,500	
	第１４９回利付国債（２０年）	2,660,000,000	2,995,133,400	
	第１５０回利付国債（２０年）	2,730,000,000	3,042,039,000	
	第１５１回利付国債（２０年）	2,325,000,000	2,534,901,000	
	第１５２回利付国債（２０年）	2,860,000,000	3,117,428,600	
	第１５３回利付国債（２０年）	2,440,000,000	2,688,660,400	
	第１５４回利付国債（２０年）	2,790,000,000	3,039,202,800	
	第１５５回利付国債（２０年）	2,800,000,000	2,976,316,000	
	第１５６回利付国債（２０年）	2,620,000,000	2,573,233,000	
	第１５７回利付国債（２０年）	2,950,000,000	2,810,848,500	
	第１５８回利付国債（２０年）	2,610,000,000	2,584,291,500	
	第１５９回利付国債（２０年）	2,480,000,000	2,484,935,200	
	第１６０回利付国債（２０年）	1,890,000,000	1,916,800,200	
	第１６１回利付国債（２０年）	1,990,000,000	1,985,900,600	
	第１６２回利付国債（２０年）	630,000,000	626,944,500	
	第１６３回利付国債（２０年）	2,180,000,000	2,163,170,400	
	第１６４回利付国債（２０年）	1,320,000,000	1,286,313,600	
	第１６５回利付国債（２０年）	2,150,000,000	2,088,338,000	
	第１６６回利付国債（２０年）	1,820,000,000	1,817,342,800	
	第１６７回利付国債（２０年）	2,210,000,000	2,132,252,200	
	第１６８回利付国債（２０年）	1,410,000,000	1,333,831,800	
	第１６９回利付国債（２０年）	1,990,000,000	1,844,312,100	
	第１７０回利付国債（２０年）	2,240,000,000	2,067,587,200	
	第１７１回利付国債（２０年）	1,670,000,000	1,535,147,500	
	第１７２回利付国債（２０年）	2,410,000,000	2,244,963,200	
	第１７３回利付国債（２０年）	2,350,000,000	2,180,283,000	
	第１７４回利付国債（２０年）	2,480,000,000	2,291,520,000	
	第１７５回利付国債（２０年）	2,030,000,000	1,901,561,900	
	第１７６回利付国債（２０年）	2,850,000,000	2,659,107,000	
	第１７７回利付国債（２０年）	2,390,000,000	2,182,500,200	
	第１７８回利付国債（２０年）	1,920,000,000	1,781,184,000	
	第１７９回利付国債（２０年）	2,975,000,000	2,750,774,250	
	第１８０回利付国債（２０年）	2,510,000,000	2,449,584,300	
国債証券合計		509,605,000,000	522,318,913,200	
地方債証券	第２回東京都公募公債（東京ソーシャルボンド（５年））	100,000,000	100,026,000	
	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	103,788,000	
	第５回東京都公募公債（東京グリーンボンド（３０年））	100,000,000	85,610,000	

第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	105,319,000	
第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	124,141,000	
第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	121,330,000	
第１３回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	116,660,000	
第１５回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	114,151,000	
第１６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	222,698,000	
第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	111,857,000	
第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	112,882,000	
第１９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	85,749,000	
第２６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	226,474,000	
第２７回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	226,568,000	
第３３回東京都公募公債（５年）	200,000,000	199,758,000	
第７２６回東京都公募公債	200,000,000	202,078,000	
第７２８回東京都公募公債	100,000,000	100,923,000	
第７５１回東京都公募公債	100,000,000	101,116,000	
第７６５回東京都公募公債	100,000,000	100,489,000	
第７７０回東京都公募公債	100,000,000	100,269,000	
第７８１回東京都公募公債	300,000,000	299,379,000	
第８００回東京都公募公債	200,000,000	196,862,000	
平成２７年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	100,582,000	
平成２８年度第１回北海道公募公債	100,000,000	100,050,000	
平成２８年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	100,599,000	
平成３０年度第１４回北海道公募公債	200,000,000	199,628,000	
第２９回１号宮城県公募公債（１０年）	100,000,000	100,864,000	
第４回神奈川県公募公債（３０年）	200,000,000	255,238,000	
第１１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	112,645,000	
第１５回神奈川県公募公債（２０年）	200,000,000	226,510,000	
第１７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	114,491,000	
第２０回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	112,910,000	
第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	110,511,000	
第７８回神奈川県公募公債（５年）	200,000,000	199,964,000	
第２０１回神奈川県公募公債	200,250,000	201,908,070	
第２１０回神奈川県公募公債	200,000,000	202,104,000	
第２１５回神奈川県公募公債	100,000,000	101,379,000	
第２１８回神奈川県公募公債	100,000,000	100,515,000	
第２２６回神奈川県公募公債	100,000,000	100,419,000	
第２２７回神奈川県公募公債	100,000,000	100,269,000	
第２４３回神奈川県公募公債	200,000,000	196,790,000	
第６回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	226,632,000	
第７回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	226,900,000	
第１０回大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	113,339,000	
第３７５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	100,924,000	

	第３７７回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	100,924,000	
	第３８９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,164,000	
	第３９５回大阪府公募公債（１０年）	151,000,000	152,707,810	
	第３９９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,533,000	
	第４０２回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,495,000	
	第４０７回大阪府公募公債（１０年）	156,000,000	156,109,200	
	第４１０回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	199,362,000	
	第４３９回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	199,602,000	
	第４４０回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	99,844,000	
	第４６５回大阪府公募公債（１０年）	160,000,000	157,187,200	
	第４６８回大阪府公募公債（１０年）	182,000,000	178,749,480	
	第４６９回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	196,402,000	
	平成２１年度第３回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	113,598,000	
	平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	113,144,000	
	平成２５年度第７回京都府公募公債	100,000,000	100,941,000	
	平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	101,550,000	
	平成２８年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	95,912,000	
	平成２９年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	99,108,000	
	令和２年度第１２回京都府公募公債	140,500,000	138,190,180	
	第２回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	111,455,000	
	第３回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	101,477,000	
	第６回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	106,861,000	
	第７回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	105,705,000	
	第８回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	105,691,000	
	第９回兵庫県公募公債（２０年）	400,000,000	456,848,000	
	平成２５年度第７回兵庫県公募公債	100,000,000	100,900,000	
	平成２６年度第１７回兵庫県公募公債	100,000,000	101,156,000	
	第３５回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	97,415,000	
	令和元年度第１７回兵庫県公募公債	300,000,000	296,718,000	
	第９回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	107,939,000	
	第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	90,450,000	
	第１５回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	113,277,000	
	第１８回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	111,390,000	
	平成２６年度第３回静岡県公募公債	100,000,000	101,247,000	
	平成２９年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	100,318,000	
	平成２９年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	100,417,000	
	平成２９年度第１１回静岡県公募公債	100,000,000	100,360,000	
	令和２年度第１１回静岡県公募公債	310,000,000	307,036,400	
	平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	113,906,000	
		100,000,000	101,172,000	

	平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）			
	平成２６年度第５回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	202,426,000	
	平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,170,000	
	平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	99,960,000	
	平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	200,800,000	
	平成２９年度第１２回愛知県公募公債（２０年）	300,000,000	295,344,000	
	平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	99,999,000	
	平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年）	100,000,000	89,247,000	
	令和元年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	196,920,000	
	令和２年度第７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	98,718,000	
	令和３年度第６回愛知県公募公債（３０年）	200,000,000	170,452,000	
	平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	113,104,000	
	平成２１年度第１回広島県公募公債（２０年）	200,000,000	226,712,000	
	平成２５年度第４回広島県公募公債	100,000,000	100,911,000	
	平成２７年度第４回広島県公募公債	125,230,000	127,048,339	
	平成２９年度第１回広島県公募公債	100,000,000	100,266,000	
	令和２年度第７回広島県公募公債	390,000,000	386,205,300	
	第３回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	111,290,000	
	第６回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	112,580,000	
	第６回埼玉県公募公債（３０年）	100,000,000	94,603,000	
	第７回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	227,970,000	
	第８回埼玉県公募公債（１５年）	200,000,000	193,580,000	
	第１０回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	226,510,000	
	第１８回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	192,296,000	
	平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	100,000,000	101,092,000	
	平成２７年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	101,446,000	
	平成２８年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	100,021,000	
	平成２８年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	100,663,000	
	平成２９年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	100,294,000	
	令和２年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	98,507,000	
	令和２年度第８回埼玉県公募公債	100,000,000	98,355,000	
	令和３年度第８回埼玉県公募公債	150,000,000	147,054,000	
	平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	111,366,000	
	平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	111,638,000	
		100,000,000	105,459,000	

平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）			
平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	114,543,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	106,118,000	
平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	119,927,000	
平成２６年度第８回福岡県公募公債	100,000,000	101,034,000	
平成２６年度第４回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	108,699,000	
平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	101,429,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	89,247,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	97,982,000	
令和２年度第１回福岡県公募公債	300,000,000	296,388,000	
令和３年度第２回福岡県公募公債	100,000,000	98,523,000	
令和３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	95,660,000	
第５回千葉県公募公債（２０年）	200,000,000	225,160,000	
第６回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	113,505,000	
第１３回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	113,277,000	
平成２５年度第５回千葉県公募公債	100,000,000	100,932,000	
平成２５年度第８回千葉県公募公債	300,000,000	302,715,000	
平成２５年度第９回千葉県公募公債	100,000,000	101,005,000	
平成２６年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	101,074,000	
平成２７年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	101,500,000	
平成２８年度第４回千葉県公募公債	100,000,000	100,021,000	
平成２８年度第６回千葉県公募公債	120,000,000	120,436,800	
令和元年度第７回千葉県公募公債	300,000,000	295,152,000	
令和２年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	98,717,000	
令和３年度第１回長野県公募公債（１０年）	300,000,000	296,472,000	
平成３０年度第３回茨城県公募公債	350,000,000	350,077,000	
第１回群馬県公募公債（２０年）	200,000,000	224,700,000	
平成２９年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	100,251,000	
第１２５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,820,000	
第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,864,000	
第１２８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,892,000	
第１３０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,312,000	
第１３１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,045,000	
第１３２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,297,000	
第１３４回共同発行市場公募地方債	112,000,000	113,379,840	
第１３５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,261,000	
第１３６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,206,000	
第１３７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,158,000	

第１４０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,280,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,122,000	
第１４６回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,024,000	
第１４８回共同発行市場公募地方債	125,400,000	127,382,574	
第１５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,520,000	
第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,150,000	
第１５７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,051,000	
第１５９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,920,000	
第１６０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,798,000	
第１６１回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,752,000	
第１６４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,828,000	
第１６６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,364,000	
第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,645,000	
第１７１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,540,000	
第１７４回共同発行市場公募地方債	194,300,000	194,245,596	
第１７５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,304,000	
第１８１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	299,910,000	
第２１９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,392,000	
平成２９年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	100,300,000	
第１３回大阪市公募公債（２０年）	200,000,000	227,484,000	
第１５回大阪市公募公債（３０年）	100,000,000	84,939,000	
第２２回大阪市公募公債（２０年）	300,000,000	289,344,000	
第２４回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	99,661,000	
平成２５年度第８回大阪市公募公債	100,000,000	101,180,000	
令和３年度第２回大阪市公募公債	200,000,000	197,132,000	
第１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	124,224,000	
第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	126,017,000	
第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	111,765,000	
第１１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	113,039,000	
第４９９回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	100,538,000	
第５１２回名古屋市公募公債（１０年）	300,000,000	296,271,000	
平成２８年度第６回京都市公募公債	200,000,000	200,728,000	
平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	120,000,000	131,620,800	
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	200,000,000	225,518,000	
平成２１年度第１１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	114,345,000	
平成２４年度第１２回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	113,586,000	
令和２年度第９回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	84,820,000	
令和３年度第６回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	85,123,000	
第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	106,307,000	
第２０回横浜市公募公債（２０年）	300,000,000	339,066,000	

	平成２８年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	100,341,000	
	平成２９年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	100,522,000	
	平成３０年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	100,085,000	
	平成３０年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	100,490,000	
	第３０回横浜市公募公債（２０年）	200,000,000	220,520,000	
	令和２年度第１回横浜市公募公債	300,000,000	296,283,000	
	令和３年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	98,566,000	
	平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年）	100,000,000	106,370,000	
	平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,001,000	
	第１１回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	112,342,000	
	第８９回川崎市公募公債	100,000,000	100,291,000	
	第９３回川崎市公募公債	100,000,000	98,360,000	
	平成２６年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	101,045,000	
	平成２７年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	101,489,000	
	平成２８年度第１回北九州市公募公債	100,000,000	100,053,000	
	平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	113,235,000	
	平成２５年度第６回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	111,702,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	200,000,000	202,386,000	
	平成３０年度第５回福岡市公募公債（５年）	200,000,000	200,042,000	
	平成３０年度第１０回福岡市公募公債（５年）	100,000,000	100,014,000	
	平成２５年度第３回広島市公募公債	150,000,000	151,593,000	
	平成２６年度第２回広島市公募公債	100,000,000	101,070,000	
	平成２８年度第４回広島市公募公債	105,000,000	105,306,600	
	平成２９年度第６回広島市公募公債	170,000,000	170,520,200	
	令和元年度第６回広島市公募公債	550,000,000	542,547,500	
	令和２年度第３回広島市公募公債（５年）	200,000,000	199,868,000	
	令和元年度第５回千葉市公募公債	200,000,000	196,768,000	
	平成２５年度第４回福井県公募公債	100,000,000	101,225,000	
	平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年）	200,000,000	201,584,000	
	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	111,097,000	
地方債証券合計		32,361,680,000	33,298,297,889	
特殊債券	第３７回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,092,000	
	第５２回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,027,000	
	第１２９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	74,948,000	
	第２１回道路債券	100,000,000	124,241,000	
	第２７回道路債券	400,000,000	416,152,000	
	第２８回道路債券	200,000,000	251,394,000	

第３３回道路債券	200,000,000	254,462,000	
第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,276,000	
第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	133,133,000	
第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,876,000	
第４２回道路債券	100,000,000	105,879,000	
第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,277,000	
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	125,236,000	
第９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	226,644,000	
第９４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	228,394,000	
第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,724,000	
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	121,741,000	
第１１５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,857,000	
第１１８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,082,000	
第１２５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,147,000	
第１３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,463,000	
第１３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,970,000	
第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,064,000	
第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,685,000	
第１５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	215,962,000	
第１８１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,223,000	
第１８８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	589,650,000	
第２００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	149,481,480	
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	100,939,000	
第２０４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	265,800,000	268,343,706	
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	202,090,000	
第２０８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	92,241,000	
第２０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	533,000,000	539,369,350	

第２１３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,420,000	
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	222,946,000	
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	103,267,860	
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	101,306,000	
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	101,257,000	
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	221,272,000	
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	101,267,000	
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	101,172,000	
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	302,532,000	
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	107,779,000	
第２４２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	216,862,000	
第２６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,170,000	
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	100,456,000	
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	83,888,000	
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	106,721,800	
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	205,422,300	
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	100,305,000	
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	200,524,000	
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	100,229,000	
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	120,368,400	
第３４８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,882,000	
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	293,532,000	
第３６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	214,590,640	
第３８５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,596,000	
第３９３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,281,000	
第２回公営企業債券（３０年）	300,000,000	362,748,000	
第３回地方公共団体金融機構債券（１５年）	100,000,000	106,006,000	
第５回公営企業債券（３０年）	300,000,000	376,362,000	

第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	103,687,000	
第７回公営企業債券（３０年）	200,000,000	251,380,000	
第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	41,508,800	
第８回公営企業債券（３０年）	100,000,000	123,765,000	
第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	226,870,000	
第１０回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	222,594,000	
第１１回政府保証地方公共団体金融機構債券（４年）	600,000,000	600,150,000	
第１１回地方公共団体金融機構債券（３０年）	200,000,000	166,716,000	
第１８回公営企業債券（２０年）	100,000,000	109,755,000	
第１９回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	227,386,000	
第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	113,120,000	
第３４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	500,000,000	562,890,000	
第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,934,000	
第５４回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	105,978,600	
第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	707,630,000	
第５８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,115,000	
第５８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,222,000	
第６５回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,483,000	
第６７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,159,000	
第６９回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,179,000	
第７６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,852,000	
Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,045,000	
第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,262,000	
第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,003,000	
第８３回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,026,000	
第８８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,895,000	
第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,092,000	
第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	251,652,600	
Ｆ９５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,360,000	
第９８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,299,000	
第９９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,253,000	
第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,335,500	
Ｆ１０７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,647,000	
第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	156,413,400	
第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,274,000	
第１１６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,425,000	
	100,000,000	98,526,000	

第１２０回政府保証地方公共団体金融機構債券			
Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,162,000	
Ｆ１４６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,072,000	
Ｆ２０２回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,578,000	
Ｆ２０６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,749,000	
Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,804,000	
Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,837,000	
第２９回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,849,000	
第７回阪神高速道路債券	100,000,000	105,714,000	
第１９回水資源債券（サステナビリティボンド）	200,000,000	199,832,000	
第４回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	113,428,000	
第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	115,458,000	
第４０回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,003,780	
第４６回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,299,000	
第４７回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	209,724,900	
第５３回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	187,445,060	
第５４回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	220,057,200	
第８７回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,902,000	
第８８回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,948,000	
第８９回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,986,000	
第１１７回都市再生債券	200,000,000	207,292,000	
第１５９回都市再生債券	200,000,000	141,444,000	
第１６１回都市再生債券	100,000,000	77,936,000	
第１７１回都市再生債券	200,000,000	166,218,000	
第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	105,321,000	
第１６回政府保証民間都市開発債券	180,000,000	181,650,600	
第６２回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	98,722,000	
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,018,000	10,062,580	
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	10,432,000	10,538,823	
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	10,553,000	10,684,595	
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	130,851,000	129,740,075	
第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	91,356,000	90,526,487	
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,522,000	10,641,845	
第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,409,000	11,613,335	
第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	162,726,000	160,922,995	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,252,000	11,447,109	
第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	185,505,000	183,110,130	

第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	66,172,000	65,450,063	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,673,000	11,912,996	
第８回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	222,702,000	219,486,183	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	10,008,000	10,050,534	
第９回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	153,832,000	151,710,656	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,830,000	12,122,201	
第１２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,318,000	
第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,628,000	16,390,490	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,776,000	16,591,934	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,616,000	18,644,598	
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,474,000	20,516,248	
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,337,000	22,603,137	
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,884,000	23,154,803	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,434,000	47,944,228	
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,264,000	10,387,065	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,629,000	21,677,365	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,462,000	10,563,272	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,061,000	10,109,896	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,931,000	21,979,433	
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,607,000	21,671,763	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,397,000	20,346,483	
第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,345,000	11,588,690	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,136,000	42,916,366	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,808,000	22,780,200	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,001,000	11,193,517	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,787,000	30,042,688	
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,601,000	28,789,223	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,824,000	29,043,804	
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,204,000	63,742,129	
第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,572,000	77,175,308	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,386,000	39,681,527	
第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,145,000	40,794,178	
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,390,000	41,097,162	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,421,000	35,804,379	
第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,757,000	34,858,153	
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,320,000	41,061,876	
第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	172,345,500	
第７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	103,035,000	106,398,062	
第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,168,000	143,685,393	

第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,875,000	41,075,237	
第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,220,000	42,481,332	
第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,190,000	43,354,865	
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,842,000	
第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	132,975,000	136,566,654	
第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,776,000	46,825,185	
第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,958,000	97,462,621	
第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,584,000	54,578,519	
第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,352,000	58,225,470	
第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,800,000	57,946,224	
第９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,055,000	180,238,066	
第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	118,858,000	121,506,156	
第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,585,000	58,755,127	
第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,366,000	63,618,932	
第１０８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,624,000	67,829,334	
第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,321,000	73,625,355	
第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,945,000	73,071,709	
第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,288,000	73,716,725	
第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,774,000	74,510,047	
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,206,000	74,801,391	
第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,075,000	76,575,554	
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,446,000	77,015,400	
第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,388,000	76,739,488	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,303,000	76,649,789	
第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,046,000	77,407,583	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,202,000	156,534,550	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,186,000	77,491,708	
第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,664,000	158,554,335	
第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,358,000	78,632,667	
第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,256,000	157,485,073	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,566,000	79,792,566	

第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	162,130,000	160,259,019	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	163,082,000	161,157,632	
第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,333,000	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,362,000	81,788,760	
第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,995,000	81,600,604	
第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,183,000	81,095,718	
第１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,382,000	166,358,531	
第１４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,957,000	83,335,170	
第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,244,000	82,757,935	
第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,980,000	167,668,117	
第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,716,000	84,411,088	
第１４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	261,909,000	253,567,198	
第１４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	175,554,000	169,913,449	
第１５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,466,000	87,784,039	
第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,940,000	87,998,195	
第１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,924,000	182,259,245	
第１６２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,612,000	92,097,357	
第１６３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,238,000	184,137,338	
第１６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,646,000	185,148,503	
第１６５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,833,000	92,335,425	
第１６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,882,000	186,611,638	
第１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,298,000	187,742,297	
第１６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,550,000	94,159,747	
第１７１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,924,000	94,817,841	
第１７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	290,529,000	284,160,604	
第１７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,267,000	95,245,791	
第１７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,734,000	97,916,482	

	第１８１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,807,000	99,002,555	
	第１９２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	93,580,000	
	第３２０回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	85,442,000	
	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	105,878,000	
	第２４回沖縄振興開発金融公庫債券	600,000,000	600,708,000	
	い第８２３号商工債	200,000,000	200,364,000	
	い第８２９号商工債	200,000,000	200,258,000	
	い第８３２号商工債	200,000,000	199,980,000	
	い第８３３号商工債	100,000,000	99,944,000	
	い第８４３号商工債	200,000,000	200,006,000	
	い第８４７号商工債	100,000,000	99,879,000	
	い第８５０号商工債	200,000,000	199,598,000	
	第３５０回信金中金債（５年）	100,000,000	100,061,000	
	第３６０回信金中金債（５年）	200,000,000	199,786,000	
	第３７６回信金中金債（５年）	100,000,000	99,780,000	
	第３７９回信金中金債（５年）	100,000,000	99,625,000	
	第３８５回信金中金債（５年）	100,000,000	99,472,000	
	第２５４号商工債（３年）	300,000,000	299,949,000	
	第２回信金中金債（１０年）	100,000,000	101,393,000	
	第２１回国際協力機構債券	100,000,000	113,612,000	
	第５３回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,128,000	
	第６４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,556,000	
	第６７回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	198,042,000	
	第７３回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	494,010,000	
	第８６回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,475,000	
	第６０回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,934,000	
	第６３回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,930,000	
	第６６回西日本高速道路株式会社社債	800,000,000	800,600,000	
	第６０回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,794,000	
	第９２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,836,000	
	第１２７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	194,568,000	
特殊債券合計		35,397,427,000	36,217,099,393	
社債券	第２４回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	99,832,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	300,000,000	298,593,000	
	第２回Ｂ・Ｐ・Ｃ・Ｅ・Ｓ・Ａ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,605,000	
	第８回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,048,000	

第１４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,057,000	
第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,901,000	
第１３回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,576,000	
第１回バンコ・サンタンデール・エセ・アー円貨社債	400,000,000	398,324,000	
第３９回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,722,000	
第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,701,000	
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	199,666,000	
第１１回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,044,000	
第２４回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	298,920,000	
第２５回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	97,974,000	
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	100,112,000	
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	199,656,000	
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	100,149,000	
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	199,712,000	
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	101,057,000	
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	198,472,000	
第８回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,559,000	
第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,949,000	
第６回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,676,000	
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	99,136,000	
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	99,965,000	
第２５回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,866,000	
第１４回株式会社セブン＆アイ・ホールディングス無担保社債	200,000,000	199,338,000	
第１３回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,882,000	
第３５回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,985,000	
第２５回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	100,045,000	
第４回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,598,000	
第２４回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,769,000	
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	198,724,000	
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	199,996,000	

	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	99,332,000	
	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	91,904,000	
	第４回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,516,000	
	第７回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,612,000	
	第４回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,041,000	
	第６回株式会社電通無担保社債	200,000,000	199,110,000	
	第１６回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	291,573,000	
	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	100,045,000	
	第１３回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,837,000	
	第１５回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,531,000	
	第１９回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	94,591,000	
	第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	101,687,000	
	第４回ＥＮＥＯＳホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,633,000	
	第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,235,000	
	第１１回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,879,000	
	第１３回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,027,000	
	第１４回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,655,000	
	第２回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,949,000	
	第３４回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,213,000	
	第８回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,773,000	
	第１７回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	106,156,000	
	第２０回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,771,000	
	第１回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,530,000	
	第２１回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,041,000	
	第２２回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	98,866,000	
	第１６回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,196,000	
	第１７回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,332,000	
	第２０回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,890,000	
	第２１回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,753,000	
	第２３回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	98,205,000	
	第１８回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,665,000	
	第１９回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,655,000	
	第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,065,000	
	第３５回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,747,000	
	第１１回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,982,000	
	第３０回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,620,000	
	第２７回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	196,726,000	
		100,000,000	100,017,000	

第１回明治安田生命２０１８基金特定目的会社特定社債			
第８回楽天カード株式会社無担保社債	100,000,000	95,228,000	
第１回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,863,000	
第６回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	91,208,000	
第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,170,000	
第１０８回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,774,000	
第７０回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	113,316,000	
第７３回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	197,364,000	
第５３回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,623,000	
第５６回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,746,000	
第６０回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,709,000	
第２２回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	99,205,000	
第２３回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	115,566,000	
第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	109,994,000	
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	101,025,000	
第１１回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,004,000	
第１回みずほＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	300,000,000	303,006,000	
第３回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,654,000	
第４回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,578,000	
第９回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,619,000	
第１６回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,678,000	
第１８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	198,452,000	
第３４回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	98,003,000	
第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,812,000	
第６４回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,762,000	
第６５回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,884,000	
第６７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,754,000	
第９４回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,983,000	
第４１回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,006,000	
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	99,414,000	
第１７回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,153,000	
第３０回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,381,000	
第３２回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,009,000	

第３５回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,794,000	
第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,325,000	
第７７回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,042,000	
第８０回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	97,682,000	
第８７回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,600,000	
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	200,012,000	
第４４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,973,000	
第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,156,000	
第５６回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,802,000	
第６４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,585,000	
第３１回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,518,000	
第１回野村ホールディングス株式会社無担保社債	800,000,000	799,808,000	
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	99,251,000	
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	199,490,000	
第６６回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,454,000	
第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,600,000	
第１３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	93,051,000	
第１３５回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	97,876,000	
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,299,000	
第１００回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,349,000	
第１０９回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	97,500,000	
第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,885,000	
第１２４回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,766,000	
第１３２回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	98,848,000	
第８６回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	88,310,000	
第４５回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	92,843,000	
第４６回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,642,000	
第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,216,000	
第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	92,753,000	
第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	83,314,000	
第４２回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	93,477,000	
第５１回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,626,000	
第４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,503,000	
第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	225,968,000	
第１１５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,517,000	

第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	95,669,000	
第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	90,449,000	
第１４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,904,000	
第１５９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	86,056,000	
第１６５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	91,736,000	
第１７２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	80,915,000	
第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	112,075,000	
第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	85,032,000	
第５０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	93,596,000	
第５９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	500,210,000	
第７５回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	91,441,000	
第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	121,881,000	
第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,215,000	
第７２回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,284,000	
第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	89,314,000	
第３７回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	76,602,000	
第４０回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	70,498,000	
第５４回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	82,820,000	
第５６回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	91,553,000	
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	167,090,000	
第６回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,482,000	
第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	100,939,000	
第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	99,645,000	
第１１回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	396,440,000	
第３１回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	187,680,000	
第３３回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	96,137,000	
第３６回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	95,216,000	
第５０７回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,104,000	
第５１１回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,107,000	
第５１９回中部電力株式会社社債	100,000,000	98,590,000	
第５４０回中部電力株式会社社債	100,000,000	90,578,000	
第５０８回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,533,000	
第５１０回関西電力株式会社社債	200,000,000	198,972,000	
第５１１回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,018,000	
第５２４回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,641,000	
第５３６回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,651,000	
第５３８回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,183,000	

第５５０回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,169,000	
第３８５回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,481,000	
第３９８回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,411,000	
第４００回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,910,000	
第４１６回中国電力株式会社社債	200,000,000	195,500,000	
第４２５回中国電力株式会社社債	100,000,000	96,889,000	
第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,671,000	
第３２２回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,274,000	
第３３０回北陸電力株式会社社債	200,000,000	195,302,000	
第４７１回東北電力株式会社社債	126,000,000	127,845,900	
第４８１回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,631,000	
第４９６回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,836,000	
第５０８回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,340,000	
第５２１回東北電力株式会社社債	200,000,000	194,808,000	
第５２７回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,857,000	
第５３５回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,156,000	
第３０９回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,250,000	
第３１４回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,725,000	
第４４９回九州電力株式会社社債	200,000,000	198,926,000	
第４６５回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,143,000	
第４６８回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,412,000	
第４８４回九州電力株式会社社債	200,000,000	194,210,000	
第４８９回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,258,000	
第４９４回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,574,000	
第３２６回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,621,000	
第３４０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,696,000	
第３５０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	95,495,000	
第４４回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	96,311,000	
第５０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,188,000	
第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,361,000	
第７７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,286,000	
第３１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	198,816,000	
第３８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	299,679,000	
第３９回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,424,000	
第４１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	298,959,000	
第４２回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,004,000	
第４４回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,012,000	
第４５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,754,000	

	第４８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	280,980,000	
	第９回株式会社ＪＥＲＡ無担保社債	100,000,000	98,179,000	
	第６４回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	85,399,000	
	第６５回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	196,984,000	
	第４１回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	196,470,000	
	第４２回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	91,233,000	
	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	199,686,000	
社債券合計		29,326,000,000	28,956,118,900	
合計			620,790,429,382	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	24,414,702
コール・ローン	1,888,116,338
国債証券	64,414,025,010
派生商品評価勘定	675,619,803
未収入金	9,330
未収利息	327,868,867
前払費用	43,786,490
差入委託証拠金	76,704,895
流動資産合計	67,450,545,435
資産合計	67,450,545,435
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	151,848,754
前受金	1,971,020
未払金	513,826,040
未払解約金	370,512,951
未払利息	577
流動負債合計	1,038,159,342
負債合計	1,038,159,342
純資産の部	
元本等	

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
元本	73,444,156,090
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△7,031,769,997
元本等合計	66,412,386,093
純資産合計	66,412,386,093
負債純資産合計	67,450,545,435

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11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	73,444,156,090口
2．	「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損　7,031,769,997円
3．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　0.9043円 (1万口当たり純資産額)　(9,043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 7月11日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月11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

	2022年 7月11日現在
	売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	29,670,453,340円
期中追加設定元本額	61,366,857,598円
期中一部解約元本額	17,593,154,848円
期末元本額	73,444,156,090円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドＡ	19,844,781,520円
分散投資コア戦略ファンドＳ	25,100,435,451円

区分	2022年 7月11日現在
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	223,555,014円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	98,370,036円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	17,397,857円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	1,785,090円
１０資産分散投資ファンド	136,344円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	6,720,017,298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）	2,483,251,979円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	3,217,695,494円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	3,137,137,153円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	3,121,142,419円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	3,116,889,260円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	3,068,394,795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）	3,293,166,380円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△8,019,840,693
合計	△8,019,840,693

(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（為替ヘッジあり）」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2022年 7月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引 買建	864,697,439	－	866,668,459	1,971,020
合計		864,697,439	－	866,668,459	1,971,020

(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11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	498,377,596	－	498,399,062	21,466
	アメリカドル	260,458,995	－	260,464,912	5,917
	カナダドル	9,474,513	－	9,474,719	206
	ユーロ	177,660,030	－	177,676,184	16,154
	イギリスポンド	25,382,975	－	25,384,989	2,014
	オーストラリアドル	9,267,432	－	9,268,325	893
	オフショア人民元	16,133,651	－	16,129,933	△3,718
	売建	65,507,185,271	－	64,985,406,708	521,778,563
	アメリカドル	33,242,951,915	－	33,379,930,376	△136,978,461
	カナダドル	1,338,459,386	－	1,335,901,503	2,557,883
	メキシコペソ	505,819,924	－	499,898,570	5,921,354
	ユーロ	22,911,869,226	－	22,308,563,289	603,305,937
	イギリスポンド	3,297,221,542	－	3,269,440,024	27,781,518
	スウェーデンクローナ	170,884,750	－	166,192,925	4,691,825
	ノルウェークローネ	136,181,858	－	133,176,232	3,005,626
	デンマーククローネ	245,278,841	－	238,659,373	6,619,468
	ポーランドズロチ	275,833,625	－	264,371,473	11,462,152
	オーストラリアドル	989,459,664	－	986,320,500	3,139,164
	シンガポールドル	285,810,583	－	284,970,234	840,349
	マレーシアリンギット	332,746,443	－	332,442,879	303,564
	イスラエルシェケル	256,956,099	－	259,865,848	△2,909,749
	オフショア人民元	1,517,711,415	－	1,525,673,482	△7,962,067
合計		66,005,562,867	－	65,483,805,770	521,800,029

(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	1,950,000.00	1,864,344.72	
		T 0.125% 02/15/24	2,100,000.00	2,003,080.08	
		T 0.125% 08/15/23	900,000.00	871,523.44	
		T 0.125% 09/15/23	3,500,000.00	3,381,191.41	
		T 0.125% 10/15/23	3,640,000.00	3,507,410.16	
		T 0.125% 12/15/23	200,000.00	191,714.84	
		T 0.25% 03/15/24	1,950,000.00	1,858,784.18	
		T 0.25% 05/15/24	2,200,000.00	2,087,507.81	
		T 0.25% 05/31/25	1,000,000.00	920,312.50	
		T 0.25% 06/15/24	1,900,000.00	1,798,765.62	
		T 0.25% 06/30/25	540,000.00	495,829.69	
		T 0.25% 07/31/25	600,000.00	549,421.87	
		T 0.25% 08/31/25	400,000.00	365,375.00	
		T 0.25% 09/30/23	3,300,000.00	3,189,269.52	
		T 0.25% 09/30/25	1,250,000.00	1,139,306.63	
		T 0.25% 10/31/25	1,940,000.00	1,763,429.69	
		T 0.25% 11/15/23	1,000,000.00	962,929.69	
		T 0.375% 01/31/26	1,550,000.00	1,405,414.06	
		T 0.375% 04/15/24	800,000.00	762,359.37	
		T 0.375% 04/30/25	1,550,000.00	1,435,021.48	
		T 0.375% 07/15/24	1,000,000.00	946,992.19	
		T 0.375% 07/31/27	1,000,000.00	871,835.94	
		T 0.375% 08/15/24	1,200,000.00	1,133,296.87	
		T 0.375% 09/15/24	1,000,000.00	942,148.44	
		T 0.375% 09/30/27	1,020,000.00	884,332.03	
		T 0.375% 10/31/23	3,120,000.00	3,012,871.86	
		T 0.375% 11/30/25	800,000.00	728,781.24	
		T 0.375% 12/31/25	1,700,000.00	1,545,140.62	
		T 0.5% 02/28/26	3,650,000.00	3,318,078.12	
		T 0.5% 03/31/25	1,270,000.00	1,182,687.50	
		T 0.5% 04/30/27	1,900,000.00	1,677,343.75	
		T 0.5% 05/31/27	350,000.00	308,314.45	
		T 0.5% 06/30/27	420,000.00	369,157.03	
		T 0.5% 08/31/27	300,000.00	262,488.28	

		T 0.5% 10/31/27	700,000.00	609,464.84	
		T 0.5% 11/30/23	4,000,000.00	3,859,687.52	
		T 0.625% 03/31/27	260,000.00	231,471.09	
		T 0.625% 05/15/30	1,620,000.00	1,343,587.50	
		T 0.625% 07/31/26	1,000,000.00	904,375.00	
		T 0.625% 08/15/30	2,020,000.00	1,665,553.12	
		T 0.625% 10/15/24	3,500,000.00	3,308,867.20	
		T 0.625% 11/30/27	1,670,000.00	1,461,250.00	
		T 0.625% 12/31/27	1,370,000.00	1,196,127.73	
		T 0.75% 01/31/28	1,270,000.00	1,114,276.16	
		T 0.75% 03/31/26	2,200,000.00	2,015,062.50	
		T 0.75% 04/30/26	2,150,000.00	1,965,150.39	
		T 0.75% 05/31/26	1,200,000.00	1,094,859.37	
		T 0.75% 08/31/26	2,050,000.00	1,860,695.31	
		T 0.75% 11/15/24	3,000,000.00	2,838,281.25	
		T 0.75% 12/31/23	2,000,000.00	1,932,187.50	
		T 0.875% 06/30/26	1,000,000.00	915,429.69	
		T 0.875% 09/30/26	2,500,000.00	2,277,050.77	
		T 0.875% 11/15/30	2,630,000.00	2,207,145.31	
		T 1.125% 02/15/31	3,190,000.00	2,724,957.81	
		T 1.125% 02/28/25	1,300,000.00	1,234,187.50	
		T 1.125% 02/28/27	800,000.00	730,562.50	
		T 1.125% 02/29/28	2,100,000.00	1,880,812.50	
		T 1.125% 05/15/40	870,000.00	597,717.18	
		T 1.125% 08/15/40	1,530,000.00	1,042,073.43	
		T 1.125% 08/31/28	1,400,000.00	1,240,421.88	
		T 1.125% 10/31/26	3,700,000.00	3,400,386.72	
		T 1.25% 03/31/28	2,320,000.00	2,087,365.61	
		T 1.25% 04/30/28	1,400,000.00	1,257,539.06	
		T 1.25% 05/15/50	1,800,000.00	1,122,046.88	
		T 1.25% 05/31/28	2,300,000.00	2,062,812.50	
		T 1.25% 06/30/28	1,150,000.00	1,029,923.83	
		T 1.25% 08/15/31	4,450,000.00	3,808,226.56	
		T 1.25% 08/31/24	380,000.00	365,319.53	
		T 1.25% 09/30/28	3,100,000.00	2,763,722.66	
		T 1.25% 11/30/26	1,600,000.00	1,477,000.00	
		T 1.25% 12/31/26	1,300,000.00	1,198,183.59	
		T 1.375% 01/31/25	300,000.00	286,992.18	
		T 1.375% 08/15/50	1,550,000.00	1,000,113.28	
		T 1.375% 08/31/23	450,000.00	441,492.18	
		T 1.375% 08/31/26	440,000.00	410,042.18	
		T 1.375% 09/30/23	600,000.00	587,800.78	

		T 1.375% 10/31/28	3,000,000.00	2,693,085.93	
		T 1.375% 11/15/31	3,160,000.00	2,724,265.64	
		T 1.375% 11/15/40	1,390,000.00	986,139.85	
		T 1.5% 01/31/27	600,000.00	558,585.93	
		T 1.5% 02/15/30	1,770,000.00	1,581,107.81	
		T 1.5% 08/15/26	1,880,000.00	1,760,370.31	
		T 1.5% 09/30/24	260,000.00	250,960.93	
		T 1.5% 10/31/24	260,000.00	250,656.25	
		T 1.5% 11/30/24	2,200,000.00	2,117,500.00	
		T 1.5% 11/30/28	3,160,000.00	2,855,479.67	
		T 1.625% 02/15/26	2,200,000.00	2,085,789.06	
		T 1.625% 05/15/26	920,000.00	869,220.31	
		T 1.625% 05/15/31	3,410,000.00	3,028,506.25	
		T 1.625% 08/15/29	1,300,000.00	1,177,617.19	
		T 1.625% 09/30/26	330,000.00	310,341.79	
		T 1.625% 10/31/23	920,000.00	902,570.31	
		T 1.625% 10/31/26	260,000.00	244,085.15	
		T 1.625% 11/15/50	1,320,000.00	910,490.63	
		T 1.625% 11/30/26	400,000.00	375,250.00	
		T 1.75% 01/31/29	750,000.00	688,242.18	
		T 1.75% 03/15/25	1,100,000.00	1,060,554.69	
		T 1.75% 06/30/24	1,210,000.00	1,178,686.51	
		T 1.75% 07/31/24	260,000.00	253,022.65	
		T 1.75% 08/15/41	2,440,000.00	1,826,568.75	
		T 1.75% 11/15/29	1,050,000.00	958,453.12	
		T 1.75% 12/31/24	450,000.00	435,146.48	
		T 1.75% 12/31/26	900,000.00	848,496.09	
		T 1.875% 02/15/32	1,480,000.00	1,332,462.49	
		T 1.875% 02/15/41	1,520,000.00	1,174,674.99	
		T 1.875% 02/15/51	2,080,000.00	1,531,400.00	
		T 1.875% 06/30/26	100,000.00	95,347.65	
		T 1.875% 07/31/26	230,000.00	218,985.15	
		T 1.875% 08/31/24	660,000.00	642,932.81	
		T 1.875% 11/15/51	1,170,000.00	861,778.12	
		T 1% 07/31/28	1,820,000.00	1,602,595.31	
		T 1% 12/15/24	2,000,000.00	1,900,000.00	
		T 2.125% 02/29/24	240,000.00	236,235.93	
		T 2.125% 03/31/24	390,000.00	383,540.62	
		T 2.125% 05/15/25	280,000.00	272,354.68	
		T 2.125% 05/31/26	420,000.00	404,430.46	
		T 2.125% 07/31/24	160,000.00	156,856.24	
		T 2.125% 09/30/24	650,000.00	636,365.23	
		T 2.125% 11/30/23	500,000.00	493,339.84	

		T 2.125% 11/30/24	400,000.00	390,703.12	
		T 2.25% 01/31/24	220,000.00	217,108.20	
		T 2.25% 02/15/27	1,120,000.00	1,076,468.74	
		T 2.25% 02/15/52	1,300,000.00	1,050,460.94	
		T 2.25% 03/31/26	220,000.00	213,056.25	
		T 2.25% 04/30/24	550,000.00	541,771.48	
		T 2.25% 05/15/41	1,570,000.00	1,289,975.78	
		T 2.25% 08/15/27	1,440,000.00	1,378,406.24	
		T 2.25% 08/15/46	780,000.00	617,418.74	
		T 2.25% 08/15/49	1,010,000.00	813,444.53	
		T 2.25% 10/31/24	300,000.00	294,187.50	
		T 2.25% 11/15/24	3,240,000.00	3,176,845.30	
		T 2.25% 11/15/25	1,840,000.00	1,786,525.00	
		T 2.25% 11/15/27	640,000.00	611,175.00	
		T 2.25% 12/31/23	210,000.00	207,370.89	
		T 2.25% 12/31/24	260,000.00	254,515.62	
		T 2.375% 02/15/42	1,200,000.00	1,001,156.25	
		T 2.375% 02/29/24	400,000.00	395,351.56	
		T 2.375% 03/31/29	1,330,000.00	1,267,032.81	
		T 2.375% 04/30/26	310,000.00	301,571.87	
		T 2.375% 05/15/27	1,740,000.00	1,679,100.00	
		T 2.375% 05/15/29	490,000.00	466,954.68	
		T 2.375% 05/15/51	2,800,000.00	2,320,937.50	
		T 2.375% 08/15/24	2,650,000.00	2,609,111.32	
		T 2.375% 11/15/49	1,060,000.00	878,723.44	
		T 2.5% 01/31/24	700,000.00	693,355.46	
		T 2.5% 01/31/25	330,000.00	324,701.95	
		T 2.5% 02/15/45	510,000.00	425,172.65	
		T 2.5% 02/15/46	520,000.00	433,265.62	
		T 2.5% 02/28/26	1,500,000.00	1,466,601.57	
		T 2.5% 05/15/24	1,160,000.00	1,147,312.50	
		T 2.5% 05/15/46	430,000.00	358,142.97	
		T 2.5% 08/15/23	1,800,000.00	1,788,820.30	
		T 2.625% 01/31/26	290,000.00	284,936.32	
		T 2.625% 02/15/29	1,150,000.00	1,113,972.66	
		T 2.625% 03/31/25	330,000.00	325,668.75	
		T 2.625% 04/15/25	900,000.00	887,449.22	
		T 2.625% 12/31/23	700,000.00	695,160.15	
		T 2.625% 12/31/25	250,000.00	245,722.65	
		T 2.75% 02/15/24	2,250,000.00	2,237,167.98	
		T 2.75% 02/15/28	100,000.00	97,851.56	
		T 2.75% 02/28/25	550,000.00	544,542.97	

		T 2.75% 06/30/25	190,000.00	187,936.71	
		T 2.75% 08/15/42	360,000.00	317,896.87	
		T 2.75% 08/15/47	790,000.00	693,471.87	
		T 2.75% 08/31/23	580,000.00	577,938.27	
		T 2.75% 08/31/25	230,000.00	227,196.87	
		T 2.75% 11/15/23	2,210,000.00	2,200,029.09	
		T 2.75% 11/15/42	490,000.00	431,927.34	
		T 2.75% 11/15/47	850,000.00	747,402.34	
		T 2.875% 04/30/25	880,000.00	873,365.62	
		T 2.875% 05/15/28	2,180,000.00	2,145,000.77	
		T 2.875% 05/15/43	700,000.00	627,812.50	
		T 2.875% 05/15/49	1,030,000.00	943,174.22	
		T 2.875% 05/15/52	200,000.00	185,531.25	
		T 2.875% 05/31/25	360,000.00	357,229.68	
		T 2.875% 07/31/25	500,000.00	496,113.28	
		T 2.875% 08/15/28	920,000.00	904,546.87	
		T 2.875% 08/15/45	550,000.00	491,132.81	
		T 2.875% 09/30/23	320,000.00	319,262.49	
		T 2.875% 10/31/23	230,000.00	229,330.66	
		T 2.875% 11/15/46	550,000.00	492,507.81	
		T 2.875% 11/30/23	500,000.00	498,476.56	
		T 2.875% 11/30/25	540,000.00	534,937.50	
		T 2% 02/15/25	1,480,000.00	1,437,796.88	
		T 2% 02/15/50	1,170,000.00	889,839.84	
		T 2% 04/30/24	140,000.00	137,303.90	
		T 2% 05/31/24	1,120,000.00	1,097,621.87	
		T 2% 06/30/24	260,000.00	254,581.64	
		T 2% 08/15/25	650,000.00	627,884.76	
		T 2% 08/15/51	2,600,000.00	1,973,156.25	
		T 2% 11/15/26	1,650,000.00	1,572,333.98	
		T 2% 11/15/41	1,650,000.00	1,289,191.41	
		T 3.125% 02/15/42	180,000.00	169,931.25	
		T 3.125% 02/15/43	680,000.00	635,800.00	
		T 3.125% 05/15/48	760,000.00	722,178.12	
		T 3.125% 08/15/44	570,000.00	531,035.15	
		T 3.125% 11/15/28	3,630,000.00	3,620,357.81	
		T 3.125% 11/15/41	330,000.00	312,778.12	
		T 3.375% 05/15/44	410,000.00	398,212.50	
		T 3.375% 11/15/48	910,000.00	908,649.22	
		T 3.5% 02/15/39	100,000.00	103,546.87	
		T 3.625% 02/15/44	590,000.00	595,623.43	
		T 3.625% 08/15/43	570,000.00	575,789.06	
		T 3.75% 08/15/41	260,000.00	270,196.87	

	T 3.75% 11/15/43	570,000.00	586,654.68	
	T 3.875% 08/15/40	390,000.00	416,325.00	
	T 3% 02/15/47	730,000.00	669,261.72	
	T 3% 02/15/48	710,000.00	656,805.47	
	T 3% 02/15/49	1,460,000.00	1,366,354.69	
	T 3% 05/15/42	370,000.00	341,874.22	
	T 3% 05/15/45	480,000.00	437,775.00	
	T 3% 05/15/47	380,000.00	348,887.50	
	T 3% 08/15/48	1,250,000.00	1,159,765.62	
	T 3% 09/30/25	460,000.00	457,843.75	
	T 3% 10/31/25	270,000.00	268,692.18	
	T 3% 11/15/44	840,000.00	765,581.25	
	T 3% 11/15/45	610,000.00	557,387.50	
	T 4.25% 05/15/39	270,000.00	305,310.93	
	T 4.25% 11/15/40	200,000.00	223,843.75	
	T 4.375% 02/15/38	210,000.00	242,484.37	
	T 4.375% 05/15/40	300,000.00	342,609.37	
	T 4.375% 05/15/41	800,000.00	907,750.00	
	T 4.375% 11/15/39	350,000.00	400,339.84	
	T 4.5% 02/15/36	310,000.00	361,900.77	
	T 4.5% 05/15/38	110,000.00	128,674.21	
	T 4.5% 08/15/39	350,000.00	407,531.25	
	T 4.625% 02/15/40	160,000.00	188,775.00	
	T 4.75% 02/15/41	150,000.00	179,085.93	
	T 5.0% 05/15/37	250,000.00	306,621.09	
	T 5.25% 11/15/28	150,000.00	167,941.40	
	T 5.375% 02/15/31	60,000.00	70,251.56	
	T 6.0% 02/15/26	420,000.00	460,195.31	
	T 6.25% 05/15/30	90,000.00	109,638.28	
アメリカドル 小計		263,890,000.00	241,512,585.66 (32,959,222,565)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	480,000.00	431,702.40	
	CAN 0.25% 04/01/24	280,000.00	266,086.80	
	CAN 0.25% 08/01/23	580,000.00	561,962.00	
	CAN 0.5% 09/01/25	860,000.00	790,684.00	
	CAN 0.5% 11/01/23	500,000.00	482,475.00	
	CAN 0.5% 12/01/30	680,000.00	541,504.40	
	CAN 0.75% 10/01/24	170,000.00	160,996.80	
	CAN 1.25% 03/01/25	430,000.00	408,452.70	
	CAN 1.25% 03/01/27	290,000.00	265,645.80	
	CAN 1.25% 06/01/30	990,000.00	851,409.90	
	CAN 1.5% 04/01/25	90,000.00	85,912.20	

		CAN 1.5% 05/01/24	70,000.00	67,851.00	
		CAN 1.5% 06/01/26	170,000.00	159,587.50	
		CAN 1.5% 06/01/31	940,000.00	810,468.00	
		CAN 1.5% 09/01/24	490,000.00	472,556.00	
		CAN 1.5% 12/01/31	620,000.00	530,732.40	
		CAN 1.75% 12/01/53	510,000.00	366,531.90	
		CAN 1% 06/01/27	340,000.00	306,550.80	
		CAN 1% 09/01/26	420,000.00	384,329.40	
		CAN 2.25% 03/01/24	60,000.00	59,061.00	
		CAN 2.25% 06/01/25	160,000.00	155,721.60	
		CAN 2.25% 06/01/29	270,000.00	253,886.40	
		CAN 2.5% 06/01/24	270,000.00	266,390.10	
		CAN 2.75% 12/01/48	320,000.00	294,438.40	
		CAN 2.75% 12/01/64	160,000.00	143,577.60	
		CAN 2% 06/01/28	150,000.00	140,319.00	
		CAN 2% 06/01/32	450,000.00	401,206.50	
		CAN 2% 09/01/23	990,000.00	975,852.90	
		CAN 2% 12/01/51	920,000.00	713,708.40	
		CAN 3.5% 12/01/45	300,000.00	312,849.00	
		CAN 4.0% 06/01/41	190,000.00	209,294.50	
		CAN 5.75% 06/01/29	220,000.00	254,005.40	
		CAN 5.75% 06/01/33	260,000.00	316,667.00	
		CAN 5% 06/01/37	120,000.00	143,715.60	
	カナダドル 小計		13,750,000.00	12,586,132.40 (1,325,949,048)	
	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	1,500,000.00	1,617,015.00	
		MBONO 10% 12/05/24	6,060,000.00	6,138,658.80	
		MBONO 5.5% 03/04/27	2,250,000.00	1,938,937.50	
		MBONO 5.75% 03/05/26	11,700,000.00	10,438,155.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	7,760,000.00	7,277,405.60	
		MBONO 7.75% 05/29/31	7,630,000.00	7,047,602.10	
		MBONO 7.75% 11/13/42	5,800,000.00	5,069,722.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	2,100,000.00	1,903,986.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	7,270,000.00	7,075,527.50	
		MBONO 8.5% 11/18/38	6,180,000.00	5,846,774.40	
		MBONO 8% 09/05/24	9,190,000.00	8,940,491.50	
		MBONO 8% 11/07/47	6,310,000.00	5,619,938.40	
		MBONO 8% 12/07/23	5,340,000.00	5,238,219.60	
	メキシコペソ 小計		79,090,000.00	74,152,433.40 (494,604,146)	
	ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	350,000.00	309,270.50	
		BGB 0.2% 10/22/23	280,000.00	279,280.40	
		BGB 0.35% 06/22/32	180,000.00	153,835.20	

		BGB 0.4% 06/22/40	200,000.00	139,592.00	
		BGB 0.5% 10/22/24	270,000.00	269,360.10	
		BGB 0.65% 06/22/71	150,000.00	69,972.00	
		BGB 0.8% 06/22/25	550,000.00	548,768.00	
		BGB 0.8% 06/22/27	330,000.00	323,274.60	
		BGB 0.8% 06/22/28	400,000.00	387,096.00	
		BGB 0.9% 06/22/29	420,000.00	403,011.00	
		BGB 0% 10/22/27	330,000.00	308,774.40	
		BGB 0% 10/22/31	550,000.00	463,837.00	
		BGB 1.25% 04/22/33	250,000.00	233,447.50	
		BGB 1.4% 06/22/53	150,000.00	109,924.50	
		BGB 1.45% 06/22/37	140,000.00	123,729.20	
		BGB 1.6% 06/22/47	260,000.00	211,569.80	
		BGB 1.7% 06/22/50	290,000.00	236,384.80	
		BGB 1.9% 06/22/38	210,000.00	196,356.30	
		BGB 1% 06/22/26	370,000.00	369,163.80	
		BGB 1% 06/22/31	450,000.00	420,808.50	
		BGB 2.15% 06/22/66	180,000.00	157,248.00	
		BGB 2.25% 06/22/57	160,000.00	146,124.80	
		BGB 2.6% 06/22/24	380,000.00	394,789.60	
		BGB 3.75% 06/22/45	260,000.00	311,394.20	
		BGB 3% 06/22/34	210,000.00	228,664.80	
		BGB 4.25% 03/28/41	450,000.00	562,932.00	
		BGB 4.5% 03/28/26	320,000.00	360,880.00	
		BGB 4% 03/28/32	170,000.00	202,580.50	
		BGB 5.5% 03/28/28	360,000.00	444,009.60	
		BGB 5% 03/28/35	520,000.00	681,610.80	
		BKO 0% 09/15/23	640,000.00	638,156.80	
		BKO 0% 12/15/23	930,000.00	926,707.80	
		BTPS 0.25% 03/15/28	250,000.00	219,662.50	
		BTPS 0.3% 08/15/23	260,000.00	258,936.60	
		BTPS 0.35% 02/01/25	270,000.00	261,875.70	
		BTPS 0.45% 02/15/29	360,000.00	310,381.20	
		BTPS 0.5% 02/01/26	550,000.00	522,879.50	
		BTPS 0.5% 07/15/28	510,000.00	450,804.30	
		BTPS 0.6% 08/01/31	620,000.00	496,347.20	
		BTPS 0.65% 10/15/23	680,000.00	678,551.60	
		BTPS 0.85% 01/15/27	780,000.00	733,746.00	
		BTPS 0.9% 04/01/31	710,000.00	590,961.40	
		BTPS 0.95% 03/01/37	480,000.00	342,475.20	
		BTPS 0.95% 06/01/32	310,000.00	250,467.60	
		BTPS 0.95% 08/01/30	510,000.00	435,290.10	
		BTPS 0.95% 09/15/27	540,000.00	502,221.60	

		BTPS 0.95% 12/01/31	590,000.00	483,829.50	
		BTPS 0% 01/30/24	250,000.00	246,080.00	
		BTPS 0% 04/01/26	600,000.00	556,182.00	
		BTPS 0% 04/15/24	720,000.00	704,894.40	
		BTPS 0% 08/01/26	510,000.00	467,986.20	
		BTPS 0% 08/15/24	210,000.00	204,267.00	
		BTPS 1.1% 04/01/27	150,000.00	141,826.50	
		BTPS 1.25% 12/01/26	480,000.00	461,832.00	
		BTPS 1.35% 04/01/30	480,000.00	428,433.60	
		BTPS 1.45% 03/01/36	290,000.00	227,853.00	
		BTPS 1.45% 05/15/25	350,000.00	347,189.50	
		BTPS 1.45% 11/15/24	1,000,000.00	999,000.00	
		BTPS 1.5% 04/30/45	270,000.00	183,791.70	
		BTPS 1.5% 06/01/25	500,000.00	496,930.00	
		BTPS 1.6% 06/01/26	390,000.00	384,107.10	
		BTPS 1.65% 03/01/32	740,000.00	646,804.40	
		BTPS 1.65% 12/01/30	540,000.00	484,477.20	
		BTPS 1.7% 09/01/51	330,000.00	217,014.60	
		BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	1,008,550.00	
		BTPS 1.8% 03/01/41	460,000.00	349,011.20	
		BTPS 1.85% 05/15/24	530,000.00	535,575.60	
		BTPS 1.85% 07/01/25	530,000.00	530,710.20	
		BTPS 2.05% 08/01/27	720,000.00	708,854.40	
		BTPS 2.1% 07/15/26	840,000.00	840,764.40	
		BTPS 2.15% 03/01/72	120,000.00	77,502.00	
		BTPS 2.15% 09/01/52	280,000.00	200,897.20	
		BTPS 2.2% 06/01/27	350,000.00	347,970.00	
		BTPS 2.25% 09/01/36	470,000.00	405,892.00	
		BTPS 2.45% 09/01/33	560,000.00	514,539.20	
		BTPS 2.45% 09/01/50	390,000.00	306,153.90	
		BTPS 2.45% 10/01/23	770,000.00	785,030.40	
		BTPS 2.5% 11/15/25	280,000.00	285,496.40	
		BTPS 2.5% 12/01/24	430,000.00	439,838.40	
		BTPS 2.5% 12/01/32	250,000.00	232,232.50	
		BTPS 2.7% 03/01/47	450,000.00	383,935.50	
		BTPS 2.8% 03/01/67	220,000.00	170,192.00	
		BTPS 2.8% 06/15/29	290,000.00	289,472.20	
		BTPS 2.8% 12/01/28	440,000.00	444,351.60	
		BTPS 2.95% 09/01/38	420,000.00	390,973.80	
		BTPS 2% 02/01/28	830,000.00	809,499.00	
		BTPS 2% 12/01/25	600,000.00	602,406.00	
		BTPS 3.1% 03/01/40	260,000.00	243,887.80	

		BTPS 3.25% 03/01/38	190,000.00	183,021.30	
		BTPS 3.25% 09/01/46	350,000.00	330,823.50	
		BTPS 3.35% 03/01/35	430,000.00	425,734.40	
		BTPS 3.45% 03/01/48	440,000.00	425,559.20	
		BTPS 3.5% 03/01/30	490,000.00	512,834.00	
		BTPS 3.75% 09/01/24	200,000.00	210,038.00	
		BTPS 3.85% 09/01/49	350,000.00	359,061.50	
		BTPS 3% 08/01/29	810,000.00	821,412.90	
		BTPS 4.5% 03/01/24	680,000.00	717,971.20	
		BTPS 4.5% 03/01/26	610,000.00	665,595.40	
		BTPS 4.75% 08/01/23	600,000.00	625,284.00	
		BTPS 4.75% 09/01/28	590,000.00	660,080.20	
		BTPS 4.75% 09/01/44	490,000.00	573,809.60	
		BTPS 4% 02/01/37	490,000.00	520,203.60	
		BTPS 5.0% 08/01/39	590,000.00	699,751.80	
		BTPS 5.25% 11/01/29	750,000.00	874,545.00	
		BTPS 5.75% 02/01/33	490,000.00	597,623.60	
		BTPS 5% 03/01/25	580,000.00	631,376.40	
		BTPS 5% 08/01/34	550,000.00	638,500.50	
		BTPS 5% 09/01/40	460,000.00	546,562.80	
		BTPS 6.5% 11/01/27	500,000.00	604,525.00	
		BTPS 6% 05/01/31	480,000.00	590,049.60	
		DBR 0.25% 02/15/27	940,000.00	915,362.60	
		DBR 0.25% 02/15/29	570,000.00	541,665.30	
		DBR 0.25% 08/15/28	530,000.00	506,330.20	
		DBR 0.5% 02/15/25	610,000.00	608,584.80	
		DBR 0.5% 02/15/26	680,000.00	674,757.20	
		DBR 0.5% 02/15/28	700,000.00	681,926.00	
		DBR 0.5% 08/15/27	540,000.00	528,876.00	
		DBR 0% 02/15/30	580,000.00	533,721.80	
		DBR 0% 02/15/31	790,000.00	713,599.10	
		DBR 0% 02/15/32	640,000.00	567,705.60	
		DBR 0% 05/15/35	550,000.00	455,152.50	
		DBR 0% 05/15/36	620,000.00	503,632.20	
		DBR 0% 08/15/26	940,000.00	910,954.00	
		DBR 0% 08/15/29	350,000.00	324,572.50	
		DBR 0% 08/15/30	850,000.00	775,633.50	
		DBR 0% 08/15/31	820,000.00	733,924.60	
		DBR 0% 08/15/50	1,030,000.00	662,228.20	
		DBR 0% 08/15/52	330,000.00	204,411.90	
		DBR 0% 11/15/27	600,000.00	570,732.00	
		DBR 0% 11/15/28	560,000.00	525,627.20	
		DBR 1.25% 08/15/48	790,000.00	732,322.10	

		DBR 1.5% 05/15/24	810,000.00	825,778.80	
		DBR 1.75% 02/15/24	510,000.00	521,373.00	
		DBR 1% 05/15/38	40,000.00	36,868.00	
		DBR 1% 08/15/24	700,000.00	706,839.00	
		DBR 1% 08/15/25	700,000.00	707,021.00	
		DBR 2.5% 07/04/44	710,000.00	832,354.30	
		DBR 2.5% 08/15/46	740,000.00	877,514.20	
		DBR 2% 08/15/23	150,000.00	152,857.50	
		DBR 3.25% 07/04/42	480,000.00	618,700.80	
		DBR 4.0% 01/04/37	700,000.00	924,609.00	
		DBR 4.25% 07/04/39	460,000.00	643,811.40	
		DBR 4.75% 07/04/28	570,000.00	694,807.20	
		DBR 4.75% 07/04/34	530,000.00	726,953.30	
		DBR 4.75% 07/04/40	520,000.00	776,354.80	
		DBR 5.5% 01/04/31	660,000.00	890,709.60	
		DBR 5.625% 01/04/28	690,000.00	862,872.60	
		DBR 6.25% 01/04/24	210,000.00	228,677.40	
		DBR 6.25% 01/04/30	490,000.00	671,275.50	
		DBR 6.5% 07/04/27	110,000.00	139,895.80	
		FRTR 0.25% 11/25/26	1,040,000.00	999,003.20	
		FRTR 0.5% 05/25/25	1,380,000.00	1,364,654.40	
		FRTR 0.5% 05/25/26	1,290,000.00	1,260,910.50	
		FRTR 0.5% 05/25/29	1,100,000.00	1,029,149.00	
		FRTR 0.5% 05/25/40	570,000.00	415,621.20	
		FRTR 0.5% 05/25/72	250,000.00	109,940.00	
		FRTR 0.5% 06/25/44	370,000.00	249,420.70	
		FRTR 0.75% 02/25/28	270,000.00	260,374.50	
		FRTR 0.75% 05/25/28	1,330,000.00	1,282,080.10	
		FRTR 0.75% 05/25/52	800,000.00	506,304.00	
		FRTR 0.75% 05/25/53	360,000.00	222,339.60	
		FRTR 0.75% 11/25/28	1,370,000.00	1,312,405.20	
		FRTR 0% 02/25/24	790,000.00	784,098.70	
		FRTR 0% 02/25/26	1,180,000.00	1,136,587.80	
		FRTR 0% 02/25/27	970,000.00	916,921.60	
		FRTR 0% 03/25/24	1,040,000.00	1,031,617.60	
		FRTR 0% 03/25/25	1,410,000.00	1,377,584.10	
		FRTR 0% 05/25/32	770,000.00	640,917.20	
		FRTR 0% 11/25/29	1,280,000.00	1,140,953.60	
		FRTR 0% 11/25/30	1,240,000.00	1,076,357.20	
		FRTR 0% 11/25/31	1,260,000.00	1,065,985.20	
		FRTR 1.25% 05/25/34	870,000.00	793,500.90	
		FRTR 1.25% 05/25/36	990,000.00	877,981.50	

		FRTR 1.5% 05/25/31	1,340,000.00	1,317,675.60	
		FRTR 1.5% 05/25/50	810,000.00	650,754.00	
		FRTR 1.75% 05/25/66	390,000.00	309,086.70	
		FRTR 1.75% 06/25/39	810,000.00	753,502.50	
		FRTR 1.75% 11/25/24	750,000.00	768,015.00	
		FRTR 1% 05/25/27	930,000.00	919,137.60	
		FRTR 1% 11/25/25	1,400,000.00	1,401,610.00	
		FRTR 2.25% 05/25/24	520,000.00	536,203.20	
		FRTR 2.5% 05/25/30	1,230,000.00	1,314,722.40	
		FRTR 2.75% 10/25/27	1,330,000.00	1,428,473.20	
		FRTR 2% 05/25/48	670,000.00	609,586.10	
		FRTR 3.25% 05/25/45	750,000.00	856,777.50	
		FRTR 3.5% 04/25/26	1,200,000.00	1,308,816.00	
		FRTR 4.25% 10/25/23	1,490,000.00	1,564,112.60	
		FRTR 4.5% 04/25/41	970,000.00	1,271,563.30	
		FRTR 4.75% 04/25/35	810,000.00	1,048,504.50	
		FRTR 4% 04/25/55	520,000.00	682,780.80	
		FRTR 4% 04/25/60	390,000.00	519,749.10	
		FRTR 4% 10/25/38	570,000.00	702,844.20	
		FRTR 5.5% 04/25/29	1,040,000.00	1,309,308.00	
		FRTR 5.75% 10/25/32	940,000.00	1,279,396.40	
		IRISH 0.2% 05/15/27	180,000.00	171,106.20	
		IRISH 0.2% 10/18/30	340,000.00	300,971.40	
		IRISH 0.35% 10/18/32	150,000.00	128,283.00	
		IRISH 0.4% 05/15/35	100,000.00	80,463.00	
		IRISH 0.55% 04/22/41	100,000.00	72,562.00	
		IRISH 0.9% 05/15/28	180,000.00	174,783.60	
		IRISH 0% 10/18/31	100,000.00	84,537.00	
		IRISH 1.1% 05/15/29	200,000.00	194,878.00	
		IRISH 1.3% 05/15/33	130,000.00	121,381.00	
		IRISH 1.35% 03/18/31	240,000.00	233,491.20	
		IRISH 1.5% 05/15/50	180,000.00	144,172.80	
		IRISH 1.7% 05/15/37	180,000.00	168,651.00	
		IRISH 1% 05/15/26	290,000.00	289,788.30	
		IRISH 2.4% 05/15/30	110,000.00	116,783.70	
		IRISH 2% 02/18/45	260,000.00	241,581.60	
		IRISH 3.4% 03/18/24	240,000.00	251,604.00	
		IRISH 5.4% 03/13/25	270,000.00	302,499.90	
		NETHER 0.25% 07/15/25	390,000.00	383,405.10	
		NETHER 0.25% 07/15/29	380,000.00	351,226.40	
		NETHER 0.5% 01/15/40	300,000.00	236,583.00	
		NETHER 0.5% 07/15/26	410,000.00	401,988.60	
		NETHER 0.5% 07/15/32	190,000.00	169,588.30	

		NETHER 0.75% 07/15/27	310,000.00	304,175.10	
		NETHER 0.75% 07/15/28	490,000.00	475,496.00	
		NETHER 0% 01/15/24	360,000.00	357,804.00	
		NETHER 0% 01/15/26	270,000.00	261,130.50	
		NETHER 0% 01/15/27	420,000.00	400,037.40	
		NETHER 0% 01/15/29	220,000.00	201,383.60	
		NETHER 0% 01/15/38	230,000.00	171,536.30	
		NETHER 0% 01/15/52	360,000.00	206,596.80	
		NETHER 0% 07/15/30	310,000.00	275,655.10	
		NETHER 0% 07/15/31	310,000.00	270,047.20	
		NETHER 1.75% 07/15/23	450,000.00	455,845.50	
		NETHER 2.5% 01/15/33	380,000.00	409,522.20	
		NETHER 2.75% 01/15/47	500,000.00	584,335.00	
		NETHER 2% 07/15/24	450,000.00	462,946.50	
		NETHER 3.75% 01/15/42	490,000.00	634,162.90	
		NETHER 4% 01/15/37	410,000.00	520,019.40	
		NETHER 5.5% 01/15/28	350,000.00	429,845.50	
		OBL 0% 04/05/24	700,000.00	695,443.00	
		OBL 0% 04/10/26	760,000.00	739,054.40	
		OBL 0% 04/11/25	660,000.00	648,846.00	
		OBL 0% 04/16/27	400,000.00	383,468.00	
		OBL 0% 10/09/26	500,000.00	482,680.00	
		OBL 0% 10/10/25	630,000.00	616,694.40	
		OBL 0% 10/13/23	180,000.00	179,569.80	
		OBL 0% 10/18/24	520,000.00	513,411.60	
		RAGB 0.25% 10/20/36	130,000.00	99,262.80	
		RAGB 0.5% 02/20/29	430,000.00	403,335.70	
		RAGB 0.5% 04/20/27	200,000.00	194,052.00	
		RAGB 0.7% 04/20/71	90,000.00	47,795.40	
		RAGB 0.75% 02/20/28	320,000.00	309,315.20	
		RAGB 0.75% 03/20/51	170,000.00	115,749.60	
		RAGB 0.75% 10/20/26	470,000.00	464,529.20	
		RAGB 0.85% 06/30/20	80,000.00	35,871.20	
		RAGB 0.9% 02/20/32	130,000.00	118,783.60	
		RAGB 0% 02/20/30	310,000.00	274,384.10	
		RAGB 0% 02/20/31	320,000.00	274,790.40	
		RAGB 0% 04/20/25	230,000.00	224,845.70	
		RAGB 0% 07/15/23	160,000.00	159,220.80	
		RAGB 0% 07/15/24	300,000.00	297,039.00	
		RAGB 0% 10/20/40	110,000.00	72,734.20	
		RAGB 1.2% 10/20/25	350,000.00	353,997.00	
		RAGB 1.5% 02/20/47	240,000.00	206,599.20	

		RAGB 1.5% 11/02/86	70,000.00	49,296.10	
		RAGB 1.65% 10/21/24	350,000.00	358,571.50	
		RAGB 1.75% 10/20/23	160,000.00	162,934.40	
		RAGB 1.85% 05/23/49	50,000.00	45,621.00	
		RAGB 2.1% 09/20/17	170,000.00	144,032.50	
		RAGB 2.4% 05/23/34	180,000.00	187,763.40	
		RAGB 3.15% 06/20/44	160,000.00	185,843.20	
		RAGB 3.8% 01/26/62	90,000.00	122,118.30	
		RAGB 4.15% 03/15/37	380,000.00	473,894.20	
		RAGB 4.85% 03/15/26	200,000.00	228,454.00	
		RAGB 6.25% 07/15/27	220,000.00	275,110.00	
		RFGB 0.125% 04/15/36	160,000.00	122,798.40	
		RFGB 0.125% 04/15/52	90,000.00	49,640.40	
		RFGB 0.125% 09/15/31	180,000.00	155,476.80	
		RFGB 0.25% 09/15/40	120,000.00	84,720.00	
		RFGB 0.5% 04/15/26	210,000.00	205,611.00	
		RFGB 0.5% 04/15/43	90,000.00	63,390.60	
		RFGB 0.5% 09/15/27	140,000.00	134,895.60	
		RFGB 0.5% 09/15/28	120,000.00	113,677.20	
		RFGB 0.5% 09/15/29	110,000.00	102,509.00	
		RFGB 0.75% 04/15/31	130,000.00	120,220.10	
		RFGB 0.875% 09/15/25	70,000.00	69,894.30	
		RFGB 0% 09/15/23	100,000.00	99,417.00	
		RFGB 0% 09/15/24	140,000.00	138,073.60	
		RFGB 0% 09/15/26	100,000.00	95,435.00	
		RFGB 0% 09/15/30	160,000.00	139,852.80	
		RFGB 1.125% 04/15/34	70,000.00	63,806.40	
		RFGB 1.375% 04/15/47	100,000.00	84,409.00	
		RFGB 1.5% 09/15/32	20,000.00	19,338.40	
		RFGB 2.625% 07/04/42	140,000.00	147,435.40	
		RFGB 2.75% 07/04/28	150,000.00	162,169.50	
		RFGB 2% 04/15/24	160,000.00	164,308.80	
		RFGB 4% 07/04/25	130,000.00	142,223.90	
		SPGB 0.1% 04/30/31	490,000.00	407,150.80	
		SPGB 0.25% 07/30/24	220,000.00	217,459.00	
		SPGB 0.35% 07/30/23	700,000.00	697,627.00	
		SPGB 0.5% 04/30/30	680,000.00	604,955.20	
		SPGB 0.5% 10/31/31	600,000.00	509,184.00	
		SPGB 0.6% 10/31/29	690,000.00	626,050.80	
		SPGB 0.7% 04/30/32	530,000.00	452,264.90	
		SPGB 0.8% 07/30/27	690,000.00	662,268.90	
		SPGB 0.85% 07/30/37	310,000.00	235,017.20	
		SPGB 0% 01/31/25	530,000.00	516,458.50	

	SPGB 0% 01/31/26	750,000.00	714,360.00	
	SPGB 0% 01/31/27	330,000.00	306,952.80	
	SPGB 0% 01/31/28	450,000.00	409,167.00	
	SPGB 0% 05/31/24	140,000.00	137,998.00	
	SPGB 0% 05/31/25	130,000.00	125,684.00	
	SPGB 1.2% 10/31/40	360,000.00	272,815.20	
	SPGB 1.25% 10/31/30	460,000.00	429,364.00	
	SPGB 1.3% 10/31/26	590,000.00	586,206.30	
	SPGB 1.4% 04/30/28	500,000.00	490,510.00	
	SPGB 1.4% 07/30/28	690,000.00	674,599.20	
	SPGB 1.45% 04/30/29	370,000.00	359,225.60	
	SPGB 1.45% 10/31/27	400,000.00	395,500.00	
	SPGB 1.45% 10/31/71	140,000.00	77,424.20	
	SPGB 1.5% 04/30/27	460,000.00	458,578.60	
	SPGB 1.6% 04/30/25	930,000.00	943,522.20	
	SPGB 1.85% 07/30/35	620,000.00	565,340.80	
	SPGB 1.9% 10/31/52	180,000.00	134,560.80	
	SPGB 1.95% 04/30/26	400,000.00	408,352.00	
	SPGB 1.95% 07/30/30	610,000.00	603,601.10	
	SPGB 1% 07/30/42	120,000.00	85,696.80	
	SPGB 1% 10/31/50	500,000.00	303,955.00	
	SPGB 2.15% 10/31/25	500,000.00	515,680.00	
	SPGB 2.35% 07/30/33	420,000.00	414,535.80	
	SPGB 2.55% 10/31/32	120,000.00	120,480.00	
	SPGB 2.7% 10/31/48	390,000.00	366,159.30	
	SPGB 2.75% 10/31/24	530,000.00	553,123.90	
	SPGB 2.9% 10/31/46	520,000.00	511,113.20	
	SPGB 3.45% 07/30/66	380,000.00	390,826.20	
	SPGB 3.8% 04/30/24	490,000.00	516,724.60	
	SPGB 4.2% 01/31/37	570,000.00	672,862.20	
	SPGB 4.4% 10/31/23	630,000.00	660,429.00	
	SPGB 4.65% 07/30/25	510,000.00	563,718.30	
	SPGB 4.7% 07/30/41	540,000.00	687,247.20	
	SPGB 4.8% 01/31/24	550,000.00	584,672.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	540,000.00	700,218.00	
	SPGB 5.15% 10/31/28	1,160,000.00	1,388,102.40	
	SPGB 5.15% 10/31/44	370,000.00	504,191.60	
	SPGB 5.75% 07/30/32	610,000.00	795,903.60	
	SPGB 5.9% 07/30/26	800,000.00	945,536.00	
ユーロ 小計		161,680,000.00	160,354,727.30 (22,223,561,656)	
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	230,000.00	216,625.50	

		UKT 0.125% 01/31/24	790,000.00	766,363.20	
		UKT 0.125% 01/31/28	280,000.00	253,335.60	
		UKT 0.25% 01/31/25	300,000.00	286,692.00	
		UKT 0.25% 07/31/31	840,000.00	706,389.60	
		UKT 0.375% 10/22/26	410,000.00	383,522.20	
		UKT 0.375% 10/22/30	310,000.00	269,569.80	
		UKT 0.5% 01/31/29	120,000.00	108,566.40	
		UKT 0.5% 10/22/61	350,000.00	176,106.00	
		UKT 0.625% 06/07/25	180,000.00	173,871.00	
		UKT 0.625% 07/31/35	480,000.00	376,824.00	
		UKT 0.625% 10/22/50	300,000.00	181,572.00	
		UKT 0.75% 07/22/23	500,000.00	493,570.00	
		UKT 0.875% 01/31/46	280,000.00	192,724.00	
		UKT 0.875% 07/31/33	230,000.00	196,555.70	
		UKT 0.875% 10/22/29	310,000.00	286,071.10	
		UKT 1.125% 01/31/39	180,000.00	143,487.00	
		UKT 1.125% 10/22/73	150,000.00	93,357.00	
		UKT 1.25% 07/22/27	170,000.00	164,689.20	
		UKT 1.25% 07/31/51	230,000.00	165,866.80	
		UKT 1.25% 10/22/41	580,000.00	456,715.20	
		UKT 1.5% 07/22/26	400,000.00	393,928.00	
		UKT 1.5% 07/22/47	420,000.00	331,426.20	
		UKT 1.5% 07/31/53	80,000.00	61,176.80	
		UKT 1.625% 10/22/28	390,000.00	382,835.70	
		UKT 1.625% 10/22/54	360,000.00	283,082.40	
		UKT 1.625% 10/22/71	290,000.00	221,397.60	
		UKT 1.75% 01/22/49	240,000.00	199,413.60	
		UKT 1.75% 07/22/57	440,000.00	355,559.60	
		UKT 1.75% 09/07/37	460,000.00	410,168.20	
		UKT 1% 01/31/32	150,000.00	133,264.50	
		UKT 1% 04/22/24	150,000.00	147,645.00	
		UKT 2.25% 09/07/23	590,000.00	591,185.90	
		UKT 2.5% 07/22/65	380,000.00	379,943.00	
		UKT 2.75% 09/07/24	310,000.00	315,251.40	
		UKT 2% 09/07/25	420,000.00	421,369.20	
		UKT 3.25% 01/22/44	480,000.00	523,315.20	
		UKT 3.5% 01/22/45	490,000.00	556,390.10	
		UKT 3.5% 07/22/68	380,000.00	482,372.00	
		UKT 3.75% 07/22/52	330,000.00	406,979.10	
		UKT 4.25% 03/07/36	390,000.00	465,219.30	
		UKT 4.25% 06/07/32	410,000.00	484,189.50	
		UKT 4.25% 09/07/39	330,000.00	401,969.70	
		UKT 4.25% 12/07/27	570,000.00	635,812.20	

	UKT 4.25% 12/07/40	310,000.00	380,692.40	
	UKT 4.25% 12/07/46	400,000.00	512,412.00	
	UKT 4.25% 12/07/49	290,000.00	377,493.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	430,000.00	586,231.90	
	UKT 4.5% 09/07/34	350,000.00	424,935.00	
	UKT 4.5% 12/07/42	410,000.00	525,333.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	460,000.00	554,957.80	
	UKT 4.75% 12/07/38	420,000.00	539,233.80	
	UKT 4% 01/22/60	330,000.00	445,038.00	
	UKT 5% 03/07/25	370,000.00	399,267.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	260,000.00	322,615.80	
イギリスポンド 小計		19,710,000.00	19,744,577.20 (3,235,938,757)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	1,160,000.00	1,032,492.80	
	SGB 0.75% 05/12/28	1,400,000.00	1,341,760.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	1,440,000.00	1,365,868.80	
	SGB 1.5% 11/13/23	2,660,000.00	2,662,633.40	
	SGB 1% 11/12/26	1,920,000.00	1,876,166.40	
	SGB 2.25% 06/01/32	1,240,000.00	1,333,049.60	
	SGB 2.5% 05/12/25	1,880,000.00	1,925,289.20	
	SGB 3.5% 03/30/39	1,120,000.00	1,456,380.80	
スウェーデンクローナ 小計		12,820,000.00	12,993,641.00 (167,877,841)	
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	1,000,000.00	872,570.00	
	NGB 1.375% 08/19/30	1,320,000.00	1,180,964.40	
	NGB 1.5% 02/19/26	830,000.00	795,646.30	
	NGB 1.75% 02/17/27	1,060,000.00	1,014,706.20	
	NGB 1.75% 03/13/25	1,340,000.00	1,308,724.40	
	NGB 1.75% 09/06/29	960,000.00	893,548.80	
	NGB 2.125% 05/18/32	730,000.00	683,353.00	
	NGB 2% 04/26/28	1,380,000.00	1,321,888.20	
	NGB 3% 03/14/24	1,790,000.00	1,802,744.80	
ノルウェークローネ 小計		10,410,000.00	9,874,146.10 (133,399,713)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	1,190,000.00	729,993.60	
	DGB 0.5% 11/15/27	1,840,000.00	1,765,038.40	
	DGB 0.5% 11/15/29	1,790,000.00	1,667,671.40	
	DGB 0% 11/15/24	820,000.00	803,526.20	
	DGB 0% 11/15/31	1,800,000.00	1,543,248.00	
	DGB 1.5% 11/15/23	1,400,000.00	1,419,138.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	990,000.00	1,013,631.30	
	DGB 4.5% 11/15/39	2,780,000.00	3,824,501.60	

デンマーククローネ 小計		12,610,000.00	12,766,748.50 (237,716,857)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	740,000.00	561,223.40	
	POLGB 0.75% 04/25/25	580,000.00	489,427.20	
	POLGB 0% 07/25/24	370,000.00	319,483.90	
	POLGB 1.25% 10/25/30	850,000.00	569,330.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	220,000.00	144,179.20	
	POLGB 2.25% 10/25/24	490,000.00	439,628.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	1,310,000.00	1,207,453.20	
	POLGB 2.5% 07/25/26	1,350,000.00	1,137,064.50	
	POLGB 2.5% 07/25/27	750,000.00	611,565.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	1,210,000.00	983,875.20	
	POLGB 2.75% 10/25/29	1,400,000.00	1,091,342.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	1,090,000.00	978,046.10	
	POLGB 3.75% 05/25/27	290,000.00	252,474.00	
	POLGB 4% 10/25/23	290,000.00	278,849.50	
ポーランドズロチ 小計		10,940,000.00	9,063,941.20 (263,333,777)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	650,000.00	612,059.50	
	ACGB 0.25% 11/21/25	400,000.00	363,808.00	
	ACGB 0.5% 09/21/26	420,000.00	376,206.60	
	ACGB 1.25% 05/21/32	500,000.00	405,065.00	
	ACGB 1.5% 06/21/31	690,000.00	583,367.40	
	ACGB 1.75% 06/21/51	450,000.00	288,238.50	
	ACGB 1.75% 11/21/32	430,000.00	362,545.90	
	ACGB 1% 11/21/31	740,000.00	591,178.60	
	ACGB 1% 12/21/30	490,000.00	400,712.20	
	ACGB 2.25% 05/21/28	420,000.00	396,265.80	
	ACGB 2.5% 05/21/30	780,000.00	728,769.60	
	ACGB 2.75% 04/21/24	490,000.00	491,259.30	
	ACGB 2.75% 05/21/41	340,000.00	291,580.60	
	ACGB 2.75% 06/21/35	160,000.00	144,873.60	
	ACGB 2.75% 11/21/27	400,000.00	389,948.00	
	ACGB 2.75% 11/21/28	160,000.00	154,475.20	
	ACGB 2.75% 11/21/29	330,000.00	315,489.90	
	ACGB 3.25% 04/21/25	390,000.00	392,503.80	
	ACGB 3.25% 04/21/29	500,000.00	495,740.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	230,000.00	214,932.70	
	ACGB 3.75% 04/21/37	340,000.00	340,928.20	
	ACGB 3% 03/21/47	340,000.00	295,460.00	
	ACGB 3% 11/21/33	220,000.00	207,638.20	
	ACGB 4.25% 04/21/26	470,000.00	488,395.80	
	ACGB 4.5% 04/21/33	620,000.00	670,920.60	

	ACGB 4.75% 04/21/27	550,000.00	587,427.50	
オーストラリアドル 小計		11,510,000.00	10,589,790.50 (988,556,943)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	120,000.00	111,951.60	
	SIGB 1.25% 11/01/26	70,000.00	66,017.00	
	SIGB 1.625% 07/01/31	100,000.00	90,554.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	240,000.00	188,649.60	
	SIGB 2.125% 06/01/26	120,000.00	117,690.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	160,000.00	147,105.60	
	SIGB 2.375% 06/01/25	180,000.00	178,817.40	
	SIGB 2.375% 07/01/39	70,000.00	64,327.20	
	SIGB 2.625% 05/01/28	120,000.00	119,595.60	
	SIGB 2.75% 03/01/46	140,000.00	132,130.60	
	SIGB 2.75% 04/01/42	160,000.00	152,963.20	
	SIGB 2.75% 07/01/23	200,000.00	200,322.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	160,000.00	161,200.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	270,000.00	271,422.90	
	SIGB 2% 02/01/24	150,000.00	148,680.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	180,000.00	188,377.20	
	SIGB 3.5% 03/01/27	320,000.00	331,462.40	
	SIGB 3% 09/01/24	250,000.00	252,130.00	
シンガポールドル 小計		3,010,000.00	2,923,396.30 (285,001,905)	
マレーシアリンギット	MGS 3.478% 06/14/24	90,000.00	90,501.30	
	MGS 3.502% 05/31/27	360,000.00	354,204.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	590,000.00	580,105.70	
	MGS 3.757% 05/22/40	580,000.00	513,549.40	
	MGS 3.8% 08/17/23	230,000.00	231,803.20	
	MGS 3.828% 07/05/34	500,000.00	468,990.00	
	MGS 3.844% 04/15/33	290,000.00	275,848.00	
	MGS 3.882% 03/14/25	530,000.00	535,485.50	
	MGS 3.885% 08/15/29	410,000.00	404,358.40	
	MGS 3.892% 03/15/27	170,000.00	170,003.40	
	MGS 3.899% 11/16/27	420,000.00	421,331.40	
	MGS 3.9% 11/30/26	370,000.00	371,295.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	560,000.00	561,579.20	
	MGS 3.955% 09/15/25	570,000.00	575,939.40	
	MGS 4.059% 09/30/24	300,000.00	304,821.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	120,000.00	106,075.20	
	MGS 4.181% 07/15/24	370,000.00	376,541.60	
	MGS 4.232% 06/30/31	710,000.00	710,149.10	
	MGS 4.254% 05/31/35	600,000.00	584,022.00	

	MGS 4.392% 04/15/26	270,000.00	276,010.20	
	MGS 4.498% 04/15/30	690,000.00	704,662.50	
	MGS 4.642% 11/07/33	380,000.00	386,741.20	
	MGS 4.736% 03/15/46	240,000.00	236,119.20	
	MGS 4.762% 04/07/37	140,000.00	143,722.60	
	MGS 4.893% 06/08/38	310,000.00	317,771.70	
	MGS 4.921% 07/06/48	810,000.00	814,082.40	
	MGS 4.935% 09/30/43	290,000.00	294,898.10	
マレーシアリンギット 小計		10,900,000.00	10,810,610.70 (333,293,290)	
イスラエルシェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	270,000.00	265,795.58	
	ILGOV 0.4% 10/31/24	350,000.00	336,517.09	
	ILGOV 0.5% 02/27/26	290,000.00	271,752.64	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	610,000.00	582,641.50	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	100,000.00	88,350.00	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	390,000.00	320,351.88	
	ILGOV 1.5% 11/30/23	730,000.00	729,660.98	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	510,000.00	505,790.04	
	ILGOV 1% 03/31/30	730,000.00	650,470.51	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	240,000.00	236,986.36	
	ILGOV 2% 03/31/27	360,000.00	354,171.96	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	510,000.00	525,361.45	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	650,000.00	695,155.82	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	510,000.00	688,392.74	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	270,000.00	312,627.07	
イスラエルシェケル 小計		6,520,000.00	6,564,025.62 (258,121,117)	
オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	4,180,000.00	4,126,537.80	
	CGB 2.26% 02/24/25	2,020,000.00	2,011,091.80	
	CGB 2.47% 09/02/24	3,260,000.00	3,267,530.60	
	CGB 2.48% 04/15/27	3,200,000.00	3,175,968.00	
	CGB 2.56% 10/21/23	7,560,000.00	7,598,707.20	
	CGB 2.68% 05/21/30	2,720,000.00	2,680,832.00	
	CGB 2.69% 08/12/26	3,100,000.00	3,107,440.00	
	CGB 2.75% 02/17/32	1,100,000.00	1,088,989.00	
	CGB 2.8% 03/24/29	3,100,000.00	3,095,846.00	
	CGB 2.84% 04/08/24	4,210,000.00	4,251,636.90	
	CGB 2.85% 06/04/27	2,850,000.00	2,874,709.50	
	CGB 2.89% 11/18/31	900,000.00	901,107.00	
	CGB 2.91% 10/14/28	3,790,000.00	3,810,882.90	
	CGB 2.94% 10/17/24	2,000,000.00	2,026,000.00	
	CGB 3.01% 05/13/28	3,320,000.00	3,365,351.20	
	CGB 3.02% 05/27/31	2,330,000.00	2,355,350.40	

		CGB 3.02% 10/22/25	4,500,000.00	4,571,865.00	
		CGB 3.03% 03/11/26	3,380,000.00	3,436,648.80	
		CGB 3.12% 12/05/26	1,300,000.00	1,326,741.00	
		CGB 3.13% 11/21/29	2,050,000.00	2,087,166.50	
		CGB 3.25% 11/22/28	1,700,000.00	1,747,668.00	
		CGB 3.27% 11/19/30	1,380,000.00	1,422,807.60	
		CGB 3.28% 12/03/27	1,170,000.00	1,206,702.90	
		CGB 3.39% 03/16/50	2,370,000.00	2,374,977.00	
		CGB 3.53% 10/18/51	290,000.00	299,039.30	
		CGB 3.72% 04/12/51	810,000.00	861,030.00	
		CGB 3.81% 09/14/50	1,450,000.00	1,563,303.00	
		CGB 3.86% 07/22/49	1,470,000.00	1,593,788.70	
		CGB 4.08% 10/22/48	1,510,000.00	1,694,476.70	
	オフショア人民元 小計		73,020,000.00	73,924,194.80 (1,507,447,395)	
合計				64,414,025,010 (64,414,025,010)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券　233銘柄	100.0%	51.2%
カナダドル	国債証券　34銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券　13銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券　340銘柄	100.0%	34.5%
イギリスポンド	国債証券　55銘柄	100.0%	5.0%
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%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券　26銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	国債証券　18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券　27銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券　15銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券　29銘柄	100.0%	2.3%

(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 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	15,405,048,822
コール・ローン	1,537,103,611
株式	499,448,683,690
投資信託受益証券	214,048,693
投資証券	12,281,758,137
派生商品評価勘定	464,787,926
未収入金	19,296,445
未収配当金	472,239,856
差入委託証拠金	2,329,861,387
流動資産合計	532,172,828,567
資産合計	532,172,828,567
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	27,560,732
前受金	433,256,818
未払金	1,752,920
未払解約金	40,338,245
未払利息	469
流動負債合計	502,909,184
負債合計	502,909,184
純資産の部	
元本等	
元本	126,863,910,081
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	404,806,009,302
元本等合計	531,669,919,383
純資産合計	531,669,919,383
負債純資産合計	532,172,828,567

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11日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2 .デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4 .収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。

	2022年 7月11日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	126,863,910,081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 4.1909円 (1万口当たり純資産額) (41,909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 7月11日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月11日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	137,442,391,078円
期中追加設定元本額	17,019,323,173円
期中一部解約元本額	27,597,804,170円

区分	2022年 7月11日現在
期末元本額	126,863,910,081円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,894,889,318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	32,516,161,572円
世界経済インデックスファンド	10,760,805,521円
外国株式インデックス・オープン	884,934,839円
ＤＣマイセレクション２５	803,309,678円
ＤＣマイセレクション５０	3,647,379,804円
ＤＣマイセレクション７５	4,418,518,110円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	11,925,136,621円
ＤＣマイセレクションＳ２５	407,078,620円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,866,378,891円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,572,262,911円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	45,877,828円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	165,178,377円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	120,833,747円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	9,885,280,249円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,464,597,079円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,636,069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）	27,832,912円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	14,652,788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）	275,499,270円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	174,614,100円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,272,821,926円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	114,301,598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）	161,383,049円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	55,395,833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）	1,116,052,687円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,136,329,338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）	1,328,248,883円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,119,523,787円

区分	2022年 7月11日現在
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）	597,135,733円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,611,078円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	157,885,757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	196,810,461円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	755,387,224円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	138,729,755円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	3,798,123円
ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	175,694,765円
グローバル経済コア	647,778,934円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	13,596,169円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	5,595,885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）	78,132,978円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	50,215,861円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	40,627,233円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	15,422,653円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	19,583,968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）	265,676,388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）	186,316,815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）	873,381,106円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,269,644,656円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	209,973,912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）	86,923,126円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	61,083,062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）	58,795,703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）	115,406,823円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)

株式	△32,455,259,824
投資信託受益証券	△8,172,061
投資証券	△969,649,024
合計	△33,433,080,909

(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 7月11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	19,200,398,532	－	19,633,655,350	433,256,818
合計		19,200,398,532	－	19,633,655,350	433,256,818

(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11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	1,448,124,700	－	1,452,095,076	3,970,376
	アメリカドル	1,082,798,800	－	1,086,234,336	3,435,536
	カナダドル	125,965,200	－	126,411,720	446,520
	ユーロ	124,667,100	－	124,731,270	64,170
	イギリスポンド	114,693,600	－	114,717,750	24,150
合計		1,448,124,700	－	1,452,095,076	3,970,376

(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	APA CORP	27,671	34.85	964,334.35	
	BAKER HUGHES CO	75,948	28.47	2,162,239.56	
	CHENIERE ENERGY INC	18,243	127.86	2,332,549.98	
	CHEVRON CORP	155,015	142.77	22,131,491.55	
	CONOCOPHILLIPS	104,031	86.46	8,994,520.26	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	26.31	1,683,840.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	54.48	2,737,946.88	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	116.33	1,543,350.11	
	EOG RESOURCES INC	46,119	105.52	4,866,476.88	
	EQT CORPORATION	27,026	34.20	924,289.20	
	EXXON MOBIL	336,966	86.08	29,006,033.28	
	HALLIBURTON CO	71,583	29.84	2,136,036.72	
	HESS CORP	22,781	100.18	2,282,200.58	
	KINDER MORGAN INC	159,310	16.97	2,703,490.70	
	MARATHON OIL CORP	57,281	21.72	1,244,143.32	
	MARATHON PETROLEUM CORP	45,012	83.27	3,748,149.24	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	74,379	60.67	4,512,573.93	
	ONEOK INC	35,533	56.82	2,018,985.06	
	PHILLIPS 66	38,237	82.01	3,135,816.37	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	18,224	217.50	3,963,720.00	
	SCHLUMBERGER	112,526	34.32	3,861,892.32	
	TARGA RESOURCES CORP	17,298	59.72	1,033,036.56	
	VALERO ENERGY CORP	32,597	107.03	3,488,856.91	
	WILLIAMS COS	98,553	31.32	3,086,679.96	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,541	232.21	4,073,195.61	
	ALBEMARLE CORP	9,440	205.93	1,943,979.20	
	ALCOA CORP	15,500	44.83	694,865.00	
	AMCOR PLC	111,485	12.44	1,386,873.40	
	AVERY DENNISON CORP	6,638	164.95	1,094,938.10	
	BALL CORP	25,605	68.62	1,757,015.10	
	CELANESE CORP-SERIES A	8,582	112.99	969,680.18	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,527	86.00	1,421,322.00	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	15.47	665,210.00	
	CORTEVA INC	58,500	52.73	3,084,705.00	

CROWN HOLDINGS INC	9,940	88.84	883,069.60	
DOW INC	57,346	51.38	2,946,437.48	
DUPONT DE NEMOURS INC	40,980	55.44	2,271,931.20	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	90.19	998,854.25	
ECOLAB INC	19,895	155.61	3,095,860.95	
FMC CORP	10,507	104.93	1,102,499.51	
FREEPORT-MCMORAN INC	113,194	28.00	3,169,432.00	
INT'L PAPER CO	30,800	42.71	1,315,468.00	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,494	116.58	2,272,610.52	
LINDE PLC	40,861	273.68	11,182,838.48	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,803	87.48	1,732,366.44	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,631	307.44	1,423,754.64	
MOSAIC CO/THE	27,732	45.22	1,254,041.04	
NEWMONT CORPORATION	61,555	59.36	3,653,904.80	
NUCOR CORP	22,299	109.01	2,430,813.99	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	139.81	1,074,719.47	
PPG INDUSTRIES INC	19,278	117.87	2,272,297.86	
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	79.98	836,270.88	
SEALED AIR CORP	11,690	56.29	658,030.10	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,719	238.29	4,698,840.51	
STEEL DYNAMICS INC	15,552	66.16	1,028,920.32	
VULCAN MATERIALS CO	10,247	146.41	1,500,263.27	
WESTLAKE CORP	4,100	97.02	397,782.00	
WESTROCK CO	21,356	40.35	861,714.60	
3 M COMPANY	44,860	128.72	5,774,379.20	
AERCAP HOLDINGS NV	11,005	39.28	432,276.40	
ALLEGION PLC	7,601	98.54	749,002.54	
AMETEK INC	18,006	112.35	2,022,974.10	
BOEING CO	43,246	139.07	6,014,221.22	
CARRIER GLOBAL CORP	68,158	36.07	2,458,459.06	
CATERPILLAR	42,499	179.10	7,611,570.90	
CUMMINS INC	11,214	200.53	2,248,743.42	
DEERE&CO	23,252	304.64	7,083,489.28	
DOVER CORP	10,672	121.78	1,299,636.16	
EATON CORP	31,624	127.82	4,042,179.68	
EMERSON ELECTRIC CO	46,305	80.67	3,735,424.35	
FASTENAL CO	44,846	50.64	2,271,001.44	
FORTIVE CORP	25,722	56.01	1,440,689.22	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	61.84	637,570.40	
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	230.56	1,201,448.16	
GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	221.11	4,194,456.70	
GENERAL ELECTRIC CO	87,527	63.25	5,536,082.75	

GRAINGER (WW) INC	3,667	475.13	1,742,301.71	
HEICO CORP	3,640	133.34	485,357.60	
HEICO CORP-CLASS A	6,449	107.63	694,105.87	
HONEYWELL INTL INC	54,596	173.34	9,463,670.64	
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	32.74	1,034,387.56	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	215.68	759,624.96	
IDEX CORP	5,916	185.69	1,098,542.04	
ILLINOIS TOOL WORKS	24,918	182.27	4,541,803.86	
INGERSOLL-RAND INC	31,562	42.45	1,339,806.90	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	51.88	918,276.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	56,689	47.27	2,679,689.03	
KORNIT DIGITAL LTD	2,776	26.14	72,564.64	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,684	238.17	3,735,458.28	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	214.49	541,801.74	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,332	420.35	8,126,206.20	
MASCO CORP	19,462	52.56	1,022,922.72	
NORDSON CORP	4,121	207.43	854,819.03	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,737	480.43	5,638,806.91	
OTIS WORLDWIDE CORP	33,858	69.89	2,366,335.62	
OWENS CORNING	8,642	79.50	687,039.00	
PACCAR INC	28,106	81.07	2,278,553.42	
PARKER HANNIFIN CORP	9,900	248.04	2,455,596.00	
PENTAIR PLC	14,533	46.50	675,784.50	
PLUG POWER INC	41,884	19.77	828,046.68	
QUANTA SERVICES INC	11,465	131.95	1,512,806.75	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	118,799	95.12	11,300,160.88	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,098	200.13	1,820,782.74	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	41.57	574,829.96	
SMITH (A.O.) CORP	9,016	56.97	513,641.52	
SNAP-ON INC	4,000	198.02	792,080.00	
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	110.28	1,389,307.44	
TEXTRON	16,934	61.06	1,033,990.04	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	131.08	2,443,069.04	
TRANSDIGM GROUP INC	4,075	536.66	2,186,889.50	
UNITED RENTALS INC	5,393	248.86	1,342,101.98	
WABTEC CORP	15,024	83.02	1,247,292.48	
XYLEM INC	13,269	78.76	1,045,066.44	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	92.54	1,051,624.56	
CINTAS CORP	7,423	381.07	2,828,682.61	
CLARIVATE PLC	27,357	14.19	388,195.83	
COPART INC	16,617	114.49	1,902,480.33	
COSTAR GROUP INC	32,116	61.80	1,984,768.80	

EQUIFAX INC	9,509	190.45	1,810,989.05	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,661	126.09	1,344,245.49	
LEIDOS HOLDINGS	11,220	101.63	1,140,288.60	
REPUBLIC SERVICES INC	16,942	129.86	2,200,088.12	
ROBERT HALF INTL INC	9,566	78.52	751,122.32	
ROLLINS INC	17,468	36.71	641,250.28	
TRANSUNION	15,741	82.77	1,302,882.57	
VERISK ANALYTICS INC	12,503	178.07	2,226,409.21	
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	125.51	2,670,225.25	
WASTE MANAGEMENT INC	32,770	152.76	5,005,945.20	
AMERCO	734	473.58	347,607.72	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,277	100.26	1,030,372.02	
CSX CORP	173,146	28.99	5,019,502.54	
DELTA AIR LINES INC	14,609	29.72	434,179.48	
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	97.24	1,387,809.28	
FEDEX CORP	20,314	230.49	4,682,173.86	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	83,011	2.50	207,527.50	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	165.70	1,168,516.40	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	48.21	515,847.00	
LYFT INC-A	21,288	13.40	285,259.20	
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	226.20	4,317,479.40	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	273.02	2,184,979.06	
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	36.70	496,661.10	
UBER TECHNOLOGIES INC	113,645	22.34	2,538,829.30	
UNION PACIFIC CORP	50,721	209.70	10,636,193.70	
UNITED PARCEL SERVICE B	58,317	185.40	10,811,971.80	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	7,175	44.55	319,646.25	
APTIV PLC	20,714	92.46	1,915,216.44	
BORGWARNER INC	19,781	34.45	681,455.45	
FORD MOTOR COMPANY	305,209	11.62	3,546,528.58	
GENERAL MOTORS CO	109,933	32.31	3,551,935.23	
LEAR CORP	5,287	128.20	677,793.40	
LUCID GROUP INC	31,234	19.99	624,367.66	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	13,363	31.99	427,482.37	
TESLA INC	69,919	752.29	52,599,364.51	
DR HORTON INC	27,764	73.36	2,036,767.04	
GARMIN LTD	12,854	102.98	1,323,704.92	
HASBRO INC	10,572	83.79	885,827.88	
LENNAR CORP-CL A	20,844	78.39	1,633,961.16	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,305	293.39	2,729,993.95	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	123.92	515,878.96	
NEWELL BRANDS INC	31,461	19.32	607,826.52	

NIKE B	101,600	107.93	10,965,688.00	
NVR INC	247	4,370.80	1,079,587.60	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	10.21	221,924.56	
PULTE GROUP INC	21,609	44.20	955,117.80	
VF CORP	25,718	45.83	1,178,655.94	
WHIRLPOOL CORP	5,220	160.81	839,428.20	
AIRBNB INC-CLASS A	26,610	97.35	2,590,483.50	
ARAMARK	20,955	30.54	639,965.70	
BOOKING HOLDINGS INC	3,255	1,769.48	5,759,657.40	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	39.59	695,200.40	
CARNIVAL CORPORATION	62,102	9.01	559,539.02	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,164	1,339.28	2,898,201.92	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	116.78	1,250,947.36	
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	401.35	1,143,044.80	
EXPEDIA GROUP INC	11,638	94.87	1,104,097.06	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,878	111.59	2,441,366.02	
LAS VEGAS SANDS CORP	24,370	34.38	837,840.60	
MARRIOTT INTL A	22,091	137.80	3,044,139.80	
MCDONALD'S CORP	59,191	253.24	14,989,528.84	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,874	29.34	847,163.16	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,767	34.44	577,455.48	
STARBUCKS CORP	91,531	79.28	7,256,577.68	
VAIL RESORTS INC	3,014	216.12	651,385.68	
WYNN RESORTS LTD	9,302	56.46	525,190.92	
YUM BRANDS INC	22,637	117.28	2,654,867.36	
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,643	78.13	4,816,167.59	
ALPHABET INC-CL A	23,937	2,387.07	57,139,294.59	
ALPHABET INC-CL C	22,610	2,403.37	54,340,195.70	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	38,290	14.66	561,331.40	
CABLE ONE INC	445	1,337.77	595,307.65	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	9,809	463.55	4,546,961.95	
COMCAST CORP-CL A	360,096	39.96	14,389,436.16	
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	18.34	369,220.88	
ELECTRONIC ARTS INC	21,814	125.63	2,740,492.82	
FOX CORP - CLASS A	27,658	33.24	919,351.92	
FOX CORP- CLASS B	10,345	30.63	316,867.35	
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	78.80	529,614.80	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	28.18	953,442.12	
LIBERTY BROADBAND-C	11,268	116.64	1,314,299.52	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	61.05	938,887.95	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	36.63	497,581.92	
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	36.73	234,484.32	

LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,343	84.36	1,041,255.48	
MATCH GROUP INC	22,730	75.24	1,710,205.20	
META PLATFORMS INC-CLASS A	183,787	170.88	31,405,522.56	
NETFLIX INC	35,348	186.97	6,609,192.30	
NEWS CORP-CLASS A	33,479	15.75	527,294.25	
OMNICOM GROUP	16,538	64.46	1,066,039.48	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	48,586	25.56	1,241,858.16	
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	20.24	926,324.08	
ROBLOX CORP -CLASS A	28,059	41.25	1,157,433.75	
ROKU INC	9,122	94.41	861,208.02	
SEA LTD-ADR	28,338	77.52	2,196,761.76	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	6.31	381,553.08	
SNAP INC - A	83,375	14.96	1,247,290.00	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	12,867	124.93	1,607,474.31	
THE WALT DISNEY CO	144,924	95.86	13,892,414.64	
TWITTER INC	63,066	36.81	2,321,459.46	
WARNER BROS DISCOVERY INC	175,398	13.99	2,453,818.02	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	36.65	803,917.75	
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	182.90	973,759.60	
AMAZON.COM	728,980	115.54	84,226,349.20	
AUTOZONE INC	1,639	2,182.37	3,576,904.43	
BATH & BODY WORKS INC	19,806	27.62	547,041.72	
BEST BUY COMPANY INC	18,175	71.17	1,293,514.75	
BURLINGTON STORES INC	5,108	152.20	777,437.60	
CARMAX INC	12,051	92.66	1,116,645.66	
CARVANA CO	5,700	25.09	143,013.00	
CHEWY INC - CLASS A	6,878	44.13	303,526.14	
DOLLAR GENERAL CORP	18,686	252.88	4,725,315.68	
DOLLAR TREE INC	17,931	167.36	3,000,932.16	
DOORDASH INC - A	15,171	74.96	1,137,218.16	
EBAY	46,820	43.14	2,019,814.80	
ETSY INC	10,294	88.75	913,592.50	
GENUINE PARTS CO	11,319	137.14	1,552,287.66	
HOME DEPOT	83,117	286.47	23,810,526.99	
LKQ CORP	22,779	51.22	1,166,740.38	
LOWES COMPANIES	53,337	181.63	9,687,599.31	
MERCADOLIBRE INC	3,567	708.63	2,527,683.21	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,407	657.88	3,557,157.16	
POOL CORP	3,304	378.21	1,249,605.84	
ROSS STORES INC	28,076	75.46	2,118,614.96	
TARGET (DAYTON HUDSON)	38,149	147.99	5,645,670.51	
TJX COMPANIES INC	94,981	58.94	5,598,180.14	

TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	203.96	1,819,731.12	
ULTA BEAUTY INC	4,315	381.44	1,645,913.60	
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	55.31	331,860.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	35,297	501.54	17,702,857.38	
KROGER CO	56,126	48.02	2,695,170.52	
SYSCO CORP	40,288	86.15	3,470,811.20	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	37.55	2,244,250.85	
WALMART INC	121,442	125.40	15,228,826.80	
ALTRIA GROUP INC	142,972	41.52	5,936,197.44	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,772	73.34	3,283,578.48	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	70.16	1,684,260.96	
BUNGE LIMITED	11,604	87.70	1,017,670.80	
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	48.58	770,916.02	
COCA-COLA CO	327,837	63.14	20,699,628.18	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	51.80	797,409.20	
CONAGRA BRANDS INC	35,941	35.31	1,269,076.71	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	242.17	3,133,679.80	
GENERAL MILLS INC	46,541	75.54	3,515,707.14	
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,352	219.79	2,495,056.08	
HORMEL FOODS CORP	23,338	47.55	1,109,721.90	
JM SMUCKER CO	9,145	131.95	1,206,682.75	
KELLOGG CO	21,630	72.52	1,568,607.60	
KEURIG DR PEPPER INC	62,155	36.20	2,250,011.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	58,511	38.37	2,245,067.07	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,909	82.07	1,551,861.63	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	55.50	814,129.50	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	110,537	62.44	6,901,930.28	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	97.48	3,145,387.16	
PEPSICO INC	110,121	171.88	18,927,597.48	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	123,371	93.89	11,583,303.19	
TYSON FOODS INC	23,306	84.11	1,960,267.66	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	94.71	1,832,259.66	
CLOROX COMPANY	9,570	141.36	1,352,815.20	
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,788	78.35	4,997,789.80	
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,438	251.48	4,636,788.24	
KIMBERLY-CLARK CORP	26,841	134.20	3,602,062.20	
PROCTER & GAMBLE CO	190,793	145.02	27,668,800.86	
ABBOTT LABORATORIES	140,374	109.26	15,337,263.24	
ABIOMED INC	3,781	267.00	1,009,527.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	261.52	1,554,213.36	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	142.55	1,838,324.80	
BAXTER INTERNATIONAL	40,013	65.18	2,608,047.34	

BECTON DICKINSON & CO	22,232	245.66	5,461,513.12	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,802	37.84	4,268,427.68	
CARDINAL HEALTH	21,902	52.92	1,159,053.84	
CENTENE CORP	46,422	88.01	4,085,600.22	
CIGNA CORP	25,554	279.19	7,134,421.26	
CVS HEALTH CORP	104,487	94.18	9,840,585.66	
DAVITA INC	4,627	83.12	384,596.24	
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	35.21	625,822.54	
DEXCOM INC	30,588	81.24	2,484,969.12	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	49,627	98.39	4,882,800.53	
ELEVANCE HEALTH INC	19,210	484.29	9,303,210.90	
HCA HEALTHCARE INC	19,440	172.60	3,355,344.00	
HENRY SCHEIN INC	11,747	76.88	903,109.36	
HOLOGIC INC	19,018	71.38	1,357,504.84	
HUMANA INC	9,953	483.38	4,811,081.14	
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	378.45	2,554,915.95	
INSULET CORP	5,311	235.51	1,250,793.61	
INTUITIVE SURGICAL INC	28,484	208.81	5,947,744.04	
LABORATORY CRP OF AMER	7,595	243.94	1,852,724.30	
MASIMO CORP	4,147	136.50	566,065.50	
MCKESSON CORP	12,089	331.20	4,003,876.80	
MEDTRONIC PLC	106,878	89.48	9,563,443.44	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	285.21	1,296,279.45	
NOVOCURE LTD	7,933	74.42	590,373.86	
QUEST DIAGNOSTICS	10,005	135.74	1,358,078.70	
RESMED INC	11,440	217.67	2,490,144.80	
STERIS PLC	8,018	209.40	1,678,969.20	
STRYKER CORP	27,055	200.88	5,434,808.40	
TELADOC HEALTH INC	11,375	41.81	475,588.75	
TELEFLEX INC	3,934	254.66	1,001,832.44	
THE COOPER COS INC	4,134	311.57	1,288,030.38	
UNITEDHEALTH GROUP INC	74,889	518.63	38,839,682.07	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	103.44	631,190.88	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	210.05	2,364,112.75	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,281	105.34	1,715,040.54	
ABBVIE INC	140,788	152.85	21,519,445.80	
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	122.51	2,913,900.35	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	152.49	1,470,461.07	
AMGEN	44,045	248.48	10,944,301.60	
AVANTOR INC	48,633	31.41	1,527,562.53	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	517.12	958,223.36	
BIO-TECHNE CORP	3,245	369.93	1,200,422.85	

BIOGEN INC	11,860	218.80	2,594,968.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	89.02	1,315,982.66	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	172,791	75.38	13,024,985.58	
CATALENT INC	13,739	111.81	1,536,157.59	
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	231.42	972,889.68	
DANAHER CORP	54,097	263.76	14,268,624.72	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	20.45	737,447.45	
EXACT SCIENCES CORP	14,756	46.58	687,334.48	
GILEAD SCIENCES INC	99,836	62.84	6,273,694.24	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	83.61	1,498,792.86	
ILLUMINA INC	12,506	197.04	2,464,182.24	
INCYTE CORP	15,212	80.48	1,224,261.76	
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	219.34	3,317,736.84	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	158.30	786,909.30	
JOHNSON & JOHNSON	209,270	178.28	37,308,655.60	
LILLY (ELI) & CO	64,434	330.47	21,293,503.98	
MERCK & CO	201,204	92.78	18,667,707.12	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,221.28	2,208,074.24	
MODERNA INC	27,309	176.23	4,812,665.07	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	95.57	809,860.18	
PERKINELMER INC	9,372	146.01	1,368,405.72	
PFIZER	447,595	53.17	23,798,626.15	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,497	621.57	5,281,480.29	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,128	42.96	1,122,458.88	
SEAGEN INC	10,981	177.45	1,948,578.45	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	7.44	598,183.44	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,139	553.71	17,241,975.69	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,030	294.29	5,894,628.70	
VIATRIS INC	90,748	10.35	939,241.80	
WATERS CORP	4,749	346.25	1,644,341.25	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	318.48	1,836,674.16	
ZOETIS INC	37,579	177.98	6,688,310.42	
BANK OF AMERICA CORP	576,261	31.79	18,319,337.19	
CITIGROUP	157,983	46.82	7,396,764.06	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	36.31	1,435,043.82	
FIFTH THIRD BANCORP	52,803	33.86	1,787,909.58	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	681.95	647,852.50	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,787	150.94	2,081,009.78	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	12.27	1,400,154.24	
JPMORGAN CHASE & CO	235,026	114.36	26,877,573.36	
KEY CORP	71,472	17.49	1,250,045.28	
M & T BANK CORP	14,037	158.92	2,230,760.04	

PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,936	161.38	5,315,211.68	
REGIONS FINL CORP	70,814	19.02	1,346,882.28	
SIGNATURE BANK	4,686	193.46	906,553.56	
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	418.63	1,902,673.35	
TRUIST FINANCIAL CORP	105,758	47.70	5,044,656.60	
US BANCORP	112,247	46.53	5,222,852.91	
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	43.34	618,591.82	
WELLS FARGO & CO	303,649	40.18	12,200,616.82	
ALLY FINANCIAL INC	27,761	34.74	964,417.14	
AMERICAN EXPRESS	51,483	141.76	7,298,230.08	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	236.53	2,058,284.06	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,854	51.56	1,642,392.24	
BANK NEW YORK CO	61,254	41.89	2,565,930.06	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	102,772	280.83	28,861,460.76	
BLACKROCK INC	12,105	619.56	7,499,773.80	
BLACKSTONE INC	55,765	96.14	5,361,247.10	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,256	108.61	3,611,934.16	
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	31.99	501,251.31	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	118.51	1,051,776.25	
CME GROUP INC	28,617	208.90	5,978,091.30	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	9,576	60.29	577,337.04	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,403	100.21	2,345,214.63	
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,355	25.97	710,409.35	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	401.63	1,264,331.24	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	23.87	622,290.90	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	51.42	221,928.72	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,636	296.47	7,896,774.92	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,703	95.87	4,285,676.61	
INVESCO LTD	26,420	16.21	428,268.20	
KKR & CO INC	44,282	47.55	2,105,609.10	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,386	181.84	1,161,230.24	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	266.11	853,414.77	
MOODY'S CORP	13,365	284.13	3,797,397.45	
MORGAN STANLEY	106,388	76.73	8,163,151.24	
MSCI INC	6,518	433.95	2,828,486.10	
NASDAQ INC	9,657	156.56	1,511,899.92	
NORTHERN TRUST CORP	15,902	96.61	1,536,292.22	
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	115.96	2,076,495.72	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	90.68	1,404,270.48	
S&P GLOBAL INC	28,197	352.48	9,938,878.56	
SCHWAB (CHARLES) CORP	115,365	64.36	7,424,891.40	
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	54.64	521,812.00	

STATE STREET CORP	27,998	63.03	1,764,713.94	
SYNCHRONY FINANCIAL	41,566	29.68	1,233,678.88	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	70.61	639,797.21	
UPSTART HOLDINGS INC	3,148	27.09	85,279.32	
AFLAC	50,591	56.25	2,845,743.75	
ALLEGHANY CORP	1,080	834.57	901,335.60	
ALLSTATE CORP	22,174	130.87	2,901,911.38	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	137.95	871,706.05	
AMERICAN INT'L GROUP	65,898	51.47	3,391,770.06	
AON PLC	17,038	274.37	4,674,716.06	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	44.47	1,321,915.22	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	166.76	2,728,026.84	
ASSURANT INC	4,726	175.09	827,475.34	
BROWN & BROWN INC	19,873	60.08	1,193,969.84	
CHUBB LTD	33,670	193.07	6,500,666.90	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	118.64	1,517,524.24	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	195.76	424,016.16	
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	280.72	923,007.36	
FNF GROUP	20,461	37.12	759,512.32	
GLOBE LIFE INC	8,106	99.27	804,682.62	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,721	65.67	1,820,438.07	
LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	47.36	638,602.24	
LOEWS CORP	16,741	57.93	969,806.13	
MARKEL CORP	1,156	1,296.51	1,498,765.56	
MARSH & MCLENNAN COS	40,031	155.59	6,228,423.29	
METLIFE INC	57,127	62.63	3,577,864.01	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,719	66.92	1,386,515.48	
PROGRESSIVE CORP	46,534	120.38	5,601,762.92	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,511	96.31	2,842,204.41	
TRAVELERS COS INC/THE	19,772	169.00	3,341,468.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,385	201.27	1,888,918.95	
WR BERKLEY CORP	17,572	67.31	1,182,771.32	
CBRE GROUP INC-A	25,382	75.85	1,925,224.70	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	5.01	494,487.00	
WEYERHAEUSER CO	58,295	35.01	2,040,907.95	
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	35.14	471,824.78	
ACCENTURE PLC-CL A	50,581	279.07	14,115,639.67	
ADOBE INC	37,548	389.44	14,622,693.12	
AFFIRM HOLDINGS INC	12,816	23.34	299,125.44	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	13,673	92.15	1,259,966.95	
ANSYS INC	6,794	249.65	1,696,122.10	
APPLOVIN CORP-CLASS A	10,000	37.39	373,900.00	

AUTODESK INC	17,467	179.83	3,141,090.61	
AUTOMATIC DATA PROCESS	33,443	217.27	7,266,160.61	
AVALARA INC	6,847	87.66	600,208.02	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	36.00	503,856.00	
BILL.COM HOLDINGS INC	7,443	129.89	966,771.27	
BLACK KNIGHT INC	11,543	65.19	752,488.17	
BLOCK INC	41,288	67.02	2,767,121.76	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	149.30	1,454,480.60	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,922	160.42	3,516,727.24	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	52.20	556,869.60	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	127.16	1,033,047.84	
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	99.22	1,036,253.68	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	52.08	1,056,338.64	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	40,421	67.02	2,709,015.42	
COUPA SOFTWARE INC	6,059	63.61	385,412.99	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,760	190.38	3,000,388.80	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	139.63	432,853.00	
DATADOG INC - CLASS A	17,059	108.29	1,847,319.11	
DOCUSIGN INC	14,969	66.45	994,690.05	
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	22.74	524,566.32	
DYNATRACE INC	14,790	42.01	621,327.90	
EPAM SYSTEMS INC	4,403	321.02	1,413,451.06	
FAIR ISAAC CORP	2,125	418.85	890,056.25	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	48,175	94.38	4,546,756.50	
FISERV INC	49,921	93.06	4,645,648.26	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	218.45	1,311,136.90	
FORTINET INC	53,225	62.70	3,337,207.50	
GARTNER INC	6,340	242.63	1,538,274.20	
GLOBAL PAYMENTS INC	22,567	113.28	2,556,389.76	
GODADDY INC - CLASS A	13,798	73.00	1,007,254.00	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	75.45	476,693.10	
HUBSPOT INC	3,646	305.80	1,114,946.80	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	72,112	140.47	10,129,572.64	
INTUIT INC	21,247	406.81	8,643,492.07	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	185.57	1,167,420.87	
MASTERCARD INC-CLASS A	69,486	323.06	22,448,147.16	
MICROSOFT CORP	567,129	267.66	151,797,748.14	
MONGODB INC	5,325	314.16	1,672,902.00	
NORTONLIFELOCK INC	43,549	23.07	1,004,675.43	
OKTA INC	11,505	103.90	1,195,369.50	
ORACLE CORP	128,255	71.87	9,217,686.85	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	10.17	1,273,731.48	

PALO ALTO NETWORKS INC	7,648	524.22	4,009,234.56	
PAYCHEX INC	25,433	116.80	2,970,574.40	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	323.29	1,369,133.15	
PAYPAL HOLDINGS INC	88,224	73.43	6,478,288.32	
PTC INC	8,304	106.90	887,697.60	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	56.92	363,889.56	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,314	402.02	3,342,394.28	
SALESFORCE INC	78,410	175.50	13,760,955.00	
SERVICENOW INC	15,923	494.15	7,868,350.45	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	16,606	159.68	2,651,646.08	
SPLUNK INC	13,355	99.71	1,331,627.05	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	59.97	1,159,519.95	
SYNOPSYS INC	12,038	317.54	3,822,546.52	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,090	45.63	1,509,896.70	
TWILIO INC - A	12,842	92.71	1,190,581.82	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	346.49	1,156,930.11	
UNITY SOFTWARE INC	16,329	45.23	738,560.67	
VERISIGN INC	7,790	178.63	1,391,527.70	
VISA INC-CLASS A SHARES	132,437	203.57	26,960,200.09	
VMWARE INC-CLASS A	16,717	113.60	1,899,051.20	
WESTERN UNION CO	29,297	16.55	484,865.35	
WIX.COM LTD	5,010	70.50	353,205.00	
WORKDAY INC-CLASS A	15,615	148.01	2,311,176.15	
ZENDESK INC	8,890	74.61	663,282.90	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,028	119.80	2,039,954.40	
ZSCALER INC	6,234	166.89	1,040,392.26	
AMPHENOL CORPORATION	47,707	65.88	3,142,937.16	
APPLE INC	1,298,829	147.04	190,979,816.16	
ARISTA NETWORKS INC	18,880	103.00	1,944,640.00	
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	111.91	682,651.00	
CDW CORP/DE	10,882	161.53	1,757,769.46	
CISCO SYSTEMS	332,253	43.39	14,416,457.67	
COGNEX CORP	14,352	44.74	642,108.48	
CORNING	64,989	32.61	2,119,291.29	
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	42.92	964,884.52	
F5 INC	4,851	157.86	765,778.86	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	98,742	13.19	1,302,406.98	
HP INC	83,910	32.11	2,694,350.10	
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	28.79	728,991.59	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	142.66	2,138,330.74	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,961	214.65	2,782,078.65	
NETAPP INC	18,303	65.04	1,190,427.12	

SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	16,583	74.87	1,241,569.21	
TE CONNECTIVITY LTD	26,068	115.04	2,998,862.72	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	384.16	1,497,839.84	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	59.76	1,265,477.76	
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	45.24	1,166,739.60	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	299.52	1,246,602.24	
AT&T INC	568,609	20.80	11,827,067.20	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	21.15	328,163.40	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	22.17	609,386.79	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	10.81	797,442.89	
T-MOBILE US INC	49,657	135.72	6,739,448.04	
VERIZON COMMUNICATIONS	334,145	50.49	16,870,981.05	
AES CORP	54,375	21.50	1,169,062.50	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	57.34	1,191,410.52	
AMEREN CORPORATION	20,898	87.75	1,833,799.50	
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,156	94.34	3,788,317.04	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,174	150.86	2,138,289.64	
ATMOS ENERGY CORP	10,802	112.05	1,210,364.10	
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	29.37	1,414,517.94	
CMS ENERGY CORP	23,697	66.02	1,564,475.94	
CONSOLIDATED EDISON INC	27,507	91.97	2,529,818.79	
CONSTELLATION ENERGY	25,732	59.65	1,534,913.80	
DOMINION ENERGY INC	64,535	79.38	5,122,788.30	
DTE ENERGY COMPANY	15,851	124.85	1,978,997.35	
DUKE ENERGY CORP	61,255	105.91	6,487,517.05	
EDISON INTL	30,339	62.47	1,895,277.33	
ENTERGY CORP	16,181	110.09	1,781,366.29	
ESSENTIAL UTILITIES INC	17,002	46.45	789,742.90	
EVERGY INC	18,475	64.40	1,189,790.00	
EVERSOURCE ENERGY	26,753	83.32	2,229,059.96	
EXELON CORP	77,196	44.29	3,419,010.84	
FIRSTENERGY CORP	41,156	37.13	1,528,122.28	
NEXTERA ENERGY INC	156,245	80.25	12,538,661.25	
NISOURCE INC	32,351	28.47	921,032.97	
NRG ENERGY INC	19,068	37.83	721,342.44	
PG&E CORP	118,132	10.27	1,213,215.64	
PPL CORPORATION	58,459	27.18	1,588,915.62	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	62.46	2,465,171.28	
SEMPRA ENERGY	24,535	147.27	3,613,269.45	
SOUTHERN CO	84,113	71.19	5,988,004.47	
UGI CORP	18,019	39.26	707,425.94	
VISTRA CORP	37,797	22.08	834,557.76	

	WEC ENERGY GROUP INC	24,561	99.51	2,444,065.11	
	XCEL ENERGY INC	43,741	69.60	3,044,373.60	
	ADVANCED MICRO DEVICES	130,137	79.35	10,326,370.95	
	ANALOG DEVICES	41,625	149.94	6,241,252.50	
	APPLIED MATERIALS	70,331	91.19	6,413,483.89	
	BROADCOM INC	32,460	498.69	16,187,477.40	
	ENPHASE ENERGY INC	10,113	216.45	2,188,958.85	
	ENTEGRIS INC	10,491	91.49	959,821.59	
	INTEL CORP	324,141	37.99	12,314,116.59	
	KLA CORP	12,119	316.84	3,839,783.96	
	LAM RESEARCH CORP	10,992	415.12	4,562,999.04	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	67,204	46.99	3,157,915.96	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,289	59.45	2,632,981.05	
	MICRON TECHNOLOGY	89,159	59.14	5,272,863.26	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	395.48	1,396,439.88	
	NVIDIA CORP	199,119	158.38	31,536,467.22	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	20,848	154.28	3,216,429.44	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	34,468	53.47	1,843,003.96	
	QORVO INC	8,556	99.41	850,551.96	
	QUALCOMM	90,300	136.01	12,281,703.00	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	97.87	1,308,717.64	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	4,214	295.11	1,243,593.54	
	TERADYNE INC	12,318	92.08	1,134,241.44	
	TEXAS INSTRUMENTS	73,796	155.53	11,477,491.88	
アメリカドル 小計		26,193,313		2,699,305,834.30 (368,374,267,206)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	54,860	15.50	850,330.00	
	CAMECO CORP	31,793	28.86	917,545.98	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,194	63.94	5,958,824.36	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	23.34	2,597,578.62	
	ENBRIDGE	161,329	54.67	8,819,856.43	
	IMPERIAL OIL	16,573	57.49	952,781.77	
	KEYERA CORP	18,607	29.98	557,837.86	
	PARKLAND CORP	14,075	35.26	496,284.50	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	46.25	2,112,052.50	
	SUNCOR ENERGY	116,208	42.43	4,930,705.44	
	TC ENERGY CORP	77,328	67.04	5,184,069.12	
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	66.37	1,659,847.33	
	AGNICO EAGLE MINES	36,354	58.53	2,127,799.62	
	BARRICK GOLD CORP	139,009	22.27	3,095,730.43	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	63.19	830,253.41	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	25.00	1,075,000.00	

FRANCO-NEVADA CORP	15,363	172.11	2,644,125.93	
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	7.58	393,000.26	
KINROSS GOLD CORP	108,451	4.35	471,761.85	
LUNDIN MINING CORP	62,243	7.92	492,964.56	
NUTRIEN LTD	44,786	98.83	4,426,200.38	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	24.49	450,885.39	
TECK RESOURCES LTD-CL B	34,747	35.76	1,242,552.72	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,100	104.79	639,219.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,238	45.59	1,560,910.42	
CAE INC	25,999	31.95	830,668.05	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,585	104.30	791,115.50	
WSP GLOBAL INC	8,602	145.76	1,253,827.52	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	33.46	451,877.30	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	85.19	872,771.55	
THOMSON REUTERS CORP	13,293	137.97	1,834,035.21	
AIR CANADA	13,805	16.81	232,062.05	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	47,367	146.06	6,918,424.02	
CP RAILWAY LIMITED	73,737	93.55	6,898,096.35	
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	110.30	643,821.10	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	72.88	1,696,792.16	
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	86.15	264,480.50	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	36.38	621,334.02	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	67.44	1,556,043.12	
QUEBECOR INC -CL B	15,200	28.15	427,880.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	36.21	1,282,630.62	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	170.13	767,796.69	
DOLLARAMA INC	22,000	78.29	1,722,380.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	67,467	52.85	3,565,630.95	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	40.43	616,678.79	
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	119.11	1,538,067.43	
METRO INC	18,840	71.16	1,340,654.40	
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	154.41	806,946.66	
SAPUTO INC	20,898	29.76	621,924.48	
BAUSCH HEALTH COS INC	20,800	11.36	236,288.00	
BANK MONTREAL	51,389	126.31	6,490,944.59	
BANK NOVA SCOTIA	96,500	75.65	7,300,225.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK	71,829	63.54	4,564,014.66	
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	87.67	2,392,426.63	
ROYAL BANK OF CANADA	112,726	127.56	14,379,328.56	
TORONTO-DOMINION BANK	145,047	83.22	12,070,811.34	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	110,505	58.91	6,509,849.55	
IGM FINANCIAL INC	7,685	35.37	271,818.45	

	ONEX CORP	6,603	64.49	425,827.47	
	TMX GROUP LTD	4,685	130.16	609,799.60	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	707.91	1,509,972.03	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	31.73	754,793.24	
	IA FINANCIAL CORP INC	10,099	64.17	648,052.83	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,312	188.23	2,505,717.76	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	154,778	22.76	3,522,747.28	
	POWER CORP OF CANADA	43,577	33.84	1,474,645.68	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	45,702	58.92	2,692,761.84	
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	166.42	447,669.80	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	7.69	302,986.00	
	CGI INC - CL A	16,178	106.32	1,720,044.96	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,604	1,993.18	3,197,060.72	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	27.44	227,642.24	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	44.06	189,502.06	
	OPEN TEXT CORP	20,463	51.20	1,047,705.60	
	SHOPIFY INC - CLASS A	92,560	46.08	4,265,164.80	
	BCE INC	6,203	63.53	394,076.59	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	26,167	61.54	1,610,317.18	
	TELUS CORP	32,908	28.79	947,421.32	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	17.48	905,778.64	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	27.44	669,398.80	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	47.05	531,429.75	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	38.54	397,886.96	
	EMERA INC	23,223	60.16	1,397,095.68	
	FORTIS INC	36,823	59.69	2,197,964.87	
	HYDRO ONE LTD	23,269	34.05	792,309.45	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	39.53	705,768.62	
カナダドル 小計		3,276,052		182,351,304.90 (19,210,709,971)	
ユーロ	ENI	197,669	11.22	2,219,032.19	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	10.24	406,337.19	
	NESTE OIL OYJ	32,126	44.20	1,419,969.20	
	OMV AG	12,549	41.27	517,897.23	
	REPSOL SA	111,112	12.98	1,442,233.76	
	TENARIS SA	40,648	12.68	515,416.64	
	TOTALENERGIES SE	197,385	49.27	9,725,158.95	
	AIR LIQUIDE	41,637	128.46	5,348,689.02	
	AKZO NOBEL	15,301	63.38	969,777.38	
	ARCELORMITTAL	48,641	21.86	1,063,292.26	
	ARKEMA	4,369	93.58	408,851.02	
	BASF SE	73,837	42.91	3,168,714.85	

COVESTRO AG	14,454	33.44	483,341.76	
CRH PLC	59,653	34.41	2,052,957.99	
EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	20.42	327,475.54	
HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	47.33	617,230.53	
KONINKLIJKE DSM NV	13,707	144.00	1,973,808.00	
OCI NV	12,000	29.56	354,720.00	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	32.88	641,291.52	
SOLVAY SA	5,356	80.68	432,122.08	
STORA ENSO OYJ R	42,169	15.50	653,619.50	
SYMRISE AG	9,776	107.95	1,055,319.20	
UMICORE	17,605	33.80	595,049.00	
UPM KYMMENE OYJ	42,324	29.63	1,254,060.12	
VOESTALPINE AG	7,152	21.16	151,336.32	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	21,143	21.69	458,591.67	
ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	21,143	1.42	30,171.06	
AIRBUS SE	46,955	96.04	4,509,558.20	
ALSTOM	24,388	24.32	593,116.16	
BOUYGUES ORD	16,606	28.58	474,599.48	
BRENNTAG SE	12,514	62.68	784,377.52	
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	11.45	928,152.83	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,388	25.30	844,883.34	
DASSAULT AVIATION SA	2,130	146.30	311,619.00	
EIFFAGE	5,924	88.12	522,022.88	
FERROVIAL SA	34,303	26.00	891,878.00	
GEA GROUP AG	13,382	33.69	450,839.58	
IMCD NV	4,641	136.85	635,120.85	
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	58.76	728,506.48	
KION GROUP AG	5,887	43.04	253,376.48	
KNORR-BREMSE AG	5,022	56.78	285,149.16	
KONE OYJ-B	26,311	47.18	1,241,352.98	
LEGRAND SA	21,768	72.78	1,584,275.04	
MTU AERO ENGINES AG	3,962	175.50	695,331.00	
PRYSMIAN SPA	21,155	27.19	575,204.45	
RATIONAL AG	483	619.00	298,977.00	
RHEINMETALL AG	3,660	195.00	713,700.00	
SAFRAN SA	26,190	99.42	2,603,809.80	
SAINT-GOBAIN	40,093	42.98	1,723,397.60	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,053	117.24	5,047,533.72	
SIEMENS	61,200	99.84	6,110,208.00	
SIEMENS ENERGY AG	36,841	14.84	546,720.44	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	17.92	402,035.20	
THALES SA	8,524	119.90	1,022,027.60	

VINCI S.A.	42,507	88.18	3,748,267.26	
WARTSILA OYJ	41,917	7.91	331,898.80	
BUREAU VERITAS SA	25,073	24.52	614,789.96	
RANDSTAD NV	10,558	48.62	513,329.96	
TELEPERFORMANCE	4,734	310.00	1,467,540.00	
WOLTERS KLUWER	20,839	95.88	1,998,043.32	
ADP	2,382	122.55	291,914.10	
AENA SME SA	5,508	122.00	671,976.00	
ATLANTIA SPA	35,937	22.34	802,832.58	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	5.80	263,034.74	
DEUTSCHE POST AG-REG	78,714	36.35	2,861,647.47	
GETLINK	35,220	17.89	630,085.80	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	76.04	1,985,176.28	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	70.55	352,115.05	
CONTINENTAL AG	8,168	67.80	553,790.40	
FERRARI NV	10,170	190.70	1,939,419.00	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	64,434	55.87	3,599,927.58	
MICHELIN	55,356	27.05	1,497,656.58	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	67.74	795,606.30	
RENAULT SA	17,362	24.62	427,452.44	
STELLANTIS NV	175,794	12.45	2,190,041.65	
VALEO SA	16,596	18.88	313,332.48	
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,282	134.46	1,920,357.72	
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	188.70	469,108.20	
ADIDAS AG	13,972	168.46	2,353,723.12	
ESSILORLUXOTTICA	22,910	143.65	3,291,021.50	
HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,070.00	2,716,730.00	
KERING	5,855	501.00	2,933,355.00	
LVMH	22,101	606.90	13,413,096.90	
MONCLER SPA	14,361	41.48	595,694.28	
PUMA SE	9,220	65.98	608,335.60	
SEB SA	2,282	95.50	217,931.00	
ACCOR	14,436	27.21	392,803.56	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,048	96.22	1,255,478.56	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	31.50	255,402.00	
SODEXO	6,027	73.54	443,225.58	
BOLLORE SE	83,646	4.60	385,440.76	
PUBLICIS GROUPE	17,077	44.25	755,657.25	
SCOUT24 SE	7,492	54.88	411,160.96	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	41.94	296,557.74	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	61,243	20.94	1,282,734.63	
VIVENDI SE	61,243	9.71	595,159.47	

D'IETEREN GROUP	2,217	146.20	324,125.40	
DELIVERY HERO SE	13,414	38.82	520,731.48	
INDITEX	87,326	23.33	2,037,315.58	
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	15.90	247,625.94	
PROSUS	66,706	67.60	4,509,325.60	
ZALANDO SE	17,664	27.12	479,047.68	
CARREFOUR	52,544	17.17	902,180.48	
HELLOFRESH SE	13,805	34.04	469,922.20	
JERONIMO MARTINS	24,901	21.06	524,415.06	
KESKO OYJ-B SHS	20,083	23.33	468,536.39	
KONINKLIJKE AHOLD NV	79,170	26.39	2,089,296.30	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	68,711	54.63	3,753,681.93	
DANONE (GROUPE)	51,543	53.59	2,762,189.37	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	10.30	505,738.48	
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	73.40	679,023.40	
HEINEKEN NV	20,157	93.02	1,875,004.14	
JDE PEET'S BV	7,000	27.00	189,000.00	
KERRY GROUP PLC-A	13,050	96.68	1,261,674.00	
PERNOD-RICARD	16,694	177.85	2,969,027.90	
REMY COINTREAU	1,382	178.00	245,996.00	
BEIERSDORF AG	7,430	98.94	735,124.20	
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	60.75	533,385.00	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	61.88	893,485.32	
LOREAL	19,188	330.45	6,340,674.60	
AMPLIFON SPA	11,650	31.15	362,897.50	
BIOMERIEUX	3,044	104.70	318,706.80	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	127.35	436,810.50	
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	135.80	281,106.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	47.60	808,486.00	
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	28.91	973,948.99	
KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	21.21	1,522,282.32	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	379.20	691,660.80	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	49.23	1,061,743.41	
ARGENX SE	3,976	348.40	1,385,238.40	
BAYER	78,757	57.83	4,554,517.31	
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	77.68	793,889.60	
GRIFOLS SA	27,685	16.90	467,876.50	
IPSEN	3,532	93.15	329,005.80	
MERCK KGAA	10,555	175.10	1,848,180.50	
ORION OYJ-CLASS B	9,854	44.01	433,674.54	
QIAGEN N.V.	17,038	47.43	808,112.34	
RECORDATI SPA	9,859	43.52	429,063.68	

SANOFI	90,542	99.33	8,993,536.86	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,939	336.10	651,697.90	
UCB (GROUPE)	9,389	85.94	806,890.66	
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	10.61	423,561.81	
BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	4.39	2,351,805.80	
BANCO SANTANDER SA	1,393,640	2.61	3,641,581.32	
BNP PARIBAS	86,730	45.46	3,942,745.80	
CAIXABANK	330,447	3.00	991,671.44	
COMMERZBANK AG	81,889	6.40	524,580.93	
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	8.74	869,318.67	
ERSTE GROUP BANK AG	23,905	24.50	585,672.50	
FINECOBANK SPA	53,120	12.15	645,673.60	
ING GROEP NV-CVA	301,618	9.42	2,842,146.41	
INTESA SANPAOLO	1,322,943	1.76	2,331,819.33	
KBC GROEP NV	18,608	52.92	984,735.36	
MEDIOBANCA	53,990	8.42	455,027.72	
SOCIETE GENERALE	63,329	20.82	1,318,826.42	
UNICREDIT SPA	168,352	9.49	1,597,997.18	
AMUNDI SA	4,626	51.50	238,239.00	
DEUTSCHE BANK NAMEN	160,613	8.20	1,317,026.60	
DEUTSCHE BOERSE	14,999	159.95	2,399,090.05	
EURAZEO SA	3,357	62.10	208,469.70	
EURONEXT NV	6,480	76.62	496,497.60	
EXOR NV	7,825	62.76	491,097.00	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	82.28	700,614.20	
SOFINA	1,238	212.80	263,446.40	
WENDEL	2,023	82.85	167,605.55	
AEGON	148,741	4.16	619,655.00	
AGEAS	11,086	42.68	473,150.48	
ALLIANZ SE-REG	32,696	180.28	5,894,434.88	
ASSICURAZIONI GENERALI	85,637	15.37	1,316,240.69	
AXA SA	154,335	21.60	3,334,407.67	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	139.00	602,287.00	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,795	224.20	2,420,239.00	
NN GROUP NV	22,611	44.47	1,005,511.17	
POSTE ITALIANE SPA	46,035	8.68	399,952.08	
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	42.44	1,640,518.20	
AROUNDTOWN SA	64,068	3.04	195,151.12	
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	79.34	418,518.50	
VONOVIA SE	59,080	28.46	1,681,416.80	
ADYEN NV	1,746	1,469.60	2,565,921.60	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	53.52	1,904,455.68	

BECHTLE AG	7,659	40.05	306,742.95	
CAPGEMINI SA	12,715	167.50	2,129,762.50	
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	37.26	1,966,098.42	
EDENRED	18,664	45.24	844,359.36	
NEMETSCHEK SE	5,455	61.06	333,082.30	
NEXI SPA	48,458	8.28	401,232.24	
SAP SE	83,516	89.60	7,483,033.60	
WORLDLINE SA	20,332	35.19	715,483.08	
NOKIA OYJ	427,600	4.60	1,968,029.00	
CELLNEX TELECOM SA	41,435	38.60	1,599,391.00	
DEUTSCHE TELEKOM	258,113	19.21	4,959,899.40	
ELISA A	10,227	54.32	555,530.64	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.98	303,142.50	
KPN (KON.)	282,927	3.38	957,142.04	
ORANGE	153,815	10.59	1,629,823.74	
PROXIMUS	13,141	14.39	189,098.99	
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.25	220,725.71	
TELEFONICA	431,420	4.72	2,036,302.40	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.86	282,324.90	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	27.60	262,558.80	
ACCIONA SA	2,181	189.80	413,953.80	
E.ON SE	170,377	8.18	1,394,365.36	
EDP RENOVAVEIS SA	21,466	24.25	520,550.50	
ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	9.56	377,820.76	
ELIA GROUP SA/NV	3,125	142.80	446,250.00	
ENAGAS	21,663	19.65	425,786.26	
ENDESA	25,972	18.07	469,443.90	
ENEL	650,125	5.25	3,414,456.50	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.63	1,047,268.16	
ENGIE	141,564	10.83	1,533,704.37	
FORTUM OYJ	32,550	13.02	423,801.00	
IBERDROLA SA	464,738	9.91	4,606,483.05	
IBERDROLA SA-RTS	464,738	0.27	128,732.42	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	28.05	280,780.50	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	18.12	556,038.75	
RWE STAMM	49,680	35.82	1,779,537.60	
SNAM SPA	147,559	4.99	737,057.20	
TERNA SPA	102,810	7.36	756,887.22	
UNIPER SE	7,335	10.92	80,098.20	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,027	23.37	1,192,500.99	
VERBUND AG	6,430	102.60	659,718.00	
ASM INTERNATIONAL NV	3,483	219.45	764,344.35	

	ASML HOLDING NV	32,248	446.15	14,387,445.20	
	INFINEON TECHNOLOGIES	101,861	23.25	2,368,268.25	
	STMICROELECTRONICS	55,076	30.83	1,697,993.08	
ユーロ 小計		15,217,090		322,651,100.46 (44,716,216,012)	
イギリスポンド	BP PLC	1,555,608	3.86	6,013,202.72	
	SHELL PLC-NEW	605,870	20.43	12,380,953.45	
	ANGLO AMERICAN PLC	102,156	28.24	2,885,396.22	
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	11.13	399,077.28	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	68.94	753,100.56	
	GLENCORE PLC	767,331	4.31	3,309,882.26	
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	19.25	324,408.24	
	MONDI PLC	36,710	14.80	543,308.00	
	RIO TINTO PLC REG	89,551	48.35	4,329,790.85	
	ASHTEAD GROUP PLC	34,104	38.28	1,305,501.12	
	BAE SYSTEMS PLC	260,104	8.09	2,106,322.19	
	BUNZL PLC	24,880	28.57	710,821.60	
	DCC PLC	6,622	52.66	348,714.52	
	FERGUSON PLC	17,761	92.80	1,648,220.80	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	1.55	498,212.56	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	0.87	554,067.51	
	SMITHS GROUP PLC	26,476	14.21	376,223.96	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	107.25	591,376.50	
	EXPERIAN PLC	74,115	26.03	1,929,213.45	
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	42.55	591,019.50	
	RELX PLC	154,242	22.42	3,458,105.64	
	RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	4.97	698,185.60	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.56	334,167.13	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7,688	38.25	294,066.00	
	BURBERRY GROUP PLC	29,776	16.39	488,177.52	
	PERSIMMON PLC	25,686	17.76	456,311.79	
	TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.12	298,305.46	
	COMPASS GROUP PLC	142,427	17.60	2,506,715.20	
	ENTAIN PLC	49,630	10.97	544,441.10	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	14,811	45.13	668,420.43	
	WHITBREAD PLC	17,434	25.44	443,520.96	
	AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	5.92	428,975.04	
	INFORMA PLC	110,598	5.43	600,768.33	
	PEARSON	55,305	7.76	429,498.63	
	WPP PLC	95,821	8.00	767,142.92	
	JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.24	258,427.83	
	KINGFISHER PLC	153,717	2.50	385,368.51	

	NEXT PLC	11,468	62.82	720,419.76	
	OCADO GROUP PLC	35,862	8.67	310,923.54	
	SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.16	321,738.61	
	TESCO PLC	601,050	2.61	1,573,548.90	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	15.90	409,394.70	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO	173,494	33.83	5,869,302.02	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	18.46	331,631.40	
	DIAGEO	184,500	35.37	6,526,687.50	
	IMPERIAL BRANDS PLC	76,080	18.15	1,381,232.40	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	57,022	62.46	3,561,594.12	
	UNILEVER PLC	201,915	38.36	7,745,459.40	
	SMITH & NEPHEW PLC	68,595	11.35	778,896.22	
	ASTRAZENECA	123,390	110.44	13,627,191.60	
	GSK PLC	405,046	17.54	7,107,747.20	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	16.97	279,224.38	
	BARCLAYS	1,339,545	1.51	2,035,572.58	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,613,344	5.25	8,482,962.75	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,667,831	0.42	2,391,824.68	
	NATWEST GROUP PLC	443,701	2.18	970,817.78	
	STANDARD CHARTERED PLC	212,446	5.79	1,230,912.12	
	3I GROUP PLC	74,757	11.58	865,686.06	
	ABRDN PLC	153,430	1.63	251,164.91	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	8.14	269,461.53	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	26,297	76.12	2,001,727.64	
	M&G PLC	229,107	1.94	445,154.90	
	SCHRODERS PLC	11,794	27.30	321,976.20	
	ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	11.44	468,284.96	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	23.35	379,554.25	
	AVIVA PLC	225,378	4.01	904,441.91	
	LEGAL & GENERAL GROUP	460,759	2.44	1,125,634.23	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.96	303,965.96	
	PRUDENTIAL	210,968	10.16	2,144,489.72	
	AVEVA GROUP PLC	10,917	23.58	257,422.86	
	SAGE GROUP PLC	76,660	6.63	508,409.12	
	HALMA PLC	31,069	21.44	666,119.36	
	BT GROUP PLC	557,358	1.93	1,077,930.37	
	VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	1.28	2,832,216.71	
	NATIONAL GRID PLC	286,046	10.68	3,056,401.51	
	SEVERN TRENT PLC	22,468	27.37	614,949.16	
	SSE PLC	81,663	16.93	1,382,962.90	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.13	593,415.40	
		22,541,258		140,787,862.70	

イギリスポンド 小計				(23,073,722,817)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	17.93	311,946.14	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	740.00	424,760.00	
	GIVAUDAN-REG	748	3,446.00	2,577,608.00	
	HOLCIM LTD	44,847	41.53	1,862,495.91	
	SIKA AG-BR	11,714	225.70	2,643,849.80	
	ABB LTD	127,656	26.50	3,382,884.00	
	GEBERIT AG-REG	2,964	478.00	1,416,792.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	180.40	369,459.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	183.70	568,000.40	
	VAT GROUP AG	1,956	227.80	445,576.80	
	ADECCO GROUP AG-REG	10,450	33.50	350,075.00	
	SGS SA	506	2,232.00	1,129,392.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	236.50	1,082,460.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,341	102.25	4,227,117.25	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	229.50	569,848.50	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	42.62	167,837.56	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,182.00	610,960.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	101,100.00	808,800.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	9,960.00	816,720.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	224,341	114.64	25,718,452.24	
	ALCON INC	39,333	70.10	2,757,243.30	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,007	323.60	1,296,665.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	120.35	1,027,789.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	70.10	129,685.00	
	LONZA GROUP AG-REG	5,895	566.00	3,336,570.00	
	NOVARTIS	174,768	82.76	14,463,799.68	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	379.20	839,928.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	56,019	321.90	18,032,516.10	
	VIFOR PHARMA AG/NEW	3,360	169.85	570,696.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	5.54	1,182,346.90	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	44.19	835,058.43	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	900.60	1,650,799.80	
	UBS GROUP AG	281,888	15.64	4,410,137.76	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,174	157.40	499,587.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	476.50	1,152,653.50	
	SWISS RE LTD	24,445	74.00	1,808,930.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,053	422.10	5,087,571.30	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	85.80	487,258.20	
	TEMENOS AG - REG	5,150	83.30	428,995.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	53.36	783,644.96	
	SWISSCOM	2,187	533.40	1,166,545.80	

スイスフラン 小計		1,382,744		111,433,456.83 (15,541,624,224)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	22,252	326.65	7,268,615.80	
	HOLMEN AB-B SHARES	10,000	421.70	4,217,000.00	
	SCA SV CELLULOSA B	43,887	157.75	6,923,174.25	
	ALFA LAVAL AB	27,268	266.80	7,275,102.40	
	ASSA ABLOY AB-B	78,158	231.40	18,085,761.20	
	ATLAS COPCO A	205,280	102.40	21,020,672.00	
	ATLAS COPCO B	127,608	91.31	11,651,886.48	
	EPIROC AB-A	53,479	169.80	9,080,734.20	
	EPIROC AB-B	28,804	150.25	4,327,801.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	81.86	3,168,964.32	
	INDUTRADE AB	22,644	205.50	4,653,342.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	222.00	3,108,444.00	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	174.10	3,128,577.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	83.96	10,314,318.08	
	SANDVIK AB	87,644	175.85	15,412,197.40	
	SKANSKA B	25,507	161.60	4,121,931.20	
	SKF AB-B	24,865	165.65	4,118,887.25	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	174.90	2,363,598.60	
	VOLVO B	121,238	169.26	20,520,743.88	
	SECURITAS B	29,533	92.96	2,745,387.68	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	77.65	3,869,998.35	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	146.52	3,116,333.88	
	EVOLUTION AB	14,096	927.90	13,079,678.40	
	EMBRACER GROUP AB	53,147	82.89	4,405,354.83	
	HENNES & MAURITZ B	55,229	131.40	7,257,090.60	
	SWEDISH MATCH AB	127,270	105.90	13,477,893.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	274.40	13,575,665.60	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	245.60	4,370,697.60	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	232.80	3,337,188.00	
	NORDEA BANK ABP	253,851	94.95	24,103,152.45	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	131,245	106.55	13,984,154.75	
	SVENSKA HANDELSBK A	110,736	92.48	10,240,865.28	
	SWEDBANK AB-A	72,526	133.80	9,703,978.80	
	EQT AB	23,207	224.40	5,207,650.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	244.00	2,883,592.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	240.80	2,689,254.40	
	INVESTOR AB-A SHS	38,925	196.90	7,664,332.50	
	INVESTOR AB-B SHS	142,777	179.94	25,691,293.38	
	KINNEVIK AB - B	18,792	158.55	2,979,471.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	442.10	3,218,488.00	

	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	50.98	2,890,566.00	
	SAGAX AB-B	12,402	207.20	2,569,694.40	
	SINCH AB	44,150	36.20	1,598,230.00	
	ERICSSON (LM) B	225,508	80.37	18,124,077.96	
	HEXAGON AB-B SHS	153,838	112.70	17,337,542.60	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	121.40	5,676,906.80	
	TELIA CO AB	230,643	40.37	9,311,057.91	
スウェーデンクローナ 小計		3,109,996		395,871,348.63 (5,114,657,824)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	27,755	331.90	9,211,884.50	
	EQUINOR ASA	76,370	334.75	25,564,857.50	
	NORSK HYDRO	96,800	55.02	5,325,936.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	409.70	5,120,430.60	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	351.20	3,036,124.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	75.75	1,448,112.75	
	MOWI ASA	31,968	234.80	7,506,086.40	
	ORKLA	69,804	81.64	5,698,798.56	
	SALMAR ASA	5,423	706.50	3,831,349.50	
	DNB BANK ASA	71,795	180.20	12,937,459.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	205.00	3,807,670.00	
	TELENOR ASA	51,193	133.65	6,841,944.45	
ノルウェークローネ 小計		489,942		90,330,653.26 (1,220,367,125)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	477.00	4,046,391.00	
	NOVOZYMES A/S	17,111	438.80	7,508,306.80	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,649.50	1,245,372.50	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	81,654	170.86	13,951,402.44	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	17,630.00	3,860,970.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	17,710.00	7,686,140.00	
	DSV A/S	15,307	1,047.50	16,034,082.50	
	PANDORA A/S	8,163	476.90	3,892,934.70	
	CARLSBERG AS-B	7,077	938.20	6,639,641.40	
	COLOPLAST-B	9,208	827.40	7,618,699.20	
	DEMANT A/S	8,512	276.10	2,350,163.20	
	GN STORE NORD A/S	9,226	253.20	2,336,023.20	
	GENMAB A/S	5,250	2,494.00	13,093,500.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	134,058	799.00	107,112,342.00	
	DANSKE BANK A/S	56,132	102.00	5,725,464.00	
	TRYG A/S	29,772	161.70	4,814,132.40	
	ORSTED A/S	15,439	804.70	12,423,763.30	
デンマーククローネ 小計		406,800		220,339,328.64 (4,102,718,299)	

オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	33.64	693,959.56	
	SANTOS	265,406	7.06	1,873,766.36	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	24.25	310,715.25	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	146,194	30.80	4,502,775.20	
	BHP GROUP LTD	405,288	39.22	15,895,395.36	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	15.75	547,627.50	
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	2.45	299,277.30	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,592	17.30	2,397,641.60	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	35.12	1,297,613.76	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	46.88	675,493.92	
	NEWCREST MINING LIMITED	73,939	19.76	1,461,034.64	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	7.00	711,396.00	
	ORICA LTD	38,288	15.55	595,378.40	
	RIO TINTO LTD	28,818	97.43	2,807,737.74	
	SOUTH32 LTD	341,133	3.73	1,272,426.09	
	REECE LTD	16,814	14.61	245,652.54	
	BRAMBLES LTD	108,007	11.06	1,194,557.42	
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.77	450,858.07	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	4.44	377,400.00	
	TRANSURBAN GROUP	249,674	14.29	3,567,841.46	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	36.57	1,689,899.70	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	75.51	267,380.91	
	IDP EDUCATION LTD	17,793	25.80	459,059.40	
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.54	826,339.02	
	REA GROUP LTD	3,586	122.50	439,285.00	
	SEEK LTD	28,001	22.38	626,662.38	
	WESFARMERS LTD	91,917	44.76	4,114,204.92	
	COLES GROUP LTD	108,486	18.33	1,988,548.38	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	7.84	861,623.84	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	36.83	3,679,353.83	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	11.43	731,062.80	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	202.16	966,931.28	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	70.50	1,145,484.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	33.30	1,240,458.30	
	CSL LIMITED	38,619	287.35	11,097,169.65	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	225,511	22.70	5,119,099.70	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	136,527	92.59	12,641,034.93	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	253,530	28.11	7,126,728.30	
	WESTPAC BANKING	283,793	19.95	5,661,670.35	
	ASX LTD	14,549	85.14	1,238,701.86	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,434	170.69	5,024,089.46	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	168,725	4.36	735,641.00	

	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.30	766,203.90	
	QBE INSURANCE GROUP	111,591	11.79	1,315,657.89	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	11.05	1,048,247.20	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	24.40	1,082,774.40	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	41.97	579,227.97	
	XERO LTD	11,340	87.04	987,033.60	
	TELSTRA CORP	308,467	3.86	1,190,682.62	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	151,467	5.70	863,361.90	
オーストラリアドル 小計		5,292,463		116,692,166.66 (10,893,213,757)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.36	867,530.56	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	21.41	855,971.80	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.93	853,471.74	
	MERCURY NZ LTD	64,613	5.94	383,801.22	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.75	525,084.00	
ニュージーランドドル 小計		506,126		3,485,859.32 (293,892,799)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	213,996	53.20	11,384,587.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	88.95	9,517,650.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	18.34	3,154,480.00	
	MTR CORP	125,000	41.40	5,175,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	23.40	2,808,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	47.65	8,291,100.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	18.66	3,694,680.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	15.02	2,586,444.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	23.10	3,370,290.00	
	WH GROUP LTD	658,301	5.87	3,864,226.87	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	29.10	8,191,650.00	
	HANG SENG BANK	59,400	133.30	7,918,020.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,800	375.80	36,001,640.00	
	AIA GROUP LTD	962,400	85.15	81,948,360.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	56.10	9,228,225.60	
	ESR GROUP LTD	157,000	20.80	3,265,600.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	14.58	2,522,340.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	28.80	3,606,566.40	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	27.35	3,729,856.25	
	SINO LAND CO	315,400	11.38	3,589,252.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	93.90	10,141,200.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	46.30	1,875,150.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	19.08	1,835,496.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	36.70	4,367,300.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	48.75	3,290,625.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	66.30	9,116,250.00	

	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	8.55	7,734,817.35	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	49.90	5,588,800.00	
香港ドル 小計		6,142,353		257,797,606.67 (4,483,100,379)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.55	738,840.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	4.11	605,814.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.19	562,243.08	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.73	448,950.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.13	737,618.00	
	DBS GROUP	141,500	30.03	4,249,245.00	
	OCBC BANK	257,100	11.45	2,943,795.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	26.41	2,479,899.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.60	633,600.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.85	860,475.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	7.88	337,264.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.36	349,600.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	16.83	432,531.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	584,543	2.66	1,554,884.38	
シンガポールドル 小計		2,644,675		16,934,758.46 (1,650,969,602)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	31.93	1,897,504.11	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	765.00	1,641,690.00	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	30.65	3,013,201.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	32.00	3,483,648.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	18.62	1,852,690.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	120.20	1,502,860.60	
	AZRIELI GROUP	4,323	252.70	1,092,422.10	
	NICE LTD	4,991	713.50	3,561,078.50	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	161.80	1,618,000.00	
イスラエルシェケル 小計		400,064		19,663,094.81 (773,223,675)	
合　計		87,602,876		499,448,683,690 (499,448,683,690)	

(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	964,200.38	
		LENDLEASE GROUP	64,786	615,467.00	
	オーストラリアドル 小計		147,479	1,579,667.38 (147,461,949)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,598,625.00	

		HKT TRUST AND HKT LTD	205,000	2,230,400.00	
	香港ドル 小計		425,500	3,829,025.00 (66,586,744)	
投資信託受益証券合計			572,979	214,048,693 (214,048,693)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,110	1,772,298.50	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	894,818.42	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	36,293	9,255,077.93	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	124,611	762,619.32	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,159,425.92	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	1,003,739.85	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	1,028,602.26	
		CROWN CASTLE INTL CORP	34,413	5,898,388.20	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	22,174	2,801,241.42	
		DUKE REALTY CORP	30,517	1,747,708.59	
		EQUINIX INC	7,120	4,631,702.40	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	1,020,538.70	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	27,140	1,936,981.80	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,368,498.60	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,881,142.12	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,186,848.30	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	905,529.35	
		INVITATION HOMES INC	46,840	1,708,254.80	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,135,976.20	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	949,318.54	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	780,061.24	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,561,586.85	
		PROLOGIS INC	58,917	7,163,128.86	
		PUBLIC STORAGE	12,441	3,929,241.03	
		REALTY INCOME CORP	47,102	3,249,095.96	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	746,030.93	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,782,694.43	
		SIMON PROPERTY GROUP	25,518	2,492,853.42	
		SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,453,844.70	
		UDR INC	24,265	1,087,314.65	
		VENTAS INC	31,565	1,602,555.05	
		VICI PROPERTIES INC	75,321	2,359,053.72	
		VORNADO REALTY TRUST	11,390	333,840.90	
		WELLTOWER INC	35,629	2,925,497.19	
		WP CAREY INC	14,258	1,164,165.70	
	アメリカドル 小計		1,025,752	77,679,675.85 (10,600,945,363)	

カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	216,738.45	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	312,588.20	
カナダドル 小計		20,377	529,326.65 (55,764,562)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	269,932.80	
	GECINA SA	3,139	282,039.15	
	KLEPIERRE	17,225	341,485.62	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	526,513.80	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	402,916.80	
ユーロ 小計		48,695	1,822,888.17 (252,634,071)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	371,101.62	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	46,289	317,079.65	
	SEGRO PLC	93,383	938,499.15	
イギリスポンド 小計		219,086	1,626,680.42 (266,596,654)	
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	872,214.30	
	GOODMAN GROUP	133,807	2,538,318.79	
	GPT GROUP	167,884	760,514.52	
	MIRVAC GROUP	266,683	562,701.13	
	SCENTRE GROUP	382,183	1,039,537.76	
	STOCKLAND	207,412	784,017.36	
	VICINITY CENTERS	365,149	684,654.37	
オーストラリアドル 小計		1,617,208	7,241,958.23 (676,036,800)	
香港ドル	LINK REIT	170,500	11,056,925.00	
香港ドル 小計		170,500	11,056,925.00 (192,279,925)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	826,841.58	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	340,429	714,900.90	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	396,000.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	498,412.64	
シンガポールドル 小計		1,127,756	2,436,155.12 (237,500,762)	
投資証券合計		4,229,374	12,281,758,137 (12,281,758,137)	
合計			12,495,806,830 (12,495,806,830)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式　604銘柄	97.2%	—	—	72.0%
	投資証券　35銘柄	—	—	2.8%	2.1%
カナダドル	株式　86銘柄	99.7%	—	—	3.8%
	投資証券　2銘柄	—	—	0.3%	0.0%
ユーロ	株式　225銘柄	99.4%	—	—	8.7%
	投資証券　5銘柄	—	—	0.6%	0.0%
イギリスポンド	株式　78銘柄	98.9%	—	—	4.5%
	投資証券　3銘柄	—	—	1.1%	0.1%
スイスフラン	株式　41銘柄	100.0%	—	—	3.0%
スウェーデンクローナ	株式　47銘柄	100.0%	—	—	1.0%
ノルウェークローネ	株式　12銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式　17銘柄	100.0%	—	—	0.8%
オーストラリアドル	株式　50銘柄	93.0%	—	—	2.1%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.3%	—	0.0%
	投資証券　7銘柄	—	—	5.8%	0.1%
ニュージーランドドル	株式　5銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式　28銘柄	94.5%	—	—	0.9%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.4%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	4.1%	0.0%
シンガポールドル	株式　14銘柄	87.4%	—	—	0.3%
	投資証券　4銘柄	—	—	12.6%	0.0%
イスラエルシェケル	株式　9銘柄	100.0%	—	—	0.2%

(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。

外国株式最小分散インデックスマザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	175,675,131
コール・ローン	350,020,338
株式	18,198,537,390
投資信託受益証券	58,392,142
投資証券	495,395,757
未収配当金	19,582,931
前払金	1,355,256
差入委託証拠金	62,725,229
流動資産合計	19,361,684,174
資産合計	19,361,684,174
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,406,993
未払解約金	350,000,000
未払利息	107
流動負債合計	351,407,100
負債合計	351,407,100
純資産の部	
元本等	
元本	11,229,018,204
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	7,781,258,870
元本等合計	19,010,277,074
純資産合計	19,010,277,074
負債純資産合計	19,361,684,174

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11日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。

	2022年 7月11日現在
	(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 7月11日現在	
1． 計算期間の末日における受益権の総数		11,229,018,204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	1.6930円
	(1万口当たり純資産額)	(16,930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 7月11日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月11日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	2022年 7月11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	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。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	13,765,562,898円
期中追加設定元本額	14,953,141円
期中一部解約元本額	2,551,497,835円
期末元本額	11,229,018,204円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,154,504,393円
分散投資コア戦略ファンドＳ	6,061,848,131円
マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	4,012,665,680円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

	2022年 7月11日現在

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△192,204,673
投資信託受益証券	△2,663,800
投資証券	△1,384,777
合計	△196,253,250

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式最小分散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 7月11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	132,136,004	－	130,780,748	△1,355,256
合計		132,136,004	－	130,780,748	△1,355,256

(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11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				
	売建	6,772,101	－	6,823,838	△51,737
	シンガポールドル	6,772,101	－	6,823,838	△51,737
合計		6,772,101	－	6,823,838	△51,737

(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	CHENIERE ENERGY INC	1,339	127.86	171,204.54	
	WILLIAMS COS	14,255	31.32	446,466.60	
	NEWMONT CORPORATION	30,962	59.36	1,837,904.32	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,600	51.88	134,888.00	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	970	92.54	89,763.80	
	REPUBLIC SERVICES INC	11,550	129.86	1,499,883.00	
	ROLLINS INC	3,531	36.71	129,623.01	
	WASTE CONNECTIONS INC	12,207	125.51	1,532,100.57	
	WASTE MANAGEMENT INC	13,151	152.76	2,008,946.76	
	AMERCO	502	473.58	237,737.16	
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,632	100.26	464,404.32	
	EXPEDITORS INTL WASH INC	3,611	97.24	351,133.64	
	UNITED PARCEL SERVICE B	861	185.40	159,629.40	
	DOMINO'S PIZZA INC	1,389	401.35	557,475.15	
	MCDONALD'S CORP	5,062	253.24	1,281,900.88	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	8,011	78.13	625,899.43	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	430	463.55	199,326.50	
	COMCAST CORP-CL A	3,130	39.96	125,074.80	
	ELECTRONIC ARTS INC	5,532	125.63	694,985.16	
	LIBERTY BROADBAND-C	7,466	116.64	870,834.24	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	490	124.93	61,215.70	
	AMAZON.COM	660	115.54	76,256.40	
	AUTOZONE INC	408	2,182.37	890,406.96	
	DOLLAR GENERAL CORP	6,877	252.88	1,739,055.76	
	DOLLAR TREE INC	2,159	167.36	361,330.24	
	HOME DEPOT	720	286.47	206,258.40	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	307	657.88	201,969.16	
	POOL CORP	179	378.21	67,699.59	
	TARGET (DAYTON HUDSON)	6,066	147.99	897,707.34	
	KROGER CO	27,039	48.02	1,298,412.78	
	WALMART INC	9,876	125.40	1,238,450.40	
	CAMPBELL SOUP CO (US)	6,053	48.58	294,054.74	
	GENERAL MILLS INC	4,120	75.54	311,224.80	
	HERSHEY FOODS CORPORATION	6,881	219.79	1,512,374.99	
	HORMEL FOODS CORP	15,704	47.55	746,725.20	

JM SMUCKER CO	4,031	131.95	531,890.45	
KELLOGG CO	11,992	72.52	869,659.84	
KEURIG DR PEPPER INC	37,107	36.20	1,343,273.40	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,320	82.07	600,752.40	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,545	62.44	96,469.80	
PEPSICO INC	10,987	171.88	1,888,445.56	
CHURCH & DWIGHT CO INC	6,796	94.71	643,649.16	
CLOROX COMPANY	3,228	141.36	456,310.08	
COLGATE-PALMOLIVE CO	7,556	78.35	592,012.60	
KIMBERLY-CLARK CORP	3,428	134.20	460,037.60	
PROCTER & GAMBLE CO	8,673	145.02	1,257,758.46	
ABBOTT LABORATORIES	3,426	109.26	374,324.76	
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,081	142.55	154,096.55	
BAXTER INTERNATIONAL	6,271	65.18	408,743.78	
BECTON DICKINSON & CO	703	245.66	172,698.98	
HOLOGIC INC	1,975	71.38	140,975.50	
QUEST DIAGNOSTICS	906	135.74	122,980.44	
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,376	518.63	713,634.88	
ABBVIE INC	1,062	152.85	162,326.70	
AMGEN	730	248.48	181,390.40	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4,697	89.02	418,126.94	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	14,866	75.38	1,120,599.08	
DANAHER CORP	3,000	263.76	791,280.00	
GILEAD SCIENCES INC	20,888	62.84	1,312,601.92	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	2,968	83.61	248,154.48	
INCYTE CORP	10,881	80.48	875,702.88	
JOHNSON & JOHNSON	11,772	178.28	2,098,712.16	
LILLY (ELI) & CO	3,663	330.47	1,210,511.61	
MERCK & CO	16,582	92.78	1,538,477.96	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,007	95.57	287,378.99	
PFIZER	25,854	53.17	1,374,657.18	
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,107	621.57	1,309,647.99	
SEAGEN INC	5,281	177.45	937,113.45	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	8,018	294.29	2,359,617.22	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	270	318.48	85,989.60	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	6,729	280.83	1,889,705.07	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,486	118.51	650,145.86	
CME GROUP INC	874	208.90	182,578.60	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2,349	95.87	225,198.63	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	402	266.11	106,976.22	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,371	70.61	379,246.31	
ALLSTATE CORP	671	130.87	87,813.77	

AON PLC	2,405	274.37	659,859.85	
ASSURANT INC	1,910	175.09	334,421.90	
CHUBB LTD	1,989	193.07	384,016.23	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,370	195.76	268,191.20	
MARSH & MCLENNAN COS	8,496	155.59	1,321,892.64	
PROGRESSIVE CORP	7,447	120.38	896,469.86	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	361	201.27	72,658.47	
ACCENTURE PLC-CL A	4,442	279.07	1,239,628.94	
ADOBE INC	286	389.44	111,379.84	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	7,787	92.15	717,572.05	
AUTOMATIC DATA PROCESS	4,937	217.27	1,072,661.99	
BLACK KNIGHT INC	5,418	65.19	353,199.42	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	5,577	149.30	832,646.10	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,603	127.16	585,317.48	
CITRIX SYSTEMS INC	6,391	99.22	634,115.02	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	5,644	67.02	378,260.88	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	746	94.38	70,407.48	
FISERV INC	5,203	93.06	484,191.18	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	5,715	140.47	802,786.05	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,134	185.57	767,146.38	
MASTERCARD INC-CLASS A	231	323.06	74,626.86	
MICROSOFT CORP	3,569	267.66	955,278.54	
NORTONLIFELOCK INC	21,749	23.07	501,749.43	
ORACLE CORP	14,565	71.87	1,046,786.55	
PAYCHEX INC	14,814	116.80	1,730,275.20	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,849	402.02	743,334.98	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	1,176	59.97	70,524.72	
VERISIGN INC	3,847	178.63	687,189.61	
VISA INC-CLASS A SHARES	3,297	203.57	671,170.29	
WESTERN UNION CO	21,926	16.55	362,875.30	
AMPHENOL CORPORATION	1,435	65.88	94,537.80	
ARROW ELECTRONICS INC	861	111.91	96,354.51	
CISCO SYSTEMS	30,700	43.39	1,332,073.00	
DELL TECHNOLOGIES -C	1,795	42.92	77,041.40	
F5 INC	617	157.86	97,399.62	
JUNIPER NETWORKS INC	6,218	28.79	179,016.22	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	8,973	142.66	1,280,088.18	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,157	214.65	1,321,600.05	
AT&T INC	26,386	20.80	548,828.80	
T-MOBILE US INC	10,157	135.72	1,378,508.04	
VERIZON COMMUNICATIONS	40,956	50.49	2,067,868.44	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	3,505	57.34	200,976.70	

	AMEREN CORPORATION	6,184	87.75	542,646.00	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	5,984	94.34	564,530.56	
	CMS ENERGY CORP	5,157	66.02	340,465.14	
	CONSOLIDATED EDISON INC	18,308	91.97	1,683,786.76	
	DOMINION ENERGY INC	7,980	79.38	633,452.40	
	DUKE ENERGY CORP	12,996	105.91	1,376,406.36	
	EVERGY INC	2,502	64.40	161,128.80	
	EVERSOURCE ENERGY	1,386	83.32	115,481.52	
	SOUTHERN CO	19,431	71.19	1,383,292.89	
	WEC ENERGY GROUP INC	14,413	99.51	1,434,237.63	
	XCEL ENERGY INC	21,770	69.60	1,515,192.00	
	TEXAS INSTRUMENTS	5,188	155.53	806,889.64	
アメリカドル 小計		925,602		92,046,427.90 (12,561,576,015)	
カナダドル	AGNICO EAGLE MINES	18,202	58.53	1,065,363.06	
	BARRICK GOLD CORP	78,094	22.27	1,739,153.38	
	FRANCO-NEVADA CORP	10,869	172.11	1,870,663.59	
	KINROSS GOLD CORP	14,868	4.35	64,675.80	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	23,246	45.59	1,059,785.14	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	11,108	36.21	402,220.68	
	INTACT FINANCIAL CORP	5,674	188.23	1,068,017.02	
	CGI INC - CL A	5,272	106.32	560,519.04	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	713	1,993.18	1,421,137.34	
	OPEN TEXT CORP	1,869	51.20	95,692.80	
	BCE INC	3,849	63.53	244,526.97	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	6,756	61.54	415,764.24	
	TELUS CORP	25,080	28.79	722,053.20	
カナダドル 小計		205,600		10,729,572.26 (1,130,360,437)	
ユーロ	SYMRISE AG	4,704	107.95	507,796.80	
	KONE OYJ-B	11,082	47.18	522,848.76	
	FERRARI NV	665	190.70	126,815.50	
	HERMES INTERNATIONAL	185	1,070.00	197,950.00	
	VIVENDI SE	30,294	9.71	294,397.09	
	INDITEX	3,278	23.33	76,475.74	
	JERONIMO MARTINS	11,688	21.06	246,149.28	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	17,256	26.39	455,385.84	
	KERRY GROUP PLC-A	3,249	96.68	314,113.32	
	DIASORIN ITALIA SPA	821	135.80	111,491.80	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,801	49.23	236,353.23	
	EUROFINS SCIENTIFIC	2,450	77.68	190,316.00	
	MERCK KGAA	1,201	175.10	210,295.10	

	QIAGEN N.V.	8,036	47.43	381,147.48	
	RECORDATI SPA	2,270	43.52	98,790.40	
	SANOFI	4,816	99.33	478,373.28	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,851	82.28	152,300.28	
	SOFINA	907	212.80	193,009.60	
	SAMPO OYJ-A SHS	2,630	42.44	111,617.20	
	SAP SE	2,611	89.60	233,945.60	
	CELLNEX TELECOM SA	18,079	38.60	697,849.40	
	DEUTSCHE TELEKOM	93,561	19.21	1,797,868.17	
	ELISA A	7,990	54.32	434,016.80	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	19,808	9.98	197,683.84	
	KPN (KON.)	190,718	3.38	645,198.99	
	ORANGE	113,354	10.59	1,201,098.98	
	PROXIMUS	8,911	14.39	128,229.29	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	60,924	2.86	174,242.64	
	ELIA GROUP SA/NV	1,596	142.80	227,908.80	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	5,874	18.12	106,466.25	
ユーロ 小計		635,610		10,750,135.46 (1,489,861,273)	
イギリスポンド	ASTRAZENECA	2,570	110.44	283,830.80	
	ADMIRAL GROUP PLC	10,360	23.35	241,906.00	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	16,787	5.96	100,050.52	
イギリスポンド 小計		29,717		625,787.32 (102,560,283)	
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	378	740.00	279,720.00	
	GIVAUDAN-REG	242	3,446.00	833,932.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	897	180.40	161,818.80	
	SGS SA	197	2,232.00	439,704.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,839	236.50	671,423.50	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	87	2,182.00	189,834.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	101,100.00	101,100.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	17,021	114.64	1,951,287.44	
	NOVARTIS	21,669	82.76	1,793,326.44	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,430	379.20	542,256.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	5,698	321.90	1,834,186.20	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	348	422.10	146,890.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	4,534	85.80	389,017.20	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,305	53.36	443,154.80	
	SWISSCOM	1,493	533.40	796,366.20	
スイスフラン 小計		65,139		10,574,017.38 (1,474,758,203)	
	ERICSSON (LM) B	27,903	80.37	2,242,564.11	

スウェーデンクローナ	TELIA CO AB	57,949	40.37	2,339,401.13	
スウェーデンクローナ 小計		85,852		4,581,965.24 (59,198,990)	
ノルウェークローネ	TELENOR ASA	35,881	133.65	4,795,495.65	
ノルウェークローネ 小計		35,881		4,795,495.65 (64,787,146)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	910	477.00	434,070.00	
	NOVOZYMES A/S	5,477	438.80	2,403,307.60	
	COLOPLAST-B	5,839	827.40	4,831,188.60	
	NOVO NORDISK A/S-B	10,034	799.00	8,017,166.00	
	TRYG A/S	7,636	161.70	1,234,741.20	
デンマーククローネ 小計		29,896		16,920,473.40 (315,059,214)	
オーストラリアドル	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	6,070	24.25	147,197.50	
	NEWCREST MINING LIMITED	6,660	19.76	131,601.60	
	WESFARMERS LTD	24,271	44.76	1,086,369.96	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	9,187	36.83	338,357.21	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	12,853	22.70	291,763.10	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	147,727	3.30	487,499.10	
	XERO LTD	3,020	87.04	262,860.80	
	TELSTRA CORP	134,735	3.86	520,077.10	
オーストラリアドル 小計		344,523		3,265,726.37 (304,855,556)	
ニュージーランドドル	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	5,300	21.41	113,473.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	50,894	4.93	250,907.42	
ニュージーランドドル 小計		56,194		364,380.42 (30,720,913)	
香港ドル	MTR CORP	86,500	41.40	3,581,100.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	79,000	23.40	1,848,600.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	65,200	15.02	979,304.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	193,500	29.10	5,630,850.00	
	HANG SENG BANK	39,500	133.30	5,265,350.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	543,505	8.55	4,646,967.75	
香港ドル 小計		1,007,205		21,952,171.75 (381,748,266)	
シンガポールドル	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	27,100	4.11	111,381.00	
	OCBC BANK	66,200	11.45	757,990.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	44,000	9.60	422,400.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	432,100	2.66	1,149,386.00	
シンガポールドル 小計		569,400		2,441,157.00 (237,988,395)	
	ICL LTD	26,951	31.93	860,545.43	

イスラエルシェケル	NICE LTD	400	713.50	285,400.00	
イスラエルシェケル 小計		27,351		1,145,945.43 (45,062,699)	
合　計		4,017,970		18,198,537,390 (18,198,537,390)	

(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	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	148,000	1,073,000.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	210,000	2,284,800.00	
	香港ドル 小計		358,000	3,357,800.00 (58,392,142)	
投資信託受益証券合計			358,000	58,392,142 (58,392,142)	
投資証券	アメリカドル	CROWN CASTLE INTL CORP	4,134	708,567.60	
		EQUINIX INC	100	65,052.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,115	192,995.35	
		PUBLIC STORAGE	5,027	1,587,677.41	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	2,319	751,842.99	
	アメリカドル 小計		12,695	3,306,135.35 (451,188,291)	
	香港ドル	LINK REIT	39,200	2,542,120.00	
	香港ドル 小計		39,200	2,542,120.00 (44,207,466)	
投資証券合計			51,895	495,395,757 (495,395,757)	
合計				553,787,899 (553,787,899)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式　131銘柄	96.5%	—	—	67.0%
	投資証券　5銘柄	—	—	3.5%	2.4%

カナダドル	株式　13銘柄	100.0%	—	—	6.0%
ユーロ	株式　30銘柄	100.0%	—	—	7.9%
イギリスポンド	株式　3銘柄	100.0%	—	—	0.5%
スイスフラン	株式　15銘柄	100.0%	—	—	7.9%
スウェーデンクローナ	株式　2銘柄	100.0%	—	—	0.3%
ノルウェークローネ	株式　1銘柄	100.0%	—	—	0.3%
デンマーククローネ	株式　5銘柄	100.0%	—	—	1.7%
オーストラリアドル	株式　8銘柄	100.0%	—	—	1.6%
ニュージーランドドル	株式　2銘柄	100.0%	—	—	0.2%
香港ドル	株式　6銘柄	78.8%	—	—	2.0%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	12.1%	—	0.3%
	投資証券　1銘柄	—	—	9.1%	0.2%
シンガポールドル	株式　4銘柄	100.0%	—	—	1.3%
イスラエルシェケル	株式　2銘柄	100.0%	—	—	0.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	132,714,085
コール・ローン	2,259,410,488
国債証券	312,597,223,127
派生商品評価勘定	15,844,299
未収入金	2,425,783,709
未収利息	1,765,961,136
前払費用	110,429,490
差入委託証拠金	678,619,777
流動資産合計	319,985,986,111
資産合計	319,985,986,111
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,842,379

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
前受金	8,516,393
未払金	20,190,565
未払解約金	2,848,936,237
未払利息	690
流動負債合計	2,891,486,264
負債合計	2,891,486,264
純資産の部	
元本等	
元本	100,796,020,727
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	216,298,479,120
元本等合計	317,094,499,847
純資産合計	317,094,499,847
負債純資産合計	319,985,986,111

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11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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。 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。

	2022年 7月11日現在
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	100,796,020,727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　3.1459円 (1万口当たり純資産額)　(31,459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 7月11日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月11日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	100,722,788,748円
期中追加設定元本額	18,470,670,614円
期中一部解約元本額	18,397,438,635円
期末元本額	100,796,020,727円

区分	2022年 7月11日現在
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,305,952,824円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	565,418,746円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	371,830,524円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,185,410,891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	8,270,921,438円
世界経済インデックスファンド	14,142,591,099円
ＤＣマイセレクション２５	1,953,373,140円
ＤＣマイセレクション５０	1,687,252,476円
ＤＣマイセレクション７５	1,149,779,413円
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	2,291,263,546円
ＤＣマイセレクションＳ２５	962,102,775円
ＤＣマイセレクションＳ５０	758,811,526円
ＤＣマイセレクションＳ７５	428,499,727円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	30,366,183円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	93,070,040円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	47,767,428円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	12,983,964,905円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	589,880,876円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,572,820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）	22,529,139円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	43,815,872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）	1,259,879,403円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	431,085,080円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,717,821,398円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	75,470,817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）	428,711,661円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	166,511,729円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	209,226,867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）	3,528,423,540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	701,050,826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

区分	2022年 7月11日現在
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）	563,442,835円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,147,854,869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）	251,347,548円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	112,616,562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）	1,287,282,482円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	198,344,875円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	15,142,997,294円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	259,984,441円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	325,268,947円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	518,189,431円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,264,365円
グローバル経済コア	849,835,096円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	16,968,143円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	1,718,427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）	30,451,896円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	18,806,212円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	18,856,106円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	8,057,027円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	11,092,702円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル債券インデックス（ノーロード）	159,677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）	280,067,571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）	11,018,700,482円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	331,659,204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）	292,749,576円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	350,568,859円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	1,040,592,444円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	81,871,472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）	70,802,270円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△8,038,387,866
合計	△8,038,387,866

(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 7月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,207,528,892	－	1,216,045,285	8,516,393
合計		1,207,528,892	－	1,216,045,285	8,516,393

(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11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	797,582,891	－	796,729,251	△853,640
	アメリカドル	449,636,386	－	452,638,879	3,002,493
	カナダドル	53,780,682	－	53,843,519	62,837
	メキシコペソ	54,111	－	54,738	627
	ユーロ	218,259,498	－	214,816,515	△3,442,983
	イギリスポンド	75,852,214	－	75,375,600	△476,614
	売建	2,477,785,061	－	2,483,445,894	△5,660,833
	アメリカドル	1,295,685,794	－	1,299,796,785	△4,110,991
	カナダドル	49,860,037	－	50,036,781	△176,744
	メキシコペソ	19,129,076	－	19,219,289	△90,213
	ユーロ	877,585,216	－	878,529,890	△944,674
	イギリスポンド	124,888,809	－	124,918,863	△30,054
	ポーランドズロチ	14,385,330	－	14,443,329	△57,999
	オーストラリアドル	37,825,288	－	37,853,675	△28,387
	オフショア人民元	58,425,511	－	58,647,282	△221,771
合計		3,275,367,952	－	3,280,175,145	△6,514,473

(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	9,560,742.20	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,492,622.47	
		T 0.125% 07/31/23	5,000,000.00	4,848,339.85	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	7,786,400.80	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,708,593.76	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,115,366.21	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,391,894.58	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,488,671.90	
		T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,520,468.75	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	918,203.13	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,761,656.27	
		T 0.25% 09/30/23	12,000,000.00	11,597,343.72	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	6,835,839.82	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,272,343.76	
		T 0.25% 11/15/23	11,000,000.00	10,592,226.59	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,253,750.00	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,670,644.54	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,406,562.48	
		T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,532,399.63	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,795,097.67	
		T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,722,070.30	
		T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,218,179.70	
		T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	6,935,937.52	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,732,929.68	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,635,625.00	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,090,781.25	

		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,723,625.00	
		T 0.5% 04/30/27	11,940,000.00	10,540,781.25	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,083,144.54	
		T 0.5% 06/30/27	3,100,000.00	2,724,730.46	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,077,317.98	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,529,980.45	
		T 0.625% 03/31/27	4,500,000.00	4,006,230.48	
		T 0.625% 05/15/30	12,000,000.00	9,952,500.00	
		T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,235,000.00	
		T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,853,148.43	
		T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,802,584.40	
		T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,187,500.00	
		T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	8,730,859.40	
		T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,457,753.88	
		T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	10,075,312.50	
		T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,742,070.32	
		T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,649,531.24	
		T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	10,737,573.43	
		T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,274,578.12	
		T 0.75% 12/31/23	3,370,000.00	3,255,735.93	
		T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,323,437.52	
		T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,464,921.86	
		T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,357,289.06	
		T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,468,234.39	
		T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	12,855,992.18	
		T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,069,687.50	
		T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,165,000.00	
		T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,174,823.43	
		T 1.125% 08/15/40	7,300,000.00	4,971,984.37	
		T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	9,046,219.58	
		T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	4,633,591.78	
		T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,185,937.52	
		T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	5,392,058.63	
		T 1.25% 05/31/28	8,000,000.00	7,175,000.00	
		T 1.25% 06/30/28	9,500,000.00	8,508,066.43	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,464,954.08	
		T 1.25% 08/15/31	19,380,000.00	16,585,040.62	
		T 1.25% 09/30/28	14,500,000.00	12,927,089.88	
		T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,461,875.00	
		T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,571,576.18	
		T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,826,562.52	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,922,753.90	

		T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	6,387,820.36	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,452,734.37	
		T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	3,918,671.88	
		T 1.375% 11/15/31	21,030,000.00	18,130,160.26	
		T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	4,256,718.78	
		T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,396,027.35	
		T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,585,859.36	
		T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,779,529.68	
		T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	7,022,753.92	
		T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,204,492.23	
		T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,470,000.00	
		T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,777,246.07	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,679,496.11	
		T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,144,706.64	
		T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	9,902,593.75	
		T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,114,550.81	
		T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,452,636.72	
		T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,628,609.36	
		T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,759,382.84	
		T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,484,237.50	
		T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,505,937.50	
		T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,337,890.61	
		T 1.75% 08/15/41	14,500,000.00	10,854,609.37	
		T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,738,437.50	
		T 1.875% 02/15/32	5,020,000.00	4,519,568.75	
		T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	6,105,218.75	
		T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,859,250.00	
		T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,785,781.24	
		T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,941,447.68	
		T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,844,843.78	
		T 1.875% 11/15/51	9,300,000.00	6,850,031.25	
		T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,163,828.16	
		T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,600,000.00	
		T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,020,013.69	
		T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,277,437.50	
		T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,334,468.74	
		T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,466,546.88	
		T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,705,687.48	
		T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,895,117.20	
		T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,644,301.56	
		T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	3,947,421.88	
		T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,602,138.64	
		T 2.25% 02/15/52	2,300,000.00	1,858,507.82	

		T 2.25% 03/31/24	12,000,000.00	11,821,875.00	
		T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,263,281.25	
		T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	6,895,273.42	
		T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	5,307,798.46	
		T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	8,184,287.08	
		T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	3,316,646.87	
		T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	4,429,648.46	
		T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,177,937.50	
		T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,952,154.27	
		T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,272,125.00	
		T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,305,451.19	
		T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,443,662.11	
		T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,286,093.75	
		T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,588,632.84	
		T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,693,062.52	
		T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,668,015.62	
		T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,529,312.50	
		T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	11,280,850.00	
		T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,633,279.68	
		T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	6,755,585.92	
		T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,922,851.55	
		T 2.375% 11/15/49	6,100,000.00	5,056,804.71	
		T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,437,062.10	
		T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,919,726.55	
		T 2.5% 02/15/45	1,710,000.00	1,425,578.91	
		T 2.5% 02/15/46	5,000,000.00	4,166,015.65	
		T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	7,813,593.75	
		T 2.5% 05/15/46	3,450,000.00	2,873,472.67	
		T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,521,740.22	
		T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,608,108.19	
		T 2.625% 02/15/29	13,340,000.00	12,922,082.87	
		T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,154,843.75	
		T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	4,882,869.15	
		T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,475,800.79	
		T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,720,423.46	
		T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	2,982,890.64	
		T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,409,277.37	
		T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,440,273.46	
		T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	996,835.94	
		T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,147,960.94	
		T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,555,140.62	
		T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,494,667.96	

		T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,815,906.25	
		T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,309,532.80	
		T 2.75% 11/15/42	3,920,000.00	3,455,418.76	
		T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,681,855.48	
		T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,969,843.76	
		T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	7,143,442.95	
		T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	3,722,031.25	
		T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	5,100,466.43	
		T 2.875% 05/15/52	1,800,000.00	1,669,781.25	
		T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,790,603.91	
		T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,417,557.01	
		T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,854,156.26	
		T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	2,053,828.12	
		T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,739,052.72	
		T 2.875% 10/31/23	7,900,000.00	7,877,009.73	
		T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	2,238,671.87	
		T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,007,751.58	
		T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	7,429,687.50	
		T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,218,757.85	
		T 2% 02/15/50	5,000,000.00	3,802,734.40	
		T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,110,023.84	
		T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,243,864.64	
		T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,385,380.88	
		T 2% 08/15/25	6,890,000.00	6,655,578.49	
		T 2% 08/15/51	15,150,000.00	11,497,429.68	
		T 2% 11/15/26	10,220,000.00	9,738,941.43	
		T 2% 11/15/41	8,200,000.00	6,406,890.66	
		T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	991,265.62	
		T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,870,000.00	
		T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	5,634,889.87	
		T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	3,856,992.20	
		T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	8,377,687.50	
		T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	1,658,671.87	
		T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,923,462.50	
		T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	5,292,132.83	
		T 3.5% 02/15/39	770,000.00	797,310.93	
		T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,422,875.00	
		T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,020,312.50	
		T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,078,437.50	
		T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	3,087,656.25	
		T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,547,875.00	
		T 3% 02/15/47	800,000.00	733,437.50	
		T 3% 02/15/48	4,450,000.00	4,116,597.67	

	T 3% 02/15/49	5,000,000.00	4,679,296.90	
	T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,496,854.69	
	T 3% 05/15/45	2,500,000.00	2,280,078.12	
	T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,947,181.25	
	T 3% 08/15/48	7,250,000.00	6,726,640.62	
	T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,180,312.50	
	T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,975,781.25	
	T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,551,937.50	
	T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,017,703.12	
	T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	2,630,164.06	
	T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,154,687.50	
	T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,169,859.37	
	T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,212,640.62	
	T 4.375% 11/15/39	2,960,000.00	3,385,731.26	
	T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,272,489.84	
	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	643,371.09	
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,979,437.50	
	T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,628,184.37	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	895,429.68	
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,349,132.81	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,455,492.19	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,283,175.79	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,862,695.32	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,659,230.47	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,279,113.28	
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,708,072.26	
アメリカドル 小計		1,275,160,000.00	1,171,386,952.08 (159,859,177,350)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,050,586.40	
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,280,744.00	
	CAN 0.25% 08/01/23	1,360,000.00	1,317,704.00	
	CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,280,112.00	
	CAN 0.5% 12/01/30	4,940,000.00	3,933,870.20	
	CAN 0.75% 02/01/24	1,300,000.00	1,250,860.00	
	CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	662,928.00	
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,367,841.60	
	CAN 1.25% 03/01/27	2,980,000.00	2,729,739.60	
	CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,113,236.20	
	CAN 1.5% 04/01/25	2,710,000.00	2,586,911.80	
	CAN 1.5% 05/01/24	490,000.00	474,957.00	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,276,700.00	
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,422,934.00	

	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,157,280.00	
	CAN 1.5% 12/01/31	4,170,000.00	3,569,603.40	
	CAN 1.75% 12/01/53	2,260,000.00	1,624,239.40	
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	730,312.20	
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,400,057.10	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,264,005.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,751,868.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	760,000.00	714,643.20	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,330,000.00	1,312,217.90	
	CAN 2.75% 08/01/24	840,000.00	831,289.20	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,650,000.00	1,518,198.00	
	CAN 2.75% 12/01/64	760,000.00	681,993.60	
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,225,452.60	
	CAN 2% 06/01/32	1,290,000.00	1,150,125.30	
	CAN 2% 09/01/23	3,460,000.00	3,410,556.60	
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	3,653,876.70	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,300,000.00	1,355,679.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,156,627.50	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,020,000.00	1,177,661.40	
	CAN 5.75% 06/01/33	960,000.00	1,169,232.00	
	CAN 5% 06/01/37	420,000.00	503,004.60	
カナダドル 小計		66,960,000.00	61,107,047.50 (6,437,627,454)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,216,985.50	
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,956,668.80	
	MBONO 5.5% 03/04/27	12,500,000.00	10,771,875.00	
	MBONO 5.75% 03/05/26	54,810,000.00	48,898,741.50	
	MBONO 5% 03/06/25	5,200,000.00	4,670,432.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	36,490,187.10	
	MBONO 7.75% 05/29/31	45,510,000.00	42,036,221.70	
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	25,007,714.90	
	MBONO 7.75% 11/23/34	10,600,000.00	9,610,596.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	33,730,000.00	32,827,722.50	
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,670,000.00	25,231,953.60	
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	33,534,139.50	
	MBONO 8% 11/07/47	28,400,000.00	25,294,176.00	
	MBONO 8% 12/07/23	29,070,000.00	28,515,925.80	
メキシコペソ 小計		387,590,000.00	363,063,339.90 (2,421,668,783)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,210,573.10	
	BGB 0.2% 10/22/23	630,000.00	628,380.90	
	BGB 0.35% 06/22/32	1,030,000.00	880,279.20	
	BGB 0.4% 06/22/40	1,240,000.00	865,470.40	

		BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,616,160.60	
		BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	298,547.20	
		BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,673,996.80	
		BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,655,557.80	
		BGB 0.8% 06/22/28	1,860,000.00	1,799,996.40	
		BGB 0.9% 06/22/29	2,060,000.00	1,976,673.00	
		BGB 0% 10/22/27	780,000.00	729,830.40	
		BGB 0% 10/22/31	1,830,000.00	1,543,312.20	
		BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,400,685.00	
		BGB 1.4% 06/22/53	960,000.00	703,516.80	
		BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	707,024.00	
		BGB 1.6% 06/22/47	1,240,000.00	1,009,025.20	
		BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	1,059,656.00	
		BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	981,781.50	
		BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,274,847.20	
		BGB 1% 06/22/31	2,070,000.00	1,935,719.10	
		BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	768,768.00	
		BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	703,225.60	
		BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,223,288.80	
		BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	1,437,204.00	
		BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,121,546.40	
		BGB 4.25% 03/28/41	2,030,000.00	2,539,448.80	
		BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,285,635.00	
		BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,286,982.00	
		BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,428,740.80	
		BGB 5% 03/28/35	2,290,000.00	3,001,709.10	
		BKO 0% 03/15/24	1,850,000.00	1,838,252.50	
		BKO 0% 09/15/23	3,150,000.00	3,140,928.00	
		BKO 0% 12/15/23	1,880,000.00	1,873,344.80	
		BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,476,132.00	
		BTPS 0.3% 08/15/23	1,900,000.00	1,892,229.00	
		BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	562,547.80	
		BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,784,691.90	
		BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,815,817.90	
		BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	2,015,360.40	
		BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,529,769.60	
		BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	668,572.90	
		BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,116,575.00	
		BTPS 0.9% 04/01/31	3,830,000.00	3,187,862.20	
		BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	727,759.80	
		BTPS 0.95% 06/01/32	2,550,000.00	2,060,298.00	
		BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,903,327.30	
		BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,213,495.20	

		BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,754,907.00	
		BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	984,350.00	
		BTPS 0% 01/30/24	1,630,000.00	1,604,441.60	
		BTPS 0% 04/01/26	3,860,000.00	3,578,104.20	
		BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	2,937,060.00	
		BTPS 0% 08/01/26	2,580,000.00	2,367,459.60	
		BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,459,050.00	
		BTPS 0% 11/29/23	1,750,000.00	1,726,322.50	
		BTPS 0% 12/15/24	2,900,000.00	2,793,657.00	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,876,192.50	
		BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	1,731,585.80	
		BTPS 1.45% 03/01/36	1,700,000.00	1,335,690.00	
		BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,281,531.00	
		BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,397,600.00	
		BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	850,887.50	
		BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,395,202.60	
		BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	2,787,238.70	
		BTPS 1.65% 03/01/32	2,100,000.00	1,835,526.00	
		BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,278,837.20	
		BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	1,104,801.60	
		BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	1,008,550.00	
		BTPS 1.8% 03/01/41	2,260,000.00	1,714,707.20	
		BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,475,774.00	
		BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,703,618.00	
		BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,697,584.80	
		BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,202,912.00	
		BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	471,470.50	
		BTPS 2.15% 09/01/52	1,300,000.00	932,737.00	
		BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,266,776.00	
		BTPS 2.25% 09/01/36	2,850,000.00	2,461,260.00	
		BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	2,425,684.80	
		BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	1,420,868.10	
		BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	2,966,803.20	
		BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,007,908.50	
		BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,017,496.00	
		BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	1,885,549.90	
		BTPS 2.8% 03/01/67	1,130,000.00	874,168.00	
		BTPS 2.8% 06/15/29	820,000.00	818,507.60	
		BTPS 2.8% 12/01/28	2,720,000.00	2,746,900.80	
		BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	1,908,324.50	
		BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,204,178.00	
		BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,098,380.90	

		BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,332,002.60	
		BTPS 3.25% 03/01/38	500,000.00	481,635.00	
		BTPS 3.25% 09/01/46	1,970,000.00	1,862,063.70	
		BTPS 3.35% 03/01/35	1,820,000.00	1,801,945.60	
		BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,050,421.60	
		BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,144,536.00	
		BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,257,908.50	
		BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	1,908,155.40	
		BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	3,407,342.40	
		BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	2,903,560.00	
		BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,269,571.20	
		BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	3,803,811.00	
		BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,942,391.40	
		BTPS 4.75% 09/01/44	2,100,000.00	2,459,184.00	
		BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	3,768,822.00	
		BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	3,558,060.00	
		BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,151,173.60	
		BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,780,779.20	
		BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	3,984,202.80	
		BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	3,447,902.70	
		BTPS 5% 09/01/40	2,240,000.00	2,661,523.20	
		BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,352,580.00	
		BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	3,614,053.80	
		BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,700,706.00	
		BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	883,720.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	3,788,043.10	
		DBR 0.25% 02/15/29	3,080,000.00	2,926,893.20	
		DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,512,544.20	
		DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	3,072,854.40	
		DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,976,870.00	
		DBR 0.5% 02/15/28	3,680,000.00	3,584,982.40	
		DBR 0.5% 08/15/27	2,930,000.00	2,869,642.00	
		DBR 0% 02/15/30	2,470,000.00	2,272,918.70	
		DBR 0% 02/15/31	3,120,000.00	2,818,264.80	
		DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	3,246,566.40	
		DBR 0% 05/15/35	2,780,000.00	2,300,589.00	
		DBR 0% 05/15/36	3,130,000.00	2,542,530.30	
		DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,215,585.00	
		DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,245,725.00	
		DBR 0% 08/15/30	3,830,000.00	3,494,913.30	
		DBR 0% 08/15/30	670,000.00	612,266.10	
		DBR 0% 08/15/31	4,370,000.00	3,911,281.10	
		DBR 0% 08/15/50	5,330,000.00	3,426,870.20	

		DBR 0% 08/15/52	1,640,000.00	1,015,865.20	
		DBR 0% 11/15/27	2,960,000.00	2,815,611.20	
		DBR 0% 11/15/28	2,500,000.00	2,346,550.00	
		DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	3,318,624.20	
		DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,334,609.20	
		DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,686,795.00	
		DBR 1% 05/15/38	800,000.00	737,360.00	
		DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,019,540.00	
		DBR 1% 08/15/25	3,640,000.00	3,676,509.20	
		DBR 2.5% 07/04/44	3,360,000.00	3,939,028.80	
		DBR 2.5% 08/15/46	3,810,000.00	4,518,012.30	
		DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	2,914,483.00	
		DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	2,874,380.80	
		DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	3,870,149.10	
		DBR 4.25% 07/04/39	2,150,000.00	3,009,118.50	
		DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,108,348.00	
		DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	4,101,113.90	
		DBR 4.75% 07/04/40	2,260,000.00	3,374,157.40	
		DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	3,832,750.40	
		DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,951,274.40	
		DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,517,276.20	
		DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,712,437.50	
		DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,246,344.40	
		FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,495,514.40	
		FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,527,839.20	
		FRTR 0.5% 05/25/26	6,690,000.00	6,539,140.50	
		FRTR 0.5% 05/25/29	6,650,000.00	6,221,673.50	
		FRTR 0.5% 05/25/40	3,210,000.00	2,340,603.60	
		FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	435,362.40	
		FRTR 0.5% 06/25/44	1,980,000.00	1,334,737.80	
		FRTR 0.75% 02/25/28	2,150,000.00	2,073,352.50	
		FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	6,063,371.30	
		FRTR 0.75% 05/25/52	3,680,000.00	2,328,998.40	
		FRTR 0.75% 05/25/53	2,560,000.00	1,581,081.60	
		FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,604,066.00	
		FRTR 0% 02/25/24	4,850,000.00	4,813,770.50	
		FRTR 0% 02/25/25	2,050,000.00	2,003,649.50	
		FRTR 0% 02/25/26	4,460,000.00	4,295,916.60	
		FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,310,476.80	
		FRTR 0% 03/25/24	4,260,000.00	4,225,664.40	
		FRTR 0% 03/25/25	6,390,000.00	6,243,093.90	
		FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,730,140.80	

		FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	4,688,606.20	
		FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	5,242,901.20	
		FRTR 0% 11/25/31	5,790,000.00	4,898,455.80	
		FRTR 1.25% 05/25/34	4,390,000.00	4,003,987.30	
		FRTR 1.25% 05/25/36	5,130,000.00	4,549,540.50	
		FRTR 1.5% 05/25/31	6,170,000.00	6,067,207.80	
		FRTR 1.5% 05/25/50	3,590,000.00	2,884,206.00	
		FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	1,410,703.40	
		FRTR 1.75% 06/25/39	3,320,000.00	3,088,430.00	
		FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,259,923.20	
		FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,595,688.00	
		FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,286,072.00	
		FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,227,756.00	
		FRTR 2.5% 05/25/30	7,180,000.00	7,674,558.40	
		FRTR 2.75% 10/25/27	5,110,000.00	5,488,344.40	
		FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	3,238,994.80	
		FRTR 3.25% 05/25/45	3,400,000.00	3,884,058.00	
		FRTR 3.5% 04/25/26	5,600,000.00	6,107,808.00	
		FRTR 4.25% 10/25/23	5,650,000.00	5,931,031.00	
		FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	5,925,222.80	
		FRTR 4.75% 04/25/35	3,630,000.00	4,698,853.50	
		FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	3,177,556.80	
		FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	2,705,360.70	
		FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	4,155,412.20	
		FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	6,508,771.50	
		FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	5,907,000.40	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,211,315.00	
		IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	884,048.70	
		IRISH 0.2% 10/18/30	960,000.00	849,801.60	
		IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	401,953.40	
		IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	490,824.30	
		IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	362,810.00	
		IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	747,685.40	
		IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	718,564.50	
		IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,169,268.00	
		IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	625,579.00	
		IRISH 1.35% 03/18/31	990,000.00	963,151.20	
		IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	640,768.00	
		IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	768,299.00	
		IRISH 1% 05/15/26	1,640,000.00	1,638,802.80	
		IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,284,620.70	
		IRISH 2% 02/18/45	1,280,000.00	1,189,324.80	
		IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,016,899.50	

		IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,299,629.20	
		NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,270,937.90	
		NETHER 0.25% 07/15/29	1,570,000.00	1,451,119.60	
		NETHER 0.5% 01/15/40	1,930,000.00	1,522,017.30	
		NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,274,667.20	
		NETHER 0.5% 07/15/32	700,000.00	624,799.00	
		NETHER 0.75% 07/15/27	1,560,000.00	1,530,687.60	
		NETHER 0.75% 07/15/28	2,080,000.00	2,018,432.00	
		NETHER 0% 01/15/24	2,230,000.00	2,216,397.00	
		NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,150,908.50	
		NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,752,544.80	
		NETHER 0% 01/15/29	1,390,000.00	1,272,378.20	
		NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	715,977.60	
		NETHER 0% 01/15/52	1,610,000.00	923,946.80	
		NETHER 0% 07/15/30	1,150,000.00	1,022,591.50	
		NETHER 0% 07/15/31	1,770,000.00	1,541,882.40	
		NETHER 1.75% 07/15/23	1,540,000.00	1,560,004.60	
		NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,176,933.80	
		NETHER 2.75% 01/15/47	2,330,000.00	2,723,001.10	
		NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,047,252.30	
		NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	2,911,972.50	
		NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	2,764,981.20	
		NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,124,664.90	
		OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,308,321.70	
		OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,985,390.80	
		OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,686,625.00	
		OBL 0% 04/16/27	1,100,000.00	1,054,537.00	
		OBL 0% 10/09/26	2,900,000.00	2,799,544.00	
		OBL 0% 10/10/25	3,500,000.00	3,426,080.00	
		OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,506,391.10	
		OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,379,465.30	
		RAGB 0.25% 10/20/36	600,000.00	458,136.00	
		RAGB 0.5% 02/20/29	2,130,000.00	1,997,918.70	
		RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	1,057,583.40	
		RAGB 0.7% 04/20/71	440,000.00	233,666.40	
		RAGB 0.75% 02/20/28	1,210,000.00	1,169,598.10	
		RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	531,086.40	
		RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,055,788.80	
		RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	147,968.70	
		RAGB 0.9% 02/20/32	510,000.00	465,997.20	
		RAGB 0% 02/20/30	1,690,000.00	1,495,835.90	
		RAGB 0% 02/20/31	1,640,000.00	1,408,300.80	

		RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	909,158.70	
		RAGB 0% 07/15/23	1,120,000.00	1,114,545.60	
		RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,425,787.20	
		RAGB 0% 10/20/28	200,000.00	182,140.00	
		RAGB 0% 10/20/40	670,000.00	443,017.40	
		RAGB 1.2% 10/20/25	1,070,000.00	1,082,219.40	
		RAGB 1.5% 02/20/47	1,030,000.00	886,654.90	
		RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	190,142.10	
		RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,014,245.10	
		RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,354,392.20	
		RAGB 1.85% 05/23/49	540,000.00	492,706.80	
		RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	686,272.50	
		RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,126,580.40	
		RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	964,061.60	
		RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	569,885.40	
		RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,269,703.80	
		RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,564,909.90	
		RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,475,590.00	
		RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	337,695.60	
		RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	253,717.60	
		RFGB 0.125% 09/15/31	540,000.00	466,430.40	
		RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	353,000.00	
		RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	607,042.00	
		RFGB 0.5% 04/15/43	440,000.00	309,909.60	
		RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	838,279.80	
		RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	615,751.50	
		RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	708,244.00	
		RFGB 0.75% 04/15/31	800,000.00	739,816.00	
		RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	688,958.10	
		RFGB 0% 09/15/23	570,000.00	566,676.90	
		RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	414,220.80	
		RFGB 0% 09/15/26	300,000.00	286,305.00	
		RFGB 0% 09/15/30	800,000.00	699,264.00	
		RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	510,451.20	
		RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	413,604.10	
		RFGB 1.5% 09/15/32	490,000.00	473,790.80	
		RFGB 2.625% 07/04/42	680,000.00	716,114.80	
		RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	594,621.50	
		RFGB 2% 04/15/24	660,000.00	677,773.80	
		RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	908,044.90	
		SPGB 0.1% 04/30/31	3,180,000.00	2,642,325.60	
		SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,263,550.50	
		SPGB 0.35% 07/30/23	2,020,000.00	2,013,152.20	

		SPGB 0.5% 04/30/30	3,400,000.00	3,024,776.00	
		SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,181,004.80	
		SPGB 0.6% 10/31/29	2,950,000.00	2,676,594.00	
		SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,877,326.00	
		SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,341,936.40	
		SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,106,855.20	
		SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,221,746.00	
		SPGB 0% 01/31/26	2,720,000.00	2,590,745.60	
		SPGB 0% 01/31/27	1,560,000.00	1,451,049.60	
		SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,754,871.80	
		SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,079,827.00	
		SPGB 0% 05/31/25	990,000.00	957,132.00	
		SPGB 1.2% 10/31/40	2,810,000.00	2,129,474.20	
		SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	2,846,870.00	
		SPGB 1.3% 10/31/26	4,250,000.00	4,222,672.50	
		SPGB 1.4% 04/30/28	3,070,000.00	3,011,731.40	
		SPGB 1.4% 07/30/28	3,850,000.00	3,764,068.00	
		SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,611,667.20	
		SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,005,800.00	
		SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	364,999.80	
		SPGB 1.5% 04/30/27	2,000,000.00	1,993,820.00	
		SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,094,347.00	
		SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	2,507,560.00	
		SPGB 1.9% 10/31/52	900,000.00	672,804.00	
		SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	2,868,672.80	
		SPGB 1.95% 07/30/30	2,740,000.00	2,711,257.40	
		SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	635,584.60	
		SPGB 1% 10/31/50	2,470,000.00	1,501,537.70	
		SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	2,898,121.60	
		SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,408,255.60	
		SPGB 2.55% 10/31/32	950,000.00	953,800.00	
		SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	1,736,909.50	
		SPGB 2.75% 10/31/24	3,050,000.00	3,183,071.50	
		SPGB 2.9% 10/31/46	2,200,000.00	2,162,402.00	
		SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	1,830,712.20	
		SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,657,440.80	
		SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	2,986,563.80	
		SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,819,927.00	
		SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,139,137.20	
		SPGB 4.7% 07/30/41	2,240,000.00	2,850,803.20	
		SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,551,296.00	
		SPGB 4.9% 07/30/40	2,030,000.00	2,632,301.00	

	SPGB 5.15% 10/31/28	3,490,000.00	4,176,273.60	
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,740,000.00	2,371,063.20	
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,731,613.60	
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,434,755.20	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,319,934.00	
ユーロ 小計		784,740,000.00	777,919,327.30 (107,811,839,570)	
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,431,612.00	
	UKT 0.125% 01/31/24	3,300,000.00	3,201,264.00	
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,044,780.20	
	UKT 0.25% 01/31/25	1,500,000.00	1,433,460.00	
	UKT 0.25% 07/31/31	3,270,000.00	2,749,873.80	
	UKT 0.375% 10/22/26	1,910,000.00	1,786,652.20	
	UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,104,383.60	
	UKT 0.5% 01/31/29	1,650,000.00	1,492,788.00	
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	674,234.40	
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,642,115.00	
	UKT 0.625% 07/31/35	2,810,000.00	2,205,990.50	
	UKT 0.625% 10/22/50	880,000.00	532,611.20	
	UKT 0.75% 07/22/23	2,360,000.00	2,329,650.40	
	UKT 0.875% 01/31/46	1,170,000.00	805,311.00	
	UKT 0.875% 07/31/33	810,000.00	692,217.90	
	UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,568,777.00	
	UKT 1.125% 01/31/39	850,000.00	677,577.50	
	UKT 1.125% 10/22/73	520,000.00	323,637.60	
	UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	920,322.00	
	UKT 1.25% 07/31/51	1,180,000.00	850,968.80	
	UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,204,832.00	
	UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,575,712.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	1,870,190.70	
	UKT 1.5% 07/31/53	420,000.00	321,178.20	
	UKT 1.625% 10/22/28	1,620,000.00	1,590,240.60	
	UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	1,462,592.40	
	UKT 1.625% 10/22/71	1,480,000.00	1,129,891.20	
	UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,080,157.00	
	UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	1,785,878.90	
	UKT 1.75% 09/07/37	2,190,000.00	1,952,757.30	
	UKT 1% 01/31/32	1,070,000.00	950,620.10	
	UKT 1% 04/22/24	800,000.00	787,440.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,505,025.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	2,180,000.00	2,179,673.00	
	UKT 2.75% 09/07/24	1,690,000.00	1,718,628.60	
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,785,802.80	

	UKT 3.25% 01/22/44	2,380,000.00	2,594,771.20	
	UKT 3.5% 01/22/45	2,290,000.00	2,600,272.10	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	2,449,942.00	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	1,973,232.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	1,640,000.00	1,956,306.80	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,479,995.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	1,973,305.80	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,528,180.20	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	2,149,070.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,920,000.00	2,459,577.60	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	1,965,567.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	2,603,960.30	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,570,000.00	1,906,137.00	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,210,000.00	2,831,673.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,761,387.80	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,118,418.50	
	UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	2,076,844.00	
	UKT 5% 03/07/25	2,300,000.00	2,481,930.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,551,037.50	
イギリスポンド 小計		95,970,000.00	95,830,454.70 (15,705,653,220)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	5,758,817.60	
	SGB 0.75% 05/12/28	7,800,000.00	7,475,520.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,560,000.00	7,170,811.20	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,512,375.00	
	SGB 1% 11/12/26	9,640,000.00	9,419,918.80	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,300,000.00	5,697,712.00	
	SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	9,524,037.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,310,000.00	6,904,805.40	
スウェーデンクローナ 小計		63,880,000.00	64,463,997.00 (832,874,841)	
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,340,000.00	3,786,953.80	
	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	5,797,461.60	
	NGB 1.5% 02/19/26	6,470,000.00	6,202,206.70	
	NGB 1.75% 02/17/27	5,130,000.00	4,910,795.10	
	NGB 1.75% 03/13/25	6,070,000.00	5,928,326.20	
	NGB 1.75% 09/06/29	6,340,000.00	5,901,145.20	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,220,000.00	3,014,242.00	
	NGB 2% 04/26/28	5,020,000.00	4,808,607.80	
	NGB 3% 03/14/24	7,760,000.00	7,815,251.20	
ノルウェークローネ 小計		50,830,000.00	48,164,989.60 (650,709,009)	

デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	6,050,000.00	3,711,312.00	
	DGB 0.5% 11/15/27	8,850,000.00	8,489,451.00	
	DGB 0.5% 11/15/29	9,380,000.00	8,738,970.80	
	DGB 0% 11/15/24	2,870,000.00	2,812,341.70	
	DGB 0% 11/15/31	8,390,000.00	7,193,250.40	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,550,000.00	7,653,208.50	
	DGB 1.75% 11/15/25	5,510,000.00	5,641,523.70	
	DGB 4.5% 11/15/39	13,600,000.00	18,709,792.00	
デンマーククローネ 小計		62,200,000.00	62,949,850.10 (1,172,126,208)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,850,000.00	2,161,468.50	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,004,070.40	
	POLGB 0% 07/25/24	2,160,000.00	1,865,095.20	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	2,779,670.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	1,610,000.00	1,055,129.60	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,525,996.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,550,000.00	3,272,106.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	7,650,000.00	6,443,365.50	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	3,082,287.60	
	POLGB 2.75% 04/25/28	5,750,000.00	4,675,440.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	4,848,676.60	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	4,405,693.90	
	POLGB 3.75% 05/25/27	100,000.00	87,060.00	
	POLGB 4% 10/25/23	2,410,000.00	2,317,335.50	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	572,646.00	
ポーランドズロチ 小計		53,230,000.00	44,096,040.80 (1,281,117,863)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	3,430,000.00	3,229,790.90	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,128,276.80	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,660,000.00	2,382,641.80	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,219,756.20	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	2,697,017.40	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,970,000.00	1,261,844.10	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,910,000.00	2,453,508.30	
	ACGB 1% 11/21/31	3,610,000.00	2,883,992.90	
	ACGB 1% 12/21/30	2,360,000.00	1,929,960.80	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,396,365.20	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,090,000.00	2,887,048.80	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,383,546.60	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,397,871.70	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,050,000.00	950,733.00	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,881,499.10	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,602,680.20	

	ACGB 2.75% 11/21/29	1,410,000.00	1,348,002.30	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,560,000.00	2,576,435.20	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,181,256.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	1,046,628.80	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	1,624,422.60	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,459,920.00	
	ACGB 3% 11/21/33	1,290,000.00	1,217,514.90	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,130,000.00	2,213,368.20	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,310,000.00	2,499,720.30	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,477,876.00	
オーストラリアドル 小計		56,070,000.00	51,331,678.10 (4,791,812,150)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	699,697.50	
	SIGB 1.25% 11/01/26	530,000.00	499,843.00	
	SIGB 1.625% 07/01/31	650,000.00	588,601.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	810,000.00	636,692.40	
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	252,624.00	
	SIGB 2.125% 06/01/26	1,080,000.00	1,059,210.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	818,274.90	
	SIGB 2.375% 06/01/25	940,000.00	933,824.20	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	395,152.80	
	SIGB 2.625% 05/01/28	610,000.00	607,944.30	
	SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	717,280.40	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	602,292.60	
	SIGB 2.75% 07/01/23	620,000.00	620,998.20	
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	654,875.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	1,360,000.00	1,367,167.20	
	SIGB 2% 02/01/24	680,000.00	674,016.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	868,628.20	
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	911,521.60	
	SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,603,546.80	
シンガポールドル 小計		15,010,000.00	14,512,190.10 (1,414,793,412)	
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,510,000.00	1,337,709.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,930,694.40	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,485,689.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	3,620,000.00	3,559,292.60	
	MGS 3.757% 05/22/40	1,830,000.00	1,620,336.90	
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	937,291.20	
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,660,224.60	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,588,504.00	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,384,179.50	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,479,360.00	

	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,130,022.60	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,976,244.90	
	MGS 3.9% 11/30/26	2,120,000.00	2,127,420.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	601,692.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	3,120,000.00	3,152,510.40	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,780,000.00	1,808,604.60	
	MGS 4.065% 06/15/50	2,340,000.00	2,068,466.40	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,302,630.40	
	MGS 4.232% 06/30/31	3,000,000.00	3,000,630.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	2,760,000.00	2,686,501.20	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,500,000.00	2,555,650.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	2,920,775.00	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,770,000.00	1,801,399.80	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,456,068.40	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,340,625.20	
	MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,367,911.70	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,688,467.20	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,047,396.70	
マレーシアリンギット 小計		53,640,000.00	53,016,297.70 (1,634,503,061)	
イスラエルシェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	840,000.00	826,919.60	
	ILGOV 0.4% 10/31/24	1,210,000.00	1,163,387.65	
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,058,898.24	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,311,463.00	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	590,000.00	521,265.00	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	1,798,899.06	
	ILGOV 1.5% 11/30/23	2,230,000.00	2,228,964.38	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,229,764.04	
	ILGOV 1% 03/31/30	2,830,000.00	2,521,687.06	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,010,000.00	1,984,760.83	
	ILGOV 2% 03/31/27	2,750,000.00	2,705,480.25	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,202,891.64	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	3,347,442.66	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,130,000.00	2,875,052.06	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	3,060,000.00	3,543,106.98	
イスラエルシェケル 小計		31,840,000.00	32,319,982.45 (1,270,938,061)	
オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	29,520,000.00	29,142,439.20	
	CGB 2.18% 06/25/24	22,500,000.00	22,443,750.00	
	CGB 2.28% 03/17/24	9,700,000.00	9,699,709.00	
	CGB 2.47% 09/02/24	18,980,000.00	19,023,843.80	
	CGB 2.48% 04/15/27	9,000,000.00	8,932,410.00	

		CGB 2.56% 10/21/23	30,440,000.00	30,595,852.80	
		CGB 2.68% 05/21/30	22,480,000.00	22,156,288.00	
		CGB 2.69% 08/12/26	17,240,000.00	17,281,376.00	
		CGB 2.75% 06/15/29	10,000,000.00	9,937,300.00	
		CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,049,072.80	
		CGB 2.84% 04/08/24	11,650,000.00	11,765,218.50	
		CGB 2.85% 06/04/27	12,330,000.00	12,436,901.10	
		CGB 2.89% 11/18/31	9,510,000.00	9,521,697.30	
		CGB 2.91% 10/14/28	7,480,000.00	7,521,214.80	
		CGB 3.01% 05/13/28	10,930,000.00	11,079,303.80	
		CGB 3.02% 05/27/31	12,290,000.00	12,423,715.20	
		CGB 3.03% 03/11/26	46,760,000.00	47,543,697.60	
		CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,062,487.00	
		CGB 3.28% 12/03/27	5,410,000.00	5,579,711.70	
		CGB 3.39% 03/16/50	5,520,000.00	5,531,592.00	
		CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	7,682,216.50	
		CGB 3.72% 04/12/51	2,390,000.00	2,540,570.00	
		CGB 3.81% 09/14/50	7,460,000.00	8,042,924.40	
		CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	12,988,835.80	
		CGB 4.08% 10/22/48	4,110,000.00	4,612,118.70	
	オフショア人民元 小計		355,060,000.00	358,594,246.00 (7,312,382,145)	
合計				312,597,223,127 (312,597,223,127)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券　222銘柄	100.0%	51.1%
カナダドル	国債証券　35銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券　14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券　349銘柄	100.0%	34.5%
イギリスポンド	国債証券　55銘柄	100.0%	5.0%
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　15銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券　26銘柄	100.0%	1.5%

シンガポールドル	国債証券　19銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリンギット	国債証券　28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券　15銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券　25銘柄	100.0%	2.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	3,302,656,539
コール・ローン	88,458,644
株式	106,738,464,625
投資信託受益証券	225,918,409
投資証券	105,662,122
派生商品評価勘定	7,310,828
未収入金	33,229,953
未収配当金	762,397,721
前払金	27,004,685
差入委託証拠金	632,191,949
流動資産合計	111,923,295,475
資産合計	111,923,295,475
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	34,132,513
未払金	4,809
未払解約金	24,310,737
未払利息	27
流動負債合計	58,448,086
負債合計	58,448,086
純資産の部	
元本等	
元本	31,174,998,147
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	80,689,849,242
元本等合計	111,864,847,389
純資産合計	111,864,847,389
負債純資産合計	111,923,295,475

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11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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。 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。

	2022年 7月11日現在
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	31,174,998,147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 3.5883円 (1万口当たり純資産額) (35,883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 7月11日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

	2022年 7月11日現在

２．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月11日現在
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	26,523,301,434円
期中追加設定元本額	5,632,117,769円
期中一部解約元本額	980,421,056円
期末元本額	31,174,998,147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	7,951,060,844円
世界経済インデックスファンド	5,997,478,443円
ＤＣ新興国株式インデックス・オープン	5,485,922,031円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	5,460,012,921円
新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	160,735,778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）	758,310,038円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	621,353,028円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	337,457,090円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	17,026,996円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	84,083,343円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	163,636,493円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	646,608,344円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	110,245,466円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	4,585,194円
グローバル経済コア	355,862,721円
ｉ－ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード）	48,113,983円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	28,837,923円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	23,422,509円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	8,879,982円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	11,205,781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）	1,098,551,147円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	187,947,316円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	51,610,211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）	7,965,227円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△19,870,060,682

投資信託受益証券	△14,630,225
投資証券	△2,905,293
合計	△19,887,596,200

(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 7月11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	4,772,458,253	－	4,745,453,568	△27,004,685
合計		4,772,458,253	－	4,745,453,568	△27,004,685

(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11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	71,113,000	－	71,296,000	183,000
	香港ドル	71,113,000	－	71,296,000	183,000
合計		71,113,000	－	71,296,000	183,000

(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	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	139,400	1.63	227,919.00	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	10,590	0.00	—	
	ROSNEFT OJSC-GDR	134,073	0.00	0.01	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	123,206	0.00	0.01	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	29,910	0.00	—	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	6.26	105,981.80	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	72,204	0.00	—	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	19,598	0.00	—	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,818	0.00	—	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,938	0.00	—	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.00	—	
	SOUTHERN COPPER CORP	11,571	51.14	591,740.94	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	53,727	26.89	1,444,719.03	
	LI AUTO INC - ADR	67,571	38.90	2,628,511.90	
	NIO INC - ADR	160,649	22.60	3,630,667.40	
	XPENG INC - ADR	53,231	32.13	1,710,312.03	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	19,163	39.65	759,812.95	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	41,058	4.69	192,562.02	
	TRIP.COM GROUP LTD	67,056	26.16	1,754,184.96	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	50,479	48.31	2,438,640.49	
	AUTOHOME INC-ADR	6,571	37.83	248,580.93	
	IQIYI INC-ADR	28,984	4.21	122,022.64	
	JOYY INC	6,185	28.05	173,489.25	
	KANZHUN LTD	6,900	26.34	181,746.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	4.81	546,161.07	
	VK CO LTD	19,368	0.00	—	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	22.84	119,887.16	
	YANDEX NV-A	32,725	0.00	—	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	—	
	PINDUODUO INC-ADR	53,748	60.80	3,267,878.40	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	52,765	10.13	534,509.45	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	39,926	0.00	—	
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	68,136	1.94	132,183.84	
	BEIGENE LTD-ADR	4,929	188.74	930,299.46	
	HUTCHMED CHINA-ADR	7,243	15.52	112,411.36	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	3,311	56.05	185,581.55	
	ZAI LAB LTD-ADR	12,825	38.50	493,762.50	

	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	189,281	1.76	334,270.24	
	CREDICORP LTD	8,778	122.88	1,078,640.64	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	—	
	360 DIGITECH INC	8,061	15.55	125,348.55	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	114,133	5.68	648,275.44	
	KE HOLDINGS INC	35,144	16.71	587,256.24	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	152,432	0.88	135,054.75	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	19,000	4.19	79,781.00	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	73.83	578,458.05	
アメリカドル 小計		2,162,588		26,100,651.06 (3,561,955,850)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,063,461	8.07	16,652,130.27	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	377,892	84.83	32,056,578.36	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	191.70	2,779,650.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	48.68	4,714,755.36	
	ALFA S.A.B.-A	313,500	14.95	4,686,825.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	77.13	2,892,375.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	395.10	9,207,805.50	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	43,680	292.61	12,781,204.80	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	146.96	6,272,987.60	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	288,490	32.85	9,476,896.50	
	WALMART DE MEXICO-SER V	567,680	68.56	38,920,140.80	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	135.99	6,864,095.25	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	242,440	123.86	30,028,618.40	
	GRUMA S.A.B.-B	25,960	227.11	5,895,775.60	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	70.60	12,835,080.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	26.41	4,801,338.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	324,600	113.73	36,916,758.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	252,500	33.37	8,425,925.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,513,640	20.31	71,362,028.40	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	74,800	23.94	1,790,712.00	
メキシコペソ 小計		8,717,560		319,361,679.84 (2,130,174,340)	
ブラジルレアル	COSAN SA	118,300	17.74	2,098,642.00	
	PETRO RIO SA	84,700	21.76	1,843,072.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	475,700	31.20	14,841,840.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	544,440	28.80	15,679,872.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	11.93	901,908.00	
	BRASKEM SA-PREF A	19,300	34.48	665,464.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	15.05	1,495,970.00	
	GERDAU SA-PREF	141,800	23.38	3,315,284.00	
	SUZANO SA	90,079	47.59	4,286,859.61	

	VALE SA	477,787	75.40	36,025,139.80	
	WEG SA	217,544	27.27	5,932,424.88	
	CCR SA	125,600	12.14	1,524,784.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	75,752	55.85	4,230,749.20	
	RUMO SA	159,700	16.08	2,567,976.00	
	AMERICANAS SA	73,040	15.80	1,154,032.00	
	LOJAS RENNER S.A.	115,947	24.78	2,873,166.66	
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	2.62	800,410.00	
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	16.57	2,866,610.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	17.47	725,005.00	
	RAIA DROGASIL SA	122,500	19.96	2,445,100.00	
	AMBEV SA	628,600	14.31	8,995,266.00	
	BRF SA	52,500	15.68	823,200.00	
	JBS SA	110,000	31.06	3,416,600.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	14.29	1,433,401.32	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	510,254	6.34	3,235,010.36	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	45,600	29.82	1,359,792.00	
	HYPERA SA	54,500	39.93	2,176,185.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	261,323	14.47	3,781,343.81	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	584,982	17.39	10,172,836.98	
	BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	33.45	2,953,635.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	575,881	22.91	13,193,433.71	
	ITAUSA SA	528,325	8.39	4,432,646.75	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	715,509	11.44	8,185,422.96	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	25.34	1,748,460.00	
	TOTVS SA	57,900	24.92	1,442,868.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	47.49	2,483,727.00	
	TIM SA	96,100	13.51	1,298,311.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	44.82	1,658,340.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	105,500	43.95	4,636,725.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	211,827	10.28	2,177,581.56	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	42.54	2,148,270.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	31.29	851,088.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	42.26	1,954,525.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	22.94	3,787,394.00	
ブラジルレアル 小計		8,711,948		194,620,372.60 (5,051,858,321)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	7,000.00	313,110,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,690.00	229,780,850.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	18,037	84,142.00	1,517,669,254.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	90.00	221,506,920.00	
	FALABELLA SA	70,837	1,988.00	140,823,956.00	

	CENCOSUD SA	137,988	1,235.00	170,415,180.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	5,900.00	43,571,500.00	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	83.00	403,599,120.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,718	27,250.00	155,815,500.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	36.91	231,788,193.11	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	87.20	304,442,668.00	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	21.00	53,786,838.00	
チリペソ 小計		20,076,902		3,786,309,979.11 (532,309,747)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,300.00	1,124,651,700.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	35,490.00	1,042,554,240.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	32,500.00	2,000,862,500.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	22,180.00	1,120,333,980.00	
コロンビアペソ 小計		630,431		5,288,402,420.00 (163,940,475)	
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	9,898	13.68	135,404.64	
	OPAP SA	18,496	13.85	256,169.60	
	JUMBO SA	19,341	13.95	269,806.95	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	0.80	210,934.40	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	282,775	0.79	223,392.25	
	NATIONAL BANK OF GREECE	73,640	3.02	222,834.64	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	16.15	423,243.05	
	PUBLIC POWER CORP	20,834	5.07	105,628.38	
ユーロ 小計		714,859		1,847,413.91 (256,033,093)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	243.10	2,820,689.30	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	26.52	3,096,342.60	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	22.20	2,210,365.20	
	KOC HOLDING AS	89,884	35.62	3,201,668.08	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	21.52	6,429,056.96	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	49.54	4,290,907.10	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	274.00	1,781,274.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	85.40	3,657,169.60	
	AKBANK T.A.S.	276,321	8.09	2,235,436.89	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	18.68	3,948,428.96	
	TURKIYE IS BANKASI-C	384,463	4.49	1,726,238.87	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	17.41	2,491,214.31	
トルコリラ 小計		1,767,743		37,888,791.87 (299,700,343)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	22,644	639.00	14,469,516.00	
	CEZ AS	13,098	1,007.00	13,189,686.00	
		35,742		27,659,202.00	

チェココルナ 小計				(155,674,286)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	44,523	2,914.00	129,740,022.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	7,195.00	109,205,710.00	
	OTP BANK NYRT	38,695	8,470.00	327,746,650.00	
ハンガリーフォリント 小計		98,396		566,692,382.00 (193,687,522)	
ポーランドズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	73.36	2,253,105.68	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	200,051	5.89	1,179,900.79	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	111.65	2,253,766.90	
	LPP SA	124	10,320.00	1,279,680.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	103.80	695,875.20	
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	21.92	791,268.16	
	ALLEGRO.EU SA	39,203	26.87	1,053,580.62	
	DINO POLSKA SA	5,945	336.40	1,999,898.00	
	BANK PEKAO SA	27,684	81.68	2,261,229.12	
	M BANK SA	1,423	235.40	334,974.20	
	PKO BANK POLSKI SA	130,297	27.70	3,609,226.90	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	235.80	1,731,479.40	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	48,568	30.35	1,474,038.80	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	6.53	363,780.68	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	10.34	656,866.12	
ポーランドズロチ 小計		673,493		21,938,670.57 (637,382,002)	
ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	1,310,610	0.00	0.13	
	LUKOIL PJSC	44,089	0.00	—	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	1,141,420	0.00	0.11	
	VTB BANK PJSC	756,074,000	0.00	75.60	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	79,708	0.00	—	
ロシアルーブル 小計		758,649,827		75.84 (164)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	6.56	2,158,240.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	116,000	7.32	849,120.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,915,400	3.48	10,145,592.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	460,000	22.30	10,258,000.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	236,000	4.08	962,880.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,648,000	3.56	9,426,880.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	142,000	21.50	3,053,000.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	2.99	1,016,600.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	144,500	34.95	5,050,275.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	219,000	8.67	1,898,730.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	8.78	3,617,360.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	5.46	1,572,480.00	

CMOC GROUP LTD-H	810,000	4.16	3,369,600.00	
DONGYUE GROUP	147,000	9.20	1,352,400.00	
GANFENG LITHIUM CO LTD-H	54,040	83.05	4,488,022.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	67,000	10.30	690,100.00	
MMG LIMITED	304,000	2.81	854,240.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	6.67	860,430.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	4,750	13.16	62,510.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	6.68	1,209,080.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	9.22	6,721,380.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	4.59	1,262,250.00	
BOC AVIATION LTD	23,800	66.20	1,575,560.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.36	658,560.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	243,000	16.74	4,067,820.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	11.22	1,436,160.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	4.96	3,501,760.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	8.89	1,511,300.00	
CITIC LTD	617,000	8.29	5,114,930.00	
CRRC CORP LTD-H	409,000	2.97	1,214,730.00	
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	7.11	2,047,680.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	19.92	1,553,760.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	8.46	1,353,600.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	54,500	10.64	579,880.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	211,800	12.88	2,727,984.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	141,216	14.08	1,988,321.28	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	38.85	2,420,355.00	
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	4.41	512,442.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	4.49	1,728,982.26	
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	6.69	1,431,660.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	4.99	1,237,520.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	13.74	2,274,615.78	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.60	809,600.00	
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	11.58	5,999,019.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	5.79	1,451,981.46	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	7.44	2,395,680.00	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	223.20	3,906,000.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	142,387	7.57	1,077,869.59	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	6.95	2,154,500.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	5.47	2,014,800.00	
BYD CO LTD-H	102,000	320.80	32,721,600.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	5.89	1,566,740.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	39.75	2,321,400.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	758,000	17.38	13,174,040.00	

GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	14.60	5,150,150.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	7.94	2,845,251.36	
MINTH GROUP LTD	64,000	21.85	1,398,400.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	108,000	16.12	1,740,960.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	151,600	99.15	15,031,140.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	5.10	2,233,800.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	303,000	27.75	8,408,250.00	
LI NING CO LTD	292,000	71.90	20,994,800.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	99,600	87.30	8,695,080.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	165,000	14.78	2,438,700.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	116,000	16.98	1,969,680.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	57,000	19.42	1,106,940.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	18.12	4,430,340.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	68,400	16.18	1,106,712.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	0.73	1,058,500.00	
BAIDU INC-CLASS A	267,900	150.00	40,185,000.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	26,600	212.40	5,649,840.00	
CHINA LITERATURE LTD	51,600	35.40	1,826,640.00	
KINGSOFT CORP LTD	92,000	28.90	2,658,800.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	211,600	86.60	18,324,560.00	
NETEASE INC	246,830	140.20	34,605,566.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	748,300	352.60	263,850,580.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,830,888	121.00	221,537,448.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	422,000	5.53	2,333,660.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	104,000	23.80	2,475,200.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	268,000	2.67	715,560.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	123,550	63.30	7,820,715.00	
JD.COM INC - CL A	237,411	245.80	58,355,623.80	
MEITUAN-CLASS B	495,300	192.30	95,246,190.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	23.50	1,261,950.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	33.15	2,141,490.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	7.26	827,640.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	55.05	5,064,600.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	122.68	1,864,736.00	
CHINA FEIHE LTD	564,000	8.49	4,788,360.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	402,000	38.70	15,557,400.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	182,000	54.30	9,882,600.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	4.18	1,028,280.00	
HUISHAN DAIRY UNTRADE	435,000	—	—	
NONGFU SPRING CO LTD-H	193,000	45.50	8,781,500.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	23.40	4,563,000.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	14.10	3,214,800.00	

TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	68,000	75.95	5,164,600.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	6.94	555,200.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	6.82	3,819,200.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	25.80	1,238,400.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	36.80	3,220,000.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	20.30	507,500.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	35,200	49.45	1,740,640.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	124,000	6.81	844,440.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	22.15	1,461,900.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	9.55	3,812,360.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	13.24	1,700,016.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	19.72	3,770,464.00	
3SBIO INC	119,000	6.12	728,280.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	10,000	77.00	770,000.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	12.48	3,082,560.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,144,160	8.47	9,691,035.20	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	486,000	4.81	2,337,660.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	32.05	4,230,600.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	97.45	496,995.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	16.72	2,039,840.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	139,000	36.80	5,115,200.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	33,450	83.85	2,804,782.50	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	32.70	2,387,100.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,113,000	5.26	5,854,380.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	42,288	115.20	4,871,577.60	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	423,000	80.00	33,840,000.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,441,000	2.70	9,290,700.00	
BANK OF CHINA LTD-H	9,806,200	2.87	28,143,794.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	4.84	5,316,619.00	
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.42	3,253,104.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	11,210,620	5.19	58,183,117.80	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.46	922,500.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	455,923	48.75	22,226,246.25	
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	2.67	1,800,648.00	
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,699,515	4.28	28,673,924.20	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,059,000	5.73	6,068,070.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.20	998,400.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.04	1,951,320.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	203,600	15.84	3,225,024.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	16.78	4,795,304.50	
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	6.49	1,557,600.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	10.28	910,808.00	

HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	5.33	1,903,876.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	135,600	10.78	1,461,768.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	918,000	12.62	11,585,160.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	18.66	7,213,956.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	8.86	1,630,452.64	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	19.88	1,916,432.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.38	2,234,820.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	8.29	5,714,197.52	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	784,500	52.85	41,460,825.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	25.55	1,167,635.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	104,500	11.10	1,159,950.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	2.12	1,225,360.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	468,540	24.90	11,666,646.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	9.22	2,074,500.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	367,111	37.00	13,583,107.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	67,600	38.35	2,592,460.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	19.30	3,443,120.00	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	64,000	8.25	528,000.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	586,560	3.23	1,894,588.80	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,016,654	4.51	4,585,109.54	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	232,000	32.65	7,574,800.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	17.40	1,261,500.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	9.03	1,625,400.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	72,600	11.16	810,216.00	
LONGFOR PROPERTIES	229,000	35.15	8,049,350.00	
SEAZEN GROUP LTD	768,000	3.33	2,557,440.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	4.42	585,650.00	
WHARF HOLDINGS	154,000	29.15	4,489,100.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	115,600	9.96	1,151,376.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	7.80	2,152,800.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	126,700	31.40	3,978,380.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	311,000	18.40	5,722,400.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	88,000	11.26	990,880.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	14.74	1,164,460.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	16.80	1,201,200.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	60,500	22.95	1,388,475.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	29.30	1,963,100.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	9.69	668,610.00	
LENOVO GROUP LTD	900,000	7.15	6,435,000.00	
SUNNY OPTICAL TECH	92,900	116.30	10,804,270.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	1,906,200	13.46	25,657,452.00	
ZTE CORP-H	82,908	17.56	1,455,864.48	

	CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	1.01	4,611,660.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	26.95	1,603,525.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	2.38	1,451,800.00	
	CGN POWER CO LTD-H	791,000	2.03	1,605,730.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	12.52	5,839,328.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	15.58	7,042,160.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	5.25	3,496,500.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,000	38.00	4,028,000.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	17.08	4,396,392.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	98,600	130.90	12,906,740.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	8.52	3,799,920.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	4.27	3,006,080.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	6.40	3,507,200.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	—	—	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	27.90	1,785,600.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	25.65	2,308,500.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	625,987	12.22	7,649,561.14	
香港ドル 小計		100,322,189		1,635,750,754.70 (28,445,705,624)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.02	835,609.36	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	21.90	549,690.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	8.47	2,286,053.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	288,600	4.28	1,235,208.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	7.16	273,512.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.18	733,234.28	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	6.31	672,608.14	
	MISC BHD	125,040	6.79	849,021.60	
	GENTING BHD	271,600	4.52	1,227,632.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.83	1,046,251.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	2.09	634,210.50	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.80	1,027,292.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	50,646	20.62	1,044,320.52	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	133.70	962,640.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	15.60	1,146,288.00	
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.26	656,448.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.07	1,005,477.22	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	181,300	2.62	475,006.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	6.36	1,458,348.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	0.99	499,851.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	3.88	1,166,716.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	923,175	5.14	4,745,119.50	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	20.22	1,239,324.24	

	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	18.50	307,710.50	
	MALAYAN BANKING BHD	571,105	8.62	4,922,925.10	
	PUBLIC BANK BERHAD	1,675,000	4.40	7,370,000.00	
	RHB BANK BHD	214,897	5.64	1,212,019.08	
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	2.74	781,691.86	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	3.49	1,087,833.00	
	MAXIS BHD	267,900	3.37	902,823.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	5.25	1,425,648.00	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	16.36	1,235,180.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	305,275	7.92	2,417,778.00	
	INARI AMERTRON BHD	274,700	2.67	733,449.00	
マレーシアリンギット 小計		9,791,928		48,166,917.90 (1,484,995,712)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	159.00	31,927,200.00	
	PTT PCL-NVDR	1,197,400	34.50	41,310,300.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	51.25	6,155,125.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	46.25	9,546,000.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	45.50	22,119,097.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	100,600	53.75	5,407,250.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	102,600	379.00	38,885,400.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	527,000	70.75	37,285,250.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.65	7,067,050.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	8.65	7,002,175.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	4.86	3,938,058.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	33.50	12,151,723.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	35.25	6,422,550.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	13.00	10,921,755.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	289,000	25.75	7,441,750.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	32.50	5,772,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	691,700	63.50	43,922,950.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	113.00	5,231,900.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	26.75	14,883,700.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	34.50	2,277,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	184,900	15.80	2,921,420.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,176,900	26.75	31,482,075.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	188.50	15,588,950.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	14.90	6,535,885.00	
	SCB X PCL-NVDR	88,700	98.75	8,759,125.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	16.70	2,757,170.00	
	JMT NETWORK SERVICES-NVDR	72,600	68.50	4,973,100.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	55.75	5,658,625.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	42.50	3,816,500.00	

	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	47.00	3,586,100.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	62.00	14,030,600.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	8.25	7,194,000.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	38,900	325.00	12,642,500.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	204.00	24,418,800.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	70.75	8,620,887.50	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	4.72	4,537,850.48	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	36.50	1,949,100.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	16,900	178.50	3,016,650.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	78.25	17,207,175.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	65.75	4,484,150.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	402,900	47.25	19,037,025.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	81,450	38.50	3,135,825.00	
タイバーツ 小計		14,249,966		526,021,745.98 (1,998,882,634)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	51.20	12,182,528.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	643.00	18,184,040.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	492.80	3,379,622.40	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	303,513	49.30	14,963,190.90	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	839.00	30,443,115.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	185.00	28,329,050.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	217.00	13,239,170.00	
	MONDE NISSIN CORP	490,500	13.04	6,396,120.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	119.50	11,419,420.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	212,515	87.00	18,488,805.00	
	BDO UNIBANK INC	219,911	118.80	26,125,426.80	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	49.70	8,015,963.90	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	3.70	8,716,090.00	
	AYALA LAND INC	794,100	25.90	20,567,190.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,567,750	36.90	57,849,975.00	
	CONVERGE INFORMATION AND COM	320,000	21.80	6,976,000.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	2,294.00	10,758,860.00	
	PLDT INC	10,460	1,690.00	17,677,400.00	
	AC ENERGY CORP	821,840	8.18	6,722,651.20	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	350.00	18,613,000.00	
フィリピンペソ 小計		7,934,509		339,047,618.20 (826,801,521)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	2,830.00	6,119,309,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	27,450.00	5,514,705,000.00	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK	964,000	1,760.00	1,696,640,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,715.00	1,690,647,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	785.00	2,262,762,500.00	

	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	7,275.00	1,776,555,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	3,890.00	6,314,625,330.00	
	PT VALE INDONESIA TBK	304,200	5,300.00	1,612,260,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	6,675.00	2,306,880,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,542,000	5,975.00	15,188,450,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	2,138,700	1,900.00	4,063,530,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	792,300	5,750.00	4,555,725,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	31,675.00	1,887,830,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	9,425.00	1,517,425,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	7,025.00	3,014,427,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	4,890.00	3,649,896,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,670.00	6,994,795,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	6,769,300	7,150.00	48,400,495,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	474,900	9,150.00	4,345,335,000.00	
	BANK MANDIRI	2,163,796	7,475.00	16,174,375,100.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	7,600.00	6,157,520,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	8,237,202	4,200.00	34,596,248,400.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	1,180.00	3,351,908,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,601,300	4,010.00	22,461,213,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,076,100	2,980.00	3,206,778,000.00	
インドネシアルピア 小計		48,743,795		208,860,334,830.00 (1,900,629,046)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	52,900.00	274,022,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	93,000.00	593,991,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	6,766	171,500.00	1,160,369,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	12,381	34,600.00	428,382,600.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	32,750.00	366,439,750.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	463,000.00	557,452,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	138,000.00	261,924,000.00	
	LG CHEM LTD	5,774	540,000.00	3,117,960,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	254,500.00	223,196,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	180,000.00	347,400,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	3,350	109,000.00	365,150,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	9,290	231,000.00	2,145,990,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	1,122	102,000.00	114,444,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	82,000.00	191,716,000.00	
	SKC CO LTD	1,734	132,000.00	228,888,000.00	
	CJ CORP	1,230	77,700.00	95,571,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	29,100.00	125,362,800.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	42,494	18,550.00	788,263,700.00	
	ECOPRO BM CO LTD	4,680	118,900.00	556,452,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	29,550.00	199,758,000.00	

GS HOLDINGS CORP	6,593	39,650.00	261,412,450.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	39,550.00	386,324,400.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	125,500.00	265,432,500.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,828	49,450.00	288,194,600.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	83,300.00	362,688,200.00	
LG CORP	11,686	78,400.00	916,182,400.00	
LG ENERGY SOLUTION	2,553	388,000.00	990,564,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	11,910	114,000.00	1,357,740,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	20,550.00	380,503,800.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	5,500.00	523,429,500.00	
SK INC	4,545	208,500.00	947,632,500.00	
S-1 CORPORATION	3,573	63,700.00	227,600,100.00	
CJ LOGISTICS	862	122,000.00	105,164,000.00	
HMM CO LTD	35,545	25,100.00	892,179,500.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	180,000.00	502,740,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	23,739	25,150.00	597,035,850.00	
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	5,590.00	166,224,240.00	
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	7,066	32,750.00	231,411,500.00	
HANON SYSTEMS	19,000	10,000.00	190,000,000.00	
HYUNDAI MOBIS	7,116	204,500.00	1,455,222,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	16,824	178,000.00	2,994,672,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,051	86,400.00	263,606,400.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	87,000.00	300,063,000.00	
KIA CORP	29,259	76,800.00	2,247,091,200.00	
COWAY CO LTD	9,036	64,900.00	586,436,400.00	
F&F CO LTD / NEW	3,017	138,000.00	416,346,000.00	
HLB INC	10,012	40,300.00	403,483,600.00	
LG ELECTRONICS INC	13,527	92,000.00	1,244,484,000.00	
KANGWON LAND INC	7,703	25,450.00	196,041,350.00	
CHEIL COMMUNICATIONS INC	9,880	23,550.00	232,674,000.00	
CJ ENM CO LTD	830	95,800.00	79,514,000.00	
HYBE CO LTD	2,474	164,500.00	406,973,000.00	
KAKAO CORP	37,877	71,800.00	2,719,568,600.00	
KAKAO GAMES CORP	3,021	49,000.00	148,029,000.00	
KRAFTON INC	3,554	237,000.00	842,298,000.00	
NAVER CORP	15,839	249,000.00	3,943,911,000.00	
NCSOFT CORPORATION	1,939	373,500.00	724,216,500.00	
NETMARBLE CORP	2,465	68,700.00	169,345,500.00	
PEARL ABYSS CORP	4,605	52,600.00	242,223,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	4,363	69,700.00	304,101,100.00	
LOTTE SHOPPING CO	1,034	99,000.00	102,366,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	1,632	189,500.00	309,264,000.00	

EMART	3,594	106,500.00	382,761,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	775	389,000.00	301,475,000.00	
KT&G CORP	18,829	80,700.00	1,519,500,300.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	106,000.00	333,052,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	3,762	133,000.00	500,346,000.00	
LG H&H CO LTD	956	714,000.00	682,584,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	389	330,500.00	128,564,500.00	
PACIFIC CORP	3,393	37,800.00	128,255,400.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,851	71,500.00	632,846,500.00	
SD BIOSENSOR INC	3,909	43,900.00	171,605,100.00	
ALTEOGEN INC	2,841	63,900.00	181,539,900.00	
CELLTRION INC	10,890	182,500.00	1,987,425,000.00	
CELLTRION PHARM INC	1,968	79,400.00	156,259,200.00	
GREEN CROSS CORP	564	177,000.00	99,828,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	1,156	322,500.00	372,810,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,993	819,000.00	1,632,267,000.00	
SEEGENE INC	3,838	44,700.00	171,558,600.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	78,800.00	251,923,600.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	140,000.00	294,000,000.00	
YUHAN CORPORATION	12,567	57,300.00	720,089,100.00	
HANA FINANCIAL GROUP	33,962	37,200.00	1,263,386,400.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	9,210.00	260,919,300.00	
KAKAOBANK CORP	18,421	31,300.00	576,577,300.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	48,657	47,000.00	2,286,879,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	50,883	36,250.00	1,844,508,750.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	11,600.00	689,109,600.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	61,600.00	283,483,200.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	7,939	26,600.00	211,177,400.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	4,665.00	223,472,160.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	6,470.00	200,667,050.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	9,230.00	111,747,610.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	33,650.00	194,362,400.00	
DB INSURANCE CO LTD	4,209	58,200.00	244,963,800.00	
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	7,329	32,550.00	238,558,950.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	196,500.00	610,722,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	60,200.00	446,503,400.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	132,500.00	493,562,500.00	
ILJIN MATERIALS CO LTD	2,166	69,300.00	150,103,800.00	
L&F CO LTD	3,026	214,200.00	648,169,200.00	
LG DISPLAY CO LTD	24,071	15,250.00	367,082,750.00	
LG INNOTEK CO LTD	1,415	338,000.00	478,270,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	6,845	134,500.00	920,652,500.00	

	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	573,964	58,700.00	33,691,686,800.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	96,421	53,900.00	5,197,091,900.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	6,526	537,000.00	3,504,462,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	12,300.00	272,137,500.00	
	SK TELECOM	9,599	54,000.00	518,346,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,459	22,200.00	587,389,800.00	
	SK HYNIX INC	65,667	94,800.00	6,225,231,600.00	
	SK SQUARE CO LTD	11,660	39,800.00	464,068,000.00	
韓国ウォン 小計		1,932,198		115,921,104,410.00 (12,206,492,294)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	89.40	10,034,256.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	43.85	10,268,617.60	
	CHINA STEEL	1,494,261	29.35	43,856,560.35	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	420,061	70.10	29,446,276.10	
	FORMOSA PLASTICS CORP	441,824	85.00	37,555,040.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	647,752	65.00	42,103,880.00	
	TAIWAN CEMENT	589,511	40.80	24,052,048.80	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	18,557	981.00	18,204,417.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	31.35	10,910,677.80	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,455.00	13,095,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	289,000	33.25	9,609,250.00	
	CHINA AIRLINES LTD	183,000	23.25	4,254,750.00	
	EVA AIRWAYS CORP	386,000	32.10	12,390,600.00	
	EVERGREEN MARINE	308,039	92.70	28,555,215.30	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	28.60	13,499,200.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	64,900	120.50	7,820,450.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	86.50	18,770,500.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	36.10	6,391,902.10	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	425.50	8,483,193.50	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	70,448	176.50	12,434,072.00	
	GIANT MANUFACTURING	34,464	228.00	7,857,792.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	277.00	8,587,000.00	
	POU CHEN	273,780	28.70	7,857,486.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	42,000	594.00	24,948,000.00	
	MOMO.COM INC	6,000	755.00	4,530,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	275.50	24,393,872.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	645,395	68.80	44,403,176.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	587,664	17.30	10,166,587.20	
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,011,237	23.85	47,968,002.45	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,397,452	28.30	39,547,891.60	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,248,238	25.50	31,830,069.00	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,059,344	22.15	23,464,469.60	

MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,211,339	35.05	42,457,431.95	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	16.60	19,204,357.40	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,284,432	15.90	20,422,468.80	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,078,434	26.00	28,039,284.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	451,861	49.80	22,502,677.80	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	151,375	192.50	29,139,687.50	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,349,159	19.80	26,713,348.20	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	888,123	44.80	39,787,910.40	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,896,226	12.90	24,461,315.40	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	909,435	58.90	53,565,721.50	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,262,866	8.51	10,746,989.66	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	206,724	70.90	14,656,731.60	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	230.00	11,040,000.00	
ACER INC	255,803	21.70	5,550,925.10	
ADVANTECH CO LTD	43,336	331.00	14,344,216.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	72,092	305.00	21,988,060.00	
AUO CORP	945,090	15.55	14,696,149.50	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	160.50	19,051,350.00	
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	1,049,000	12.25	12,850,250.00	
COMPAL ELECTRONICS	431,760	21.90	9,455,544.00	
DELTA ELECTRONICS INC	217,903	227.50	49,572,932.50	
E INK HOLDINGS INC	94,000	170.50	16,027,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,510,248	102.00	154,045,296.00	
INVENTEC CO LTD	280,511	24.00	6,732,264.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	15,040	1,870.00	28,124,800.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	57.20	12,895,854.40	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	108.00	6,480,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	262.00	5,502,000.00	
PEGATRON CORP	200,474	57.40	11,507,207.60	
QUANTA COMPUTER INC	286,270	76.20	21,813,774.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	52.50	10,610,250.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	141,000	157.50	22,207,500.00	
WIWYNN CORP	8,000	669.00	5,352,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	260,692	53.00	13,816,676.00	
YAGEO CORPORATION	54,764	308.50	16,894,694.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	96.00	13,240,512.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	505,315	124.50	62,911,717.50	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	84.80	18,316,800.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	103.00	25,255,600.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	359,315	76.10	27,343,871.50	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	3,000	1,055.00	3,165,000.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	6,000	1,050.00	6,300,000.00	

	GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	433.50	10,404,000.00	
	MEDIATEK INC	179,804	651.00	117,052,404.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	115,000	49.65	5,709,750.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	74,045	300.00	22,213,500.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	1,170.00	9,360,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	301,000	40.55	12,205,550.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	61,944	335.00	20,751,240.00	
	SILERGY CORP	9,000	2,485.00	22,365,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,954,389	467.00	1,379,699,663.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,411,000	39.70	56,016,700.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	71.80	6,390,200.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	171.50	5,488,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	20.25	7,067,250.00	
新台湾ドル 小計		39,396,945		3,290,803,677.71 (15,070,893,602)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	96,221	325.30	31,300,691.30	
	COAL INDIA LTD	180,326	189.80	34,225,874.80	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	241.30	14,339,252.50	
	INDIAN OIL CORP LTD	290,647	72.70	21,130,036.90	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	381,562	121.50	46,359,783.00	
	PETRONET LNG LTD	83,779	225.35	18,879,597.65	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	367,287	2,391.40	878,330,131.80	
	ACC LTD	5,315	2,169.35	11,530,095.25	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	368.45	27,093,233.85	
	ASIAN PAINTS LTD	42,204	2,879.80	121,539,079.20	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	585.25	17,235,027.25	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	31,529	1,391.35	43,867,874.15	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	180,501	357.55	64,538,132.55	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	343.40	23,960,391.60	
	JSW STEEL LTD	99,332	566.20	56,241,778.40	
	PI INDUSTRIES LTD	12,797	2,752.35	35,221,822.95	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	18,199	2,250.85	40,963,219.15	
	SHREE CEMENT LTD	1,387	19,932.80	27,646,793.60	
	SRF LTD	14,609	2,175.50	31,781,879.50	
	TATA STEEL LTD	94,085	885.90	83,349,901.50	
	ULTRATECH CEMENT LTD	11,556	5,839.10	67,476,639.60	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	690.25	48,076,602.75	
	VEDANTA LTD	107,173	224.00	24,006,752.00	
	ADANI ENTERPRISES LTD	34,272	2,293.05	78,587,409.60	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	169,135	236.00	39,915,860.00	
	HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,218.60	43,462,587.60	
	LARSEN & TOUBRO LTD	82,638	1,687.45	139,447,493.10	

SIEMENS INDIA LTD	11,025	2,681.35	29,561,883.75	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	589.00	13,542,877.00	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	64,743	715.70	46,336,565.10	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	656.60	17,370,353.00	
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,677.90	14,027,244.00	
BAJAJ AUTO LTD	9,644	3,825.00	36,888,300.00	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,289.15	20,215,483.65	
BHARAT FORGE LTD	30,322	668.65	20,274,805.30	
EICHER MOTORS LTD	14,685	2,931.60	43,050,546.00	
HERO MOTOCORP LTD	12,238	2,849.30	34,869,733.40	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	101,669	1,133.60	115,251,978.40	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	15,707	8,475.95	133,131,746.65	
MRF LTD	432	76,044.95	32,851,418.40	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	124,426	119.00	14,806,694.00	
TATA MOTORS LTD	190,082	441.55	83,930,707.10	
PAGE INDUSTRIES LTD	886	43,575.70	38,608,070.20	
TITAN INDUSTRIES LTD	46,501	2,144.35	99,714,419.35	
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	575.20	25,268,536.00	
INFO EDGE INDIA LTD	7,855	3,978.65	31,252,295.75	
TRENT LTD	19,255	1,204.25	23,187,833.75	
ZOMATO LTD	170,264	54.80	9,330,467.20	
AVENUE SUPERMARTS LTD	17,524	3,941.70	69,074,350.80	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	11,474	3,816.95	43,795,684.30	
ITC LTD	345,135	293.05	101,141,811.75	
MARICO LTD	81,711	503.75	41,161,916.25	
NESTLE INDIA LIMITED	3,906	18,419.15	71,945,199.90	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	61,013	761.40	46,455,298.20	
UNITED SPIRITS LTD	32,483	814.05	26,442,786.15	
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	9,566	1,566.70	14,987,052.20	
DABUR INDIA LTD	58,111	543.90	31,606,572.90	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	850.25	53,902,449.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	97,997	2,496.85	244,683,809.45	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	13,485	3,936.15	53,078,982.75	
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	546.55	19,356,068.25	
BIOCON LTD	58,256	322.80	18,805,036.80	
CIPLA LTD	49,816	935.45	46,600,377.20	
DIVI'S LABORATORIES LTD	14,782	3,671.30	54,269,156.60	
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	4,406.20	55,711,992.80	
LUPIN LTD	26,552	635.00	16,860,520.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	110,469	857.70	94,749,261.30	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	1,466.70	17,923,074.00	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	582.05	17,539,494.70	

	AXIS BANK LTD	273,120	669.15	182,758,248.00	
	BANDHAN BANK LTD	74,811	271.90	20,341,110.90	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	214,032	2,239.75	479,378,172.00	
	ICICI BANK LTD	618,625	755.70	467,494,912.50	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	73,561	1,744.75	128,345,554.75	
	STATE BANK OF INDIA	226,932	488.55	110,867,628.60	
	YES BANK LTD	1,020,164	12.80	13,058,099.20	
	BAJAJ FINANCE LTD	32,202	5,873.20	189,128,786.40	
	BAJAJ FINSERV LTD	5,500	12,003.10	66,017,050.00	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	38,543	630.95	24,318,705.85	
	MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,035.60	12,865,258.80	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	1,709.70	20,041,103.40	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	31,013	851.15	26,396,714.95	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	21,216	1,280.45	27,166,027.20	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	129,053	545.35	70,379,053.55	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	23,540	1,276.20	30,041,748.00	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	518.25	16,445,109.00	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	53,770	1,146.90	61,668,813.00	
	DLF LTD	56,420	340.40	19,205,368.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	12,724	1,302.55	16,573,646.20	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	123,161	983.55	121,135,001.55	
	INFOSYS LTD	396,083	1,514.45	599,847,899.35	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	5,756	4,067.85	23,414,544.60	
	MINDTREE LTD	6,247	2,889.75	18,052,268.25	
	MPHASIS LTD	7,796	2,232.80	17,406,908.80	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	106,835	3,265.45	348,864,350.75	
	TATA ELXSI LTD	4,179	7,993.15	33,403,373.85	
	TECH MAHINDRA LTD	72,109	1,026.50	74,019,888.50	
	WIPRO LTD	179,580	419.10	75,261,978.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	294,891	695.15	204,993,478.65	
	INDUS TOWERS LTD	90,578	209.40	18,967,033.20	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	1,921.00	81,796,180.00	
	ADANI POWER LTD	85,623	271.55	23,250,925.65	
	ADANI TOTAL GAS LTD	33,068	2,540.80	84,019,174.40	
	ADANI TRANSMISSION LTD	32,827	2,545.90	83,574,259.30	
	GAIL INDIA LTD	174,768	137.25	23,986,908.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	370.90	9,911,931.60	
	NTPC LTD	664,141	143.70	95,437,061.70	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	327,337	218.80	71,621,335.60	
	TATA POWER CO LTD	199,512	220.05	43,902,615.60	
インドルピー 小計		10,553,342		8,129,429,022.50 (14,063,912,208)	

カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	17.06	1,022,132.84	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	3.77	1,770,882.10	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.58	1,145,326.50	
	INDUSTRIES QATAR	196,788	15.40	3,030,535.20	
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	6.59	1,345,314.05	
	MASRAF AL RAYAN	732,376	3.99	2,922,180.24	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	11.00	1,084,149.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	185,298	23.52	4,358,208.96	
	QATAR NATIONAL BANK	530,405	19.21	10,189,080.05	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.44	713,973.09	
	OOREDOO QSC	72,800	7.76	564,928.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	17.73	1,711,157.76	
カタールリアル 小計		3,297,787		29,857,867.79 (1,111,309,839)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	22,520	199.01	4,481,705.20	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	226.17	3,317,913.90	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	5,906	1,512.42	8,932,352.52	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	51,324	257.46	13,213,877.04	
	GOLD FIELDS LTD	97,102	158.55	15,395,522.10	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	56,301	56.60	3,186,636.60	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	114,090	190.40	21,722,736.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	520.78	2,797,630.16	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	32,710	182.22	5,960,416.20	
	SASOL LTD	72,299	375.27	27,131,645.73	
	SIBANYE STILLWATER LTD	394,924	43.67	17,246,331.08	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	215.57	5,971,720.14	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	119.90	4,859,427.10	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	177.64	5,064,516.40	
	NASPERS LTD-N SHS	27,673	2,656.50	73,513,324.50	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	144,533	19.82	2,864,644.06	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	37,554	120.83	4,537,649.82	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	54.88	6,063,965.60	
	BID CORP LTD	35,017	317.51	11,118,247.67	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	283.07	10,026,905.54	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	60,003	207.51	12,451,222.53	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	137.24	3,194,123.76	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	146.92	8,254,259.44	
	ABSA GROUP LTD	95,814	157.23	15,064,835.22	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	9,724	1,991.08	19,361,261.92	
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	207.37	13,087,328.07	
	STANDARD BANK GROUP LTD	173,745	154.16	26,784,529.20	
	FIRSTRAND LTD	617,542	63.93	39,479,460.06	

	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	293.19	5,039,056.53	
	REMGRO LTD	55,441	130.90	7,257,226.90	
	DISCOVERY LIMITED	59,544	130.35	7,761,560.40	
	OLD MUTUAL LTD	489,612	11.57	5,664,810.84	
	SANLAM LTD	214,053	53.56	11,464,678.68	
	NEPI ROCKCASTLE SA	60,556	91.57	5,545,112.92	
	MTN GROUP LTD	194,516	144.49	28,105,616.84	
	VODACOM GROUP	62,331	136.27	8,493,845.37	
南アフリカランド 小計		3,607,288		464,416,096.04 (3,761,770,377)	
アラブ首長国連邦ディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	4.25	1,887,093.50	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	327,038	8.21	2,684,981.98	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	8.00	1,486,248.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	335,455	5.43	1,821,520.65	
	EMIRATES NBD PJSC	270,260	11.85	3,202,581.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	492,228	18.34	9,027,461.52	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	487,034	4.36	2,123,468.24	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	576,832	5.14	2,964,916.48	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	404,510	25.72	10,403,997.20	
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		3,523,160		35,602,268.57 (1,325,116,436)	
クウェートディナール	AGILITY	157,695	0.77	122,055.93	
	BOUBYAN BANK K.S.C	152,875	0.77	119,089.62	
	GULF BANK	137,143	0.32	44,022.90	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	632,130	0.84	534,149.85	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	838,738	1.06	889,901.01	
	MABANEE CO KPSC	133,798	0.77	103,559.65	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.59	175,426.53	
クウェートディナール 小計		2,349,209		1,988,205.49 (884,095,335)	
オフショア人民元	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20,000	33.45	669,000.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	5.19	519,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	20.03	1,926,886.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	12.97	1,032,412.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	14.04	1,232,712.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	37.90	1,061,200.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	20,700	37.73	781,011.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	4.67	767,281.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	35.00	1,030,400.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	6.19	239,553.00	
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	69.38	1,429,228.00	
	CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	78,847	15.51	1,222,916.97	

CHINA JUSHI CO LTD -A	300	15.76	4,728.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	34.02	707,616.00	
GANFENG LITHIUM CO LTD-A	11,200	108.48	1,214,976.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	62.51	1,551,873.26	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	21.26	788,746.00	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	12,900	114.90	1,482,210.00	
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	18.67	186,700.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	2.36	1,087,960.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.61	276,600.00	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	16.77	373,971.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	7,800	125.67	980,226.00	
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	30,400	9.05	275,120.00	
LB GROUP CO LTD-A	15,300	21.23	324,819.00	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	14.22	1,126,224.00	
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	5.52	1,214,952.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	14.56	705,432.00	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	39,625	25.06	993,002.50	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	18.01	130,608.52	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	27.92	500,884.80	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.52	1,008,832.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	11,200	84.29	944,048.00	
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	5.41	743,334.00	
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	21.65	1,067,345.00	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	51.20	552,960.00	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	4,200	399.23	1,676,766.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	15.19	148,862.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.24	1,074,384.00	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	6.00	553,200.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	94.30	1,650,250.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	60.27	555,689.40	
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	11,775	99.50	1,171,612.50	
YINTAI GOLD CO LTD-A	111,300	9.56	1,064,028.00	
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	11,400	170.49	1,943,586.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	241.92	991,872.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	91.18	675,643.80	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	105,600	9.07	957,792.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	52.30	596,220.00	
AVICOPTER PLC-A	15,500	45.51	705,405.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	32.47	272,748.00	
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	13.12	839,680.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	18.76	1,035,833.40	
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.34	1,411,254.00	

CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	5.39	1,136,751.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	17,700	541.00	9,575,700.00	
CRRC CORP LTD-A	185,800	5.23	971,734.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	7,573	103.00	780,019.00	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	7.57	172,596.00	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	10,200	215.82	2,201,364.00	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	44.72	259,376.00	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	112.80	710,640.00	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	26,320	42.31	1,113,599.20	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	57.20	655,283.20	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	17.22	828,282.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.49	1,154,841.00	
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	31.77	1,150,074.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	69,984	28.57	1,999,442.88	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	11,675	143.19	1,671,743.25	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	7.57	1,235,424.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	19.01	796,519.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	64.43	1,829,360.99	
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	17,900	10.72	191,888.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	104.50	1,045,000.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	30.89	1,257,223.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	2,560	477.00	1,221,120.00	
TBEA CO LTD-A	22,519	28.43	640,215.17	
WEICHAI POWER CO LTD-A	43,200	12.92	558,144.00	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	5,320	167.00	888,440.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	5.43	1,082,742.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	14.58	293,218.38	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	36.64	1,157,824.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	48.55	401,023.00	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,200	11.52	1,039,104.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	6.02	482,202.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	5.00	403,000.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	51.35	564,850.00	
AIR CHINA LTD-A	25,900	10.11	261,849.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	338,800	4.86	1,646,568.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	5.08	203,200.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	6.06	972,630.00	
S F HOLDING CO LTD-A	20,300	54.38	1,103,914.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	51.52	274,034.88	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.75	255,300.00	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	19.72	1,098,404.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	17.37	379,360.80	

BYD CO LTD -A	9,700	338.00	3,278,600.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	17.83	772,966.16	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	42.15	779,775.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	23.03	789,929.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	154.28	1,295,952.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	14.78	433,054.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	71.00	49,700.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	18.56	790,656.00	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	27.17	1,066,531.18	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	1,443	382.98	552,640.14	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	109.00	305,200.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	33.40	1,452,900.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	33.20	921,632.00	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	52.55	416,826.60	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	135.29	1,041,733.00	
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	26.18	680,680.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	102,000	4.75	484,500.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	54.20	433,600.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	59.62	1,562,044.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	5.87	465,491.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	13.68	458,006.40	
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	19.80	485,100.00	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	8.69	465,784.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	6.64	925,616.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	366.80	1,063,720.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	31.79	518,177.00	
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	13.54	308,712.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	4.60	282,900.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	12,200	211.97	2,586,034.00	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	8.67	958,035.00	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	18,576	31.11	577,899.36	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	10,140	52.63	533,668.20	
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	45.14	482,998.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	238.33	381,328.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	55.42	121,924.00	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	59.63	1,091,229.00	
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	153.17	459,510.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	7.81	464,695.00	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	26.10	268,830.00	
CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	51.50	515,000.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	135.48	1,070,292.00	
CHONGQING FULING ZHACAI-A	4,600	31.61	145,406.00	

FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	20,248	87.09	1,763,398.32	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	19.01	520,874.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	61.73	1,049,410.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	28.40	34,080.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	36.34	1,246,534.68	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	46.77	809,121.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	178.64	1,625,624.00	
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	27,700	7.57	209,689.00	
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	171.03	957,768.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	32.49	373,635.00	
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	52.34	366,380.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	8,500	1,999.00	16,991,500.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	240.97	2,361,506.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	62.84	2,108,784.72	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	17.44	467,392.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	300.77	2,821,222.60	
TONGWEI CO LTD-A	31,600	63.73	2,013,868.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	25.00	954,000.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	30,200	192.70	5,819,540.00	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	52.38	529,038.00	
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	16.19	85,807.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	20.77	616,869.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	54,323	43.24	2,348,926.52	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	82.02	232,772.76	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	45.70	444,204.00	
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	9,450	24.40	230,580.00	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	49.29	608,731.50	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	11.81	122,824.00	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	18.33	271,284.00	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	5.41	134,384.40	
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	54.50	392,890.50	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	8,400	316.66	2,659,944.00	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	163.63	327,260.00	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	37,830	8.81	333,282.30	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	302.51	60,502.00	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	23,400	25.12	587,808.00	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	7,491	159.54	1,195,114.14	
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	58.40	940,240.00	
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	69.50	382,250.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	222.91	490,402.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	43.25	441,150.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	112.16	1,110,384.00	

DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	37.99	843,112.07	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	30.81	492,960.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	119.90	959,200.00	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	22.76	429,026.00	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	581.00	1,208,480.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	38,102	38.45	1,465,021.90	
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	7,940	131.85	1,046,889.00	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	21,294	28.45	605,814.30	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	6.05	387,805.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	43.81	476,652.80	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	26.70	186,900.00	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	25.11	237,038.40	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	19.74	221,719.68	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	47.80	812,600.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	16,464	110.20	1,814,332.80	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	59.16	588,050.40	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	3,900	338.49	1,320,111.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	22.52	203,130.40	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	21.39	745,398.72	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	53.43	518,271.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.03	1,071,408.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.51	261,580.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	4.98	492,522.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	14.48	1,631,896.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	7.03	1,615,072.20	
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	10.06	1,483,850.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	34.06	1,985,698.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	6.09	277,095.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	5.71	713,179.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	2.96	381,544.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	137,700	39.81	5,481,837.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.68	1,006,848.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	308,600	3.26	1,006,036.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.12	611,328.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	4.77	1,245,924.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	19.31	1,838,312.00	
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	14.54	1,736,076.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.30	749,950.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	7.88	1,089,804.00	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.26	399,350.00	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	12.94	1,027,436.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	7.59	435,134.70	

CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.60	111,440.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	9.66	451,122.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	13.94	399,520.40	
CITIC SECURITIES CO-A	49,680	20.67	1,026,885.60	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	27.67	666,847.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	97,856	23.63	2,312,337.28	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	15.03	54,108.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	6.17	371,434.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	6.61	547,308.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	17.44	1,056,864.00	
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	171,679	6.46	1,109,046.34	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	15.17	1,096,791.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	6.00	912,300.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	91.31	493,074.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	13.70	431,550.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	6.77	595,083.00	
NANJING SECURITIES CO LTD-A	42,700	8.11	346,297.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	9.29	376,951.04	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.17	864,024.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.86	440,040.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	10.83	473,271.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	22.88	416,416.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	45.82	3,060,776.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	12.80	700,160.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	19.28	1,035,336.00	
GEMDALE CORP-A	45,500	12.72	578,760.00	
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	566,400	2.71	1,534,944.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	16.22	1,326,796.00	
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	23.01	294,528.00	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	12.16	103,360.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	8.13	218,697.00	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	182.18	878,654.14	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	26,460	14.27	377,584.20	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	9.91	285,408.00	
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	6.07	338,099.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	12,740	43.70	556,738.00	
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	42.60	460,080.00	
NAVINFO CO LTD-A	33,200	13.94	462,808.00	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	98.20	294,600.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	6,110	53.59	327,434.90	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	127.29	700,095.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	20.62	271,565.40	

AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	29.49	1,117,671.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	3.92	449,232.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	27.95	782,600.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	10.20	354,960.00	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	134.20	1,221,220.00	
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	14.53	302,224.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	9.74	439,274.00	
GOERTEK INC -A	26,900	33.07	889,583.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	4.99	249,500.00	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	73.49	514,430.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	25.54	503,444.48	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	11.50	193,200.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	34.64	1,609,028.00	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	130.20	224,985.60	
NINESTAR CORP-A	18,543	52.70	977,216.10	
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	6.42	200,946.00	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	16.57	402,651.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	92.27	439,205.20	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	83.18	535,263.30	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	21.76	620,160.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	9.94	467,180.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	18,340	19.52	357,996.80	
WESTONE INFORMATION INDUST-A	20,100	46.92	943,092.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	76.51	321,342.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	41,316	12.71	525,126.36	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	205.10	963,970.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	72.42	814,725.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	15.83	479,649.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	30.01	261,087.00	
ZTE CORP-A	12,600	24.67	310,842.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	6.83	1,187,054.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	6.39	1,541,907.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	179,880	24.20	4,353,096.00	
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	18.19	1,011,364.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	4.16	1,313,312.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	11.58	782,808.00	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	92,300	13.81	1,274,663.00	
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	125.51	890,744.47	
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	93.43	947,193.34	
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	3.81	314,325.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	6,272	135.28	848,476.16	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	15,120	62.69	947,872.80	

	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	50.87	381,525.00	
	INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	92.91	696,825.00	
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	24,430	76.50	1,868,895.00	
	JCET GROUP CO LTD-A	29,800	26.20	780,760.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	47,040	62.18	2,924,947.20	
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	56.19	1,183,080.45	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	305.00	945,500.00	
	SG MICRO CORP-A	3,150	184.01	579,631.50	
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	2,800	392.22	1,098,216.00	
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	29,500	59.80	1,764,100.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	9.12	298,680.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	15.06	338,337.96	
	TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	67.90	1,725,882.20	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	4,900	206.21	1,010,429.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	5,400	161.25	870,750.00	
	YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	65.56	930,952.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	69.86	1,189,156.92	
オフショア人民元 小計		16,789,895		302,859,661.89 (6,175,853,653)	
サウジアラビアリアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	44,939	17.70	795,420.30	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	288,739	37.95	10,957,645.05	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	47.60	560,490.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	15.02	479,558.56	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	28,237	133.00	3,755,521.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	47.35	1,528,600.05	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	95,014	48.70	4,627,181.80	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	106,249	97.60	10,369,902.40	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	38,414	26.75	1,027,574.50	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	14.68	1,518,367.08	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	47.95	1,273,360.20	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	180.60	759,784.20	
	JARIR MARKETING CO	12,500	157.00	1,962,500.00	
	ALMARAI CO	30,130	51.50	1,551,695.00	
	SAVOLA	25,336	34.75	880,426.00	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	11,717	191.00	2,237,947.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,962	225.00	1,791,450.00	
	AL RAJHI BANK	237,965	81.60	19,417,944.00	
	ALINMA BANK	109,956	33.30	3,661,534.80	
	ARAB NATIONAL BANK	86,031	30.00	2,580,930.00	
	BANK AL-JAZIRA	35,813	21.82	781,439.66	
	BANK ALBILAD	61,145	40.90	2,500,830.50	
	BANQUE SAUDI FRANSI	67,536	48.30	3,261,988.80	

	RIYAD BANK	166,012	33.40	5,544,800.80	
	SAUDI BRITISH BANK	116,762	41.55	4,851,461.10	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	41,945	19.52	818,766.40	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	265,761	67.40	17,912,291.40	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	3,929	192.80	757,511.20	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	158.00	957,954.00	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	10.84	1,094,742.44	
	EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	9.52	439,700.24	
	ELM CO	2,436	260.00	633,360.00	
	ETIHAD ETISALAT CO	34,414	34.80	1,197,607.20	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	11.28	1,020,930.24	
	SAUDI TELECOM CO	66,310	98.00	6,498,380.00	
	ACWA POWER CO	9,184	147.60	1,355,558.40	
	SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	23.94	2,207,770.74	
サウジアラビアリアル 小計		2,540,586		123,572,925.06 (4,499,290,201)	
合　計		1,067,272,286		106,738,464,625 (106,738,464,625)	

(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	6,567,664.00	
	メキシコペソ 小計		58,400	6,567,664.00 (43,806,975)	
	ブラジルレアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	131,500	2,956,120.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,309,068.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,477,300.00	
		KLABIN SA-UNIT	64,600	1,273,266.00	
	ブラジルレアル 小計		279,400	7,015,754.00 (182,111,434)	
投資信託受益証券合計			337,800	225,918,409 (225,918,409)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391,700	8,190,447.00	
	メキシコペソ 小計		391,700	8,190,447.00 (54,631,100)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	6,300,126.28	
	南アフリカランド 小計		478,733	6,300,126.28 (51,031,022)	
			870,433	105,662,122	

投資証券合計		(105,662,122)	
合計		331,580,531 (331,580,531)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式　46銘柄	100.0%	—	—	3.3%
メキシコペソ	株式　20銘柄	95.6%	—	—	2.0%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	2.0%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	2.5%	0.1%
ブラジルレアル	株式　44銘柄	96.5%	—	—	4.7%
	投資信託受益証券　4銘柄	—	3.5%	—	0.2%
チリペソ	株式　12銘柄	100.0%	—	—	0.5%
コロンビアペソ	株式　4銘柄	100.0%	—	—	0.2%
ユーロ	株式　8銘柄	100.0%	—	—	0.2%
トルコリラ	株式　12銘柄	100.0%	—	—	0.3%
チェココルナ	株式　2銘柄	100.0%	—	—	0.1%
ハンガリーフォリント	株式　3銘柄	100.0%	—	—	0.2%
ポーランドズロチ	株式　15銘柄	100.0%	—	—	0.6%
ロシアルーブル	株式　5銘柄	100.0%	—	—	0.0%
香港ドル	株式　197銘柄	100.0%	—	—	26.6%
マレーシアリンギット	株式　34銘柄	100.0%	—	—	1.4%
タイバーツ	株式　42銘柄	100.0%	—	—	1.9%
フィリピンペソ	株式　20銘柄	100.0%	—	—	0.8%
インドネシアルピア	株式　25銘柄	100.0%	—	—	1.8%
韓国ウォン	株式　112銘柄	100.0%	—	—	11.4%
新台湾ドル	株式　87銘柄	100.0%	—	—	14.1%
インドルピー	株式　109銘柄	100.0%	—	—	13.1%
カタールリアル	株式　12銘柄	100.0%	—	—	1.0%
南アフリカランド	株式　36銘柄	98.7%	—	—	3.5%
	投資証券　1銘柄	—	—	1.3%	0.0%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式　9銘柄	100.0%	—	—	1.2%

クウェートディナール	株式　7銘柄	100.0%	—	—	0.8%
オフショア人民元	株式　323銘柄	100.0%	—	—	5.8%
サウジアラビアリアル	株式　37銘柄	100.0%	—	—	4.2%

(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 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,747,915,012
コール・ローン	1,066,458,058
国債証券	79,938,834,161
未収利息	982,251,497
前払費用	128,672,018
流動資産合計	84,864,130,746
資産合計	84,864,130,746
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	230,400
未払金	2,002,727,475
未払解約金	282,269,338
未払利息	326
流動負債合計	2,285,227,539
負債合計	2,285,227,539
純資産の部	
元本等	
元本	47,067,575,964
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	35,511,327,243
元本等合計	82,578,903,207
純資産合計	82,578,903,207
負債純資産合計	84,864,130,746

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11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月11日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	47,067,575,964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 1.7545円 (1万口当たり純資産額) (17,545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 7月11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 7月11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。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月11日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	40,865,028,836円
期中追加設定元本額	11,231,204,839円
期中一部解約元本額	5,028,657,711円
期末元本額	47,067,575,964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	5,303,294,254円
世界経済インデックスファンド	12,469,652,960円
ＤＣ新興国債券インデックス・オープン	5,153,423,674円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	11,083,708,698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）	4,011,356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）	55,145,361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）	469,847,295円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,538,525,126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）	208,027,818円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	97,277,140円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	169,797,543円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	2,932,221,728円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	340,389,586円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	424,883,080円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	676,868,978円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	9,337,069円
グローバル経済コア	741,975,483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	30,305,617円

区分	2022年 7月11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	22,760,104円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	8,213,124円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	9,944,183円
Ｍｙ　ＳＭＴ　新興国債券インデックス（ノーロード）	284,888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）	58,193,652円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	470,170,421円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	107,109,719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）	13,933,739円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	292,262,934円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	286,165,422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）	283,079,813円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	278,676,104円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△5,604,911,630
合計	△5,604,911,630

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2022年 7月11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				
	売建	184,737,000	－	184,967,400	△230,400
	マレーシアリンギット	184,737,000	－	184,967,400	△230,400
合計		184,737,000	－	184,967,400	△230,400

(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	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	31,800,000.00	34,280,718.00	
		MBONO 10% 12/05/24	104,250,000.00	105,603,165.00	
		MBONO 5.5% 03/04/27	17,000,000.00	14,649,750.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	198,300,000.00	176,913,345.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	61,600,000.00	60,577,440.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	114,000,000.00	106,910,340.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	140,600,000.00	129,868,002.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	84,500,000.00	73,860,605.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	34,600,000.00	31,370,436.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	115,100,000.00	112,021,075.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	92,999,664.00	
		MBONO 8% 09/05/24	128,400,000.00	124,913,940.00	
		MBONO 8% 11/07/47	100,600,000.00	89,598,384.00	
		MBONO 8% 12/07/23	88,000,000.00	86,322,720.00	
	メキシコペソ 小計		1,317,050,000.00	1,239,889,584.00 (8,270,187,514)	
	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/24	138,400,000.00	114,619,627.59	
		BLTN 0% 07/01/23	55,000,000.00	48,479,722.49	
		BLTN 0% 07/01/24	30,850,000.00	24,158,449.90	
		BLTN 0% 07/01/25	38,900,000.00	27,104,800.35	
		BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000.00	29,868,133.14	
		BNTNF 10% 01/01/27	41,200,000.00	37,218,665.60	
		BNTNF 10% 01/01/29	31,700,000.00	27,665,638.31	
		BNTNF 10% 01/01/31	13,850,000.00	11,727,262.71	
		BNTNF 10% 01/01/33	600,000.00	496,039.54	
		BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,286,250.00	
		BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,770,562.50	
	ブラジルレアル 小計		385,600,000.00	324,395,152.13 (8,420,487,161)	

チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	805,000,000.00	634,304,270.88	
	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,855,000,000.00	2,584,856,770.92	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,820,000,000.00	1,713,395,369.14	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,940,000,000.00	1,741,950,715.60	
	BTPCL 4% 03/01/23	1,010,000,000.00	979,209,389.47	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,210,000,000.00	1,966,497,355.68	
	BTPCL 5% 10/01/28	660,000,000.00	611,994,493.44	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,730,000,000.00	1,684,096,463.72	
チリペソ 小計		13,030,000,000.00	11,916,304,828.85 (1,675,289,463)	
コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000.00	64,127,865,000.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	15,900,000,000.00	13,888,809,000.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	37,100,000,000.00	26,584,747,000.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	14,900,000,000.00	9,225,186,000.00	
コロンビアペソ 小計		133,200,000,000.00	113,826,607,000.00 (3,528,624,817)	
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,500,000.00	3,304,350.00	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	6,350,000.00	5,038,280.50	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,675,913.00	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	8,200,000.00	7,394,842.00	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,800,000.00	6,788,262.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	8,350,000.00	7,783,369.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	7,450,000.00	6,632,139.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	9,150,000.00	8,561,655.00	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	6,050,000.00	6,288,793.50	
ペルーソル 小計		61,550,000.00	55,467,604.00 (1,936,995,292)	
ウルグアイペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	21,093,500.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	15,235,060.00	
ウルグアイペソ 小計		42,000,000.00	36,328,560.00 (122,924,948)	
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	20,261,688.00	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	33,000,000.00	31,654,920.00	
ドミニカペソ 小計		53,400,000.00	51,916,608.00 (129,505,978)	
チェココルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	26,100,000.00	18,721,008.00	
	CZGB 0.25% 02/10/27	69,200,000.00	55,623,652.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	47,000,000.00	43,400,740.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	64,900,000.00	49,397,986.00	
	CZGB 0% 12/12/24	12,000,000.00	10,396,320.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	57,000,000.00	43,433,430.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25	58,500,000.00	51,826,320.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	22,700,000.00	14,324,381.00	

	CZGB 1.75% 06/23/32	47,000,000.00	36,993,700.00	
	CZGB 1% 06/26/26	54,800,000.00	46,412,312.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	62,700,000.00	56,892,099.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	63,300,000.00	55,502,073.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	58,500,000.00	51,786,540.00	
	CZGB 2% 10/13/33	64,500,000.00	50,646,045.00	
	CZGB 3.5% 05/30/35	22,000,000.00	19,807,700.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	34,500,000.00	33,309,060.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	45,200,000.00	44,795,460.00	
	CZGB 6% 02/26/26	39,500,000.00	40,229,170.00	
チェココルナ 小計		849,400,000.00	723,497,996.00 (4,072,063,770)	
ハンガリーフォリント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	461,446,425.00	
	HGB 1.5% 08/23/23	222,500,000.00	205,701,250.00	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	378,684,360.00	
	HGB 1% 11/26/25	635,000,000.00	486,689,400.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	542,000,000.00	308,435,940.00	
	HGB 2.25% 06/22/34	256,000,000.00	138,764,800.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	471,718,400.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	470,500,000.00	359,527,870.00	
	HGB 2% 05/23/29	403,000,000.00	263,126,760.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	812,000,000.00	540,848,840.00	
	HGB 3% 04/25/41	321,000,000.00	161,219,040.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	356,836,375.00	
	HGB 3% 08/21/30	555,000,000.00	375,324,300.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	438,482,560.00	
	HGB 3% 10/27/38	380,000,000.00	200,054,800.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	593,604,000.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	396,000,000.00	379,894,680.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	572,000,000.00	503,565,920.00	
ハンガリーフォリント 小計		8,892,000,000.00	6,623,925,720.00 (2,263,965,076)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	18,500,000.00	14,030,585.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	14,300,000.00	12,066,912.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	15,200,000.00	10,180,960.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	12,400,000.00	8,126,464.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	17,950,000.00	16,104,740.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	19,800,000.00	18,250,056.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000.00	20,298,707.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	17,600,000.00	14,351,392.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	20,600,000.00	16,750,272.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000.00	20,345,733.00	

	POLGB 3.25% 07/25/25	20,350,000.00	18,259,851.50	
	POLGB 3.75% 05/25/27	4,800,000.00	4,178,880.00	
	POLGB 4% 10/25/23	12,700,000.00	12,211,685.00	
ポーランドズロチ 小計		224,400,000.00	185,156,237.50 (5,379,325,652)	
ルーマニアレイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	3,000,000.00	2,213,130.00	
	ROMGB 3.25% 04/29/24	1,200,000.00	1,092,384.00	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	3,300,000.00	2,697,321.00	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	12,600,000.00	10,892,700.00	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	6,000,000.00	4,063,500.00	
	ROMGB 3.7% 11/25/24	10,000,000.00	8,944,800.00	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	10,500,000.00	8,365,140.00	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	6,400,000.00	4,656,704.00	
	ROMGB 4.25% 06/28/23	11,800,000.00	11,316,672.00	
	ROMGB 4.5% 06/17/24	2,200,000.00	2,036,716.00	
	ROMGB 4.75% 02/24/25	3,200,000.00	2,899,584.00	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	3,800,000.00	2,602,278.00	
	ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,103,570.00	
	ROMGB 4% 10/25/23	13,800,000.00	13,011,330.00	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	7,600,000.00	6,670,672.00	
	ROMGB 5% 02/12/29	6,000,000.00	4,846,860.00	
ルーマニアレイ 小計		106,100,000.00	90,413,361.00 (2,537,243,025)	
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	12,200,000.00	10,807,980.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,178,685.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	14,100,000.00	14,160,207.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	14,650,000.00	14,414,135.00	
	MGS 3.582% 07/15/32	3,500,000.00	3,348,205.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	25,500,000.00	25,072,365.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	4,882,349.50	
	MGS 3.757% 05/22/40	18,350,000.00	16,247,640.50	
	MGS 3.8% 08/17/23	7,100,000.00	7,155,664.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	7,691,436.00	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,600,000.00	1,616,560.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	20,300,000.00	20,020,672.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	20,800,000.00	20,865,936.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	14,450,000.00	14,500,575.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	8,700,000.00	8,724,534.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000.00	26,270,920.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	19,550,000.00	19,864,168.50	
	MGS 4.065% 06/15/50	12,450,000.00	11,005,302.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,100,000.00	9,260,888.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	20,050,000.00	19,516,068.50	

	MGS 4.504% 04/30/29	3,200,000.00	3,286,848.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	9,550,000.00	9,803,934.50	
マレーシアリンギット 小計		279,350,000.00	273,695,074.00 (8,438,073,870)	
タイバーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	90,500,000.00	88,948,830.00	
	THAIGB 0.95% 06/17/25	116,700,000.00	113,432,400.00	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	184,000,000.00	182,430,480.00	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	59,800,000.00	50,016,720.00	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	54,435,318.00	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	111,100,000.00	104,628,425.00	
	THAIGB 1% 06/17/27	176,000,000.00	165,644,160.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	113,600,000.00	113,513,664.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	123,000,000.00	124,858,530.00	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	90,100,000.00	75,937,181.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	93,200,000.00	95,792,824.00	
	THAIGB 2% 06/17/42	78,600,000.00	61,928,154.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	122,700,000.00	122,831,289.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	129,200,000.00	130,725,852.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	99,000,000.00	101,355,210.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	175,500,000.00	191,068,605.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	198,590,400.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	111,708,190.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	119,500,000.00	136,715,170.00	
タイバーツ 小計		2,233,000,000.00	2,224,561,402.00 (8,453,333,327)	
フィリピンペソ	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	28,878,000.00	
フィリピンペソ 小計		30,000,000.00	28,878,000.00 (70,421,890)	
インドネシアルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,677,875,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	8,584,200,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	26,000,000,000.00	24,869,520,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	36,500,000,000.00	35,735,325,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	50,300,000,000.00	50,941,325,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	34,000,000,000.00	33,360,800,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	16,103,660,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	41,000,000,000.00	38,520,730,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	62,500,000,000.00	59,767,500,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	26,300,000,000.00	26,979,329,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	18,909,600,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	28,300,000,000.00	27,722,114,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	33,943,220,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,700,000,000.00	19,723,640,000.00	

	INDOGB 7.5% 06/15/35	34,700,000,000.00	34,848,863,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	18,542,968,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	40,800,000,000.00	41,967,696,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	43,000,000,000.00	42,589,350,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	45,600,000,000.00	47,926,512,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	31,200,000,000.00	33,193,056,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	31,800,000,000.00	33,630,726,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,163,398,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	53,600,000,000.00	56,360,400,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	44,000,000,000.00	46,871,000,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	22,558,920,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	43,261,484,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	23,700,000,000.00	25,761,900,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	12,970,692,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	31,706,899,000.00	
インドネシアルピア 小計		892,800,000,000.00	910,192,702,000.00 (8,282,753,588)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	169,400,000.00	178,618,748.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	54,800,000.00	35,483,548.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	46,100,000.00	28,292,492.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	32,000,000.00	32,218,880.00	
	SAGB 7% 02/28/31	64,700,000.00	50,750,680.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	129,000,000.00	107,691,780.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	97,700,000.00	77,083,346.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	116,000,000.00	89,872,160.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	143,200,000.00	110,069,248.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	110,000,000.00	91,811,500.00	
	SAGB 8% 01/31/30	140,700,000.00	122,047,401.00	
	SAGB 9% 01/31/40	74,300,000.00	59,848,650.00	
南アフリカランド 小計		1,177,900,000.00	983,788,433.00 (7,968,686,307)	
オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,426,056.00	
	CGB 2.26% 02/24/25	3,000,000.00	2,986,770.00	
	CGB 2.36% 07/02/23	8,000,000.00	8,027,680.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	26,906,880.00	
	CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,024,000.00	
	CGB 2.75% 02/17/32	7,200,000.00	7,127,928.00	
	CGB 2.8% 03/24/29	12,000,000.00	11,983,920.00	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,700,000.00	11,815,713.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	18,400,000.00	18,559,528.00	
	CGB 2.88% 11/05/23	16,900,000.00	17,061,902.00	
	CGB 2.89% 11/18/31	5,000,000.00	5,006,150.00	
	CGB 2.91% 10/14/28	6,000,000.00	6,033,060.00	

		CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,299,000.00	
		CGB 3.01% 05/13/28	15,000,000.00	15,204,900.00	
		CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,592,480.00	
		CGB 3.02% 10/22/25	12,900,000.00	13,106,013.00	
		CGB 3.03% 03/11/26	17,500,000.00	17,793,300.00	
		CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,411,400.00	
		CGB 3.13% 11/21/29	15,300,000.00	15,577,389.00	
		CGB 3.19% 04/11/24	24,100,000.00	24,507,531.00	
		CGB 3.22% 12/06/25	5,600,000.00	5,726,728.00	
		CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,558,140.00	
		CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,588,812.00	
		CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,682,440.00	
		CGB 3.28% 12/03/27	15,200,000.00	15,676,824.00	
		CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	14,663,062.00	
		CGB 3.29% 10/18/23	10,000,000.00	10,154,600.00	
		CGB 3.53% 10/18/51	5,100,000.00	5,258,967.00	
		CGB 3.72% 04/12/51	7,300,000.00	7,759,900.00	
		CGB 3.81% 09/14/50	17,500,000.00	18,867,450.00	
	オフショア人民元 小計		404,600,000.00	411,388,523.00 (8,388,952,483)	
合計				79,938,834,161 (79,938,834,161)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券　14銘柄	100.0%	10.3%
ブラジルレアル	国債証券　11銘柄	100.0%	10.5%
チリペソ	国債証券　8銘柄	100.0%	2.1%
コロンビアペソ	国債証券　4銘柄	100.0%	4.4%
ペルーソル	国債証券　9銘柄	100.0%	2.4%
ウルグアイペソ	国債証券　2銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券　2銘柄	100.0%	0.2%
チェココルナ	国債証券　18銘柄	100.0%	5.1%
ハンガリーフォリント	国債証券　18銘柄	100.0%	2.8%
ポーランドズロチ	国債証券　13銘柄	100.0%	6.7%
ルーマニアレイ	国債証券　16銘柄	100.0%	3.2%

マレーシアリンギット	国債証券　22銘柄	100.0%	10.6%
タイバーツ	国債証券　19銘柄	100.0%	10.6%
フィリピンペソ	国債証券　1銘柄	100.0%	0.1%
インドネシアルピア	国債証券　29銘柄	100.0%	10.4%
南アフリカランド	国債証券　12銘柄	100.0%	10.0%
オフショア人民元	国債証券　30銘柄	100.0%	10.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,892,990,763
投資証券	111,921,301,500
未収入金	141,063,905
未収配当金	804,670,812
前払金	58,731,200
差入委託証拠金	279,180,000
流動資産合計	117,097,938,180
資産合計	117,097,938,180
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	58,731,200
未払金	67,938,471
未払解約金	1,016,338,174
未払利息	1,190
流動負債合計	1,143,009,035
負債合計	1,143,009,035
純資産の部	
元本等	
元本	54,153,941,017
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	61,800,988,128
元本等合計	115,954,929,145
純資産合計	115,954,929,145
負債純資産合計	117,097,938,180

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11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	54,153,941,017口
2．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.1412円 (1万口当たり純資産額) (21,412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 7月11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 7月11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。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月11日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	49,323,843,791円
期中追加設定元本額	11,756,960,790円
期中一部解約元本額	6,926,863,564円
期末元本額	54,153,941,017円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,705,786,562円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,245,206円
ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・オープン	16,744,764,057円
Ｊリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	25,940,928,130円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,251,789,992円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,893,665,668円
分散投資コア戦略ファンドＡ	795,726,284円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,687,481,776円
コア投資戦略ファンド（切替型）	836,132,888円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	26,554,421円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	237,536,234円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	7,652,173円
グローバル経済コア	243,816,340円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	12,294,790円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	427,010,890円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	79,651,592円
Ｍｙ　ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス（ノーロード）	228,697円
１０資産分散投資ファンド	7,002円
ＦＯＦｓ用　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	464,425,592円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	18,776,554円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	290,852,804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）	63,046,816円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－０５（適格機関投資家専用）	862,312,035円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－１１（適格機関投資家専用）	260,376,353円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１９－０３（適格機関投資家専用）	296,878,161円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	△4,373,936,926
合計	△4,373,936,926

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

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2022年 7月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	4,085,127,200	－	4,026,396,000	△58,731,200
合計		4,085,127,200	－	4,026,396,000	△58,731,200

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,070	255,231,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,256	315,506,400	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	4,782	721,125,600	
	東海道リート投資法人	787	97,037,100	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,550	2,424,650,000	

森ヒルズリート投資法人	12,088	1,834,958,400	
産業ファンド投資法人	14,594	2,654,648,600	
アドバンス・レジデンス投資法人	10,278	3,761,748,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,356	1,614,642,000	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,411	2,175,222,000	
ＧＬＰ投資法人	33,294	5,536,792,200	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,782	1,606,752,000	
日本プロロジスリート投資法人	16,819	5,752,098,000	
星野リゾート・リート投資法人	1,798	1,120,154,000	
Ｏｎｅリート投資法人	1,784	477,220,000	
イオンリート投資法人	12,089	1,829,065,700	
ヒューリックリート投資法人	9,590	1,529,605,000	
日本リート投資法人	3,172	1,149,850,000	
積水ハウス・リート投資法人	31,204	2,465,116,000	
トーセイ・リート投資法人	2,148	287,402,400	
ケネディクス商業リート投資法人	4,104	1,138,039,200	
ヘルスケア＆メディカル投資法人	2,518	416,225,400	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,329	306,496,400	
野村不動産マスターファンド投資法人	33,243	5,524,986,600	
いちごホテルリート投資法人	1,703	155,654,200	
ラサールロジポート投資法人	12,584	2,151,864,000	
スターアジア不動産投資法人	10,624	626,816,000	
マリモ地方創生リート投資法人	1,204	159,168,800	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,049	2,129,774,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,659	113,641,500	
投資法人みらい	12,452	608,902,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,412	298,605,600	
三菱地所物流リート投資法人	2,986	1,379,532,000	
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	3,981	776,693,100	
ザイマックス・リート投資法人	1,659	212,849,700	
タカラレーベン不動産投資法人	4,054	462,561,400	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	4,008	609,216,000	
日本ビルファンド投資法人	11,985	8,245,680,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	10,280	6,486,680,000	
日本都市ファンド投資法人	51,867	5,456,408,400	
オリックス不動産投資法人	20,483	3,684,891,700	
日本プライムリアルティ投資法人	7,024	2,763,944,000	
ＮＴＴ都市開発リート投資法人	9,854	1,417,005,200	
東急リアル・エステート投資法人	6,892	1,339,115,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	7,043	742,332,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	23,142	3,256,079,400	
森トラスト総合リート投資法人	7,347	1,032,253,500	

	インヴィンシブル投資法人	45,246	1,701,249,600	
	フロンティア不動産投資法人	3,604	1,920,932,000	
	平和不動産リート投資法人	7,008	999,340,800	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,931	2,207,523,500	
	福岡リート投資法人	5,317	881,558,600	
	ケネディクス・オフィス投資法人	3,180	2,216,460,000	
	いちごオフィスリート投資法人	8,423	708,374,300	
	大和証券オフィス投資法人	2,149	1,517,194,000	
	阪急阪神リート投資法人	4,643	681,592,400	
	スターツプロシード投資法人	1,601	391,604,600	
	大和ハウスリート投資法人	15,435	4,792,567,500	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	31,493	1,974,611,100	
	大和証券リビング投資法人	13,890	1,682,079,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	9,430	1,141,973,000	
合計		600,688	111,921,301,500	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	399,299,818
コール・ローン	111,234,721
投資証券	98,555,848,725
派生商品評価勘定	240,526
未収入金	185,364,601
未収配当金	361,069,155
流動資産合計	99,613,057,546
資産合計	99,613,057,546
負債の部	
流動負債	
未払金	210,969,933
未払解約金	15,508,761
未払利息	34
流動負債合計	226,478,728

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
負債合計	226,478,728
純資産の部	
元本等	
元本	39,468,176,591
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	59,918,402,227
元本等合計	99,386,578,818
純資産合計	99,386,578,818
負債純資産合計	99,613,057,546

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11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	39,468,176,591口
2．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　2.5181円 (1万口当たり純資産額)　(25,181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 7月11日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月11日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引

	2022年 7月11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	「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	41,364,083,335円
期中追加設定元本額	8,486,061,804円
期中一部解約元本額	10,381,968,548円
期末元本額	39,468,176,591円
期末元本額の内訳	
グローバル３資産バランスオープン	58,177,468円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	92,933,067円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,683,758,722円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,249,291円
ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス・オープン	12,415,354,671円
グローバルリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	17,237,332,439円

区分	2022年 7月11日現在
コア投資戦略ファンド（安定型）	691,010,554円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,599,810,944円
分散投資コア戦略ファンドＡ	663,634,730円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,393,496,043円
コア投資戦略ファンド（切替型）	670,889,410円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	133,525,271円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	197,133,452円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	6,395,181円
グローバル経済コア	236,021,994円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	11,817,729円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	247,841,401円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	67,389,589円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス（ノーロード）	183,233円
１０資産分散投資ファンド	3,975円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	960,030,534円
ＦＯＦｓ用　グローバルＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	305,448,493円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	142,356,210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）	61,423,192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）	36,636,271円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	92,875,637円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	98,941,913円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	98,437,291円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	89,958,325円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	88,558,498円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド２０２１－１１（適格機関投資家専用）	81,551,063円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	△17,835,034,281
合計	△17,835,034,281

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2022年 7月11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	113,054,790	－	113,295,316	240,526
	アメリカドル	86,072,600	－	86,241,674	169,074
	オーストラリアドル	6,529,250	－	6,534,150	4,900
	香港ドル	20,452,940	－	20,519,492	66,552
合計		113,054,790	－	113,295,316	240,526

(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
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	46,940	736,488.60	
		AGREE REALTY CORP	39,746	2,915,369.10	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	37,122	659,657.94	
		ALEXANDER'S INC	1,190	273,307.30	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	78,931	11,551,551.85	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	98,325.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	27,081	799,701.93	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	74,632	4,844,363.12	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	158,975	5,696,074.25	
		AMERICOLD REALTY TRUST	144,381	4,532,119.59	
		APARTMENT INCOME REIT CO	82,424	3,407,408.16	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	79,751	527,951.62	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	115,953	1,746,252.18	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	38,600	496,396.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	119,850.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	74,229	14,145,078.24	

		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	391,743.00	
		BOSTON PROPERTIES	76,208	6,793,943.20	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	128,576.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	864,112.60	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	161,483	3,279,719.73	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	93,466	1,988,956.48	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	110,600.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	56,319	7,475,784.06	
		CARETRUST REIT INC	52,477	998,637.31	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	13,620	350,170.20	
		CEDAR REALTY TRUST INC	6,800	195,908.00	
		CENTERSPACE	7,659	607,588.47	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,360	275,156.00	
		CITY OFFICE REIT INC	25,050	319,638.00	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	59,787.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	12,543	447,408.81	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	61,455	1,592,299.05	
		COUSINS PROPERTIES INC	77,846	2,207,712.56	
		CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	5,000	36,150.00	
		CTO REALTY GROWTH INC	8,400	170,604.00	
		CUBESMART	118,025	5,042,028.00	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	948,192.00	
		DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800	134,994.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	150,967	19,071,661.11	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	207,904.00	
		DOUGLAS EMMETT INC-W/I	91,858	2,043,840.50	
		DUKE REALTY CORP	205,550	11,771,848.50	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	47,668	909,028.76	
		EASTGROUP PROPERTIES,INC	22,037	3,434,686.82	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	568,637.18	
		EPR PROPERTIES	40,671	1,974,170.34	
		EQUINIX INC	48,360	31,459,147.20	
		EQUITY COMMONWEALTH	58,772	1,608,589.64	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	92,206	6,678,480.58	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	181,743	12,970,997.91	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	67,427	1,478,674.11	
		ESSEX PROPERTY TRUST	34,785	9,145,672.20	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	71,334	12,347,202.06	
		FARMLAND PARTNERS INC	17,200	244,240.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	38,253	3,707,480.76	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	70,684	3,411,209.84	

		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	44,515	1,217,930.40	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	172,858.48	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	125,567	5,926,762.40	
		GETTY REALTY CORP	21,985	590,956.80	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	385,066.50	
		GLADSTONE LAND CORP	15,500	363,165.00	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	33,930	373,230.00	
		GLOBAL NET LEASE INC	57,012	794,177.16	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	80,080	2,067,665.60	
		HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	123,697	3,569,895.42	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	288,224	7,557,233.28	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	13,650	131,176.50	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	54,799	1,839,602.43	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	381,010	6,077,109.50	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	79,230	1,172,604.00	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	115,571	2,346,091.30	
		INDUS REALTY TRUST INC	3,840	230,630.40	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	468,635.58	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	15,495	1,776,966.60	
		INVENTRUST PROPERTIES CORP	35,960	943,950.00	
		INVITATION HOMES INC	326,294	11,899,942.18	
		IRON MOUNTAIN INC	154,471	7,522,737.70	
		JBG SMITH PROPERTIES	59,353	1,401,324.33	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	331,350.00	
		KILROY REALTY CORPORATION	55,124	2,916,059.60	
		KIMCO REALTY CORP	329,127	6,523,297.14	
		KITE REALTY GROUP TRUST	114,476	1,990,737.64	
		LIFE STORAGE INC	45,348	5,176,927.68	
		LTC PROPERTIES INC	20,624	791,136.64	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	155,791	1,642,037.14	
		MACERICH CO/THE	110,615	1,007,702.65	
		MANULIFE US REAL ESTATE INV	957,964	550,829.30	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	323,332	5,040,745.88	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	61,525	10,448,790.75	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	95,046	4,243,803.90	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	44,489	2,274,277.68	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	25,030	1,513,814.40	
		NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	71,590	516,163.90	
		NETSTREIT CORP	25,337	506,740.00	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	740,490.53	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	561,887.70	

		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	126,982	3,740,889.72
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	222,112.17
		ORION OFFICE REIT INC	30,374	319,230.74
		PARAMOUNT GROUP INC	89,726	640,643.64
		PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	127,795	1,759,737.15
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	72,812	1,257,463.24
		PENN REAL ESTATE INVEST TST	2,333	9,565.30
		PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	60,769	2,068,576.76
		PHYSICIANS REALTY TRUST	118,562	1,979,985.40
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	868,747.96
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	24,051	431,474.94
		POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	105,980.00
		PRIME US REIT	295,000	196,175.00
		PROLOGIS INC	394,520	47,965,741.60
		PS BUSINESS PARKS INC	10,803	2,022,429.63
		PUBLIC STORAGE	81,454	25,725,616.82
		REALTY INCOME CORP	319,869	22,064,563.62
		REGENCY CENTERS CORP	83,010	4,949,886.30
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	66,972	1,053,469.56
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	88,413	5,226,976.56
		RLJ LODGING TRUST	90,877	1,019,639.94
		RPT REALTY	43,950	431,589.00
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	28,793	2,159,475.00
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	118,863	1,702,118.16
		SAFEHOLD INC	8,335	325,898.50
		SAUL CENTERS INC	6,800	324,632.00
		SERVICE PROPERTIES TRUST	84,169	502,488.93
		SIMON PROPERTY GROUP	174,214	17,018,965.66
		SITE CENTERS CORP	99,504	1,327,383.36
		SL GREEN REALTY CORP	33,508	1,542,373.24
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	71,011	2,822,687.25
		STAG INDUSTRIAL INC	96,394	2,945,800.64
		STORE CAPITAL CORP	133,113	3,575,415.18
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	52,970	386,151.30
		SUN COMMUNITIES INC	65,053	10,433,200.14
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	109,586	1,065,175.92
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	53,323	789,713.63
		TERRENO REALTY CORP	39,525	2,230,791.00
		UDR INC	159,872	7,163,864.32
		UMH PROPERTIES INC	25,320	466,141.20
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	361,340.86

		URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	885,780.00	
		URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	244,713.00	
		VENTAS INC	213,026	10,815,330.02	
		VERIS RESIDENTIAL INC	42,236	545,266.76	
		VICI PROPERTIES INC	513,921	16,096,005.72	
		VORNADO REALTY TRUST	83,354	2,443,105.74	
		WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	45,570	930,995.10	
		WELLTOWER INC	241,432	19,823,981.52	
		WHITESTONE REIT	23,074	239,277.38	
		WP CAREY INC	103,303	8,434,689.95	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,382	924,109.56	
	アメリカドル 小計		14,057,737	558,196,945.06 (76,177,137,092)	
	カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	34,242	1,148,134.26	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	345,762.00	
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	156,120.00	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,260	490,373.00	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	72,200.00	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	46,174	2,047,816.90	
		CHOICE PROPERTIES REIT	86,170	1,202,071.50	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	429,484.32	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	453,385.50	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	69,960	843,717.60	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	267,693.40	
		EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	86,040.00	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	867,750.45	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,745	1,367,607.15	
		H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	72,239	914,545.74	
		INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	64,641.00	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	34,090	408,739.10	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	504,166.50	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	161,505.00	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	214,102.90	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,000	87,930.00	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	60,470	751,642.10	
		PLAZA RETAIL REIT	25,000	101,000.00	
		PRIMARIS REIT	28,309	348,766.88	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	78,168	1,577,430.24	

	SLATE GROCERY REIT	17,300	239,605.00	
	SLATE OFFICE REI	17,000	76,500.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	36,116	1,004,385.96	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	799,470.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	164,088.00	
カナダドル 小計		990,445	17,196,674.50 (1,811,669,658)	
ユーロ	AEDIFICA	20,787	1,979,961.75	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	7,200	80,208.00	
	ALTAREA	2,480	339,760.00	
	BEFIMMO S.C.A.	12,210	575,701.50	
	CARE PROPERTY INVEST	15,000	357,000.00	
	CARMILA	25,000	367,500.00	
	COFINIMMO	16,047	1,739,494.80	
	COIMA RES SPA	11,900	118,048.00	
	COVIVIO(FP)	25,611	1,393,238.40	
	CROMWELL REIT EUR	160,000	313,600.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	21,060	450,262.80	
	GECINA SA	29,522	2,652,551.70	
	HAMBORNER REIT AG	37,000	310,430.00	
	ICADE	16,740	749,952.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	124,854.05	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	146,462	891,221.27	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	310,365.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	289,380.00	
	KLEPIERRE	101,585	2,013,922.62	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	166,260.00	
	MERCIALYS	28,000	232,540.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	172,874	1,659,590.40	
	MONTEA NV	5,300	490,250.00	
	NSI NV	10,050	338,182.50	
	RETAIL ESTATES	6,400	415,360.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	61,621	3,103,233.56	
	VASTNED RETAIL	10,650	244,417.50	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	74,672	2,329,766.40	
	WERELDHAVE NV	22,670	337,329.60	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	10,440	433,782.00	
ユーロ 小計		1,341,171	24,808,163.85 (3,438,163,427)	
イギリスポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	260,756	203,650.43	
	AEW UK REIT PLC	68,000	76,296.00	

		ASSURA PLC	1,592,040	1,057,910.58	
		BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	435,000	486,330.00	
		BIG YELLOW GROUP PLC	90,946	1,206,853.42	
		BRITISH LAND CO PLC	499,911	2,336,084.10	
		CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	447,878	670,025.48	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	250,190.78	
		CUSTODIAN REIT PLC	234,276	234,041.72	
		DERWENT LONDON PLC	61,172	1,665,101.84	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	268,362.00	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	129,280	776,972.80	
		HAMMERSON PLC	1,784,000	366,255.20	
		HOME REIT PLC	419,934	481,244.36	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	177,355	206,441.22	
		INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	400,606	2,744,151.10	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	530,380	1,250,636.04	
		LXI REIT PLC	1,004,008	1,469,867.71	
		NEWRIVER REIT PL	126,000	110,880.00	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	234,232.00	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	735,888	1,023,620.20	
		PRS REIT PLC/THE	269,000	285,678.00	
		REGIONAL REIT LTD	222,000	158,952.00	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	110,637	1,181,603.16	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	182,350.00	
		SEGRO PLC	641,133	6,443,386.65	
		SHAFTESBURY PLC	155,193	817,867.11	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	655,099	805,771.77	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	182,347.54	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	997,516	1,840,417.02	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	490,000	365,540.00	
		UNITE GROUP PLC	215,072	2,393,751.36	
		WORKSPACE GROUP PLC	70,347	387,963.70	
	イギリスポンド 小計		14,802,740	32,174,045.29 (5,273,004,282)	
	オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	197,716	535,810.36	
		ARENA REIT	171,053	790,264.86	
		BWP TRUST	262,160	1,051,261.60	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	356,300	687,659.00	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	269,606	800,729.82	
		CENTURIA OFFICE REIT	240,945	418,039.57	
		CHARTER HALL GROUP	246,135	2,808,400.35	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	334,782	1,486,432.08	

	CHARTER HALL RETAIL REIT	261,160	1,023,747.20	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	685,447.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	822,633	653,993.23	
	DEXUS	572,242	5,304,683.34	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	309,620.00	
	GDI PROPERTY GROUP	324,500	308,275.00	
	GOODMAN GROUP	904,315	17,154,855.55	
	GPT GROUP	1,022,142	4,630,303.26	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	593,665.60	
	HEALTHCO REIT	137,130	201,581.10	
	HOME CONSORTIUM LTD	90,500	432,590.00	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	782,342	1,052,249.99	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	117,885	386,662.80	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	193,766	825,443.16	
	MIRVAC GROUP	2,122,238	4,477,922.18	
	NATIONAL STORAGE REIT	549,040	1,213,378.40	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	162,044.00	
	RURAL FUNDS GROUP	191,095	489,203.20	
	SCENTRE GROUP	2,765,307	7,521,635.04	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	571,980	1,618,703.40	
	STOCKLAND	1,279,093	4,834,971.54	
	VICINITY CENTERS	2,067,663	3,876,868.12	
	WAYPOINT REIT LTD	390,099	963,544.53	
オーストラリアドル 小計		17,903,577	67,299,985.28 (6,282,453,625)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	417,278	542,461.40	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	535,300	1,108,071.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	858,490.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	682,894	949,222.66	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	249,502	673,655.40	
ニュージーランドドル 小計		2,743,464	4,131,900.46 (348,360,527)	
香港ドル	CHAMPION REIT	938,000	3,339,280.00	
	FORTUNE REIT	756,000	4,974,480.00	
	LINK REIT	1,128,800	73,202,680.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	1,804,800.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	2,058,870.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,315,660	3,999,606.40	
香港ドル 小計		5,451,460	89,379,716.40 (1,554,313,268)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	376,750.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,756,818	5,112,340.38	

	ASCOTT TRUST	991,877	1,130,739.78	
	CAPITALAND CHINA TRUST	557,721	630,224.73	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,711,644	5,694,452.40	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	517,328.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	178,400	117,744.00	
	EC WORLD REIT	180,000	86,400.00	
	ESR-LOGOS REIT	2,769,764	1,121,754.42	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	342,900.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	147,977.50	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	574,262	1,303,574.74	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	1,578,196	2,162,128.52	
	IREIT GLOBAL	405,985	247,650.85	
	KEPPEL DC REIT	709,903	1,412,706.97	
	KEPPEL REIT	1,051,400	1,135,512.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	1,025,950	805,370.75	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,185,273	2,133,491.40	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,048,463	2,767,942.32	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,658,685	2,919,285.60	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	496,721.16	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	195,500	954,040.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	226,287.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	659,400	385,749.00	
	SUNTEC REIT	1,175,200	1,856,816.00	
シンガポールドル 小計		23,754,185	34,085,887.52 (3,323,033,174)	
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	124,538,400.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	81,340	444,116,400.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	57,840,420.00	
	JR REIT XXVII	64,338	289,842,690.00	
	JR REIT XXVII-RIGHTS	12,345	382,695.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	25,433	147,511,400.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	383,419,200.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	194,134,000.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	67,868,460.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	26,380	205,500,200.00	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	14,201	71,289,020.00	
	SK REITS CO LTD	30,940	176,667,400.00	
韓国ウォン 小計		424,849	2,163,110,285.00 (227,775,513)	
イスラエル シェケル	REIT 1 LTD	103,500	1,945,800.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	115,000	1,104,230.00	

	イスラエルシェケル 小計	218,500	3,050,030.00 (119,938,159)	
合計		81,688,128	98,555,848,725 (98,555,848,725)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券　151銘柄	100.0%	77.3%
カナダドル	投資証券　30銘柄	100.0%	1.8%
ユーロ	投資証券　30銘柄	100.0%	3.5%
イギリスポンド	投資証券　34銘柄	100.0%	5.4%
オーストラリアドル	投資証券　31銘柄	100.0%	6.4%
ニュージーランドドル	投資証券　5銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券　6銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	投資証券　25銘柄	100.0%	3.4%
韓国ウォン	投資証券　12銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券　2銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	467,117,793
コール・ローン	62,823,485

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
投資信託受益証券	30,800,841,961
未収入金	9,161,430
流動資産合計	31,339,944,669
資産合計	31,339,944,669
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	127,634,251
未払金	437,832,767
未払解約金	11,723,825
未払利息	19
流動負債合計	577,190,862
負債合計	577,190,862
純資産の部	
元本等	
元本	25,625,430,409
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	5,137,323,398
元本等合計	30,762,753,807
純資産合計	30,762,753,807
負債純資産合計	31,339,944,669

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11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益

	2022年 7月11日現在
	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11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	25,625,430,409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　1.2005円 (1万口当たり純資産額)　(12,005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 7月11日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月11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11日現在
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	28,562,552,203円
期中追加設定元本額	6,967,660,991円
期中一部解約元本額	9,904,782,785円
期末元本額	25,625,430,409円
期末元本額の内訳	

区分	2022年 7月11日現在
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,142,523,185円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,170,298,646円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,712,735,507円
分散投資コア戦略ファンドＳ	10,094,568,830円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,401,776,538円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	531,503,932円
グローバル経済コア	865,761,480円
ＳＭＴ　ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	2,991,595,246円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	703,991,983円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	114,323,910円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	319,203,374円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	517,708,034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）	59,439,744円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	△1,330,295,766
合計	△1,330,295,766

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2022年 7月11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				
	売建	31,581,390,978	－	31,709,025,229	△127,634,251
	アメリカドル	31,581,390,978	－	31,709,025,229	△127,634,251
合計		31,581,390,978	－	31,709,025,229	△127,634,251

(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
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST	6,820,695	225,696,797.55	
	アメリカドル 小計		6,820,695	225,696,797.55 (30,800,841,961)	
合計			6,820,695	30,800,841,961 (30,800,841,961)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

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

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

ＨＦリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,758,235,285
国債証券	6,302,412,900
投資信託受益証券	1,662,515,465
派生商品評価勘定	107,876,208
未収入金	31,184
未収配当金	1,502,946
差入委託証拠金	2,129,450,711
流動資産合計	12,962,024,699
資産合計	12,962,024,699
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	100,902,143
前受金	34,834,827
未払金	1,873,704
未払利息	843
流動負債合計	137,611,517
負債合計	137,611,517
純資産の部	
元本等	
元本	14,257,391,013
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△1,432,977,831
元本等合計	12,824,413,182
純資産合計	12,824,413,182
負債純資産合計	12,962,024,699

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11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引及び債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。

	(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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。 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 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	14,257,391,013口
2．	「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 1,432,977,831円
3．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.8995円 (1万口当たり純資産額) (8,995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 7月11日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ること及び組入外貨建資産の為替リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従って株価指数先物取引、債券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。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 7月11日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 10月20日
期首元本額	11,300,495,000円
期中追加設定元本額	3,182,911,112円
期中一部解約元本額	226,015,099円
期末元本額	14,257,391,013円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドＡ	3,927,125,252円
分散投資コア戦略ファンドＳ	4,120,114,511円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	6,088,045,301円
ＨＦリターン・ターゲット・ファンド・為替ヘッジあり（ＳＭＡ専用）	122,105,949円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△4,485,600
投資信託受益証券	△163,114,793
合計	△167,600,393

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 7月11日現在）

			時価	評価損益

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,109,265,712	－	4,083,501,943	△25,763,769
	売建	830,382,282	－	832,278,489	△1,896,207
合計		4,939,647,994	－	4,915,780,432	△27,659,976

(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。

債券関連

（2022年 7月11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				
	売建	2,935,853,594	－	2,873,358,791	62,494,803
合計		2,935,853,594	－	2,873,358,791	62,494,803

(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11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				
	売建	3,720,849,212	－	3,748,709,974	△27,860,762

	アメリカドル	2,625,581,509	—	2,670,086,333	△44,504,824
	カナダドル	7,048,332	—	6,951,739	96,593
	ユーロ	376,927,651	—	365,602,794	11,324,857
	イギリスポンド	383,611,824	—	373,617,900	9,993,924
	スイスフラン	324,482,584	—	329,428,140	△4,945,556
	スウェーデンクローナ	3,197,312	—	3,023,068	174,244
合計		3,720,849,212	—	3,748,709,974	△27,860,762

(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	円	第１０３１回国庫短期証券	6,300,000,000	6,302,412,900	
国債証券合計			6,300,000,000	6,302,412,900	
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GSCI COMMODITY DYNAM	121,560	4,875,771.60	
		ISHARES JP MORGAN USD EMERGI	34,210	2,895,192.30	
		SPDR GOLD SHARES ETF	27,180	4,411,314.00	
	アメリカドル 小計		182,950	12,182,277.90 (1,662,515,465)	
投資信託受益証券合計			182,950	1,662,515,465 (1,662,515,465)	
合計				7,964,928,365 (1,662,515,465)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券3銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

２【ファンドの現況】

【分散投資コア戦略ファンドＡ】

【純資産額計算書】

（2022年 7月29日現在）

Ⅰ　資産総額	84,805,819,334円
Ⅱ　負債総額	77,908,501円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	84,727,910,833円
Ⅳ　発行済口数	77,859,178,440口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0882円
（1万口当たり純資産額）	（10,882円）

【分散投資コア戦略ファンドＳ】

【純資産額計算書】

（2022年 7月29日現在）

Ⅰ　資産総額	180,827,646,195円
Ⅱ　負債総額	202,637,044円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	180,625,009,151円
Ⅳ　発行済口数	144,270,874,690口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2520円
（1万口当たり純資産額）	（12,520円）

（参考）

国内株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 7月29日現在）

Ⅰ　資産総額	511,291,535,513円
Ⅱ　負債総額	4,639,557,910円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	506,651,977,603円
Ⅳ　発行済口数	264,034,110,826口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9189円
（1万口当たり純資産額）	（19,189円）

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

純資産額計算書

（2022年 7月29日現在）

Ⅰ　資産総額	3,658,831,852円
Ⅱ　負債総額	286,671円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,658,545,181円
Ⅳ　発行済口数	3,029,447,803口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2077円
（1万口当たり純資産額）	（12,077円）

国内債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 7月29日現在）

Ⅰ　資産総額	635,253,248,817円
Ⅱ　負債総額	6,601,394,477円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	628,651,854,340円
Ⅳ　発行済口数	455,974,406,469口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3787円
（1万口当たり純資産額）	（13,787円）

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

（2022年 7月29日現在）

Ⅰ　資産総額	68,360,544,068円
Ⅱ　負債総額	141,831,792円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	68,218,712,276円
Ⅳ　発行済口数	73,610,343,371口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9268円
（1万口当たり純資産額）	（9,268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 7月29日現在）

Ⅰ　資産総額	552,192,105,102円
Ⅱ　負債総額	1,363,847,724円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	550,828,257,378円
Ⅳ　発行済口数	127,841,218,523口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.3087円
（1万口当たり純資産額）	（43,087円）

外国株式最小分散インデックスマザーファンド

純資産額計算書

（2022年 7月29日現在）

Ⅰ　資産総額	19,051,671,427円
Ⅱ　負債総額	4,617,125円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	19,047,054,302円
Ⅳ　発行済口数	11,229,018,204口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6962円
（1万口当たり純資産額）	（16,962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 7月29日現在）

Ⅰ　資産総額	318,379,661,499円
Ⅱ　負債総額	127,099,884円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	318,252,561,615円
Ⅳ　発行済口数	99,676,178,836口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.1929円
（1万口当たり純資産額）	（31,929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 7月29日現在）

Ⅰ　資産総額	111,216,005,982円
Ⅱ　負債総額	35,539,331円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	111,180,466,651円

Ⅳ　発行済口数	31,388,761,154口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.5420円
（1万口当たり純資産額）	（35,420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 7月29日現在）

Ⅰ　資産総額	83,207,151,865円
Ⅱ　負債総額	3,855,934円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	83,203,295,931円
Ⅳ　発行済口数	47,447,500,719口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7536円
（1万口当たり純資産額）	（17,536円）

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 7月29日現在）

Ⅰ　資産総額	121,573,477,433円
Ⅱ　負債総額	1,269,443,356円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	120,304,034,077円
Ⅳ　発行済口数	54,445,063,987口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2096円
（1万口当たり純資産額）	（22,096円）

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 7月29日現在）

Ⅰ　資産総額	107,983,735,968円
Ⅱ　負債総額	1,655,672円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	107,982,080,296円
Ⅳ　発行済口数	40,735,270,544口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.6508円
（1万口当たり純資産額）	（26,508円）

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

（2022年 7月29日現在）

Ⅰ　資産総額	33,826,168,097円
Ⅱ　負債総額	533,326,588円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	33,292,841,509円
Ⅳ　発行済口数	27,567,556,446口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2077円
（1万口当たり純資産額）	（12,077円）

ＨＦリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

（2022年 7月29日現在）

Ⅰ　資産総額	13,045,888,991円
Ⅱ　負債総額	145,484,640円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	12,900,404,351円
Ⅳ　発行済口数	14,256,343,597口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9049円
（1万口当たり純資産額）	（9,049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。

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2022年 7月29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11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7月29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	541	14,129,345
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	71	228,589
単位型公社債投資信託	51	226,070
合計	663	14,584,004

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

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

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				
	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 （2021年3月31日）		当事業年度 （2022年3月31日）	
建　　物	106	百万円	146	百万円
器具備品	391	〃	535	〃
そ の 他	4	〃	―	〃
計	503	〃	681	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2020年4月1日　至 2021年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 2021年4月1日　至 2022年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

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

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

2022年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	利益剰余金	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

（リース取引関係）

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

（注3） 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2021年3月31日）　　（単位:百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,589	－	－	－
未収委託者報酬	8,471	－	－	－
未収運用受託報酬	6,151	－	－	－
投資有価証券 投資信託	－	10	5,751	0

当事業年度（2022年3月31日）　　（単位:百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,675	－	－	－
未収委託者報酬	9,067	－	－	－
未収運用受託報酬	6,252	－	－	－
投資有価証券				
投資信託	－	108	1,712	0

（有価証券関係）

１．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位:百万円）

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

２．その他有価証券

前事業年度（2021年3月31日）　　（単位:百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9	10	△1
小計	9	10	△1
合計	9,950	8,809	1,141

当事業年度（2022年3月31日）　　（単位：百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,585	1,711	△126
小計	1,585	1,711	△126
合計	6,474	5,115	1,358

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

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位:百万円）

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

３．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）　（単位:百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	109	1	0

当事業年度（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日）　（単位:百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2021年3月31日）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	2,889	―	△41	△41
	英ポンド	128	―	△0	△0
	カナダドル	21	―	△0	△0
	スイスフラン	51	―	0	0
	香港ドル	128	―	△1	△1
	ユーロ	246	―	0	0
	買建				
	米ドル	99	―	1	1
	香港ドル	2	―	0	0
合計		3,567	―	△41	△41

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

（2）株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	13,711	―	△315	△315
合計		13,711	―	△315	△315

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等（百万円）	契約額等のうち1年超（百万円）	時価（百万円）
原則的処理方法	為替予約取引				
	売建				
	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 売建 米ドル	投資有価証券 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 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）	当事業年度 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）
退職給付債務の期首残高	600	626
勤務費用	－	124
利息費用	－	2
転籍者受入	18	－
退職給付の支払額	△69	△81
簡便法で計算した退職給付費用	77	8
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	－	120
その他	－	18
退職給付債務の期末残高	626	820

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（単位：百万円）

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

（単位：百万円）

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

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

(5) 年金資産に関する事項
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

3．確定拠出制度
当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度92百万円、当事業年度100百万円であります。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（収益認識関係）

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

2．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報
顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針７．収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

［関連情報］

１．製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

２．地域ごとの情報

（1）営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

３．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2020年4月1日　至 2021年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,372百万円

(*)当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載しております。

当事業年度（自 2021年4月1日　至 2022年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,395百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395百万円

(*)当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載しております。

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	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 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	当事業年度 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1株当たり純資産額	20,274,967円09銭	21,406,512円22銭
1株当たり当期純利益金額	2,331,221円85銭	2,162,405円20銭

（注）１．潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
２．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）	当事業年度 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）
当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株主に帰属しない金額	－	－
普通株式に係る当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

４【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

５【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2022年10月11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） （2022年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社北海道銀行※	93,524	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

※分散投資コア戦略ファンドＳの募集・販売等の取扱いを行います。

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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2021年10月12日	有価証券届出書
2021年10月12日	有価証券報告書
2022年 4月12日	有価証券届出書
2022年 4月12日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2022年６月２日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　三　上　和　彦
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　藤　澤　　孝

監査意見
　当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年４月１日から2022年３月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

　当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
　その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。
　当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任
　監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による

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

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

利害関係

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

以　上

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

２．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9月20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」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドAの2021年7月13日から2022年7月11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、分散投資コア戦略ファンドAの2022年7月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

独立監査人の監査報告書

2022年9月20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」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドSの2021年7月13日から2022年7月11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、分散投資コア戦略ファンドSの2022年7月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。